

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

29/07/2016

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	789.915.162,29	100,00%	100,00%							2,21%	3,95%	13,94%	16,35%	15,81%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,13%	3,60%	7,27%	16,13%	9,42%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,01%	3,15%	6,71%	15,26%	8,59%
Títulos Públicos	101.265.994,94	12,82%	10,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	101.265.994,94	12,82%								1,96%	3,84%	16,51%	21,79%	19,13%
Fundos que contenham somente títulos públicos	435.161.877,81	55,09%	80,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	4.093.664,07	0,52%		2.082.093.165,04	0,20%	OK	OK	OK	1,32%	3,70%	12,70%	16,29%	15,79%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IX FI	5.497.861,12	0,70%		2.360.055.312,68	0,23%	OK	OK	OK	1,13%	3,79%	6,65%	15,79%	8,58%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	30.504.140,35	3,86%		2.103.181.078,48	1,45%	OK	OK	OK	1,29%	3,31%	7,60%	15,78%	10,16%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	6.548.706,38	0,83%		646.219.846,36	1,01%	OK	OK	OK	1,04%	3,10%	6,93%	12,87%	9,36%	
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	75.032.123,28	9,50%		538.914.978,24	13,92%	OK	OK	OK	2,53%	4,24%	16,69%	19,92%	18,86%	
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.839.426,38	0,74%		42.846.192,20	13,63%	OK	OK	OK	1,89%	4,19%	9,40%	-	12,11%	
BTG PACTUAL FI RF IMA B	16.716.441,10	2,12%		174.243.526,45	9,59%	OK	OK	OK	2,49%	4,23%	16,86%	20,51%	19,11%	
CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF	5.640.090,00	0,71%		854.489.428,98	0,66%	OK	OK	OK	1,15%	4,00%	3,74%	9,55%	5,37%	
CAIXA FI BRASIL 2016 III TP RF	13.330.632,00	1,69%		794.911.971,54	1,68%	OK	OK	OK	1,15%	4,00%	6,70%	12,64%	8,37%	
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	3.270.616,70	0,41%		566.382.678,45	0,58%	OK	OK	OK	1,60%	2,64%	5,73%	9,85%	9,49%	
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	11.532.911,60	1,46%		776.055.891,32	1,49%	OK	OK	OK	2,23%	3,55%	12,44%	12,20%	14,20%	
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	12.058.811,22	1,53%		200.733.967,85	6,01%	OK	OK	OK	2,52%	5,22%	17,45%	15,44%	20,22%	
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	5.687.880,00	0,72%		1.536.046.069,67	0,37%	OK	OK	OK	1,16%	4,00%	3,73%	9,55%	5,36%	
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	85.939.257,89	10,88%		3.975.981.533,89	2,16%	OK	OK	OK	2,48%	4,31%	16,75%	19,10%	18,83%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	11.460.465,10	1,45%		2.150.711.919,93	0,53%	OK	OK	OK	1,17%	2,87%	6,75%	15,79%	9,88%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	34.638.114,65	4,39%		536.827.586,81	6,45%	OK	OK	OK	2,47%	4,26%	16,54%	19,98%	18,72%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	62.062.641,87	7,86%		1.573.294.917,70	3,94%	OK	OK	OK	1,17%	2,90%	6,85%	16,06%	10,01%	
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	45.308.094,10	5,74%		394.531.534,47	11,48%	OK	OK	OK	2,27%	4,31%	17,02%	20,44%	19,31%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	117.411.878,98	14,86%	60,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	9.736.182,26	1,23%		1.883.872.588,62	0,52%	OK	OK	OK	1,18%	2,90%	6,87%	15,88%	10,02%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	33.866.444,65	4,29%		979.215.484,53	3,46%	OK	OK	OK	2,46%	4,20%	16,35%	19,89%	18,53%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	51.204.423,63	6,48%		227.641.654,14	22,49%	OK	OK	OK	1,16%	2,81%	6,88%	15,53%	10,06%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	6.671.438,11	0,84%		2.355.481.144,47	0,28%	OK	OK	OK	2,39%	4,36%	16,28%	19,54%	18,20%	
ITAU INSTITUCIONAL TIT PUBLICOS RF FI	5.705.822,51	0,72%		50.763.678,09	11,24%	OK	OK	OK	0,99%	-0,51%	3,98%	-	8,02%	
SAFRA IMA FIC FI RF	6.036.751,47	0,76%		207.625.041,06	2,91%	OK	OK	OK	2,48%	4,17%	15,20%	20,33%	17,19%	
WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA	4.190.816,35	0,53%		103.739.547,30	4,04%	OK	OK	OK	1,33%	2,72%	8,42%	16,77%	12,84%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	34.032.958,35	4,31%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	706.311,32	0,09%		1.019.927.733,65	0,07%	OK	OK	OK	1,05%	3,33%	6,34%	13,09%	7,39%	
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	2.725.943,85	0,35%		2.086.605.453,02	0,13%	OK	OK	OK	1,10%	3,36%	6,77%	13,78%	8,01%	
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	744.392,12	0,09%		407.067.377,45	0,18%	OK	OK	OK	1,12%	3,71%	6,60%	14,13%	7,81%	
INFINITY LOTUS FIRF	543.380,28	0,07%		50.289.757,60	1,08%	OK	OK	OK	1,65%	3,77%	7,49%	15,77%	8,84%	
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	22.016.036,71	2,79%		754.288.682,39	2,92%	OK	OK	OK	1,68%	3,84%	13,31%	19,27%	14,90%	
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	7.296.894,07	0,92%		5.558.727.663,00	0,13%	OK	OK	OK	1,12%	3,46%	6,78%	14,05%	7,91%	
FIDC			5,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:		
FIDC Fechado	8.683.521,82	1,10%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BELSUL 500 FDO DE INVEST EM DIR CRED SR	1.186.683,06	0,15%		7.962.138,49	14,90%	OK	OK	OK	-0,08%	-0,06%	14,11%	9,94%	14,33%	
FIDC LAVORO II MEZ	419.607,58	0,05%		3.870.801,63	10,84%	OK	OK	OK	-9,38%	-5,73%	-18,43%	-47,04%	-16,92%	
FIDC LAVORO II SEN	2.496.873,27	0,32%		27.008.062,23	9,24%	OK	OK	OK	-10,16%	-7,86%	-21,61%	-50,62%	-20,33%	
FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2	112.697,39	0,01%		4.501.368,89	2,50%	OK	OK	OK	-74,95%	-79,82%	-78,97%	-77,10%	-78,68%	
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	1.034.452,18	0,13%		53.180.524,03	1,95%	OK	OK	OK	1,05%	3,83%	8,47%	17,99%	10,27%	
GAVEA SUL FIDC SEN1	2.387.318,33	0,30%		45.937.762,56	5,20%	OK	OK	OK	1,50%	4,64%	9,25%	19,37%	10,81%	
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL 6 SENIOR	1.045.890,01	0,13%		68.242.257,02	1,53%	OK	OK	OK	0,98%	3,57%	7,95%	17,17%	9,67%	
Fundo Crédito Privado	20.096.100,46	2,54%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
HSBC FI RF CRED PRIV LP NILO	20.096.100,46	2,54%		383.716.645,84	5,24%	OK	OK	OK	2,86%	4,56%	16,50%	19,56%	19,43%	

