



# ENQUADRAMENTO LEGAL



**JOINVILLE**

**31/01/2019**

| 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  |       |                  |                   |
| <b>CONSOLIDADO</b>                         | <b>2.485.626.653,05</b> | <b>100,00%</b> |               |                  |            |        |                                     |                |               |                |         |         |          |         |       |                  |                   |
| META ATUARIAL ( INPC + 6%)                 |                         |                |               |                  |            |        |                                     |                |               |                | 3,67%   | 6,06%   | 11,60%   | 12,39%  | 4,24% |                  |                   |
| META ATUARIAL ( IPCA + 6%)                 |                         |                |               |                  |            |        |                                     |                |               |                | 0,85%   | 1,72%   | 3,94%    | 9,78%   | 0,85% |                  |                   |
|                                            |                         |                |               |                  |            |        |                                     |                |               |                | 0,83%   | 1,71%   | 4,09%    | 9,95%   | 0,83% |                  |                   |
| <b>Fundos de Ações Referenciados</b>       | <b>72.222.996,32</b>    | <b>2,91%</b>   | <b>15,00%</b> |                  |            |        | <b>Art. 8º, Inciso I, Alínea A</b>  |                |               |                |         |         |          |         |       | <b>Alocação:</b> | <b>Enquadrado</b> |
| BB ACOES IBRX INDEXADO FC FI               | 8.444.064,65            | 0,34%          |               | 189.969.551,11   | 4,44%      | 13,82% | OK                                  | OK             | OK            | 10,46%         | 11,45%  | 22,27%  | 12,69%   | 10,46%  |       |                  |                   |
| BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS                 | 8.686.500,32            | 0,35%          |               | 287.575.714,43   | 3,02%      | 14,14% | OK                                  | OK             | OK            | 10,80%         | 11,45%  | 23,03%  | 14,74%   | 10,80%  |       |                  |                   |
| ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI        | 55.092.431,35           | 2,22%          |               | 869.865.682,06   | 6,33%      | 14,09% | OK                                  | OK             | OK            | 9,88%          | 13,31%  | 23,67%  | 16,27%   | 9,88%   |       |                  |                   |
| <b>Fundos de Índices de Renda Variável</b> |                         |                |               |                  |            |        | <b>Art. 8º, Inciso I, Alínea B</b>  |                |               |                |         |         |          |         |       | <b>Alocação:</b> |                   |
| <b>Fundos de Ações</b>                     | <b>70.701.829,42</b>    | <b>2,84%</b>   | <b>15,00%</b> |                  |            |        | <b>Art. 8º, Inciso II, Alínea A</b> |                |               |                |         |         |          |         |       | <b>Alocação:</b> | <b>Enquadrado</b> |
| BB ACOES DIVIDENDOS FC FI                  | 8.177.853,29            | 0,33%          |               | 714.072.629,09   | 1,15%      | 12,32% | OK                                  | OK             | OK            | 8,27%          | 14,62%  | 25,89%  | 15,18%   | 8,27%   |       |                  |                   |
| BB PREV ACOES GOVERNANCA FI                | 5.791.296,69            | 0,23%          |               | 447.231.351,88   | 1,29%      | 14,09% | OK                                  | OK             | OK            | 10,42%         | 12,38%  | 25,18%  | 16,05%   | 10,42%  |       |                  |                   |
| BRADESCO FIA DIVIDENDOS                    | 18.387.124,90           | 0,74%          |               | 2.253.227.684,17 | 0,82%      | 14,59% | OK                                  | OK             | OK            | 8,34%          | 11,71%  | 24,13%  | 17,93%   | 8,34%   |       |                  |                   |
| BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA    | 3.088.045,12            | 0,12%          |               | 162.203.185,32   | 1,90%      | 13,65% | OK                                  | OK             | OK            | 8,77%          | 11,34%  | 22,69%  | 17,78%   | 8,77%   |       |                  |                   |
| CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS      | 8.547.399,37            | 0,34%          |               | 506.731.472,62   | 1,69%      | 15,80% | OK                                  | OK             | OK            | 12,23%         | 22,22%  | 31,91%  | 17,58%   | 12,23%  |       |                  |                   |
| CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS       | 9.408.580,73            | 0,38%          |               | 146.747.805,79   | 6,41%      | 15,42% | OK                                  | OK             | OK            | 13,32%         | 26,19%  | 32,83%  | 23,83%   | 13,32%  |       |                  |                   |
