

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

30/09/2015

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	609.612.877,98	100,00%	100,00%												
META ATUARIAL (INPC + 6%)										-0,48%	-3,44%	0,54%	5,63%	3,76%	
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,00%	2,83%	6,94%	16,50%	13,07%	
										1,03%	2,87%	6,74%	16,06%	12,45%	
Títulos Públicos	43.249.334,95	7,09%	10,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	43.249.334,95	7,09%								-	-	-	-	-	-
Fundos que contenham somente títulos públicos	310.011.837,03	50,85%	80,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado		
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IX FI	4.968.742,44	0,82%		2.132.911.192,34	0,23%	OK	OK	OK	1,35%	3,26%	-	-	-	-	-
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	27.115.952,03	4,45%		1.869.574.312,94	1,45%	OK	OK	OK	0,78%	1,46%	4,92%	-	-	-	-
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	5.792.605,83	0,95%		571.608.594,85	1,01%	OK	OK	OK	-0,28%	1,65%	3,98%	8,31%	6,33%		
BRADESCO FI RF IMA B TIT. PUBLICOS	60.961.495,68	10,00%		449.184.220,37	13,57%	OK	OK	OK	-0,73%	-4,72%	-0,06%	5,28%	3,15%		
BTG PACTUAL FI RF IMA B	13.740.474,22	2,25%		322.862.514,67	4,26%	OK	OK	OK	-0,73%	-4,47%	-0,29%	5,21%	3,10%		
CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF	5.110.160,00	0,84%		774.203.787,34	0,66%	OK	OK	OK	1,50%	0,67%	-	-	-	-	-
CAIXA FI BRASIL 2016 III TP RF	12.078.168,00	1,98%		720.227.139,51	1,68%	OK	OK	OK	1,50%	0,64%	-	-	-	-	-
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	5.153.680,00	0,85%		1.391.782.806,32	0,37%	OK	OK	OK	1,50%	0,68%	-	-	-	-	-
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	79.519.092,95	13,04%		3.455.269.717,59	2,30%	OK	OK	OK	-1,09%	-5,27%	-0,94%	4,51%	2,28%		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	9.921.850,20	1,63%		1.599.833.756,41	0,62%	OK	OK	OK	0,76%	1,99%	4,90%	11,47%	9,35%		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	27.762.354,42	4,55%		494.587.061,15	5,61%	OK	OK	OK	-0,72%	-4,57%	-0,11%	5,39%	3,15%		
SAFRA IMA FIC FI RF	4.909.658,55	0,81%		156.674.345,69	3,13%	OK	OK	OK	-0,16%	-1,97%	1,34%	7,32%	5,22%		
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	52.977.602,71	8,69%		309.983.002,82	17,09%	OK	OK	OK	-0,71%	-4,53%	0,06%	5,35%	3,40%		
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	123.401.698,48	20,24%	60,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	27.201.694,15	4,46%		929.372.251,93	2,93%	OK	OK	OK	-0,67%	-4,43%	0,18%	5,75%	3,41%		
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	8.419.634,64	1,38%		1.076.382.657,16	0,78%	OK	OK	OK	0,74%	1,96%	4,93%	11,45%	9,29%		
BRADESCO FI RF IMA B	43.097.987,13	7,07%		1.000.751.729,82	4,31%	OK	OK	OK	-0,70%	-4,63%	0,09%	6,09%	3,41%		
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	6.583.507,56	1,08%		2.358.460.633,60	0,28%	OK	OK	OK	-0,78%	-4,74%	-0,28%	5,84%	3,38%		
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	38.098.875,00	6,25%		165.906.029,22	22,96%	OK	OK	OK	-1,41%	-4,94%	-0,87%	4,64%	2,64%		
Fundos de Renda Fixa (Normal)	27.096.683,56	4,44%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	3.602.180,67	0,59%		5.815.160.052,45	0,06%	OK	OK	OK	1,12%	3,47%	6,71%	12,86%	9,74%		
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	3.250.411,14	0,53%		1.989.298.437,25	0,16%	OK	OK	OK	0,97%	3,24%	6,28%	12,16%	9,24%		
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	3.414.299,55	0,56%		440.822.329,87	0,77%	OK	OK	OK	1,12%	3,55%	6,93%	13,53%	10,32%		
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	8.519.004,76	1,40%		257.118.756,15	3,31%	OK	OK	OK	0,64%	1,71%	-	-	-		
SANT FIC FI CORPORATE REF DI	8.310.787,44	1,36%		5.237.819.543,67	0,16%	OK	OK	OK	1,11%	3,47%	6,64%	12,74%	9,68%		
FIDC			5,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:			
FIDC Fechado	14.027.887,40	2,30%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
BELSUL 500 FDO DE INVEST EM DIR CRED SR	1.102.144,44	0,18%		7.393.563,95	14,91%	OK	OK	OK	0,89%	3,69%	-	-	-		
FIDC LAVORO II	4.888.716,65	0,80%		52.880.041,99	9,24%	OK	OK	OK	-4,19%	-2,05%	1,99%	12,11%	7,94%		
FIDC LAVORO II 2 MEZ	780.036,50	0,13%		7.195.691,02	10,84%	OK	OK	OK	-3,42%	0,49%	5,87%	16,55%	11,12%		
FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2	2.157.541,11	0,35%		86.176.693,04	2,50%	OK	OK	OK	1,44%	4,48%	-	-	-		
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	1.063.364,92	0,17%		-	-	OK	OK	OK	-	-	-	-	-		
GAVEA SUL FIDC MULT LP SR	2.060.363,13	0,34%		39.646.355,87	5,20%	OK	OK	OK	1,50%	4,66%	-	-	-		
GOAL FIDC MULTISSETORIAL LP_SEN IV	691.852,95	0,11%		-	-	OK	OK	OK	-	-	-	-	-		
LIBRA FIDC SENIOR 3 MULTISSETORIAL	1.283.867,70	0,21%		35.456.829,24	3,62%	OK	OK	OK	-	-	-	-	-		
Fundo Crédito Privado	15.799.374,27	2,59%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado		
HSBC FI RF CRED PRIV LP NILO	15.799.374,27	2,59%		422.400.736,65	3,74%	OK	OK	OK	-1,68%	-6,67%	-2,29%	2,30%	1,48%		

