

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

30/06/2016

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	770.194.368,69	100,00%	100,00%							1,70%	5,00%	13,31%	13,56%	13,31%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,96%	3,60%	8,20%	16,06%	8,20%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,84%	3,24%	7,50%	15,38%	7,50%
Títulos Públicos	90.283.942,71	11,72%	10,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	90.283.942,71	11,72%								1,50%	5,67%	16,84%	18,02%	16,84%
Fundos que contenham somente títulos públicos	426.571.076,97	55,38%	80,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	4.040.494,04	0,52%		1.931.296.848,84	0,21%	OK	OK	OK	OK	2,06%	5,94%	14,28%	16,18%	14,28%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IX FI	5.436.313,74	0,71%		2.333.635.001,93	0,23%	OK	OK	OK	OK	1,27%	3,53%	7,36%	16,27%	7,36%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	30.115.839,21	3,91%		2.076.408.726,97	1,45%	OK	OK	OK	OK	1,03%	3,57%	8,76%	16,01%	8,76%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	6.481.599,68	0,84%		639.597.821,54	0,10%	OK	OK	OK	OK	1,00%	3,17%	8,24%	13,74%	8,24%
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	73.181.014,79	9,50%		530.620.267,42	13,79%	OK	OK	OK	OK	1,85%	5,68%	15,93%	15,92%	15,93%
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.731.336,57	0,74%		42.053.094,79	13,63%	OK	OK	OK	OK	0,62%	3,73%	10,04%	-	10,04%
BTG PACTUAL FI RF IMA B	16.310.361,38	2,12%		163.850.491,90	9,95%	OK	OK	OK	OK	1,87%	5,78%	16,22%	16,76%	16,22%
CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF	5.575.695,00	0,72%		844.733.538,59	0,66%	OK	OK	OK	OK	1,34%	3,54%	4,16%	9,84%	4,16%
CAIXA FI BRASIL 2016 III TP RF	13.178.436,00	1,71%		785.836.910,69	1,68%	OK	OK	OK	OK	1,34%	3,53%	7,14%	12,94%	7,14%
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	3.219.201,39	0,42%		557.479.136,89	0,58%	OK	OK	OK	OK	0,68%	3,34%	7,77%	-	7,77%
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	11.281.833,34	1,46%		759.160.551,90	1,49%	OK	OK	OK	OK	0,74%	5,33%	11,72%	9,43%	11,72%
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	11.762.562,10	1,53%		195.802.603,66	6,01%	OK	OK	OK	OK	2,73%	7,13%	17,26%	9,92%	17,26%
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	5.622.920,00	0,73%		1.518.503.050,21	0,37%	OK	OK	OK	OK	1,34%	3,54%	4,16%	9,84%	4,16%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	83.858.309,62	10,89%		3.767.202.804,98	2,23%	OK	OK	OK	OK	1,92%	5,78%	15,96%	15,21%	15,96%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	11.327.622,83	1,47%		2.113.723.699,40	0,54%	OK	OK	OK	OK	0,90%	3,21%	8,61%	16,44%	8,61%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	33.804.191,41	4,39%		563.725.584,67	6,00%	OK	OK	OK	OK	1,89%	5,71%	15,87%	16,20%	15,87%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	61.342.592,33	7,96%		1.535.560.353,00	3,99%	OK	OK	OK	OK	0,92%	3,26%	8,73%	16,74%	8,73%
