

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

31/03/2016

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	726.528.537,37	100,00%	100,00%							4,28%	7,91%	12,21%	12,76%	7,91%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,93%	4,44%	8,94%	16,50%	4,44%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,92%	4,13%	8,63%	15,95%	4,13%
Títulos Públicos	81.403.514,39	11,20%	10,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PRÓPRIA SANTOS	81.403.514,39	11,20%								4,92%	10,56%	16,27%	17,99%	10,56%
Fundos que contenham somente títulos públicos	333.364.858,08	45,88%	80,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUBL IX FI	5.251.085,72	0,72%		2.254.122.552,99	0,23%	OK	OK	OK	OK	0,84%	3,70%	8,76%	-	3,70%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUBL VII FI	29.078.670,51	4,00%		2.004.898.643,85	1,45%	OK	OK	OK	OK	1,02%	5,01%	10,40%	15,83%	5,01%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUBL VIII FI	6.282.366,59	0,86%		619.937.700,88	1,01%	OK	OK	OK	OK	1,37%	4,91%	8,45%	12,77%	4,91%
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.525.216,13	0,76%		40.540.705,43	13,63%	OK	OK	OK	OK	3,74%	6,08%	-	-	6,08%
BTG PACTUAL FI RF IMA B	15.418.956,53	2,12%		128.991.423,32	11,95%	OK	OK	OK	OK	5,44%	9,87%	15,54%	15,21%	9,87%
CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF	5.385.320,00	0,74%		815.891.028,34	0,66%	OK	OK	OK	OK	0,91%	0,61%	5,38%	-	0,61%
CAIXA FI BRASIL 2016 III TP RF	12.728.508,00	1,75%		759.007.093,78	1,68%	OK	OK	OK	OK	0,91%	3,48%	8,39%	-	3,48%
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	3.115.107,04	0,43%		462.835.859,24	0,67%	OK	OK	OK	OK	1,12%	4,28%	9,92%	-	4,28%
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	10.710.688,18	1,47%		720.727.989,70	1,49%	OK	OK	OK	OK	4,05%	6,06%	11,41%	8,19%	6,06%
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	10.979.867,94	1,51%		182.773.619,31	6,01%	OK	OK	OK	OK	7,77%	9,46%	15,15%	8,81%	9,46%
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	5.430.865,00	0,75%		1.466.638.401,13	0,37%	OK	OK	OK	OK	0,91%	0,60%	5,38%	-	0,60%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	79.273.901,66	10,91%		3.387.647.993,76	2,34%	OK	OK	OK	OK	5,31%	9,62%	14,97%	13,89%	9,62%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	10.975.750,46	1,51%		1.961.009.424,33	0,56%	OK	OK	OK	OK	0,72%	5,24%	10,62%	16,05%	5,24%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	31.979.078,09	4,40%		531.868.395,23	6,01%	OK	OK	OK	OK	5,26%	9,61%	15,19%	15,06%	9,61%
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	59.406.497,26	8,18%		353.644.217,16	16,80%	OK	OK	OK	OK	5,32%	9,73%	15,38%	15,45%	9,73%
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	41.822.978,97	5,76%		267.259.096,58	15,65%	OK	OK	OK	OK	5,59%	10,14%	16,18%	15,17%	10,14%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	174.403.527,61	24,01%	60,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B	31.286.605,61	4,31%		906.306.624,70	3,45%	OK	OK	OK	OK	5,16%	9,50%	15,02%	15,22%	9,50%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B 5 LP FC	9.317.358,81	1,28%		1.609.080.196,25	0,58%	OK	OK	OK	OK	0,75%	5,29%	10,66%	16,12%	5,29%
BRADESCO FI RF IMA B	47.165.914,44	6,49%		1.025.977.549,72	4,60%	OK	OK	OK	OK	5,08%	9,26%	14,78%	14,89%	9,26%
BRADESCO FI RF IMA B TIT. PUBLICOS	69.246.546,29	9,53%		552.094.581,28	12,54%	OK	OK	OK	OK	5,33%	9,70%	15,13%	15,06%	9,70%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	6.166.680,69	0,85%		2.180.053.523,18	0,28%	OK	OK	OK	OK	5,23%	9,26%	14,76%	14,44%	9,26%
ITAU INSTITUCIONAL TIT PUBLICOS RF FI	5.621.805,23	0,77%		49.857.459,74	11,28%	OK	OK	OK	OK	0,63%	6,43%	-	-	6,43%
SAFRA IMA FIC FI RF	5.598.616,54	0,77%		180.008.842,26	3,11%	OK	OK	OK	OK	4,60%	8,68%	14,03%	15,56%	8,68%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	48.362.200,88	6,66%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB RPPS RENDA FIXA FLUXO FIC FI	8.395.074,69	1,16%		1.030.036.870,92	0,82%	OK	OK	OK	OK	1,05%	2,98%	6,23%	12,77%	2,98%
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	7.467.871,73	1,03%		2.010.405.174,32	0,37%	OK	OK	OK	OK	1,17%	3,36%	6,75%	13,46%	3,36%
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	3.632.345,43	0,50%		469.000.666,31	0,77%	OK	OK	OK	OK	0,56%	2,78%	6,39%	13,76%	2,78%
INFINITY LOTUS FIRF	517.563,42	0,07%		44.629.645,42	1,16%	OK	OK	OK	OK	1,33%	3,67%	7,68%	15,29%	3,67%
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	20.509.511,19	2,82%		322.905.619,41	6,35%	OK	OK	OK	OK	3,82%	7,04%	10,22%	-	7,04%
SANT FIC FI CORPORATE REF DI	7.839.834,42	1,08%		5.337.061.404,95	0,15%	OK	OK	OK	OK	1,14%	3,21%	6,69%	13,77%	3,21%
FIDC			5,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:		
FIDC Fechado	10.074.825,40	1,39%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BELSUL 500 FDO DE INVEST EM DIR CRED SR	1.188.597,71	0,16%		7.973.274,27	14,91%	OK	OK	OK	OK	14,27%	14,49%	7,84%	-	14,49%
FIDC LAVORO II	2.680.059,73	0,37%		28.989.544,87	9,24%	OK	OK	OK	OK	1,09%	-14,49%	-45,18%	-44,09%	-14,49%
FIDC LAVORO II 2 MEZ	437.038,01	0,06%		4.031.594,03	10,84%	OK	OK	OK	OK	2,04%	-13,47%	-43,97%	-40,68%	-13,47%
FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2	1.293.773,01	0,18%		51.675.993,22	2,50%	OK	OK	OK	OK	-30,08%	-42,56%	-40,03%	-	-42,56%
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	1.078.001,58	0,15%		55.419.370,73	1,95%	OK	OK	OK	OK	1,50%	5,00%	11,09%	17,39%	5,00%
GAVEA SUL FIDC MULT LP SR	2.249.483,36	0,31%		43.285.485,30	5,20%	OK	OK	OK	OK	1,57%	4,41%	9,18%	-	4,41%
GOAL FIDC MULTISSETORIAL LP_SEN IV*	251.508,50	0,03%		-	-	OK	OK	OK	OK	-	-	-	-	-
LIBRA FIDC SENIOR 3 MULTISSETORIAL*	896.363,50	0,12%		-	-	OK	OK	OK	OK	-	-	-	-	-
Fundo Crédito Privado	18.380.004,88	2,53%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
HSBC FI RF CRED PRIV LP NILO	18.380.004,88	2,53%		395.854.337,94	4,64%	OK	OK	OK	OK	3,84%	9,23%	16,33%	13,67%	9,23%

