

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

30/12/2016

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	833.473.748,32	100,00%	100,00%							2,35%	2,36%	6,90%	21,12%	21,12%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,63%	1,85%	4,42%	12,97%	12,97%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,79%	2,22%	4,80%	12,67%	12,67%
Títulos Públicos	112.263.694,43	13,47%	100,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	112.263.694,43	13,47%								3,08%	3,47%	8,43%	26,69%	26,69%
Fundos que contenham somente títulos públicos	458.243.469,74	54,98%	80,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5 FI	6.158.108,96	0,74%		1.052.170.875,89	0,59%	OK	OK	OK	3,71%	2,24%	8,34%	30,74%	30,74%	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	4.356.164,07	0,52%		3.466.342.099,07	0,13%	OK	OK	OK	1,81%	3,35%	7,81%	23,21%	23,21%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IX FI	805.959,37	0,10%		345.988.624,72	0,23%	OK	OK	OK	1,12%	2,23%	5,49%	13,26%	13,26%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	15.843.635,96	1,90%		1.092.377.460,92	1,45%	OK	OK	OK	1,42%	2,18%	5,84%	15,11%	15,11%	
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	78.622.117,61	9,43%		578.599.195,71	13,59%	OK	OK	OK	2,89%	2,31%	7,44%	24,55%	24,55%	
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.943.288,51	0,71%		43.608.270,78	13,63%	OK	OK	OK	1,84%	2,15%	3,70%	14,10%	14,10%	
BTG PACTUAL FI RF IMA B	17.510.539,45	2,10%		201.213.335,54	8,70%	OK	OK	OK	2,89%	2,19%	7,36%	24,77%	24,77%	
CAIXA FI BRASIL 2018 II TP RF	4.063.001,10	0,49%		3.107.198.535,12	0,13%	OK	OK	OK	1,13%	2,16%	2,88%	8,58%	8,58%	
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	3.327.227,92	0,40%		892.478.414,06	0,37%	OK	OK	OK	1,55%	2,11%	3,36%	11,38%	11,38%	
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	11.697.885,31	1,40%		820.476.215,39	1,43%	OK	OK	OK	1,74%	1,81%	3,69%	15,84%	15,84%	
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	12.262.145,42	1,47%		209.356.623,51	5,86%	OK	OK	OK	3,34%	2,45%	4,25%	22,24%	22,24%	
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	120.028.096,07	14,40%		4.724.619.896,78	2,54%	OK	OK	OK	2,88%	2,33%	7,42%	24,56%	24,56%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	11.996.464,29	1,44%		1.893.493.369,33	0,63%	OK	OK	OK	1,36%	2,17%	5,90%	15,02%	15,02%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	36.232.176,93	4,35%		576.494.963,14	6,28%	OK	OK	OK	2,87%	2,18%	7,18%	24,19%	24,19%	
ITAU INSTITUCIONAL TIT PUBLICOS RF FI	5.993.307,70	0,72%		83.932.441,47	7,14%	OK	OK	OK	1,25%	-0,86%	3,03%	10,20%	10,20%	
SAFRA IMA FIC FI RF	6.308.927,76	0,76%		347.599.459,09	1,81%	OK	OK	OK	2,75%	2,10%	7,10%	22,47%	22,47%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	65.029.021,89	7,80%		1.331.744.011,26	4,88%	OK	OK	OK	1,38%	2,22%	6,01%	15,27%	15,27%	
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	47.672.715,49	5,72%		431.237.880,85	11,05%	OK	OK	OK	2,76%	2,34%	7,61%	25,54%	25,54%	
WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA	4.392.685,93	0,53%		133.353.536,67	3,29%	OK	OK	OK	1,73%	1,97%	6,21%	18,27%	18,27%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	117.427.449,52	14,09%	60,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	10.201.225,45	1,22%		1.970.956.693,10	0,52%	OK	OK	OK	1,36%	2,20%	6,01%	15,28%	15,28%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	46.412.384,27	5,57%		1.109.454.048,62	4,18%	OK	OK	OK	2,88%	2,30%	7,59%	24,46%	24,46%	
BRADERCO INST FIC FI RF IMA B	53.807.183,46	6,46%		1.271.470.620,48	4,23%	OK	OK	OK	3,00%	2,42%	7,69%	24,64%	24,64%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	7.006.656,34	0,84%		2.286.107.718,62	0,31%	OK	OK	OK	2,80%	2,48%	7,53%	24,14%	24,14%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	37.696.882,76	4,52%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	3.365.655,58	0,40%		1.345.651.611,08	0,25%	OK	OK	OK	1,05%	3,05%	6,44%	13,11%	13,11%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	6.912.345,64	0,83%		682.103.408,40	1,01%	OK	OK	OK	1,10%	3,16%	6,65%	15,43%	15,43%	
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	780.843,34	0,09%		423.433.792,05	0,18%	OK	OK	OK	0,53%	2,40%	6,07%	13,09%	13,09%	
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	1.626.157,75	0,20%		1.865.446.621,60	0,09%	OK	OK	OK	1,11%	3,20%	6,74%	14,04%	14,04%	
INFINITY LOTUS FIRF	576.707,60	0,07%		72.320.533,71	0,80%	OK	OK	OK	1,36%	3,49%	7,88%	15,52%	15,52%	
ITAU INST ALOCACAO DINAMICA RF FIC FI	23.276.360,70	2,79%		1.223.348.136,08	1,90%	OK	OK	OK	2,12%	2,91%	7,50%	21,48%	21,48%	
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	1.158.812,15	0,14%		5.440.219.438,73	0,02%	OK	OK	OK	1,13%	3,27%	6,87%	14,04%	14,04%	
FIDC			5,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:		
FIDC Fechado	5.558.857,30	0,67%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BELSUL 500 FDO DE INVEST EM DIR CRED SR	773.474,30	0,09%		5.187.735,45	14,91%	OK	OK	OK	-0,41%	-34,34%	-34,90%	-25,51%	-25,51%	
FIDC LAVORO II MEZ	173.243,06	0,02%		1.598.134,92	10,84%	OK	OK	OK	-23,52%	-47,13%	-62,59%	-65,70%	-65,70%	
FIDC LAVORO II SEN	981.576,01	0,12%		10.617.433,18	9,24%	OK	OK	OK	-24,29%	-48,61%	-64,68%	-68,68%	-68,68%	
FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2	111.733,27	0,01%		4.462.859,77	2,50%	OK	OK	OK	-0,16%	0,96%	3,84%	12,23%	12,23%	
FIDC SUL INVEST MULT SUB JR	947.576,94	0,11%		24.091.795,50	3,93%	OK	OK	OK	5,16%	5,55%	15,86%	32,53%	32,53%	
GAVEA SUL FIDC-MEZ1	2.571.253,72	0,31%		14.785.919,37	17,39%	OK	OK	OK	1,69%	4,90%	10,41%	12,83%	12,83%	
Fundo Crédito Privado	21.199.889,92	2,54%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
HSBC FI RF CRED PRIV LP NILO	21.199.889,92	2,54%		369.880.498,89	5,73%	OK	OK	OK	3,18%	2,47%	8,51%	25,99%	25,99%	

