

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

31/08/2016

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	799.254.806,44	100,00%	100,00%							0,71%	4,68%	12,71%	20,47%	16,63%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,80%	2,91%	6,59%	16,20%	10,29%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,93%	2,80%	6,22%	15,51%	9,60%
Títulos Públicos	106.737.230,92	13,35%	10,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	106.737.230,92	13,35%								0,91%	4,43%	14,08%	26,42%	20,21%
Fundos que contenham somente títulos públicos	434.066.182,79	54,31%	80,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5 FI	5.925.806,81	0,74%		1.355.838.563,44	0,44%	OK	OK	OK	0,89%	6,92%	21,25%	29,82%	25,80%	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	4.133.932,47	0,52%		3.281.801.252,74	0,13%	OK	OK	OK	0,98%	4,42%	12,05%	18,50%	16,92%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IX FI	778.024,50	0,10%		333.996.521,44	0,23%	OK	OK	OK	0,69%	3,13%	6,31%	16,22%	9,33%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	15.291.952,42	1,91%		1.054.340.316,79	1,45%	OK	OK	OK	0,86%	3,21%	6,88%	17,72%	11,11%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	6.625.326,59	0,83%		653.780.650,84	1,01%	OK	OK	OK	1,17%	3,24%	6,91%	14,05%	10,64%	
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	75.654.398,06	9,47%		580.871.557,80	13,02%	OK	OK	OK	0,83%	5,30%	15,08%	24,87%	19,85%	
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.738.880,96	0,72%		42.108.451,85	13,63%	OK	OK	OK	-1,72%	0,75%	7,75%	-	10,18%	
BTG PACTUAL FI RF IMA B	16.863.051,80	2,11%		182.893.371,51	9,22%	OK	OK	OK	0,88%	5,32%	15,31%	25,44%	20,16%	
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	3.211.454,56	0,40%		591.146.646,18	0,54%	OK	OK	OK	-1,81%	0,44%	4,24%	13,26%	7,51%	
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	11.362.161,27	1,42%		764.566.016,80	1,49%	OK	OK	OK	-1,48%	1,45%	10,38%	17,41%	12,51%	
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	11.889.917,62	1,49%		197.922.615,63	6,01%	OK	OK	OK	-1,40%	3,84%	16,70%	22,76%	18,53%	
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	115.461.465,73	14,45%		5.226.399.198,11	2,21%	OK	OK	OK	0,83%	5,32%	15,12%	24,30%	19,82%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	11.582.154,67	1,45%		2.141.229.623,60	0,54%	OK	OK	OK	1,06%	3,17%	6,29%	17,62%	11,05%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	34.928.570,62	4,37%		545.643.076,62	6,40%	OK	OK	OK	0,84%	5,28%	14,97%	24,91%	19,72%	
SAFRA IMA FIC FI RF	6.084.840,61	0,76%		246.904.584,88	2,46%	OK	OK	OK	0,80%	5,14%	13,68%	23,74%	18,12%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	62.742.781,86	7,85%		1.656.473.815,57	3,79%	OK	OK	OK	1,10%	3,22%	6,40%	17,90%	11,21%	
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	45.791.462,25	5,73%		412.637.539,16	11,10%	OK	OK	OK	1,07%	5,39%	15,61%	25,41%	20,59%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKa	122.897.674,76	15,38%	60,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	9.844.525,72	1,23%		2.318.867.463,76	0,42%	OK	OK	OK	1,11%	3,23%	6,45%	17,79%	11,25%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	44.636.076,65	5,58%		1.113.831.021,21	4,01%	OK	OK	OK	0,98%	5,37%	14,95%	24,89%	19,70%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	51.676.114,44	6,47%		1.106.731.938,87	4,67%	OK	OK	OK	0,92%	5,43%	15,13%	24,88%	19,71%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	6.735.829,88	0,84%		2.344.278.875,66	0,29%	OK	OK	OK	0,97%	5,35%	14,94%	24,37%	19,34%	
ITAU INSTITUCIONAL TIT PUBLICOS RF FI	5.770.426,14	0,72%		63.752.083,70	9,05%	OK	OK	OK	1,13%	2,97%	3,29%	-	9,24%	
WA IMABS ATIVO FI RENDA FIXA	4.234.701,93	0,53%		114.837.658,32	3,69%	OK	OK	OK	1,05%	3,40%	7,33%	20,00%	14,02%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	33.641.444,70	4,21%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	673.044,34	0,08%		1.359.282.502,77	0,05%	OK	OK	OK	1,16%	3,42%	6,60%	13,22%	8,63%	
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	753.739,94	0,09%		406.885.119,59	0,19%	OK	OK	OK	1,26%	3,83%	6,80%	14,26%	9,16%	
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	2.403.050,26	0,30%		2.244.004.211,62	0,11%	OK	OK	OK	1,19%	3,48%	6,97%	13,97%	9,30%	
INFINITY LOTUS FIRF	550.074,59	0,07%		58.678.227,17	0,94%	OK	OK	OK	1,23%	3,84%	7,69%	15,88%	10,18%	
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	22.217.704,62	2,78%		1.118.927.964,08	1,99%	OK	OK	OK	0,92%	4,67%	12,46%	20,17%	15,95%	
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	7.043.830,95	0,88%		5.609.404.436,80	0,13%	OK	OK	OK	1,22%	3,56%	7,03%	14,16%	9,22%	
FIDC			5,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:		
FIDC Fechado	8.275.352,86	1,04%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BELSUL 500 FDO DE INVEST EM DIR CRED SR	1.185.971,75	0,15%		7.955.905,08	14,91%	OK	OK	OK	-0,08%	-0,15%	14,02%	8,57%	14,24%	
FIDC LAVORO II MEZ	374.988,20	0,05%		3.459.196,16	10,84%	OK	OK	OK	-10,63%	-17,37%	-12,45%	-53,57%	-25,76%	
FIDC LAVORO II SEN	2.209.746,37	0,28%		23.902.281,38	9,24%	OK	OK	OK	-11,50%	-19,63%	-16,65%	-56,69%	-29,50%	
FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2	112.762,90	0,01%		4.503.985,65	2,50%	OK	OK	OK	1,05%	2,51%	7,00%	16,36%	9,88%	
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	1.047.837,15	0,13%		53.868.636,51	1,95%	OK	OK	OK	1,29%	3,76%	7,98%	18,17%	11,69%	
GAVEA SUL FIDC-SEN1	2.426.510,42	0,30%		46.691.912,96	5,20%	OK	OK	OK	1,64%	4,78%	9,56%	19,54%	12,63%	
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL 6 SENIOR	917.536,05	0,11%		59.867.414,86	1,53%	OK	OK	OK	1,19%	3,34%	7,39%	17,51%	10,98%	
Fundo Crédito Privado	20.291.840,66	2,54%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
HSBC FI RF CRED PRIV LP NILO	20.291.840,66	2,54%		367.730.446,18	5,52%	OK	OK	OK	0,97%	5,85%	14,64%	26,27%	20,59%	

