

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

30/09/2016

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	811.699.046,91	100,00%	100,00%							1,43%	4,41%	9,63%	22,88%	18,30%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,57%	2,52%	6,21%	15,70%	10,92%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,57%	2,53%	5,85%	14,98%	10,22%
Títulos Públicos	108.307.645,69	13,34%	10,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	108.307.645,69	13,34%								1,85%	4,79%	10,74%	28,75%	22,44%
Fundos que contenham somente títulos públicos	440.616.060,45	54,28%	80,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5 FI	6.023.254,93	0,74%		1.350.203.899,00	0,45%	OK	OK	OK	1,64%	5,97%	13,71%	34,39%	27,87%	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	4.214.848,74	0,52%		3.309.894.909,48	0,13%	OK	OK	OK	1,96%	4,32%	10,51%	22,07%	19,21%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IX FI	788.402,57	0,10%		338.451.703,46	0,23%	OK	OK	OK	1,33%	3,19%	6,83%	16,20%	10,79%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	15.505.667,18	1,91%		1.069.075.394,25	1,45%	OK	OK	OK	1,40%	3,59%	7,28%	18,44%	12,66%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	6.700.779,55	0,83%		661.226.278,18	1,01%	OK	OK	OK	1,14%	3,38%	6,66%	15,68%	11,90%	
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	76.843.969,69	9,47%		595.151.799,32	12,91%	OK	OK	OK	1,57%	5,01%	10,97%	27,76%	21,73%	
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.818.439,54	0,72%		42.692.202,16	13,63%	OK	OK	OK	1,39%	1,52%	5,31%	-	11,71%	
BTG PACTUAL FI RF IMA B	17.135.964,43	2,11%		176.576.773,33	9,70%	OK	OK	OK	1,62%	5,06%	11,14%	28,41%	22,10%	
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	3.258.443,95	0,40%		609.890.289,59	0,53%	OK	OK	OK	1,46%	1,22%	4,60%	14,98%	9,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	11.490.044,10	1,42%		773.171.327,69	1,49%	OK	OK	OK	1,13%	1,85%	7,28%	19,52%	13,78%	
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	11.968.418,30	1,47%		204.341.615,48	5,86%	OK	OK	OK	0,66%	1,75%	9,00%	25,51%	19,32%	
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	117.289.620,14	14,45%		5.236.456.842,45	2,24%	OK	OK	OK	1,58%	4,97%	11,04%	27,66%	21,72%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	11.741.512,70	1,45%		2.171.390.486,84	0,54%	OK	OK	OK	1,38%	3,65%	6,98%	18,34%	12,58%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	35.459.068,50	4,37%		569.048.476,91	6,23%	OK	OK	OK	1,52%	4,90%	10,88%	27,72%	21,54%	
SAFRA IMA FIC FI RF	6.179.256,28	0,76%		277.963.130,60	2,22%	OK	OK	OK	1,55%	4,90%	10,37%	25,86%	19,96%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	63.613.996,43	7,84%		1.683.893.135,40	3,78%	OK	OK	OK	1,39%	3,70%	7,08%	18,58%	12,76%	
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	46.584.373,39	5,74%		430.195.360,56	10,83%	OK	OK	OK	1,73%	5,15%	11,38%	29,41%	22,68%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	124.905.429,13	15,39%	60,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	9.981.626,24	1,23%		2.234.777.780,68	0,45%	OK	OK	OK	1,39%	3,73%	7,13%	18,55%	12,80%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	45.369.470,54	5,59%		1.169.761.031,60	3,88%	OK	OK	OK	1,64%	5,17%	11,11%	27,79%	21,66%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	52.537.936,55	6,47%		1.191.572.422,21	4,41%	OK	OK	OK	1,67%	5,15%	11,39%	27,86%	21,70%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	6.837.352,01	0,84%		2.345.947.611,75	0,29%	OK	OK	OK	1,51%	4,94%	10,88%	27,24%	21,14%	
ITAU INSTITUCIONAL TIT PUBLICOS RF FI	5.871.071,81	0,72%		67.896.100,62	8,65%	OK	OK	OK	1,74%	3,92%	4,43%	-	11,15%	
WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA	4.307.971,97	0,53%		128.248.275,67	3,36%	OK	OK	OK	1,73%	4,16%	8,19%	21,75%	15,99%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	36.015.818,43	4,44%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	902.635,65	0,11%		1.087.310.565,32	0,08%	OK	OK	OK	1,04%	3,29%	6,59%	13,23%	9,76%	
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	762.546,37	0,09%		413.021.030,54	0,18%	OK	OK	OK	1,17%	3,58%	7,45%	14,32%	10,44%	
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	3.861.222,81	0,48%		2.173.188.938,54	0,18%	OK	OK	OK	1,10%	3,43%	6,90%	14,12%	10,50%	
INFINITY LOTUS FIRF	557.251,44	0,07%		67.724.737,89	0,82%	OK	OK	OK	1,30%	4,24%	7,67%	15,94%	11,62%	
ITAU INSTIT ALOCAAO DINAMICA RF FICFI	22.619.003,19	2,79%		1.151.542.145,17	1,96%	OK	OK	OK	1,81%	4,46%	10,29%	21,56%	18,05%	
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	7.313.158,97	0,90%		5.656.991.417,92	0,13%	OK	OK	OK	1,11%	3,48%	7,00%	14,15%	10,43%	
FIDC			5,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:		
FIDC Fechado	7.447.939,38	0,92%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BELSUL 500 FDO DE INVEST EM DIR CRED SR	1.177.774,34	0,15%		7.900.914,01	14,91%	OK	OK	OK	-0,69%	-0,85%	-0,91%	6,86%	13,45%	
FIDC LAVORO II MEZ	327.672,49	0,04%		3.022.717,52	10,84%	OK	OK	OK	-12,62%	-29,24%	-25,02%	-57,99%	-35,12%	
FIDC LAVORO II SEN	1.910.025,62	0,24%		20.660.275,89	9,24%	OK	OK	OK	-13,56%	-31,28%	-28,73%	-60,93%	-39,06%	
FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2	115.207,24	0,01%		4.601.617,39	2,50%	OK	OK	OK	2,54%	4,25%	8,10%	17,62%	12,67%	
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	529.334,27	0,07%		27.212.735,80	1,95%	OK	OK	OK	1,03%	3,41%	7,47%	19,39%	12,85%	
GAVEA SUL FIDC-SEN1	2.462.856,16	0,30%		47.391.292,59	5,20%	OK	OK	OK	1,50%	4,71%	9,49%	19,54%	14,32%	
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL 6 SENIOR	925.069,26	0,11%		60.358.942,14	1,53%	OK	OK	OK	0,90%	3,11%	6,93%	17,28%	11,98%	
Fundo Crédito Privado	20.688.195,04	2,55%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
HSBC FI RF CRED PRIV LP NILO	20.688.195,04	2,55%		370.917.188,74	5,58%	OK	OK	OK	1,95%	5,89%	12,56%	30,94%	22,95%	

