

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

31/12/2015

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	652.514.763,80	100,00%	100,00%							1,32%	3,99%	0,37%	7,85%	7,85%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,39%	4,31%	7,27%	17,95%	17,95%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,45%	4,32%	7,32%	17,31%	17,31%
Títulos Públicos	58.467.396,51	8,96%	10,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	58.467.396,51	8,96%								2,15%	5,16%	1,01%	9,73%	9,73%
Fundos que contenham somente títulos públicos	271.887.329,62	41,67%	80,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B							Alocação:	Enquadrado
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IX FI	5.211.172,56	0,80%		2.236.978.154,79	0,23%	OK	OK	OK	1,73%	4,88%	8,30%	-	-	-
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	28.507.478,12	4,37%		1.965.516.421,82	1,45%	OK	OK	OK	2,06%	5,13%	6,67%	-	-	-
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	5.988.312,04	0,92%		590.920.687,68	1,01%	OK	OK	OK	1,24%	3,38%	5,08%	9,92%	9,92%	-
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.208.623,15	0,80%		38.217.737,78	13,63%	OK	OK	OK	2,38%	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL FI RF IMA B	14.033.973,28	2,15%		136.945.160,00	10,25%	OK	OK	OK	1,68%	5,17%	0,46%	8,42%	8,42%	-
CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF	5.352.765,00	0,82%		810.958.856,25	0,66%	OK	OK	OK	1,67%	4,75%	5,44%	-	-	-
CAIXA FI BRASIL 2016 III TP RF	12.651.552,00	1,94%		754.418.401,28	1,68%	OK	OK	OK	1,67%	4,75%	5,41%	-	-	-
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	2.987.178,56	0,46%		417.078.698,97	0,72%	OK	OK	OK	2,68%	5,41%	-	-	-	-
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	10.098.532,99	1,55%		513.777.711,94	1,97%	OK	OK	OK	2,27%	5,04%	-2,04%	-	-	-
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	5.398.420,00	0,83%		1.457.875.650,08	0,37%	OK	OK	OK	1,67%	4,75%	5,46%	-	-	-
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	72.319.113,21	11,08%		3.317.951.442,96	2,18%	OK	OK	OK	1,46%	4,88%	-0,64%	7,27%	7,27%	-
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	10.429.600,99	1,60%		1.649.982.018,06	0,63%	OK	OK	OK	2,08%	5,12%	7,21%	14,94%	14,94%	-
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	55.726.942,35	8,54%		375.552.723,34	14,84%	OK	OK	OK	1,50%	5,15%	0,39%	8,72%	8,72%	-
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	37.973.665,37	5,82%		235.721.170,00	16,11%	OK	OK	OK	1,78%	5,49%	0,27%	8,27%	8,27%	-
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKA	189.627.874,61	29,06%	60,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	8.849.101,50	1,36%		1.193.004.322,28	0,74%	OK	OK	OK	2,07%	5,10%	7,17%	14,87%	14,87%	-
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	28.572.124,41	4,38%		901.755.196,20	3,17%	OK	OK	OK	1,50%	5,04%	0,39%	8,62%	8,62%	-
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	63.785.056,76	9,78%		479.563.296,46	13,30%	OK	OK	OK	1,47%	4,95%	-0,01%	8,25%	8,25%	-
BRADESCO FI RF IMA B	43.168.633,63	6,62%		1.023.375.388,84	4,22%	OK	OK	OK	1,43%	5,06%	0,19%	8,64%	8,64%	-
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	5.644.266,61	0,87%		2.360.710.492,14	0,24%	OK	OK	OK	1,21%	5,04%	0,07%	8,59%	8,59%	-
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	29.175.124,84	4,47%		490.477.147,67	5,95%	OK	OK	OK	1,48%	5,09%	0,29%	8,50%	8,40%	-
ITAU INSTITUCIONAL TIT PUBLICOS RF FI*	5.282.256,83	0,81%		26.494.179,32	19,94%	OK	OK	OK	-	-	-	-	-	-
SAFRA IMA FIC FI RF	5.151.310,04	0,79%		160.605.433,15	3,21%	OK	OK	OK	1,58%	4,92%	2,86%	10,40%	10,40%	-
Fundos de Renda Fixa (Normal)	48.490.272,72	7,43%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
BB RPPS RENDA FIXA FLUXO FIC FI	2.342.753,72	0,36%		1.020.727.607,67	0,23%	OK	OK	OK	1,08%	3,16%	6,47%	12,36%	12,36%	-
BB RPPS RENDA FIXA PERFL FIC FI	2.371.405,83	0,36%		5.926.736.811,87	0,04%	OK	OK	OK	1,18%	3,39%	6,98%	13,46%	13,46%	-
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	12.576.889,54	1,93%		1.822.392.479,27	0,69%	OK	OK	OK	1,13%	3,28%	6,62%	12,82%	12,82%	-
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	3.534.110,63	0,54%		457.540.406,10	0,77%	OK	OK	OK	1,24%	3,51%	7,19%	14,19%	14,19%	-
INFINITY LOTUS FIRF	499.247,58	0,08%		42.030.182,12	1,19%	OK	OK	OK	1,40%	3,87%	7,72%	17,21%	17,21%	-
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	9.060.936,48	1,39%		285.903.555,03	3,17%	OK	OK	OK	0,98%	2,97%	4,73%	-	-	-
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	9.060.936,48	1,39%		285.903.555,03	3,17%	OK	OK	OK	0,98%	2,97%	4,73%	-	-	-
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	9.043.992,47	1,39%		4.836.404.372,02	0,19%	OK	OK	OK	1,17%	3,37%	6,96%	13,37%	13,37%	-
FIDC			5,00%			Art. 7o, Inciso VI							Alocação:	
FIDC Fechado	11.935.203,90	1,83%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
BELSUL 500 FDO DE INVEST EM DIR CRED SR	1.038.116,65	0,16%		6.964.043,48	14,91%	OK	OK	OK	-8,23%	-5,81%	-2,34%	-	-	-
FIDC EMPIRICA GOAL ONE SUB SENIOR4*	482.013,06	0,07%		23.629.888,26	2,04%	OK	OK	OK	-	-	-	-	-	-
FIDC LAVORO II MEZ	505.074,29	0,08%		4.659.216,05	10,84%	OK	OK	OK	-13,66%	-35,25%	-34,93%	-28,05%	-28,05%	-
FIDC LAVORO II SEN	3.134.215,51	0,48%		33.902.036,00	9,24%	OK	OK	OK	-13,84%	-35,89%	-37,20%	-30,80%	-30,80%	-
FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2	2.252.277,89	0,35%		89.960.677,76	2,50%	OK	OK	OK	1,51%	4,39%	9,07%	-	-	-
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	1.026.675,17	0,16%		52.780.688,46	1,95%	OK	OK	OK	1,87%	5,80%	8,64%	18,05%	18,05%	-
GAVEA SUL FIDC SEN1	2.154.389,45	0,33%		41.455.648,99	5,20%	OK	OK	OK	1,57%	4,56%	9,43%	-	-	-
LIBRA FIDC SENIOR 3*	1.342.441,87	0,21%		37.064.324,19	3,62%	OK	OK	OK	-	-	-	-	-	-
Fundo Crédito Privado	16.827.138,66	2,58%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B							Alocação:	Enquadrado
HSBC FI RF CRED PRIV LP NILO	16.827.138,66	2,58%		389.447.790,48	4,32%	OK	OK	OK	2,26%	6,51%	-0,60%	8,08%	8,08%	-

