

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

30/04/2015

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		
CONSOLIDADO	595.759.489,26	100,00%	100,00%												
META ATUARIAL (INPC + 6%)										2,40%	3,90%	5,62%	13,78%	5,68%	
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,20%	4,93%	9,30%	14,84%	7,01%	
										1,20%	4,80%	9,05%	14,66%	6,62%	
Títulos Públicos	17.011.905,83	2,86%	10,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	17.011.905,83	2,86%								3,31%	2,55%	5,99%	14,85%	6,22%	
Fundos que contenham somente títulos públicos	302.438.683,96	50,77%	80,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado		
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TP	10.866.067,72	1,82%		5.332.883.868,32	0,20%	OK	OK	OK	2,47%	2,67%	5,92%	15,21%	5,81%		
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	24.887.154,64	4,18%		957.362.605,71	2,60%	OK	OK	OK	0,95%	-	-	-	-		
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	5.617.415,00	0,94%		554.320.937,97	1,01%	OK	OK	OK	0,83%	1,33%	3,97%	10,18%	3,12%		
BRADERCO FI RF IMA B TIT. PUBLICOS	55.695.737,30	9,35%		740.513.571,23	7,52%	OK	OK	OK	2,52%	2,64%	5,97%	15,03%	5,80%		
BTG PACTUAL FI RF IMA B	14.081.959,61	2,36%		273.369.874,22	5,15%	OK	OK	OK	2,19%	2,41%	5,68%	14,97%	5,66%		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	5.298.802,58	0,89%		3.589.353.908,66	0,15%	OK	OK	OK	0,44%	2,57%	5,74%	11,87%	4,62%		
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	68.963.848,03	11,58%		4.203.302.606,79	1,64%	OK	OK	OK	2,42%	2,62%	5,89%	15,27%	5,75%		
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	36.472.811,11	6,12%		137.102.839,15	26,60%	OK	OK	Desenquadrado	2,19%	2,50%	5,90%	15,18%	6,56%		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	13.164.643,26	2,21%		1.685.709.790,15	0,78%	OK	OK	OK	0,43%	2,62%	5,75%	11,71%	4,68%		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	24.734.860,93	4,15%		586.094.981,01	4,22%	OK	OK	OK	2,40%	2,59%	5,88%	15,05%	5,75%		
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	42.655.383,78	7,16%		407.547.372,12	10,47%	OK	OK	OK	2,41%	2,64%	5,68%	14,43%	5,82%		
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKa	115.303.130,42	19,35%	60,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	16.983.187,92	2,85%		1.323.671.600,78	1,28%	OK	OK	OK	2,49%	2,62%	5,92%	15,40%	5,79%		
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	8.059.052,35	1,35%		633.287.999,49	1,27%	OK	OK	OK	0,44%	2,57%	5,71%	11,68%	4,61%		
BRADERCO FI RF IMA B	44.149.861,53	7,41%		940.485.803,28	4,69%	OK	OK	OK	2,54%	2,77%	6,41%	15,68%	5,93%		
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	6.761.947,78	1,14%		2.431.032.909,75	0,28%	OK	OK	OK	2,42%	3,08%	6,46%	15,98%	6,18%		
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	39.349.080,84	6,60%		232.609.351,80	16,92%	OK	OK	OK	2,38%	2,58%	5,95%	14,69%	6,01%		
Fundos de Renda Fixa (Normal)	57.061.894,30	9,58%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	9.735.102,38	1,63%		5.086.494.933,28	0,19%	OK	OK	OK	0,97%	2,87%	5,76%	11,62%	3,84%		
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	30.361.354,15	5,10%		2.273.273.190,61	1,34%	OK	OK	OK	0,91%	2,71%	5,52%	11,19%	3,72%		
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	5.135.806,27	0,86%		398.384.300,01	1,29%	OK	OK	OK	1,05%	3,19%	6,23%	12,25%	4,25%		
SANT FIC FI CORPORATE REF DI	11.829.631,50	1,99%		4.269.665.667,93	0,28%	OK	OK	OK	0,96%	2,87%	5,72%	11,56%	3,83%		
FIDC			5,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:			
FIDC Fechado	11.811.012,01	1,98%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
BELSUL 500 FDO DE INVEST EM DIR CRED SR*	1.035.345,05	0,17%		-		OK	OK	OK	-	-	-	-	-		
FIDC LAVORO II	4.855.270,61	0,81%		52.518.264,43	9,24%	OK	OK	OK	1,29%	5,25%	9,92%	16,76%	7,20%		
FIDC LAVORO II 2 MEZ	749.023,41	0,13%		6.909.601,09	10,84%	OK	OK	OK	1,66%	5,00%	10,09%	20,78%	6,71%		
FIDC MULTISSET SILVERADO MAXIMUM II SEM*	2.011.053,75	0,34%		-		OK	OK	OK	-	-	-	-	-		
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	1.096.116,52	0,18%		56.350.647,95	1,95%	OK	OK	OK	1,71%	5,59%	9,99%	-	7,40%		
GOAL FIDC MULTISSETORIAL LP_SEN IV*	857.840,22	0,14%		-		OK	OK	OK	-	-	-	-	-		
LIBRA FIDC SENIOR 3 MULTISSETORIAL*	1.206.362,45	0,20%		-		OK	OK	OK	-	-	-	-	-		
Fundo Crédito Privado	8.211.660,35	1,38%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado		
ITAU BBA INVEST GRADE RF CRED PRIV FICFI	8.211.660,35	1,38%		713.997.698,55	1,15%	OK	OK	OK	0,95%	2,87%	5,78%	11,67%	3,85%		