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

30/12/2016

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	833.473.748,32	100,00%	100,00%							2,35%	2,36%	6,90%	21,12%	21,12%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,63%	1,85%	4,42%	12,97%	12,97%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,79%	2,22%	4,80%	12,67%	12,67%
Fundos de Ações Referenciados	18.475.188,45	2,22%	30,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FIA PROGRAMADO	4.047.277,82	0,49%		522.144.503,14	0,78%	OK	OK	OK	1,42%	6,30%	19,67%	5,01%	5,01%	
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	8.491.787,04	1,02%		77.750.217,03	10,92%	OK	OK	OK	-1,54%	2,18%	12,53%	24,67%	24,67%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	5.936.123,59	0,71%		481.259.581,68	1,23%	OK	OK	OK	-1,50%	1,13%	10,86%	29,55%	29,55%	
Fundos de Índices de Ações			20,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:		
Fundos de Ações	16.893.414,64	2,03%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FI ACOES	14.829.059,74	1,78%		177.807.612,23	8,34%	OK	OK	OK	-1,23%	-4,72%	-1,27%	18,32%	18,32%	
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	2.064.354,90	0,25%		75.262.181,94	2,74%	OK	OK	OK	5,13%	3,50%	19,33%	8,56%	8,56%	
Fundos Multimercados	36.702.555,93	4,40%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
CAPITANIA MULTI CRED PRIV FIC FI MULT	1.193.874,91	0,14%		153.142.274,36	0,78%	OK	OK	OK	1,30%	3,21%	6,93%	14,68%	14,68%	
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	4.470.620,02	0,54%		25.823.727,25	17,31%	OK	OK	OK	1,25%	3,74%	7,12%	16,69%	16,69%	
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	4.795.688,89	0,58%		570.675.708,58	0,84%	OK	OK	OK	1,41%	3,01%	6,73%	14,72%	14,72%	
SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV	3.752.835,43	0,45%		381.889.419,02	0,98%	OK	OK	OK	1,11%	3,69%	7,81%	13,93%	13,93%	
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.779.712,19	0,45%		35.897.050,22	10,53%	OK	OK	OK	1,32%	3,19%	6,08%	6,72%	6,72%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	8.845.339,16	1,06%		138.540.096,97	6,38%	OK	OK	OK	3,16%	6,94%	14,05%	22,78%	22,78%	
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULT	6.551.712,63	0,79%		255.143.261,89	2,57%	OK	OK	OK	1,39%	4,94%	9,52%	17,48%	17,48%	
XP LONG SHORT FI MULTIMERCADO	3.312.772,70	0,40%		633.826.786,18	0,52%	OK	OK	OK	0,86%	4,36%	9,26%	25,72%	25,72%	
Fundos de Participações	5.818.820,01	0,70%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL ENERGIA RENOVAVEL FIP	403.265,92	0,05%		220.909.073,22	0,18%	OK	OK	OK	0,07%	-0,63%	1,03%	-0,19%	-0,19%	
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	767.474,91	0,09%		31.159.480,45	2,46%	OK	OK	OK	3,72%	2,91%	2,36%	-15,93%	-15,93%	
FIP LSH	4.648.079,18	0,56%		417.193.797,20	1,11%	OK	OK	OK	-0,02%	-0,04%	-0,12%	15,50%	15,50%	
Fundos de Investimento Imobiliários	3.193.525,62	0,38%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	968.000,00	0,12%		162.124.042,52	0,60%	OK	OK	OK	-9,36%	-8,22%	-5,96%	-5,03%	-5,03%	
VECTOR LAJES FII	2.225.525,62	0,27%		43.429.806,86	5,12%	OK	OK	OK	2,13%	2,08%	3,88%	10,87%	10,87%	

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.