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	44.300.753,55	5,75%		346.762.077,30	12,78%	OK	OK	OK	OK	1,96%	5,92%	16,66%	16,98%	16,66%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKA	114.833.395,63	14,91%	60,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	9.623.069,10	1,25%		1.758.048.467,38	0,55%	OK	OK	OK	OK	0,91%	3,28%	8,75%	16,54%	8,75%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	33.052.606,46	4,29%		965.702.846,13	3,42%	OK	OK	OK	OK	1,84%	5,64%	15,68%	16,13%	15,68%
BRADESCO FI RF IMA B	49.965.537,02	6,49%		1.009.545.222,24	4,95%	OK	OK	OK	OK	1,94%	5,94%	15,75%	15,97%	15,75%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	6.515.774,75	0,85%		2.216.566.245,83	0,29%	OK	OK	OK	OK	1,90%	5,66%	15,44%	15,52%	15,44%
ITAU INSTITUCIONAL TIT PUBLICOS RF FI	5.649.824,33	0,73%		50.265.471,77	11,24%	OK	OK	OK	OK	0,82%	0,50%	6,96%	-	6,96%
SAFRA IMA FIC FI RF	5.890.620,28	0,76%		181.506.406,71	3,25%	OK	OK	OK	OK	1,79%	5,22%	14,35%	17,62%	14,35%
WA IMABS ATIVO FI RENDA FIXA	4.135.963,68	0,54%		104.744.508,22	3,95%	OK	OK	OK	OK	0,99%	3,87%	11,36%	16,91%	11,36%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	39.820.750,48	5,17%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	3.373.795,95	0,44%		1.002.995.941,73	0,34%	OK	OK	OK	OK	1,17%	3,20%	6,27%	13,15%	6,27%
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	6.108.906,28	0,79%		1.991.201.007,16	0,31%	OK	OK	OK	OK	1,15%	3,36%	6,84%	13,91%	6,84%
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	736.172,28	0,10%		393.755.607,04	0,19%	OK	OK	OK	OK	1,41%	3,74%	6,62%	14,28%	6,62%
INFINITY LOTUS FIRF	534.583,48	0,07%		47.622.032,18	1,12%	OK	OK	OK	OK	0,91%	3,29%	7,08%	15,34%	7,08%
ITAU INSTIT ALOCAO DINAMICA RF FICFI	21.652.706,26	2,81%		653.608.041,71	3,31%	OK	OK	OK	OK	2,01%	5,57%	13,01%	18,35%	13,01%
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	7.414.586,24	0,96%		5.471.759.977,56	0,14%	OK	OK	OK	OK	1,18%	3,39%	6,71%	14,14%	6,71%
FIDC			5,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:		
FIDC Fechado	9.524.157,86	1,24%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BELSUL 500 FDO DE INVEST EM DIR CRED SR	1.187.839,70	0,15%		7.968.435,93	14,91%	OK	OK	OK	OK	0,01%	-0,06%	14,42%	11,75%	14,42%
FIDC LAVORO II MEZ	463.048,72	0,06%		4.271.538,02	10,84%	OK	OK	OK	OK	2,04%	5,95%	-8,32%	-40,34%	-8,32%
FIDC LAVORO II SEN	2.779.234,88	0,36%		30.062.298,10	9,24%	OK	OK	OK	OK	1,09%	3,70%	-11,33%	-44,31%	-11,33%
FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2	449.806,05	0,06%		17.966.191,95	2,50%	OK	OK	OK	OK	-20,62%	-18,36%	-14,91%	-7,20%	-14,91%
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	1.023.733,56	0,13%		52.629.486,28	1,95%	OK	OK	OK	OK	1,37%	3,93%	9,12%	18,55%	9,12%
GAVEA SUL FIDC SEN1	2.352.087,35	0,31%		45.259.833,48	5,20%	OK	OK	OK	OK	1,57%	4,56%	9,18%	19,47%	9,18%
LIBRA FIDC MULTISSETORIAL SENIOR 3	232.710,65	0,03%		6.425.055,04	3,62%	OK	OK	OK	OK	-49,33%	-48,10%	-45,64%	-	-45,64%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL 6 SENIOR	1.035.696,95	0,13%		62.606.933,86	1,65%	OK	OK	OK	OK	1,13%	3,71%	8,61%	17,59%	8,61%
Fundo Crédito Privado	19.536.709,63	2,54%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
HSCB FI RF CRED PRIV LP NILO	19.536.709,63	2,54%		371.409.165,19	5,26%	OK	OK	OK	OK	1,92%	6,29%	16,10%	15,41%	16,10%