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

30/04/2015

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	
CONSOLIDADO	595.759.489,26	100,00%	100,00%							2,40%	3,90%	5,62%	13,78%	5,68%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,20%	4,93%	9,30%	14,84%	7,01%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,20%	4,80%	9,05%	14,66%	6,62%
Fundos de Ações Referenciados	43.830.013,39	7,36%	30,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FIA PROGRAMADO	1.857.308,60	0,31%		566.353.175,49	0,33%	OK	OK	OK	6,06%	15,11%	-1,25%	4,41%	3,75%	
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	22.355.701,76	3,75%		215.505.410,95	10,37%	OK	OK	OK	6,72%	16,66%	3,06%	7,11%	8,56%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	19.617.003,03	3,29%		491.192.639,30	3,99%	OK	OK	OK	5,98%	15,30%	2,58%	6,57%	7,91%	
Fundos de Índices de Ações			20,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:		
Fundos de Ações	22.156.402,00	3,72%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
BB ACOES CONSUMO FICFI	6.241.455,06	1,05%		112.363.819,22	5,55%	OK	OK	OK	5,13%	9,80%	3,20%	19,45%	6,82%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	7.475.295,72	1,25%		1.352.126.469,86	0,55%	OK	OK	OK	6,80%	17,82%	9,49%	19,52%	12,48%	
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	1.941.417,23	0,33%		74.579.063,66	2,60%	OK	OK	OK	6,89%	12,70%	-1,82%	6,55%	0,54%	
ITAU CONSUMO ACOES FI	6.015.950,58	1,01%		33.598.387,90	17,91%	OK	OK	OK	5,31%	9,99%	3,67%	20,22%	7,14%	
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	482.283,41	0,08%		159.701.741,76	0,30%	OK	OK	OK	1,13%	8,15%	-6,58%	-3,08%	-2,99%	
Fundos Multimercados	8.936.568,46	1,50%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.224.960,70	0,54%		25.150.983,80	12,82%	OK	OK	OK	0,83%	2,65%	5,70%	13,52%	4,21%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	5.711.607,76	0,96%		216.777.235,82	2,63%	OK	OK	OK	1,64%	6,73%	9,04%	23,05%	3,89%	
Fundos de Participações	4.769.077,28	0,80%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA	126.420,90	0,02%		6.561.244,54	1,93%	OK	OK	OK	-6,39%	-16,95%	-24,91%	-	-21,32%	
FIP LSH	4.090.299,98	0,69%		317.142.772,49	1,29%	OK	OK	OK	-0,59%	-1,03%	-1,47%	38,46%	-1,09%	
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	552.356,40	0,09%		302.580.835,65	0,18%	OK	OK	OK	-43,59%	-43,71%	-44,03%	-44,66%	-43,82%	
Fundos de Investimento Imobiliários	4.229.141,26	0,71%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII**	2.182.608,51	0,37%		190.978.244,36	1,14%	OK	OK	OK	0,03%	0,11%	12,52%	9,10%	0,13%	
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII**	2.046.532,75	0,34%		26.610.600,59	7,69%	OK	OK	OK	0,52%	1,56%	2,66%	-0,51%	1,98%	

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 22/05/2015 às 10:00 hrs.