

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

30/10/2015

| 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 | 626.322.190,72 | 100,00% | 100,00% | | | | | | | 1,89% | -1,42% | -0,01% | 5,68% | 5,67% |
| META ATUARIAL (INPC + 6%) | | | | | | | | | | 1,26% | 3,03% | 7,00% | 16,95% | 14,50% |
| META ATUARIAL (IPCA + 6%) | | | | | | | | | | 1,31% | 3,08% | 6,86% | 16,53% | 13,92% |
| Títulos Públicos | 43.459.322,52 | 6,94% | 10,00% | | | Art. 7o, Inciso I, Alínea A | | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| CARTEIRA PROPRIA SANTOS | 43.459.322,52 | 6,94% | | | | | | | | 2,13% | -1,90% | 3,64% | 8,65% | 6,57% |
| Fundos que contenham somente títulos públicos | 288.902.345,90 | 46,13% | 80,00% | | | Art. 7o, Inciso I, Alínea B | | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IX FI | 5.078.334,72 | 0,81% | | 2.179.955.406,02 | 0,23% | OK | OK | OK | 2,21% | 3,93% | - | - | - | - |
| BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI | 27.727.769,15 | 4,43% | | 1.911.757.510,09 | 1,45% | OK | OK | OK | 2,26% | 2,23% | 6,28% | - | - | - |
| BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI | 5.867.348,40 | 0,94% | | 578.984.117,69 | 1,01% | OK | OK | OK | 1,29% | 1,12% | 4,45% | 8,60% | 7,70% | |
| BRADERCO FI RF IMA B TIT. PUBLICOS | 62.428.895,08 | 9,97% | | 468.805.871,22 | 13,32% | OK | OK | OK | 2,41% | -1,55% | -0,16% | 5,80% | 5,63% | |
| BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA | 5.034.647,81 | 0,80% | | 36.941.213,38 | 13,63% | OK | OK | OK | 0,64% | - | - | - | - | |
| BTG PACTUAL FI RF IMA B | 14.071.230,38 | 2,25% | | 330.862.106,42 | 4,25% | OK | OK | OK | 2,41% | -1,48% | -0,08% | 5,60% | 5,58% | |
| CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF | 5.215.155,00 | 0,83% | | 790.110.862,33 | 0,66% | OK | OK | OK | 2,05% | 1,29% | - | - | - | |
| CAIXA FI BRASIL 2016 III TP RF | 12.326.328,00 | 1,97% | | 735.025.462,87 | 1,68% | OK | OK | OK | 2,05% | 1,27% | - | - | - | |
| FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA | 5.259.595,00 | 0,84% | | 1.420.384.968,06 | 0,37% | OK | OK | OK | 2,06% | 1,31% | - | - | - | |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP | 81.376.411,13 | 12,99% | | 3.411.487.200,27 | 2,39% | OK | OK | OK | 2,34% | -2,22% | -1,03% | 4,80% | 4,66% | |
| ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI | 10.164.397,48 | 1,62% | | 1.630.733.233,88 | 0,62% | OK | OK | OK | 2,44% | 2,70% | 7,01% | 13,17% | 12,02% | |
| SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP | 54.352.233,75 | 8,68% | | 326.722.028,46 | 16,64% | OK | OK | OK | 2,56% | -1,34% | 0,20% | 5,89% | 6,04% | |
| Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKa | 159.984.494,09 | 25,54% | 60,00% | | | Art. 7o, Inciso III, Alínea A | | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| BB PREVIDENCIARIO RF IMA B | 27.866.590,30 | 4,45% | | 923.089.696,51 | 3,02% | OK | OK | OK | 2,44% | -1,35% | 0,14% | 6,07% | 5,94% | |
| BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC | 8.624.472,13 | 1,38% | | 1.118.575.406,06 | 0,77% | OK | OK | OK | 2,43% | 2,65% | 7,02% | 13,12% | 11,95% | |