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

29/07/2016

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	789.915.162,29	100,00%	100,00%							2,21%	3,95%	13,94%	16,35%	15,81%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,13%	3,60%	7,27%	16,13%	9,42%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,01%	3,15%	6,71%	15,26%	8,59%
Fundos de Ações Referenciados	17.942.294,92	2,27%	30,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.740.815,25	0,47%		477.662.788,62	0,78%	OK	OK	OK	10,61%	6,32%	5,52%		-6,25%	-2,95%
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	8.315.677,79	1,05%		125.699.832,70	6,62%	OK	OK	OK	10,20%	9,14%	27,24%		8,88%	22,08%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	5.885.801,88	0,75%		468.496.918,04	1,26%	OK	OK	OK	9,92%	10,19%	33,13%		15,13%	28,45%
Fundos de Índices de Ações			20,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
Fundos de Ações	18.017.839,87	2,28%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FI ACOES	16.097.292,95	2,04%		149.145.080,04	10,79%	OK	OK	OK	8,27%	11,86%	30,41%		13,87%	29,75%
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	1.920.546,92	0,24%		69.829.752,19	2,75%	OK	OK	OK	11,01%	8,68%	8,62%		-0,32%	0,99%
Fundos Multimercados	28.503.506,10	3,61%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
CAPITANIA MULTI CRED PRIV FIC FI MULT	1.132.005,64	0,14%		215.174.549,62	0,53%	OK	OK	OK	1,39%	4,16%	8,16%		14,61%	8,74%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.368.864,39	0,17%		12.566.095,63	10,89%	OK	OK	OK	1,52%	7,40%	9,44%		18,99%	10,59%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	4.545.309,62	0,58%		442.296.999,44	1,03%	OK	OK	OK	1,16%	3,35%	7,30%		13,84%	8,73%
SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV	3.524.117,14	0,45%		400.365.279,72	0,88%	OK	OK	OK	1,24%	3,40%	5,86%		13,72%	6,99%
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.557.640,98	0,45%		33.356.607,80	10,67%	OK	OK	OK	-0,15%	-0,47%	-1,22%		6,22%	0,45%
WA US INDEX 500 FI MULTI	8.115.855,48	1,03%		136.823.630,45	5,93%	OK	OK	OK	4,64%	8,73%	19,84%		16,76%	12,65%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULT	3.178.019,43	0,40%		146.259.751,94	2,17%	OK	OK	OK	1,94%	3,86%	6,95%		16,83%	9,35%
XP LONG SHORT FI MULTIMERCADO	3.081.693,42	0,39%		630.493.678,72	0,49%	Desenquadrado	OK	OK	1,64%	6,48%	14,69%		22,59%	16,95%
Fundos de Participações	5.578.535,48	0,71%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL ENERGIA RENOVAVEL FIP	405.767,90	0,05%		222.279.656,94	0,18%	OK	OK	OK	1,65%	-0,10%	-0,21%		-25,28%	0,43%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	520.165,86	0,07%		21.118.735,17	2,46%	OK	OK	OK	-0,89%	-5,18%	-18,66%		-	-18,60%
FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA*	79,27	0,00%		-	-	OK	OK	OK	-	-	-		-	-
FIP LSH	4.652.522,45	0,59%		387.644.115,03	1,20%	OK	OK	OK	-0,03%	-0,08%	16,31%		13,93%	15,61%
Fundos de Investimento Imobiliários	3.220.653,56	0,41%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	1.070.000,00	0,14%		173.542.101,36	0,62%	OK	OK	OK	0,66%	1,72%	1,52%		-9,22%	1,66%
VECTOR LAJES FII	2.150.653,56	0,27%		32.256.311,05	6,67%	OK	OK	OK	-0,89%	-0,38%	2,20%		4,62%	4,56%

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.