| VINCI SELECTION EQUITIES FIA               | 6.113.951,86            | 0,25%          |               | 201.128.998,36   | 3,04%      | 12,39% | OK                                  | OK             | OK            | 10,44%         | 13,56%  | 23,90%  | 21,56%   | 10,44%  |       |                  |                   |
| WA VALUATION FIA                           | 11.187.577,46           | 0,45%          |               | 144.158.757,73   | 7,76%      | 16,80% | OK                                  | OK             | OK            | 10,30%         | 14,91%  | 20,00%  | 12,40%   | 10,30%  |       |                  |                   |
| <b>Fundos de Índices de Renda Variável</b> |                         |                |               |                  |            |        | <b>Art. 8º, Inciso II, Alínea B</b> |                |               |                |         |         |          |         |       | <b>Alocação:</b> |                   |
| <b>Fundos Multimercados</b>                | <b>9.486.053,29</b>     | <b>0,38%</b>   | <b>5,00%</b>  |                  |            |        | <b>Art. 8º, Inciso III</b>          |                |               |                |         |         |          |         |       | <b>Alocação:</b> | <b>Enquadrado</b> |
| WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULT         | 9.486.053,29            | 0,38%          |               | 411.622.803,45   | 2,30%      | 1,63%  | OK                                  | OK             | OK            | 0,10%          | 0,99%   | 2,54%   | 7,26%    | 0,10%   |       |                  |                   |
| <b>Fundos de Participação</b>              | <b>39.437.308,81</b>    | <b>1,59%</b>   | <b>5,00%</b>  |                  |            |        | <b>Art. 8º, Inciso IV, Alínea A</b> |                |               |                |         |         |          |         |       | <b>Alocação:</b> | <b>Enquadrado</b> |
| BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIFM     | 1.536.316,10            | 0,06%          |               | 181.092.558,85   | 0,85%      | -      | OK                                  | OK             | OK            | -              | -       | -       | -        | -       |       |                  |                   |
| BTG PACTUAL PRINCIPAL INVESTMENTS FICFIP   | 2.633.445,62            | 0,11%          |               | 180.448.308,37   | 1,46%      | -      | OK                                  | OK             | OK            | 0,77%          | -6,73%  | -13,17% | 0,77%    | 158,34% |       |                  |                   |
| BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP   | 2.379.731,13            | 0,10%          |               | 360.888.586,82   | 0,66%      | -      | OK                                  | OK             | OK            | -0,18%         | -0,52%  | 31,94%  | -0,18%   | 264,55% |       |                  |                   |
| FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II             | 10.374.488,27           | 0,42%          |               | 73.616.063,02    | 14,09%     | -      | OK                                  | OK             | Desenquadrado | -              | -       | -       | -        | -       |       |                  |                   |
| KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME           | 3.016.172,04            | 0,12%          |               | 24.053.971,98    | 12,54%     | -      | OK                                  | OK             | Desenquadrado | -              | -       | -       | -        | -       |       |                  |                   |
| FIP ME CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA      | 1.771.218,91            | 0,07%          |               | 93.577.026,46    | 1,89%      | -      | OK                                  | OK             | OK            | 0,07%          | -0,33%  | -0,74%  | 0,07%    | -1,33%  |       |                  |                   |
| PATRIA BRASIL INFRAESTRUTURA III FIC FIP   | 10.743.560,26           | 0,43%          |               | 256.151.574,00   | 4,19%      | -      | OK                                  | OK             | OK            | -0,51%         | 9,88%   | 20,14%  | -0,51%   | 33,39%  |       |                  |                   |
| PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP     | 6.982.376,48            | 0,28%          |               | 576.881.171,00   | 1,21%      | -      | OK                                  | OK             | OK            | -0,10%         | 1,45%   | 1,61%   | -0,10%   | 1,14%   |       |                  |                   |
| <b>Fundos Imobiliários</b>                 |                         |                | <b>5,00%</b>  |                  |            |        | <b>Art. 8º, Inciso IV, Alínea B</b> |                |               |                |         |         |          |         |       | <b>Alocação:</b> |                   |

1 - As informações utilizadas na geração deste enquadramento foram obtidas junto ao 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.