

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

31/08/2015

Fundo	Valor Investido R\$	% Recursos	Limite PI	PL Fundo	% PL Fundo	Adequação Fundo	Diversificação		Rentabilidades						
							RPPS	Fundo	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	No Ano		
CONSOLIDADO	606.928.019,87	100,00%	100,00%												
META ATUARIAL (INPC + 6%)										-2,73%	-2,87%	1,10%	1,76%	4,24%	
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,74%	3,10%	8,00%	16,47%	11,96%	
										0,71%	3,13%	7,57%	16,10%	11,31%	
Títulos Públicos	26.208.418,01	4,32%	10,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	26.208.418,01	4,32%								-2,78%	-4,10%	0,49%	2,35%	4,34%	
Fundos que contenham somente títulos públicos	319.592.139,55	52,66%	80,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado		
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TP	10.685.797,41	1,76%		4.950.905.293,76	0,22%	OK	OK	OK	-3,07%	-4,16%	0,44%	2,61%	4,06%		
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IX FI	4.902.495,63	0,81%		1.748.403.957,01	0,28%	OK	OK	OK	0,33%	2,83%	-	-	-		
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	24.924.597,79	4,11%		1.690.293.101,25	1,47%	OK	OK	OK	-0,80%	1,25%	-	-	-		
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	5.809.097,16	0,96%		573.235.942,50	1,01%	OK	OK	OK	0,12%	2,14%	4,44%	7,46%	6,64%		
BRADESCO FI RF IMA B TIT. PUBLICOS	61.407.342,09	10,12%		650.127.156,46	9,45%	OK	OK	OK	-3,16%	-4,32%	0,31%	2,26%	3,90%		
BTG PACTUAL FI RF IMA B	13.842.137,58	2,28%		313.221.926,81	4,42%	OK	OK	OK	-3,09%	-4,11%	0,10%	2,35%	3,86%		
CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF	5.034.430,00	0,83%		762.730.108,34	0,66%	OK	OK	OK	-2,22%	0,34%	-	-	-		
CAIXA FI BRASIL 2016 III TP RF	11.899.248,00	1,96%		709.558.030,14	1,68%	OK	OK	OK	-2,24%	-	-	-	-		
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	5.077.285,00	0,84%		1.371.151.638,90	0,37%	OK	OK	OK	-2,21%	0,35%	-	-	-		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	5.497.059,78	0,91%		3.859.928.140,21	0,14%	OK	OK	OK	-0,51%	2,02%	5,21%	10,74%	8,53%		
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	74.123.942,92	12,21%		3.971.882.522,76	1,87%	OK	OK	OK	-3,39%	-4,63%	-0,17%	2,07%	3,40%		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	13.648.177,38	2,25%		1.694.384.289,47	0,81%	OK	OK	OK	-0,50%	2,05%	5,14%	10,60%	8,53%		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	24.302.429,46	4,00%		514.546.250,96	4,72%	OK	OK	OK	-3,15%	-4,17%	0,29%	2,37%	3,90%		
SAFRA IMA FIC FI RF	4.917.496,32	0,81%		166.151.211,51	2,96%	OK	OK	OK	-1,98%	-1,60%	2,17%	6,39%	5,39%		
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	53.520.603,03	8,82%		384.238.151,00	13,93%	OK	OK	OK	-3,12%	-4,12%	0,46%	2,12%	4,13%		
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	113.752.120,74	18,74%	60,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	16.712.382,14	2,75%		1.172.057.752,08	1,43%	OK	OK	OK	-3,06%	-4,07%	0,50%	2,71%	4,11%		
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	8.358.023,05	1,38%		1.132.510.124,47	0,74%	OK	OK	OK	-0,52%	2,03%	5,18%	10,61%	8,49%		
BRADESCO FI RF IMA B	43.402.868,63	7,15%		1.038.086.029,93	4,18%	OK	OK	OK	-3,23%	-4,21%	0,44%	2,96%	4,14%		
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	6.635.534,48	1,09%		2.555.593.816,71	0,26%	OK	OK	OK	-2,96%	-4,19%	0,57%	3,26%	4,20%		
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	38.643.312,44	6,37%		203.165.410,47	19,02%	OK	OK	OK	-2,94%	-4,06%	-0,18%	2,55%	4,10%		
Fundos de Renda Fixa (Normal)	37.644.748,72	6,20%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	4.760.313,63	0,78%		5.275.034.019,33	0,09%	OK	OK	OK	1,11%	3,44%	6,62%	12,61%	8,52%		
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	6.820.354,68	1,12%		1.960.781.087,64	0,35%	OK	OK	OK	1,02%	3,28%	6,27%	12,10%	8,19%		
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	5.374.344,43	0,89%		412.491.696,99	1,30%	OK	OK	OK	1,14%	3,56%	6,98%	13,32%	9,09%		
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	8.464.642,66	1,39%		255.362.735,72	3,31%	OK	OK	OK	0,16%	-	-	-	-		
SANT FIC FI CORPORATE REF DI	12.225.093,32	2,01%		5.035.608.354,53	0,24%	OK	OK	OK	1,12%	3,44%	6,58%	12,54%	8,47%		
FIDC			5,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:			
FIDC Fechado	14.163.883,30	2,33%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
BELSUL 500 FDO DE INVEST EM DIR CRED SR	1.092.377,88	0,18%		7.328.046,52	14,91%	OK	OK	OK	1,18%	4,18%	-	-	-		
FIDC LAVORO II	5.102.370,58	0,84%		55.191.083,77	9,24%	OK	OK	OK	0,91%	3,89%	8,82%	18,34%	12,66%		
FIDC LAVORO II 2 MEZ	807.656,81	0,13%		7.450.483,22	10,84%	OK	OK	OK	1,95%	6,00%	11,61%	22,58%	15,06%		
FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2	2.126.871,52	0,35%		84.951.685,55	2,50%	OK	OK	OK	1,44%	4,42%	-	-	-		
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	1.052.747,75	0,17%		54.121.087,16	1,95%	OK	OK	OK	1,14%	2,57%	7,95%	-	11,58%		
GAVEVA SUL FIDC MULT LP SR	2.028.520,55	0,33%		39.061.272,59	5,19%	OK	OK	OK	1,50%	4,60%	-	-	-		
GOAL FIDC MULTISSETORIAL LP_SEN IV*	681.769,32	0,11%		-	-	OK	OK	OK	-	-	-	-	-		
LIBRA FIDC SENIOR 3 MULTISSETORIAL*	1.271.568,89	0,21%		-	-	OK	OK	OK	-	-	-	-	-		
Fundo Crédito Privado	16.069.776,77	2,65%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado		
HSBC FI RF CRED PRIV LP NILO	16.069.776,77	2,65%		461.534.783,64	3,48%	OK	OK	OK	-4,40%	-5,49%	-1,24%	0,21%	3,22%		

