

ENQUADRAMENTO LEGAL



JOINVILLE

31/12/2018

Fundo	Valor Investido R\$	% Recursos	Limite PI	PL Fundo	% PL Fundo	VaR %	Adequação Fundo	Diversificação		Rentabilidades					
								RPPS	Fundo	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	No Ano	
CONSOLIDADO	2.376.698.596,47	100,00%	198,00%								1,28%	7,59%	9,73%	11,42%	11,42%
META ATUARIAL (INPC + 6%)											0,60%	1,74%	3,82%	9,59%	9,59%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)											0,61%	1,84%	4,10%	9,92%	9,92%
Títulos Públicos	1.005.840.436,21	42,32%	50,00%				Art. 7º, Inciso I, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
CARTEIRA ADMINISTRADA JOINVILLE - BRADESCO	507.728.665,49	21,36%	-	-	-	2,66%					1,19%	5,74%	7,71%	10,38%	10,38%
CARTEIRA ADMINISTRADA JOINVILLE - BANCO DO BRASIL	434.574.055,48	18,28%	-	-	-	3,49%					1,34%	6,30%	8,35%	10,83%	10,83%
CARTEIRA ADMINISTRADA JOINVILLE - XP INVESTIMENTOS	63.537.715,24	2,67%	-	-	-	5,14%					1,84%	9,59%	11,53%	12,84%	12,84%
Fundos Referenciados Renda Fixa que contenham somente títulos públicos	758.072.652,51	31,90%	50,00%				Art. 7º, Inciso I, Alínea B							Alocação:	Enquadrado
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	80.981.763,11	3,41%		3.128.030.529,16	2,59%	2,08%	OK	OK	OK	1,35%	4,60%	6,77%	9,65%	9,65%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	355.502.751,85	14,96%		3.870.963.791,60	9,18%	4,96%	OK	OK	OK	1,62%	9,79%	11,61%	12,76%	12,76%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5 FI	88.424.781,28	3,72%		946.928.584,30	9,34%	7,48%	OK	OK	OK	1,84%	14,35%	16,04%	15,14%	15,14%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI	3.647.197,77	0,15%		219.918.719,92	1,66%	1,05%	OK	OK	OK	0,93%	2,77%	4,96%	9,10%	9,10%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA III FI	12.616.882,98	0,53%		836.451.095,65	1,51%	2,39%	OK	OK	OK	1,39%	5,18%	11,95%	17,97%	17,97%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	14.873.285,19	0,63%		309.189.095,47	4,81%	3,56%	OK	OK	OK	4,91%	7,12%	9,33%	11,28%	11,28%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA I FI	15.301.853,98	0,64%		464.531.856,67	3,29%	2,97%	OK	OK	OK	1,63%	6,13%	8,41%	10,60%	10,60%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IX FI	896.889,49	0,04%		120.401.118,20	0,74%	0,00%	OK	OK	OK	0,47%	1,47%	3,06%	7,44%	7,44%	
BTG PACTUAL NTNB FI RF	26.219.390,00	1,10%		155.420.390,54	16,87%	0,00%	OK	OK	OK	0,35%	-0,81%	1,80%	4,21%	4,21%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	30.357.280,00	1,28%		405.648.494,83	7,48%	4,14%	OK	OK	OK	1,80%	8,19%	6,60%	6,00%	6,00%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	78.981.687,30	3,32%		1.231.561.219,42	6,41%	7,43%	OK	OK	OK	1,80%	14,17%	15,84%	14,98%	14,98%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFACAO 5 FICFI	35.769.686,65	1,51%		1.197.433.455,24	2,99%	2,07%	OK	OK	OK	1,33%	4,54%	6,64%	9,41%	9,41%	
WA IMABS ATIVO FI RENDA FIXA	14.499.199,91	0,61%		300.631.188,10	4,82%	4,01%	OK	OK	OK	2,12%	6,83%	9,34%	11,76%	11,76%	
Fundos de índice Renda fixa que contenham somente títulos públicos							Art. 7º, Inciso I, Alínea C							Alocação:	
Operações Compromissadas			5,00%				Art. 7º, Inciso II							Alocação:	
Fundos Referenciados Renda Fixa			25,00%				Art. 7º, Inciso III, Alínea A							Alocação:	
Fundos Índice Renda Fixa							Art. 7º, Inciso III, Alínea B							Alocação:	