**SANTOS****31/12/2015**

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	652.514.763,80	100,00%	100,00%							1,32%	3,99%	0,37%	7,85%	7,85%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,39%	4,31%	7,27%	17,95%	17,95%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,45%	4,32%	7,32%	17,31%	17,31%
Fundos de Ações Referenciados	15.247.942,39	2,34%	30,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.854.357,63	0,59%		501.729.173,51	0,77%	OK	OK	OK	-1,14%	1,00%	-0,94%	0,69%	0,69%	
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	6.811.467,14	1,04%		118.563.109,99	5,75%	OK	OK	OK	-2,30%	-2,95%	-12,52%	-8,69%	-8,69%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	4.582.117,62	0,70%		422.194.003,62	1,09%	OK	OK	OK	-2,14%	-2,34%	-12,20%	-9,20%	-9,20%	
Fundos de Índices de Ações			20,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
Fundos de Ações	14.307.691,42	2,19%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	12.406.036,29	1,90%		939.279.255,50	1,32%	OK	OK	OK	-2,14%	-5,78%	-11,72%	-1,18%	-1,18%	
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	1.901.655,13	0,29%		73.977.514,86	2,57%	OK	OK	OK	-0,32%	2,59%	0,17%	-1,52%	-1,52%	
Fundos Multimercados	18.603.945,57	2,85%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
CAPITANIA MULTI CRED PRIV FIC FI MULT	1.041.043,57	0,16%		296.139.574,45	0,35%	OK	OK	OK	1,21%	3,64%	6,74%	15,27%	15,27%	
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	299.843,01	0,05%		6.353.216,97	4,72%	OK	OK	OK	1,49%	4,41%	9,36%	26,51%	26,51%	
SAFRA CARTEIRA INSTIT PREMIUM FI MULT	3.223.200,42	0,49%		196.072.176,70	1,64%	OK	OK	OK	1,44%	3,50%	6,59%	14,60%	14,60%	
SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV	3.294.025,37	0,50%		382.753.085,29	0,86%	OK	OK	OK	1,42%	3,74%	7,63%	14,56%	14,56%	
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.541.566,22	0,54%		32.836.663,08	10,79%	OK	OK	OK	1,58%	4,35%	7,31%	14,44%	14,44%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	7.204.266,99	1,10%		188.384.804,92	3,82%	OK	OK	OK	0,31%	11,23%	6,65%	12,08%	12,08%	
Fundos de Participações	5.063.186,85	0,78%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	580.961,28	0,09%		299.188.562,87	0,19%	OK	OK	OK	0,08%	-	-	-	-	
FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA	54.038,51	0,01%		2.863.165,75	1,89%	OK	OK	OK	-15,46%	-33,37%	-50,47%	-66,37%	-66,37%	
FIP LSH	4.024.169,93	0,62%		327.709.619,76	1,23%	OK	OK	OK	-0,03%	-0,96%	-1,53%	-2,69%	-2,69%	
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	404.017,13	0,06%		221.320.582,33	0,18%	OK	OK	OK	2,57%	-24,60%	-25,96%	-58,91%	-58,91%	
Fundos de Investimento Imobiliários	2.056.781,54	0,32%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
VECTOR LAJES FII	2.056.781,54	0,32%		29.892.267,86	6,88%	OK	OK	OK	-0,83%	0,68%	0,06%	2,48%	2,48%	

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.