

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

29/01/2016

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	681.827.041,95	100,00%	100,00%							1,64%	3,74%	2,27%	7,77%	1,64%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										2,00%	5,08%	8,26%	17,99%	2,00%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,76%	4,79%	8,02%	17,35%	1,76%
Títulos Públicos	71.139.891,46	10,43%	10,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	71.139.891,46	10,43%								2,25%	5,28%	4,54%	8,32%	2,25%
Fundos que contenham somente títulos públicos	288.790.494,07	42,36%	80,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B							Alocação:	Enquadrado
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IX FI	5.305.312,51	0,78%		2.277.389.217,80	0,23%	OK	OK	OK	OK	1,81%	4,47%	8,57%	-	1,81%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	29.184.897,72	4,28%		2.012.222.726,62	1,45%	OK	OK	OK	OK	2,38%	5,26%	7,60%	-	2,38%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	6.124.389,77	0,90%		604.348.705,85	1,01%	OK	OK	OK	OK	2,27%	4,38%	5,55%	10,47%	2,27%
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.337.879,39	0,78%		39.166.144,22	13,63%	OK	OK	OK	OK	2,48%	6,02%	-	-	2,48%
BTG PACTUAL FI RF IMA B	14.305.030,30	2,10%		104.457.836,20	13,69%	OK	OK	OK	OK	1,93%	4,68%	3,12%	7,12%	1,93%
CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF	5.436.900,00	0,80%		823.705.342,89	0,66%	OK	OK	OK	OK	1,57%	4,25%	5,60%	-	1,57%
CAIXA FI BRASIL 2016 III TP RF	12.850.392,00	1,88%		766.275.551,53	1,68%	OK	OK	OK	OK	1,57%	4,25%	5,57%	-	1,57%
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	3.093.412,39	0,45%		437.696.262,33	0,71%	OK	OK	OK	OK	3,56%	6,78%	3,90%	-	3,56%
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	10.256.679,81	1,50%		533.893.199,92	1,92%	OK	OK	OK	OK	1,57%	5,26%	-0,22%	-	1,57%
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	10.267.410,70	1,51%		165.876.251,53	6,19%	OK	OK	OK	OK	2,36%	4,64%	-1,71%	-	2,36%
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	5.483.290,00	0,80%		1.480.795.475,51	0,37%	OK	OK	OK	OK	1,57%	4,25%	5,61%	-	1,57%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	73.606.498,63	10,80%		3.187.126.351,83	2,31%	OK	OK	OK	OK	1,78%	4,32%	2,00%	5,95%	1,78%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	10.735.594,58	1,57%		1.746.737.329,73	0,61%	OK	OK	OK	OK	2,93%	5,62%	8,47%	15,98%	2,93%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	58.084.013,76	8,52%		1.232.640.430,95	4,71%	OK	OK	OK	OK	2,96%	5,67%	8,62%	16,29%	2,96%
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	38.718.792,51	5,68%		239.177.397,18	16,19%	OK	OK	OK	OK	1,96%	4,85%	2,93%	6,83%	1,96%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKA	192.636.211,29	28,25%	60,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	9.109.890,98	1,34%		1.202.461.273,48	0,76%	OK	OK	OK	OK	2,95%	5,63%	8,43%	15,94%	2,95%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	29.107.903,69	4,27%		855.918.960,52	3,40%	OK	OK	OK	OK	1,88%	4,45%	3,05%	7,34%	1,88%
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	64.301.629,70	9,43%		516.354.121,80	12,45%	OK	OK	OK	OK	1,86%	4,39%	2,77%	6,97%	1,86%
BRADESCO FI RF IMA B	43.930.377,94	6,44%		1.020.535.005,25	4,30%	OK	OK	OK	OK	1,76%	4,29%	2,73%	7,25%	1,76%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	5.737.252,48	0,84%		2.284.418.068,01	0,25%	OK	OK	OK	OK	1,65%	4,15%	2,80%	7,16%	1,65%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	29.721.706,27	4,36%		499.177.148,72	5,95%	OK	OK	OK	OK	1,87%	4,41%	2,95%	7,14%	1,87%
ITAU INSTITUCIONAL TIT PUBLICOS RF FI	5.487.190,00	0,80%		46.702.026,90	11,75%	OK	OK	OK	OK	3,88%	-	-	-	3,88%
SAFRA IMA FIC FI RF	5.240.260,24	0,77%		160.580.261,11	3,26%	OK	OK	OK	OK	1,73%	4,38%	4,45%	9,88%	1,73%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	45.473.424,13	6,67%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
BB RPPS RENDA FIXA FLUXO FIC FI	1.503,12	0,00%		1.159.126.532,19	0,00%	OK	OK	OK	OK	0,98%	3,10%	6,34%	12,51%	0,98%
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	247.975,87	0,04%		6.435.498.720,79	0,00%	OK	OK	OK	OK	1,05%	3,33%	6,83%	13,59%	1,05%
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	13.744.831,02	2,02%		1.937.724.829,29	0,71%	OK	OK	OK	OK	1,16%	3,34%	6,56%	13,01%	1,16%
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	3.574.166,68	0,52%		467.954.172,63	0,76%	OK	OK	OK	OK	1,13%	3,52%	7,06%	14,30%	1,13%
INFINITY LOTUS FIRF	505.521,54	0,07%		42.852.411,63	1,18%	OK	OK	OK	OK	1,26%	3,88%	7,70%	14,89%	1,26%
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	19.430.608,24	2,85%		290.317.041,19	6,69%	OK	OK	OK	OK	1,41%	3,24%	5,26%	-	1,41%
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	7.968.817,67	1,17%		5.011.660.128,90	0,16%	OK	OK	OK	OK	1,05%	3,32%	6,80%	13,50%	1,05%
FIDC			5,00%			Art. 7o, Inciso VI							Alocação:	
FIDC Fechado	11.403.026,51	1,67%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
BELSUL 500 FDO DE INVEST EM DIR CRED SR	1.040.099,69	0,15%		6.977.346,41	14,91%	OK	OK	OK	OK	0,19%	-6,79%	-3,66%	-	0,19%
FIDC EMPIRICA GOAL ONE SUB SENIOR4	244.401,37	0,04%		11.981.370,21	2,04%	OK	OK	OK	OK	-49,30%	-	-	-	-49,30%
FIDC LAVORO II MEZ	514.433,92	0,08%		4.745.556,81	10,84%	OK	OK	OK	OK	1,85%	-10,43%	-35,07%	-27,89%	1,85%
FIDC LAVORO II SEN	3.185.089,88	0,47%		34.452.331,43	9,24%	OK	OK	OK	OK	1,62%	-11,10%	-37,01%	-30,96%	1,62%
FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2	1.826.570,53	0,27%		72.957.037,54	2,50%	OK	OK	OK	OK	-18,90%	-16,54%	-12,88%	-	-18,90%
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	1.043.632,88	0,15%		53.652.472,71	1,95%	OK	OK	OK	OK	1,65%	5,05%	8,78%	17,98%	1,65%
GAVEA SUL FIDC SEN1	2.185.125,99	0,32%		42.047.094,20	5,20%	OK	OK	OK	OK	1,43%	4,49%	9,26%	-	1,43%
LIBRA FIDC SENIOR 3	1.363.672,27	0,20%		37.650.487,79	3,62%	OK	OK	OK	OK	1,58%	-	-	-	1,58%
Fundo Crédito Privado	17.250.403,39	2,53%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B							Alocação:	Enquadrado
HSBC FI RF CRED PRIV LP NILO	17.250.403,39	2,53%		391.417.553,13	4,41%	OK	OK	OK	OK	2,52%	6,04%	2,63%	6,56%	2,52%