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

30/09/2016

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	811.699.046,91	100,00%	100,00%							1,43%	4,41%	9,63%	22,88%	18,30%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,57%	2,52%	6,21%	15,70%	10,92%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,57%	2,53%	5,85%	14,98%	10,22%
Fundos de Ações Referenciados	17.987.165,23	2,22%	30,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.807.313,44	0,47%		489.143.733,39	0,78%	OK	OK	OK	0,95%	12,58%	11,01%	-0,23%	-1,22%	
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	8.310.239,55	1,02%		109.523.639,96	7,59%	OK	OK	OK	-0,14%	10,13%	13,10%	18,40%	22,00%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	5.869.612,23	0,72%		467.298.233,20	1,26%	OK	OK	OK	-0,22%	9,62%	16,08%	25,10%	28,10%	
Fundos de Índices de Ações			20,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
Fundos de Ações	17.558.300,47	2,16%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FI ACOES	15.563.724,29	1,92%		152.186.771,23	10,23%	OK	OK	OK	-1,19%	3,62%	12,54%	17,01%	24,18%	
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	1.994.576,18	0,25%		72.393.350,44	2,76%	OK	OK	OK	0,88%	15,29%	16,52%	7,61%	4,89%	
Fundos Multimercados	29.185.942,12	3,60%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
CAPITANIA MULTI CRED PRIV FIC FI MULT	1.156.712,23	0,14%		147.548.685,46	0,78%	OK	OK	OK	1,00%	3,60%	7,55%	15,15%	11,11%	
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.392.373,35	0,17%		17.619.115,57	7,90%	OK	OK	OK	2,65%	3,26%	8,27%	17,45%	12,49%	
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	4.655.441,37	0,57%		494.167.548,80	0,94%	OK	OK	OK	1,24%	3,61%	7,35%	15,26%	11,36%	
SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV	3.619.178,00	0,45%		399.822.950,99	0,91%	OK	OK	OK	1,37%	3,97%	7,34%	13,98%	9,87%	
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.662.731,35	0,45%		34.846.670,63	10,51%	OK	OK	OK	1,55%	2,80%	4,06%	7,92%	3,42%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	8.271.318,22	1,02%		135.394.550,15	6,11%	OK	OK	OK	0,79%	6,65%	12,17%	27,71%	14,81%	
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULT	3.253.854,14	0,40%		180.089.238,79	1,81%	OK	OK	OK	0,81%	4,37%	7,72%	15,37%	11,96%	
XP LONG SHORT FI MULTIMERCADO	3.174.333,47	0,39%		624.413.110,80	0,51%	OK	OK	OK	0,69%	4,70%	13,01%	25,25%	20,47%	
Fundos de Participações	5.566.332,39	0,69%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL ENERGIA RENOVAVEL FIP	405.805,61	0,05%		222.300.315,77	0,18%	OK	OK	OK	0,09%	1,66%	0,22%	-24,26%	0,44%	
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	510.366,15	0,06%		24.248.576,63	2,10%	OK	OK	OK	1,38%	-0,53%	-5,54%	-	-18,31%	
FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA*	79,27	0,00%		-	-	OK	OK	OK	-	-	-	-	-	
FIP LSH	4.650.081,36	0,57%		387.440.725,67	1,20%	OK	OK	OK	-0,03%	-0,08%	16,32%	14,44%	15,55%	
Fundos de Investimento Imobiliários	3.420.218,60	0,42%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	1.240.000,00	0,15%		176.652.664,23	0,70%	OK	OK	OK	0,77%	2,47%	3,19%	-7,63%	3,48%	
VECTOR LAJES FII	2.180.218,60	0,27%		32.699.738,62	6,67%	OK	OK	OK	0,89%	0,47%	1,71%	6,73%	6,00%	

- 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.