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

31/08/2015

Fundo	Valor Investido R\$	% Recursos	Limite PI	PL Fundo	% PL Fundo	Adequação Fundo	Diversificação		Rentabilidades						
							RPPS	Fundo	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	No Ano		
CONSOLIDADO	606.928.019,87	100,00%	100,00%												
META ATUARIAL (INPC + 6%)										-2,73%	-2,87%	1,10%	1,76%	4,24%	
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,74%	3,10%	8,00%	16,47%	11,96%	
										0,71%	3,13%	7,57%	16,10%	11,31%	
Fundos de Ações Referenciados	29.396.750,22	4,84%	30,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado		
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.727.880,18	0,61%		506.320.798,89	0,74%	OK	OK	OK	-6,57%	-2,89%		2,89%	-16,40%	-2,62%	
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	14.079.136,46	2,32%		140.704.897,90	10,01%	OK	OK	OK	-6,33%	-7,48%		-4,81%	-17,58%	-4,10%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	11.589.733,58	1,91%		460.569.970,98	2,52%	OK	OK	OK	-6,67%	-7,99%		-6,13%	-18,56%	-5,44%	
Fundos de Índices de Ações			20,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado		
Fundos de Ações	26.522.972,78	4,37%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado		
BB ACOES CONSUMO FICFI	5.781.721,92	0,95%		96.670.353,71	5,98%	OK	OK	OK	-6,05%	-4,83%		-1,67%	-5,40%	-1,04%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	13.362.886,48	2,20%		1.492.780.466,95	0,90%	OK	OK	OK	-5,47%	-2,66%		2,47%	-2,10%	6,44%	
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	1.802.007,13	0,30%		71.360.084,95	2,53%	OK	OK	OK	-6,47%	-3,25%		2,21%	-14,91%	-6,68%	
ITAU CONSUMO ACOES FI	5.576.357,25	0,92%		25.859.049,04	21,56%	OK	OK	OK	-6,06%	-4,98%		-1,43%	-4,74%	-0,69%	
Fundos Multimercados	14.055.754,00	2,32%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado		
SAFRA CARTEIRA INSTIT PREMIUM FI MULT	3.076.600,40	0,51%		140.944.994,52	2,18%	OK	OK	OK	-0,05%	2,28%		6,03%	14,18%	9,39%	
SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV	1.026.588,14	0,17%		263.244.688,60	0,39%	OK	OK	OK	1,08%	3,51%		7,00%	13,30%	8,94%	
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.362.597,56	0,55%		28.861.821,55	11,65%	OK	OK	OK	0,39%	3,10%		6,18%	12,00%	8,66%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	6.589.967,90	1,09%		214.005.359,02	3,08%	OK	OK	OK	-5,20%	-3,40%		-0,42%	10,34%	2,53%	
Fundos de Participações	5.293.655,55	0,87%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado		
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP*	598.036,38	0,10%		-		OK	OK	OK	-	-		-	-	-	
FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA	91.512,02	0,02%		4.749.473,84	1,93%	OK	OK	OK	-8,91%	-22,29%		-36,24%	-51,94%	-43,05%	
FIP LSH	4.064.259,31	0,67%		320.136.287,30	1,27%	OK	OK	OK	-0,47%	-0,61%		-1,27%	-0,05%	-1,72%	
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	539.847,84	0,09%		295.728.647,31	0,18%	OK	OK	OK	-0,59%	-1,77%		-45,00%	-45,59%	-45,09%	
Fundos de Investimento Imobiliários	4.227.800,23	0,70%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado		
DOMO FII	2.184.981,20	0,36%		191.185.854,91	1,14%	OK	OK	OK	0,01%	0,06%		0,17%	12,60%	0,24%	
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	2.042.819,03	0,34%		29.689.343,52	6,88%	OK	OK	OK	-1,76%	-0,53%		0,90%	2,99%	1,79%	

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.

* Até a geração do relatório, as informações não foram divulgadas.