

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

31/10/2016

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	820.909.351,05	100,00%	100,00%							0,96%	3,15%	7,22%	21,90%	19,46%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,66%	2,04%	5,71%	15,02%	11,65%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,75%	2,26%	5,48%	14,35%	11,04%
Títulos Públicos	108.788.997,84	13,25%	100,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	108.788.997,84	13,25%								0,49%	3,28%	7,25%	26,69%	23,04%
Fundos que contenham somente títulos públicos	446.687.479,10	54,41%	80,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5 FI	6.066.903,32	0,74%		1.479.492.929,20	0,41%	OK	OK	OK	0,72%	3,29%	8,71%	31,90%	28,80%	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	4.266.639,16	0,52%		3.531.171.082,90	0,12%	OK	OK	OK	1,23%	4,23%	8,08%	22,44%	20,68%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IX FI	791.621,74	0,10%		339.833.655,81	0,23%	OK	OK	OK	0,41%	2,45%	6,34%	14,15%	11,24%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	15.575.369,95	1,90%		1.073.881.220,23	1,45%	OK	OK	OK	0,45%	2,73%	6,13%	16,35%	13,17%	
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	77.330.720,20	9,42%		615.059.615,46	12,57%	OK	OK	OK	0,63%	3,06%	7,44%	25,54%	22,50%	
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.841.356,38	0,71%		42.860.354,09	13,63%	OK	OK	OK	0,39%	0,03%	4,23%	16,02%	12,15%	
BTG PACTUAL FI RF IMA B	17.245.203,11	2,10%		183.222.909,17	9,41%	OK	OK	OK	0,64%	3,16%	7,52%	26,19%	22,88%	
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	3.273.000,12	0,40%		612.614.326,29	0,53%	OK	OK	OK	0,45%	0,07%	2,71%	12,98%	9,57%	
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	11.520.298,36	1,40%		775.206.750,87	1,49%	OK	OK	OK	0,26%	-0,11%	3,44%	18,23%	14,08%	
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	12.071.152,02	1,47%		206.095.627,13	5,86%	OK	OK	OK	0,86%	0,10%	5,33%	23,03%	20,34%	
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	118.048.749,00	14,38%		5.531.286.059,18	2,13%	OK	OK	OK	0,65%	3,09%	7,53%	25,56%	22,51%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	11.791.839,78	1,44%		2.116.249.348,57	0,56%	OK	OK	OK	0,43%	2,89%	5,84%	16,01%	13,06%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	35.674.999,01	4,35%		566.025.738,42	6,30%	OK	OK	OK	0,61%	2,99%	7,38%	25,33%	22,28%	
ITAU INSTITUCIONAL TIT PUBLICOS RF FI	5.893.906,65	0,72%		68.160.172,92	8,65%	OK	OK	OK	0,39%	3,30%	2,77%	-	11,58%	
SAFRA IMA FIC FI RF	6.218.484,43	0,76%		321.890.728,93	1,93%	OK	OK	OK	0,63%	3,01%	7,30%	23,86%	20,72%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	63.893.276,58	7,78%		1.729.688.385,31	3,69%	OK	OK	OK	0,44%	2,95%	5,94%	16,24%	13,25%	
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	46.850.749,79	5,71%		461.169.793,79	10,16%	OK	OK	OK	0,57%	3,40%	7,87%	26,87%	23,38%	
WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA	4.333.209,50	0,53%		131.999.612,46	3,28%	OK	OK	OK	0,59%	3,40%	6,21%	19,32%	16,67%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	115.491.810,69	14,07%	60,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	10.025.834,79	1,22%		2.233.696.690,00	0,45%	OK	OK	OK	0,44%	2,98%	5,96%	16,25%	13,30%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	45.662.725,60	5,56%		1.192.314.678,43	3,83%	OK	OK	OK	0,65%	3,31%	7,64%	25,55%	22,45%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	52.908.255,09	6,45%		1.244.532.604,98	4,25%	OK	OK	OK	0,70%	3,33%	7,78%	25,60%	22,56%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	6.894.995,21	0,84%		2.407.096.858,85	0,29%	OK	OK	OK	0,84%	3,35%	7,86%	25,16%	22,16%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	41.875.657,96	5,10%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	745.694,98	0,09%		1.136.422.256,79	0,07%	OK	OK	OK	0,99%	3,22%	6,66%	13,17%	10,85%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	6.768.222,63	0,82%		667.881.490,72	1,01%	OK	OK	OK	1,01%	3,35%	6,56%	15,35%	13,02%	
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	769.909,86	0,09%		402.406.335,00	0,19%	OK	OK	OK	0,97%	3,43%	7,27%	14,14%	11,51%	
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	2.865.926,06	0,35%		1.935.964.764,02	0,15%	OK	OK	OK	1,04%	3,37%	6,84%	14,05%	11,65%	
INFINITY LOTUS FIRF	562.800,19	0,07%		68.027.553,56	0,83%	OK	OK	OK	1,00%	3,57%	7,48%	15,65%	12,73%	
ITAU INSTIT ALOCAAO DINAMICA RF FICFI	22.844.903,40	2,78%		1.202.923.288,33	1,90%	OK	OK	OK	1,00%	3,76%	7,75%	21,38%	19,23%	
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	7.318.200,84	0,89%		5.641.409.397,27	0,13%	OK	OK	OK	1,05%	3,42%	6,99%	14,10%	11,59%	
FIDC			5,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:		
FIDC Fechado	6.969.387,56	0,85%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BELSUL 500 FDO DE INVEST EM DIR CRED SR	1.006.427,79	0,12%		6.751.462,64	14,91%	OK	OK	OK	-14,55%	-15,21%	-15,25%	-9,81%	-3,05%	
FIDC LAVORO II MEZ	278.088,53	0,03%		2.565.314,80	10,84%	OK	OK	OK	-15,13%	-33,73%	-37,53%	-51,58%	-44,94%	
FIDC LAVORO II SEN	1.606.764,90	0,20%		17.379.979,56	9,24%	OK	OK	OK	-15,88%	-35,65%	-40,71%	-55,15%	-48,73%	
FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2	115.075,46	0,01%		4.596.353,89	2,50%	OK	OK	OK	0,54%	2,78%	5,77%	15,01%	11,76%	
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	533.330,49	0,06%		27.418.178,72	1,95%	OK	OK	OK	0,84%	3,20%	7,16%	17,60%	13,80%	
GAVEA SUL FIDC-SEN1	2.497.771,80	0,30%		48.063.153,63	5,20%	OK	OK	OK	1,42%	4,63%	9,48%	19,44%	15,94%	
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL 6 SENIOR	931.928,58	0,11%		60.806.499,10	1,53%	OK	OK	OK	0,83%	2,95%	6,63%	16,65%	12,91%	
Fundo Crédito Privado	20.848.924,40	2,54%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
HSBC FI RF CRED PRIV LP NILO	20.848.924,40	2,54%		365.140.122,81	5,71%	OK	OK	OK	0,78%	3,75%	8,47%	28,17%	23,90%	