| BRADERCO FI RF IMA B | 44.175.170,29 | 7,05% | | 1.006.382.558,36 | 4,39% | OK | OK | OK | 2,51% | -1,50% | 0,07% | 6,49% | 6,01% | |
| CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP | 6.749.349,26 | 1,08% | | 2.385.423.121,35 | 0,28% | OK | OK | OK | 2,52% | -1,29% | -0,19% | 6,26% | 5,98% | |
| ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI | 28.465.153,26 | 4,54% | | 484.231.323,28 | 5,88% | OK | OK | OK | 2,53% | -1,41% | 0,02% | 5,90% | 5,76% | |
| SAFRA IMA FIC FI RF | 5.020.586,58 | 0,80% | | 161.817.062,92 | 3,10% | OK | OK | OK | 2,26% | 0,07% | 2,34% | 8,44% | 7,60% | |
| SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP | 39.083.172,27 | 6,24% | | 232.453.262,50 | 16,81% | OK | OK | OK | 2,58% | -1,84% | -0,68% | 5,24% | 5,29% | |
| Fundos de Renda Fixa (Normal) | 29.031.564,03 | 4,64% | 30,00% | | | Art. 7o, Inciso IV, Alínea A | | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI | 2.788.692,61 | 0,45% | | 5.798.165.028,87 | 0,05% | OK | OK | OK | 1,12% | 3,39% | 6,86% | 13,01% | 10,96% | |
| CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP | 5.854.729,56 | 0,93% | | 1.903.449.827,21 | 0,31% | OK | OK | OK | 1,10% | 3,12% | 6,48% | 12,36% | 10,44% | |
| FICFI RF DI LP 1 MILHAO | 3.452.619,07 | 0,55% | | 439.745.384,97 | 0,79% | OK | OK | OK | 1,12% | 3,42% | 7,01% | 13,67% | 11,56% | |
| ITAU INSTTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 8.616.780,23 | 1,38% | | 249.692.060,22 | 3,45% | OK | OK | OK | 1,15% | 1,96% | - | - | - | |
| SANT FIC FI CORPORATE REF DI | 8.318.742,56 | 1,33% | | 5.292.616.633,51 | 0,16% | OK | OK | OK | 1,10% | 3,37% | 6,79% | 12,90% | 10,89% | |
| FIDC | | | 5,00% | | | Art. 7o, Inciso VI | | | | | | Alocação: | | |
| FIDC Fechado | 12.398.978,22 | 1,98% | 5,00% | | | Art. 7o, Inciso VII, Alínea A | | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| BELSUL 500 FDO DE INVEST EM DIR CRED SR | 1.115.839,99 | 0,18% | | 7.485.438,39 | 14,91% | OK | OK | OK | 1,24% | 3,36% | 7,77% | - | - | |
| FIDC LAVORO II | 3.582.598,72 | 0,57% | | 38.752.086,52 | 9,24% | OK | OK | OK | -26,72% | -29,15% | -26,21% | -18,89% | -20,90% | |
| FIDC LAVORO II 2 MEZ | 574.323,41 | 0,09% | | 5.298.026,19 | 10,84% | OK | OK | OK | -26,37% | -27,51% | -23,32% | -15,59% | -18,18% | |
| FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2 | 2.188.658,90 | 0,35% | | 87.419.602,37 | 2,50% | OK | OK | OK | 1,44% | 4,39% | 8,83% | - | - | |
| FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5 | 1.077.804,92 | 0,17% | | 55.409.260,50 | 1,95% | OK | OK | OK | 2,38% | 3,55% | 6,37% | 16,99% | 14,24% | |
| GAVEA SUL FIDC MULT LP SR | 2.091.230,38 | 0,33% | | 40.240.316,24 | 5,20% | OK | OK | OK | 1,50% | 4,56% | 9,19% | - | - | |
| GOAL FIDC MULTISSETORIAL_LP_SEN IV* | 468.058,12 | 0,07% | | - | - | OK | OK | Desenquadrado | - | - | - | - | - | |
| LIBRA FIDC SENIOR 3 MULTISSETORIAL* | 1.300.463,78 | 0,21% | | - | - | OK | OK | Desenquadrado | - | - | - | - | - | |
| Fundo Crédito Privado | 16.267.217,34 | 2,60% | 5,00% | | | Art. 7o, Inciso VII, Alínea B | | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| HSBC FI RF CRED PRIV LP NILO | 16.267.217,34 | 2,60% | | 385.270.449,72 | 4,22% | OK | OK | OK | 2,96% | -3,22% | -1,80% | 4,10% | 4,49% | |