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

31/08/2016

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	799.254.806,44	100,00%	100,00%							0,71%	4,68%	12,71%	20,47%	16,63%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,80%	2,91%	6,59%	16,20%	10,29%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,93%	2,80%	6,22%	15,51%	9,60%
Fundos de Ações Referenciados	17.976.070,60	2,25%	30,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.771.574,41	0,47%		489.198.882,99	0,77%	OK	OK	OK	0,82%	16,67%	4,15%		1,17%	-2,15%
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	8.322.096,01	1,04%		115.596.192,30	7,20%	OK	OK	OK	0,08%	16,13%	22,57%		16,33%	22,18%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	5.882.400,17	0,74%		468.226.200,22	1,26%	OK	OK	OK	-0,06%	15,93%	27,75%		23,28%	28,38%
Fundos de Índices de Ações			20,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
Fundos de Ações	17.728.266,18	2,22%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FI ACOES	15.751.097,75	1,97%		147.856.703,51	10,65%	OK	OK	OK	-3,14%	11,34%	24,31%		16,68%	25,68%
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	1.977.168,43	0,25%		71.967.389,47	2,75%	OK	OK	OK	2,95%	21,39%	9,41%		9,72%	3,97%
Fundos Multimercados	28.864.097,77	3,61%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
CAPITANIA MULTI CRED PRIV FIC FI MULT	1.145.311,36	0,14%		217.703.734,36	0,53%	OK	OK	OK	1,18%	3,88%	7,81%		15,04%	10,02%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.356.411,14	0,17%		16.971.162,87	7,99%	OK	OK	OK	-0,91%	3,16%	7,56%		16,29%	9,59%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	4.598.636,03	0,58%		477.318.832,62	0,96%	OK	OK	OK	1,17%	3,43%	7,24%		15,24%	10,00%
SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV	3.570.317,71	0,45%		395.722.244,72	0,90%	OK	OK	OK	1,31%	3,76%	6,18%		13,98%	8,39%
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.606.787,43	0,45%		33.817.406,94	10,67%	OK	OK	OK	1,38%	2,26%	-0,97%		7,26%	1,84%
WA US INDEX 500 FI MULTI	8.206.409,06	1,03%		136.647.968,99	6,01%	OK	OK	OK	1,12%	6,96%	19,58%		24,53%	13,91%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULT	3.227.666,97	0,40%		166.697.886,28	1,94%	OK	OK	OK	1,56%	4,50%	7,88%		16,98%	11,06%
XP LONG SHORT FI MULTIMERCADO	3.152.558,08	0,39%		626.499.695,46	0,50%	OK	OK	OK	2,30%	5,82%	15,20%		24,78%	19,64%
Fundos de Participações	5.571.683,92	0,70%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL ENERGIA RENOVAVEL FIP	405.425,04	0,05%		222.091.838,15	0,18%	OK	OK	OK	-0,08%	0,09%	-0,25%		-24,90%	0,35%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	514.918,09	0,06%		20.905.675,53	2,46%	OK	OK	OK	-1,01%	-5,37%	-12,68%		-	-19,42%
FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA	79,27	0,00%		-		OK	OK	OK	-	-	-		-	-
FIP LSH	4.651.261,52	0,58%		387.539.055,73	1,20%	OK	OK	OK	-0,03%	-0,08%	16,31%		14,44%	15,58%
Fundos de Investimento Imobiliários	3.204.961,27	0,40%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	1.044.000,00	0,13%		175.308.174,56	0,60%	OK	OK	OK	1,02%	2,66%	2,45%		-8,30%	2,70%
VECTOR LAJES FII	2.160.961,27	0,27%		32.410.910,08	6,67%	OK	OK	OK	0,48%	-0,41%	2,02%		5,78%	5,07%

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.