

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SANTOS**

**31/03/2015**

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	
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>577.429.342,51</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>							<b>0,09%</b>	<b>3,20%</b>	<b>4,99%</b>	<b>13,54%</b>	<b>3,20%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										<b>2,00%</b>	<b>5,74%</b>	<b>8,94%</b>	<b>14,92%</b>	<b>5,74%</b>
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										<b>1,81%</b>	<b>5,35%</b>	<b>8,74%</b>	<b>14,62%</b>	<b>5,35%</b>
<b>Títulos Públicos</b>	<b>16.579.959,85</b>	<b>2,87%</b>	<b>10,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	16.579.959,85	2,87%								-0,98%	2,82%	4,83%	14,34%	2,82%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>271.497.684,31</b>	<b>47,02%</b>	<b>80,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TP	10.604.027,60	1,84%		5.186.278.994,26	0,20%	OK	OK	OK	-0,33%	3,26%	5,53%	15,13%	3,26%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	5.571.130,38	0,96%		549.753.617,57	1,01%	OK	OK	OK	0,16%	2,27%	4,17%	10,83%	2,27%	
BRADESCO FI RF IMA B TIT. PUBLICOS	54.329.065,09	9,41%		723.055.859,28	7,51%	OK	OK	OK	-0,36%	3,21%	5,34%	14,86%	3,21%	
BTG PACTUAL FI RF IMA B	13.779.803,47	2,39%		216.416.676,88	6,37%	OK	OK	OK	-0,35%	3,39%	5,51%	15,17%	3,39%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	5.275.633,53	0,91%		3.199.763.695,05	0,16%	OK	OK	OK	0,97%	4,16%	6,29%	12,84%	4,16%	
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	67.331.224,44	11,66%		3.984.674.148,05	1,69%	OK	OK	OK	-0,32%	3,25%	5,51%	15,25%	3,25%	
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	35.691.101,03	6,18%		134.125.141,03	26,61%	OK	OK	Desenquadrado	-0,45%	4,28%	4,94%	15,42%	4,28%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	13.108.592,98	2,27%		1.674.120.590,06	0,78%	OK	OK	OK	0,99%	4,24%	6,26%	12,67%	4,24%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	24.155.215,38	4,18%		574.986.233,18	4,20%	OK	OK	OK	-0,32%	3,27%	5,51%	15,02%	3,27%	
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	41.651.890,41	7,21%		323.589.594,03	12,87%	OK	OK	OK	-0,31%	3,33%	5,29%	14,38%	3,33%	
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKa</b>	<b>112.689.018,03</b>	<b>19,52%</b>	<b>60,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso III, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	16.571.288,39	2,87%		1.288.420.870,62	1,29%	OK	OK	OK	-0,35%	3,23%	5,56%	15,39%	3,23%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	8.023.695,54	1,39%		532.033.826,39	1,51%	OK	OK	OK	0,97%	4,15%	6,21%	12,61%	4,15%	
BRADESCO FI RF IMA B	43.058.194,88	7,46%		940.204.586,54	4,58%	OK	OK	OK	-0,36%	3,31%	5,99%	15,49%	3,31%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	6.601.989,95	1,14%		2.384.200.141,55	0,28%	OK	OK	OK	0,06%	3,67%	6,14%	16,02%	3,67%	
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	38.433.849,27	6,66%		226.628.361,27	16,96%	OK	OK	OK	-0,72%	3,54%	5,56%	14,78%	3,54%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>78.244.972,20</b>	<b>13,55%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	20.564.826,75	3,56%		5.430.629.201,45	0,38%	OK	OK	OK	1,04%	2,84%	5,77%	11,47%	2,84%	
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	40.860.200,61	7,08%		2.243.363.395,27	1,82%	OK	OK	OK	0,96%	2,79%	5,53%	11,09%	2,79%	
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	5.082.385,04	0,88%		392.030.136,87	1,30%	OK	OK	OK	1,17%	3,17%	6,18%	12,07%	3,17%	
SANT FIC FI CORPORATE REF DI	11.737.559,80	2,03%		4.147.035.622,93	0,28%	OK	OK	OK	1,06%	2,85%	5,72%	11,42%	2,85%	
<b>FIDC</b>			<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>		
<b>FIDC Fechado</b>	<b>9.868.427,18</b>	<b>1,71%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BELSUL 500 FIDC SENIOR I*	1.016.061,30	0,18%		-		OK	OK	OK	-	-	-	-	-	
FIDC LAVORO II	4.793.228,31	0,83%		51.847.168,05	9,24%	OK	OK	OK	2,23%	5,83%	9,92%	-	5,83%	
FIDC LAVORO II 2 MEZ	736.778,94	0,13%		6.796.648,17	10,84%	OK	OK	OK	1,82%	4,96%	10,08%	-	4,96%	
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	1.077.671,71	0,19%		55.402.412,07	1,95%	OK	OK	OK	2,16%	5,59%	9,58%	-	5,59%	
GOAL FIDC MULTISSETORIAL LP_SEN IV*	1.058.542,57	0,18%		-		OK	OK	OK	-	-	-	-	-	
LIBRA FIDC SENIOR 3 MULTISSETORIAL*	1.186.144,35	0,21%		-		OK	OK	OK	-	-	-	-	-	
<b>Fundo Crédito Privado</b>	<b>8.134.068,82</b>	<b>1,41%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
ITAU BBA INVEST GRADE RF CRED PRIV FICFI	8.134.068,82	1,41%		579.949.883,30	1,40%	OK	OK	OK	1,05%	2,87%	5,80%	11,53%	2,87%	