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

31/10/2016

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	820.909.351,05	100,00%	100,00%							0,96%	3,15%	7,22%	21,90%	19,46%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,66%	2,04%	5,71%	15,02%	11,65%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,75%	2,26%	5,48%	14,35%	11,04%
Fundos de Ações Referenciados	19.907.189,23	2,43%	30,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FIA PROGRAMADO	4.281.347,40	0,52%		542.930.443,19	0,79%	OK	OK	OK	12,45%	14,45%	21,69%	12,86%	11,08%	
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	9.209.835,15	1,12%		109.462.980,97	8,41%	OK	OK	OK	10,83%	10,75%	20,87%	30,52%	35,21%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	6.416.006,68	0,78%		516.352.020,78	1,24%	OK	OK	OK	9,31%	9,01%	20,12%	35,68%	40,02%	
Fundos de Índices de Ações			20,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
Fundos de Ações	18.746.023,47	2,28%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	2.201.307,47	0,27%		79.901.984,59	2,76%	OK	OK	OK	10,36%	14,62%	24,57%	18,86%	15,76%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FI ACOES	16.544.716,00	2,02%		163.191.071,80	10,14%	OK	OK	OK	6,30%	1,74%	13,81%	26,48%	32,01%	
Fundos Multimercados	32.519.856,49	3,96%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
CAPITANIA MULTI CRED PRIV FIC FI MULT	1.169.196,11	0,14%		149.141.113,55	0,78%	OK	OK	OK	1,08%	3,29%	7,58%	14,83%	12,31%	
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.407.720,46	0,17%		16.824.583,09	8,37%	OK	OK	OK	0,95%	2,68%	10,29%	16,85%	13,56%	
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	4.707.413,62	0,57%		501.314.302,83	0,94%	OK	OK	OK	1,12%	3,57%	7,04%	15,43%	12,60%	
SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV	3.662.621,59	0,45%		406.246.848,94	0,90%	OK	OK	OK	1,20%	3,93%	7,46%	13,89%	11,19%	
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.701.315,18	0,45%		35.213.751,21	10,51%	OK	OK	OK	1,05%	4,04%	3,55%	7,18%	4,51%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	8.204.951,58	1,00%		130.183.594,81	6,30%	OK	OK	OK	-0,80%	1,10%	9,92%	15,81%	13,89%	
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULT	6.394.595,06	0,78%		196.438.755,63	3,26%	OK	OK	OK	2,42%	4,86%	8,92%	17,54%	14,67%	
XP LONG SHORT FI MULTIMERCADO	3.272.042,87	0,40%		637.894.430,02	0,51%	OK	OK	OK	3,08%	6,18%	13,06%	28,64%	24,17%	
Fundos de Participações	5.651.871,36	0,69%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL ENERGIA RENOVAVEL FIP	405.444,22	0,05%		222.102.344,58	0,18%	OK	OK	OK	-0,09%	-0,08%	-0,18%	2,32%	0,35%	
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	596.181,60	0,07%		24.204.973,79	2,46%	OK	OK	OK	-0,07%	0,29%	-4,91%	-	-18,37%	
FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA*	79,27	0,00%		-		OK	OK	OK	0,00%	0,00%	-99,40%	-99,89%	-99,85%	
FIP LSH	4.650.166,27	0,57%		417.381.126,32	1,11%	OK	OK	OK	0,00%	-0,05%	-0,13%	15,49%	15,56%	
Fundos de Investimento Imobiliários	3.422.152,95	0,42%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	1.240.000,00	0,15%		177.972.408,12	0,70%	OK	OK	OK	0,00%	15,89%	6,90%	26,02%	5,98%	
VECTOR LAJES FII	2.182.152,95	0,27%		32.728.750,76	6,67%	OK	OK	OK	0,09%	1,46%	2,72%	7,81%	8,71%	

- 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.