Fundos Renda Fixa - DI	429.268.089,46	18,06%	20,00%				Art. 7º, Inciso IV, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	588.401,03	0,02%		1.157.483.382,72	0,05%	0,01%	OK	OK	OK	0,41%	1,27%	2,60%	5,29%	5,29%	
BB PREVIDENCIARIO RF REF DI LP PERFL FC	85.055,08	0,00%		4.810.359.689,92	0,00%	0,00%	OK	OK	OK	0,47%	1,49%	3,09%	6,33%	6,33%	
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	27.790.837,06	1,17%		6.818.674.974,42	0,41%	0,01%	OK	OK	OK	0,48%	1,49%	3,06%	6,22%	6,22%	
BRADESCO FI RF REF DI PREMIUM	23.465.417,39	0,99%		7.300.537.475,50	0,32%	0,00%	OK	OK	OK	0,49%	1,51%	3,10%	6,33%	6,33%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5+	15.854.809,24	0,67%		183.844.013,91	8,62%	7,48%	OK	OK	OK	1,85%	15,94%	15,04%	15,04%	15,04%	
BRADESCO INST FICFI RF IMA B 5	4.025.170,52	0,17%		556.904.316,48	0,72%	2,16%	OK	OK	OK	1,36%	6,86%	9,62%	9,62%	15,04%	
BRADESCO INST FICFI RF IMA B	124.047.402,39	5,22%		1.220.981.481,89	10,16%	5,18%	OK	OK	OK	1,70%	10,29%	11,90%	12,86%	12,86%	
BRADESCO INST FICFI RF IMA GERAL	79.689.240,54	3,35%		769.535.094,75	10,36%	2,38%	OK	OK	OK	1,17%	5,61%	7,53%	10,04%	10,04%	
BRAM INSTITUCIONAL FI RF IRF M	15.101.438,78	0,64%		200.860.864,26	7,52%	2,72%	OK	OK	OK	1,60%	6,26%	8,17%	10,98%	10,98%	
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	83.908,08	0,00%		658.051.553,40	0,01%	0,00%	OK	OK	OK	0,43%	1,33%	2,72%	5,55%	5,55%	
CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP	503.518,57	0,02%		6.777.682.965,68	0,01%	0,01%	OK	OK	OK	0,48%	1,51%	3,06%	6,23%	6,23%	
ITAU INST ALOCAAO DINAMICA II RF FICFI	7.860.663,97	0,33%		2.536.010.521,38	0,31%	3,37%	OK	OK	OK	1,50%	2,78%	4,18%	8,23%	8,23%	
ITAU INST ALOCAAO DINAMICA RF FICFI	67.659.643,94	2,85%		1.172.042.980,66	5,77%	3,37%	OK	OK	OK	1,51%	2,78%	4,19%	8,22%	8,22%	
WA IMA B ATIVO FI RENDA FIXA	19.648.083,68	0,83%		136.584.316,08	14,39%	7,00%	OK	OK	OK	2,41%	12,19%	14,43%	14,57%	14,57%	
WA RENDA FIXA ATIVO FI	33.435.370,86	1,41%		1.528.650.474,30	2,19%	1,57%	OK	OK	OK	1,11%	3,30%	5,17%	8,14%	8,14%	
WA SOBERANO II FCFI RENDA FIXA REF SELIC	9.430.128,33	0,40%		137.014.432,08	6,88%	0,00%	OK	OK	OK	0,48%	1,45%	2,99%	6,19%	6,19%	
Fundos de Índice Renda Fixa - DI							Art. 7º, Inciso IV, Alínea B							Alocação:	
Letras Imobiliárias Garantidas							Art. 7º, Inciso V							Alocação:	
Certificado de Depósito Bancário (CDB)							Art. 7º, Inciso VI, Alínea A							Alocação:	
Depósito Poupança							Art. 7º, Inciso VI, Alínea B							Alocação:	
FIDC Cota Sênior	58.720,25	0,00%	1,00%				Art. 7º, Inciso VII, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
FIDC ITALIA SEN	36.762,71	0,00%		818.112,37	4,49%	-	OK	OK	OK	-51,05%	-80,18%	-90,64%	-90,81%	-90,81%	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III SENIOR	21.957,54	0,00%		626.337,36	3,51%	-	OK	OK	OK	-8,37%	-29,17%	-42,45%	-97,50%	-97,50%	
Fundos Crédito Privado	4.750.441,68	0,20%	2,00%				Art. 7º, Inciso VII, Alínea B							Alocação:	Enquadrado
SANTOS CREDIT YIELD FI RF CP	262.249,68	0,01%		18.402.540,12	1,43%	0,10%	OK	OK	OK	0,37%	21,26%	42,45%	52,59%	52,59%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV	4.488.192,00	0,19%		151.751.036,37	2,96%	1,50%	OK	OK	OK	1,17%	3,38%	5,83%	7,73%	7,73%	
Fundos Lei nº12.431							Art. 7º, Inciso VII, Alínea C							Alocação:	