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

30/06/2016

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	770.194.368,69	100,00%	100,00%												
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,70%	5,00%	13,31%	13,56%	13,31%	
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,96%	3,60%	8,20%	16,06%	8,20%	
										0,84%	3,24%	7,50%	15,38%	7,50%	
Fundos de Ações Referenciados	16.282.534,88	2,11%	30,00%			Art. 8o, Inciso I							Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.381.927,81	0,44%		433.709.901,34	0,78%	OK	OK	OK	4,61%	-1,39%	-12,26%	-13,09%	-12,26%		
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	7.546.147,57	0,98%		109.118.981,22	6,92%	OK	OK	OK	5,30%	2,70%	10,79%	-3,09%	10,79%		
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	5.354.459,50	0,70%		471.039.649,96	1,14%	OK	OK	OK	5,53%	5,90%	16,86%	2,60%	16,86%		
Fundos de Índices de Ações			20,00%			Art. 8o, Inciso II							Alocação:	Enquadrado	
Fundos de Ações	16.597.631,43	2,15%	15,00%			Art. 8o, Inciso III							Alocação:	Enquadrado	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	14.867.623,65	1,93%		128.140.982,03	11,60%	OK	OK	OK	6,17%	8,60%	19,84%	5,80%	19,84%		
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	1.730.007,78	0,22%		63.954.037,06	2,71%	OK	OK	OK	6,21%	1,06%	-9,03%	-8,87%	-9,03%		
Fundos Multimercados	27.907.449,42	3,62%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV							Alocação:	Enquadrado	
CAPITANIA MULTI CRED PRIV FIC FI MULT	1.116.516,21	0,14%		212.230.279,48	0,53%	OK	OK	OK	1,27%	3,81%	7,25%	14,48%	7,25%		
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.348.380,54	0,18%		11.914.784,64	11,32%	OK	OK	OK	2,55%	4,85%	8,94%	19,13%	8,94%		
SAFRA CARTEIRA INSTIT PREMIUM FI MULT	4.493.357,92	0,58%		427.916.694,30	1,05%	OK	OK	OK	1,06%	3,61%	7,48%	14,57%	7,48%		
SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV	3.480.964,69	0,45%		414.232.636,67	0,84%	OK	OK	OK	1,16%	3,24%	5,68%	13,74%	5,68%		
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.562.935,98	0,46%		33.406.253,74	10,67%	OK	OK	OK	1,02%	1,23%	0,60%	7,96%	0,60%		
WA US INDEX 500 FI MULTI	7.755.730,40	1,01%		134.237.995,15	5,78%	OK	OK	OK	1,08%	5,18%	7,65%	14,81%	7,65%		
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULT	3.117.654,85	0,40%		112.685.839,05	2,77%	OK	OK	OK	0,93%	3,21%	7,27%	16,36%	7,27%		
XP LONG SHORT FI MULTIMERCADO	3.031.908,83	0,39%		624.953.328,65	0,49%	Desenquadrado	OK	OK	1,77%	7,94%	15,06%	24,98%	15,06%		
Fundos de Participações	5.577.826,14	0,72%	5,00%			Art. 8o, Inciso V							Alocação:	Enquadrado	
BRASIL ENERGIA RENOVAVEL FIP	399.165,68	0,05%		218.662.958,26	0,18%	OK	OK	OK	-1,46%	-1,42%	-1,20%	-26,85%	-1,20%		
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	524.848,91	0,07%		21.308.864,67	2,46%	OK	OK	OK	-3,55%	-5,03%	-17,87%	-	-17,87%		
FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA*	79,27	0,00%				OK	OK	OK	-	-	-	-	-		
FIP LSH	4.653.732,28	0,60%		387.744.917,22	1,20%	OK	OK	OK	-0,03%	16,41%	15,64%	13,88%	15,64%		
Fundos de Investimento Imobiliários	3.258.893,54	0,42%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI							Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	1.039.900,00	0,14%		172.395.932,04	0,60%	OK	OK	OK	-11,87%	-10,20%	-11,12%	-17,47%	-11,12%		
VECTOR LAJES FII	2.218.993,54	0,29%		31.537.215,04	7,04%	OK	OK	OK	0,01%	1,23%	5,50%	5,57%	5,50%		

- 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.