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

30/09/2015

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	609.612.877,98	100,00%	100,00%												
META ATUARIAL (INPC + 6%)										-0,48%	-3,44%	0,54%	5,63%	3,76%	
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,00%	2,83%	6,94%	16,50%	13,07%	
										1,03%	2,87%	6,74%	16,06%	12,45%	
Fundos de Ações Referenciados	25.105.813,91	4,12%	30,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado		
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.816.122,45	0,63%		509.892.656,82	0,75%	OK	OK	OK	2,37%	-1,93%		1,90%	-6,46%	-0,31%	
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	11.841.744,06	1,94%		131.492.625,26	9,01%	OK	OK	OK	-1,89%	-9,86%		-7,51%	-9,50%	-5,92%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	9.447.947,40	1,55%		448.258.525,40	2,11%	OK	OK	OK	-1,67%	-10,09%		-8,68%	-10,13%	-7,02%	
Fundos de Índices de Ações			20,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado		
Fundos de Ações	26.377.849,06	4,33%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado		
BB ACOES CONSUMO FICFI	5.778.043,83	0,95%		88.780.988,59	6,51%	OK	OK	OK	-0,06%	-6,86%		-2,68%	1,08%	-1,11%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	13.166.832,67	2,16%		1.458.410.132,34	0,90%	OK	OK	OK	-1,47%	-6,30%		-0,42%	6,47%	4,88%	
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	1.853.578,73	0,30%		73.617.246,47	2,52%	OK	OK	OK	2,86%	-2,36%		2,05%	-6,57%	-4,01%	
ITAU CONSUMO ACOES FI	5.579.393,83	0,92%		25.191.559,08	22,15%	OK	OK	OK	0,05%	-6,76%		-2,33%	1,76%	-0,63%	
Fundos Multimercados	15.030.127,64	2,47%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado		
CAPITANIA MULTI CRED PRIV FIC FI MULT	1.004.510,56	0,16%		318.038.726,67	0,32%	OK	OK	OK	0,90%	2,99%		7,45%	14,05%	11,23%	
SAFRA CARTEIRA INSTIT PREMIUM FI MULT	3.114.151,91	0,51%		151.880.415,80	2,05%	OK	OK	OK	1,22%	2,98%		5,60%	13,91%	10,72%	
SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV	1.040.641,10	0,17%		284.268.298,23	0,37%	OK	OK	OK	1,37%	3,75%		7,24%	13,80%	10,43%	
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.393.968,53	0,56%		29.131.084,63	11,65%	OK	OK	OK	0,93%	2,84%		6,11%	12,58%	9,67%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	6.476.855,54	1,06%		190.203.773,66	3,41%	OK	OK	OK	-1,72%	-4,12%		-1,42%	9,18%	0,77%	
Fundos de Participações	5.274.063,97	0,87%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado		
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	593.913,18	0,10%		-		OK	OK	OK	-	-		-	-	-	
FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA	81.098,29	0,01%		4.209.001,38	1,93%	OK	OK	OK	-11,38%	-25,66%		-39,95%	-58,49%	-49,53%	
FIP LSH	4.063.232,98	0,67%		320.055.444,50	1,27%	OK	OK	OK	-0,03%	-0,57%		-1,25%	-2,22%	-1,74%	
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	535.819,52	0,09%		293.521.931,91	0,18%	OK	OK	OK	-0,75%	-1,81%		-45,27%	-45,87%	-45,50%	
Fundos de Investimento Imobiliários	4.238.207,71	0,70%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado		
DOMO FII	2.185.675,36	0,36%		191.246.594,40	1,14%	OK	OK	OK	0,03%	0,06%		0,17%	12,66%	0,27%	
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	2.052.532,35	0,34%		29.830.512,26	6,88%	OK	OK	OK	0,48%	-0,64%		0,81%	3,23%	2,28%	

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.