ENQUADRAMENTO LEGAL



JOINVILLE

31/12/2018

Fundo	Valor Investido R\$	% Recursos	Limite PI	PL Fundo	% PL Fundo	VaR %	Adequação Fundo	Diversificação		Rentabilidades				
								RPPS	Fundo	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	No Ano
CONSOLIDADO	2.376.698.596,47	100,00%	198,00%							1,28%	7,59%	9,73%	11,42%	11,42%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,60%	1,74%	3,82%	9,59%	9,59%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,61%	1,84%	4,10%	9,92%	9,92%
Fundos de Ações Referenciados	65.623.738,75	2,76%	15,00%				Art. 8º, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadro
BB ACOES IBRX INDEXADO FC FI	7.644.221,12	0,32%		169.540.756,00	4,51%	13,46%	OK	OK	OK	-1,43%	11,01%	20,17%	12,72%	12,72%
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	7.840.109,56	0,33%		249.766.399,94	3,14%	13,80%	OK	OK	OK	-1,74%	10,82%	20,91%	15,06%	15,06%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	50.139.408,07	2,11%		783.807.802,01	6,40%	13,26%	OK	OK	OK	0,06%	15,46%	20,55%	16,10%	16,10%
Fundos de índices de Renda Variável							Art. 8º, Inciso I, Alínea B						Alocação:	
Fundos de Ações	64.205.870,50	2,70%	15,00%				Art. 8º, Inciso II, Alínea A						Alocação:	Enquadro
BB ACOES DIVIDENDOS FC FI	7.553.281,01	0,32%		596.882.604,10	1,27%	12,16%	OK	OK	OK	0,34%	15,85%	24,28%	17,05%	17,05%
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	5.244.903,07	0,22%		360.081.522,68	1,46%	13,70%	OK	OK	OK	-0,87%	13,50%	22,69%	13,64%	13,64%
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	16.971.561,79	0,71%		1.943.989.553,44	0,87%	13,52%	OK	OK	OK	0,25%	13,88%	24,35%	21,17%	21,17%
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	2.839.028,06	0,12%		158.154.880,13	1,80%	15,52%	OK	OK	OK	0,23%	12,59%	22,27%	20,81%	20,81%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	7.615.840,05	0,32%		449.315.909,25	1,69%	12,78%	OK	OK	OK	3,23%	22,59%	23,32%	10,75%	10,75%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	8.302.543,70	0,35%		115.325.480,66	7,20%	14,46%	OK	OK	OK	4,88%	22,87%	23,97%	15,62%	15,62%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	5.536.032,72	0,23%		177.731.801,31	3,11%	12,60%	OK	OK	OK	-0,20%	14,16%	19,50%	19,35%	19,35%
WESTERN ASSET VALUATION FI EM ACOES	10.142.680,10	0,43%		135.477.497,93	7,49%	16,22%	OK	OK	OK	-0,01%	14,34%	15,83%	10,12%	10,12%
Fundos de índices de Renda Variável							Art. 8º, Inciso II, Alínea B						Alocação:	
Fundos Multimercados	9.476.864,28	0,40%	5,00%				Art. 8º, Inciso III						Alocação:	Enquadro
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULT	9.476.864,28	0,40%		366.126.986,48	2,59%	1,62%	OK	OK	OK	0,82%	2,31%	2,78%	8,35%	8,35%
Fundos de Participação	39.401.782,83	1,66%	5,00%				Art. 8º, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadro
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	1.601.010,64	0,07%		180.099.094,81	0,89%	-	OK	OK	OK	-0,14%	-0,45%	-0,88%	-15,18%	-15,18%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	2.383.968,27	0,10%		361.218.876,20	0,66%	-	OK	OK	OK	-0,16%	-0,56%	49,89%	62,91%	62,91%
BTG PACTUAL PRINCIPAL INVESTMENTS FICFIP	2.613.210,45	0,11%		177.687.014,10	1,47%	-	OK	OK	OK	-5,60%	-10,77%	-15,12%	156,48%	156,48%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	10.382.153,21	0,44%		73.670.452,41	14,09%	-	OK	OK	OK	-18,73%	-25,87%	-26,02%	-29,57%	-29,57%
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	1.762.873,55	0,07%		93.305.372,53	1,89%	-	OK	OK	OK	-0,24%	-0,54%	-0,74%	-1,53%	-1,53%
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	3.124.882,35	0,13%		24.920.936,74	12,54%	-	OK	OK	OK	-4,15%	64,51%	16,32%	-	-
P2 BRASIL INFRAESTRUTURA III FIQ.FIP	10.544.650,09	0,44%		251.441.044,75	4,19%	-	OK	OK	OK	10,98%	8,23%	20,90%	34,07%	34,07%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	6.989.034,27	0,29%		577.431.235,07	1,21%	-	OK	OK	OK	-0,09%	1,63%	1,65%	1,14%	1,14%
Fundos Imobiliários			5,00%				Art. 8º, Inciso IV, Alínea B						Alocação:	

1 - As informações utilizadas na geração deste enquadramento foram obtidas junto a RPPS que administra o plano e aos seus prestadores de serviços, não sendo de responsabilidade da Risk Office quaisquer erros decorrentes de ruídos ou falhas de informação;

2 - Os dados de mercado utilizados para verificação do enquadramento foram obtidos junto a fontes públicas nas quais a Risk Office deposita confiança. Entretanto, a Risk Office não se responsabiliza pela acurácia desses dados;

3 - Adicionalmente, é preciso ressaltar que este relatório é confidencial, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não deve, portanto, ser utilizado para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização;

4 - Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.