ENQUADRAMENTO LEGAL



SANTOS

30/10/2015

| 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 | 626.322.190,72 | 100,00% | 100,00% | | | | | | | | | | | | |
| META ATUARIAL (INPC + 6%) | | | | | | | | | | 1,89% | -1,42% | -0,01% | 5,68% | 5,67% | |
| META ATUARIAL (IPCA + 6%) | | | | | | | | | | 1,26% | 3,03% | 7,00% | 16,95% | 14,50% | |
| | | | | | | | | | | 1,31% | 3,08% | 6,86% | 16,53% | 13,92% | |
| Fundos de Ações Referenciados | 25.220.737,15 | 4,03% | 30,00% | | | Art. 8o, Inciso I | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | |
| GERACAO FIA PROGRAMADO | 3.793.352,54 | 0,61% | | 502.928.607,02 | 0,75% | OK | OK | OK | -0,60% | -4,93% | -4,49% | -5,69% | -0,91% | | |
| HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV | 11.905.492,15 | 1,90% | | 132.200.799,29 | 9,01% | OK | OK | OK | 0,54% | -7,61% | -12,87% | -10,20% | -5,41% | | |
| ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI | 9.521.892,46 | 1,52% | | 448.431.067,91 | 2,12% | OK | OK | OK | 0,78% | -7,50% | -13,16% | -10,92% | -6,29% | | |
| Fundos de Índices de Ações | | | 20,00% | | | Art. 8o, Inciso II | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | |
| Fundos de Ações | 25.958.563,62 | 4,14% | 15,00% | | | Art. 8o, Inciso III | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | |
| BB ACOES CONSUMO FICFI | 5.669.037,51 | 0,91% | | 85.649.551,20 | 6,62% | OK | OK | OK | -1,89% | -7,88% | -9,17% | -6,26% | -2,97% | | |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES | 12.948.014,89 | 2,07% | | 1.452.422.146,28 | 0,89% | OK | OK | OK | -1,66% | -8,41% | -8,31% | 0,39% | 3,13% | | |
| GERACAO FUTURO SELECAO FIA | 1.852.028,08 | 0,30% | | 73.202.364,84 | 2,53% | OK | OK | OK | -0,08% | -3,88% | -4,60% | -6,35% | -4,09% | | |
| ITAU CONSUMO ACOES FI | 5.489.483,14 | 0,88% | | 24.678.349,43 | 22,24% | OK | OK | OK | -1,61% | -7,53% | -8,75% | -5,41% | -2,24% | | |
| Fundos Multimercados | 15.754.808,85 | 2,52% | 5,00% | | | Art. 8o, Inciso IV | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | |
| CAPITANIA MULTI CRED PRIV FIC FI MULT | 1.018.226,93 | 0,16% | | 322.381.477,45 | 0,32% | OK | OK | OK | 1,37% | 3,09% | 7,52% | 14,62% | 12,75% | | |
| SAFRA CARTEIRA INSTIT PREMIUM FI MULT | 3.144.340,17 | 0,50% | | 159.727.569,25 | 1,97% | OK | OK | OK | 0,97% | 2,15% | 6,01% | 14,15% | 11,80% | | |
| SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV | 1.053.936,61 | 0,17% | | 311.740.346,15 | 0,34% | OK | OK | OK | 1,28% | 3,78% | 7,41% | 13,90% | 11,84% | | |
| SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV | 3.453.243,63 | 0,55% | | 29.639.854,21 | 11,65% | OK | OK | OK | 1,75% | 3,10% | 7,08% | 13,18% | 11,59% | | |
| WA US INDEX 500 FI MULTI | 7.085.061,51 | 1,13% | | 199.429.544,83 | 3,55% | OK | OK | OK | 9,39% | 1,93% | 6,10% | 15,69% | 10,23% | | |
| Fundos de Participações | 5.083.544,86 | 0,81% | 5,00% | | | Art. 8o, Inciso V | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | |
| BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP* | 589.689,36 | 0,09% | | - | | OK | OK | OK | - | - | - | - | - | | |
| FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA | 71.151,95 | 0,01% | | 3.692.785,95 | 1,93% | OK | OK | OK | -12,26% | -29,18% | -43,72% | -57,74% | -55,72% | | |
| FIP LSH | 4.026.464,57 | 0,64% | | 327.896.484,44 | 1,23% | OK | OK | OK | -0,90% | -1,40% | -1,56% | -3,01% | -2,63% | | |
| RIO BRAVO ENERGIA I FIP | 396.238,98 | 0,06% | | 217.059.715,44 | 0,18% | OK | OK | OK | -26,05% | -27,03% | -28,26% | -59,85% | -59,70% | | |
| Fundos de Investimento Imobiliários | 4.260.614,14 | 0,68% | 5,00% | | | Art. 8o, Inciso VI | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | |
| DOMO FII | 2.186.691,36 | 0,35% | | 191.335.494,32 | 1,14% | OK | OK | OK | 0,74% | 2,18% | 2,28% | 15,08% | 2,41% | | |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII | 2.073.922,78 | 0,33% | | 30.141.390,43 | 6,88% | OK | OK | OK | 1,04% | -0,26% | 1,33% | 4,03% | 3,34% | | |

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.