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SANTOS**

**31/03/2015**

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	
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>577.429.342,51</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>							<b>0,09%</b>	<b>3,20%</b>	<b>4,99%</b>	<b>13,54%</b>	<b>3,20%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										<b>2,00%</b>	<b>5,74%</b>	<b>8,94%</b>	<b>14,92%</b>	<b>5,74%</b>
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										<b>1,81%</b>	<b>5,35%</b>	<b>8,74%</b>	<b>14,62%</b>	<b>5,35%</b>
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>41.208.468,60</b>	<b>7,14%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
GERACAO FIA PROGRAMADO	1.751.250,34	0,30%		538.494.923,50	0,33%	OK	OK	OK	3,36%	-2,17%	-8,20%	-1,85%	-2,17%	
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	20.947.231,14	3,63%		217.631.482,51	9,63%	OK	OK	OK	0,97%	1,72%	-2,16%	2,85%	1,72%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	18.509.987,12	3,21%		474.960.711,11	3,90%	OK	OK	OK	1,08%	1,82%	-1,59%	2,63%	1,82%	
<b>Fundos de Índices de Ações</b>			<b>20,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso II</b>						<b>Alocação:</b>		
<b>Fundos de Ações</b>	<b>20.942.178,20</b>	<b>3,63%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB ACOES CONSUMO FICFI	5.937.152,95	1,03%		112.381.158,57	5,28%	OK	OK	OK	0,98%	1,62%	3,86%	15,41%	1,62%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	6.999.173,77	1,21%		1.258.748.206,09	0,56%	OK	OK	OK	1,39%	5,31%	6,91%	15,07%	5,31%	
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	1.816.313,18	0,31%		63.568.021,20	2,86%	OK	OK	OK	3,02%	-5,94%	-8,45%	0,08%	-5,94%	
ITAU CONSUMO ACOES FI	5.712.623,41	0,99%		31.680.370,68	18,03%	OK	OK	OK	0,98%	1,74%	4,19%	15,85%	1,74%	
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	476.914,89	0,08%		167.373.500,54	0,28%	OK	OK	OK	3,63%	-4,07%	-7,48%	-0,72%	-4,07%	
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>8.817.931,91</b>	<b>1,53%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.198.456,71	0,55%		24.944.283,06	12,82%	OK	OK	OK	1,00%	3,36%	6,10%	13,42%	3,36%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	5.619.475,20	0,97%		220.683.353,07	2,55%	OK	OK	OK	-0,72%	2,22%	10,75%	22,89%	2,22%	
<b>Fundos de Participações</b>	<b>5.228.629,12</b>	<b>0,91%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA	135.050,24	0,02%		7.009.107,22	1,93%	OK	OK	OK	-5,90%	-15,95%	-30,88%	-	-15,95%	
FIP LSH	4.114.481,87	0,71%		312.571.701,49	1,32%	OK	OK	OK	-0,05%	-0,50%	-0,98%	39,15%	-0,50%	
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	979.097,01	0,17%		536.349.340,49	0,18%	OK	OK	OK	-0,25%	-0,41%	-1,09%	-1,96%	-0,41%	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>4.218.004,29</b>	<b>0,73%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
DOMO FII**	2.182.000,23	0,38%		190.925.019,99	1,14%	OK	OK	OK	0,03%	0,10%	12,47%	9,09%	0,10%	
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII**	2.036.004,06	0,35%		26.610.600,59	7,65%	OK	OK	OK	0,57%	1,46%	2,40%	-1,03%	1,46%	

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.

\*\* Todas as informações foram retiradas do portal CVM dia 22/04/2015 às 10:00 hrs.