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

31/03/2016

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	726.528.537,37	100,00%	100,00%							4,28%	7,91%	12,21%	12,76%	7,91%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,93%	4,44%	8,94%	16,50%	4,44%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,92%	4,13%	8,63%	15,95%	4,13%
Fundos de Ações Referenciados	15.833.802,17	2,18%	30,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.429.597,89	0,47%		442.237.448,45	0,78%	OK	OK	OK	-5,29%	-11,02%	-10,13%	-8,42%	-11,02%	
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	7.347.850,89	1,01%		123.380.398,71	5,96%	OK	OK	OK	8,22%	7,87%	4,69%	-3,17%	7,87%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	5.056.353,39	0,70%		451.203.118,83	1,12%	OK	OK	OK	9,81%	10,35%	7,77%	-1,59%	10,35%	
Fundos de Índices de Ações			20,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
Fundos de Ações	15.401.645,18	2,12%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	13.689.815,57	1,88%		141.687.661,88	9,66%	OK	OK	OK	9,15%	10,35%	3,97%	3,54%	10,35%	
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	1.711.829,61	0,24%		66.430.915,89	2,58%	OK	OK	OK	-5,27%	-9,98%	-7,65%	-5,75%	-9,98%	
Fundos Multimercados	21.023.729,48	2,89%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
CAPITANIA MULTI CRED PRIV FIC FI MULT	1.075.500,86	0,15%		245.812.991,77	0,44%	OK	OK	OK	1,24%	3,31%	7,07%	15,05%	3,31%	
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	311.530,38	0,04%		12.225.840,62	2,55%	OK	OK	OK	1,97%	3,90%	8,48%	18,16%	3,90%	
SAFRA CARTEIRA INSTIT PREMIUM FI MULT	3.343.675,58	0,46%		320.460.473,54	1,04%	OK	OK	OK	1,14%	3,74%	7,37%	13,88%	3,74%	
SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV	3.371.698,05	0,46%		440.476.866,98	0,77%	OK	OK	OK	0,28%	2,36%	6,19%	13,87%	2,36%	
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.519.694,11	0,48%		32.633.869,36	10,79%	OK	OK	OK	-3,36%	-0,62%	3,70%	10,04%	-0,62%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	7.373.669,76	1,01%		146.210.783,10	5,04%	OK	OK	OK	7,45%	2,35%	13,85%	12,23%	2,35%	
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULT	2.027.960,74	0,28%		76.870.056,87	2,64%	OK	OK	OK	0,96%	3,93%	7,10%	18,12%	3,93%	
Fundos de Participações	4.978.816,69	0,69%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	552.646,96	0,08%		22.437.465,73	2,46%	OK	OK	OK	-6,28%	-13,52%	-	-	-13,52%	
FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA	23.573,14	0,00%		1.248.994,66	1,89%	OK	OK	OK	-30,29%	-56,38%	-70,93%	-82,54%	-56,38%	
FIP LSH	3.997.695,64	0,55%		333.084.516,18	1,20%	OK	OK	OK	-0,03%	-0,66%	-1,61%	-2,84%	-0,66%	
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	404.900,95	0,06%		221.804.742,85	0,18%	OK	OK	OK	-0,38%	0,22%	-24,43%	-58,65%	0,22%	
Fundos de Investimento Imobiliários	3.301.612,61	0,45%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	1.158.000,00	0,16%		171.183.406,46	0,68%	OK	OK	OK	-0,17%	-1,03%	11,35%	-5,08%	-1,03%	
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	2.143.612,61	0,30%		31.154.228,67	6,88%	OK	OK	OK	1,20%	4,22%	4,93%	5,29%	4,22%	

- 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.