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

29/01/2016

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	681.827.041,95	100,00%	100,00%							1,64%	3,74%	2,27%	7,77%	1,64%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										2,00%	5,08%	8,26%	17,99%	2,00%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,76%	4,79%	8,02%	17,35%	1,76%
Fundos de Ações Referenciados	14.501.605,09	2,13%	30,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.545.162,70	0,52%		458.206.513,76	0,77%	OK	OK	OK	-8,02%	-6,54%	-11,15%	2,75%	-8,02%	
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	6.535.324,59	0,96%		112.839.408,22	5,79%	OK	OK	OK	-4,05%	-7,38%	-14,43%	-5,86%	-4,05%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	4.421.117,80	0,65%		411.497.965,03	1,07%	OK	OK	OK	-3,51%	-6,50%	-13,52%	-6,39%	-3,51%	
Fundos de Índices de Ações			20,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
Fundos de Ações	14.111.905,00	2,07%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	12.343.709,55	1,81%		284.449.588,94	4,34%	OK	OK	OK	-0,50%	-4,67%	-12,68%	2,99%	-0,50%	
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	1.768.195,45	0,26%		68.588.004,71	2,58%	OK	OK	OK	-7,02%	-4,53%	-8,23%	2,65%	-7,02%	
Fundos Multimercados	18.318.403,75	2,69%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
CAPITANIA MULTI CRED PRIV FIC FI MULT	1.046.562,20	0,15%		299.516.163,02	0,35%	OK	OK	OK	0,53%	2,78%	5,96%	14,20%	0,53%	
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	303.005,28	0,04%		9.277.843,04	3,27%	OK	OK	OK	1,05%	3,98%	8,73%	17,73%	1,05%	
SAFRA CARTEIRA INSTIT PREMIUM FI MULT	3.266.109,68	0,48%		226.502.548,35	1,44%	OK	OK	OK	1,33%	3,87%	6,10%	14,69%	1,33%	
SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV	3.329.061,79	0,49%		432.940.708,84	0,77%	OK	OK	OK	1,06%	3,52%	7,43%	14,67%	1,06%	
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.601.568,29	0,53%		33.392.989,54	10,79%	OK	OK	OK	1,69%	4,30%	7,53%	14,64%	1,69%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	6.772.096,50	0,99%		166.147.428,03	4,08%	OK	OK	OK	-6,00%	-4,42%	-2,58%	8,24%	-6,00%	
Fundos de Participações	5.027.291,87	0,74%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	576.682,02	0,08%		299.398.900,71	0,19%	OK	OK	OK	0,08%	-	-	-	0,08%	
FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA	43.992,63	0,01%		2.330.896,55	1,89%	OK	OK	OK	-18,59%	-38,17%	-56,21%	-71,10%	-18,59%	
FIP LSH	4.000.011,77	0,59%		333.277.494,44	1,20%	OK	OK	OK	-0,60%	-0,66%	-2,05%	-3,22%	-0,60%	
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	406.605,45	0,06%		222.738.466,12	0,18%	OK	OK	OK	0,64%	2,62%	-25,12%	-58,56%	0,64%	
Fundos de Investimento Imobiliários	3.174.385,39	0,47%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	1.070.000,00	0,16%		170.937.876,70	0,63%	OK	OK	OK	0,14%	-10,66%	-10,58%	-10,40%	0,14%	
VECTOR LAJES FII	2.104.385,39	0,31%		30.584.119,28	6,88%	OK	OK	OK	2,31%	1,47%	2,37%	4,42%	2,31%	

- 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.