

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SANTOS**

**30/11/2015**

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>638.946.260,02</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>						<b>0,80%</b>	<b>2,16%</b>	<b>-0,78%</b>	<b>4,59%</b>	<b>6,51%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)									<b>1,60%</b>	<b>3,91%</b>	<b>7,13%</b>	<b>17,63%</b>	<b>16,33%</b>
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)									<b>1,50%</b>	<b>3,89%</b>	<b>7,14%</b>	<b>17,10%</b>	<b>15,64%</b>
<b>Títulos Públicos</b>	<b>52.275.556,21</b>	<b>8,18%</b>	<b>10,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>					<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	52.275.556,21	8,18%							0,80%	2,95%	-1,27%	4,92%	7,42%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>258.379.898,37</b>	<b>40,44%</b>	<b>80,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B</b>					<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IX FI	5.122.654,88	0,80%		2.198.980.538,31	0,23%	OK	OK	OK	0,87%	4,40%	7,45%	-	-
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	27.932.661,86	4,37%		1.925.884.328,96	1,45%	OK	OK	OK	0,74%	3,55%	5,11%	-	-
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	5.915.174,09	0,93%		583.703.508,97	1,01%	OK	OK	OK	0,82%	1,56%	4,01%	8,29%	8,58%
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.087.382,04	0,80%		37.328.144,14	13,63%	OK	OK	OK	1,05%	-	-	-	-
BTG PACTUAL FI RF IMA B	14.210.977,37	2,22%		286.059.935,76	4,97%	OK	OK	OK	0,99%	1,98%	-1,55%	4,51%	6,63%
CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF	5.264.890,00	0,82%		797.645.273,78	0,66%	OK	OK	OK	0,95%	4,52%	4,93%	-	-
CAIXA FI BRASIL 2016 III TP RF	12.443.868,00	1,95%		742.033.897,79	1,68%	OK	OK	OK	0,95%	4,52%	-	-	-
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	5.309.770,00	0,83%		1.433.935.475,10	0,37%	OK	OK	OK	0,95%	4,52%	4,94%	-	-
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	72.484.845,05	11,34%		3.404.827.995,08	2,13%	OK	OK	OK	1,02%	1,51%	-2,49%	3,69%	5,73%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	10.216.651,26	1,60%		1.631.133.719,64	0,63%	OK	OK	OK	0,51%	3,50%	5,87%	12,60%	12,60%
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	54.904.393,17	8,59%		350.244.066,70	15,68%	OK	OK	OK	1,02%	2,19%	-1,37%	4,79%	7,12%
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	39.486.630,64	6,18%		235.465.204,62	16,77%	OK	OK	OK	1,03%	1,45%	-1,96%	4,76%	6,38%
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKa</b>	<b>185.155.002,88</b>	<b>28,98%</b>	<b>60,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso III, Alínea A</b>					<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	28.150.182,02	4,41%		901.110.215,67	3,12%	OK	OK	OK	1,02%	2,12%	-1,38%	4,97%	7,02%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	8.669.491,67	1,36%		1.150.167.990,03	0,75%	OK	OK	OK	0,52%	3,47%	5,83%	12,55%	12,53%
BRADESCO FI RF IMA B	44.633.273,62	6,99%		1.000.474.517,49	4,46%	OK	OK	OK	1,04%	2,18%	-1,48%	5,06%	7,11%
BRADESCO FI RF IMA B TIT. PUBLICOS	63.049.048,74	9,87%		474.313.113,11	13,29%	OK	OK	OK	0,99%	2,00%	-1,76%	4,67%	6,68%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	6.832.780,80	1,07%		2.373.977.273,27	0,29%	OK	OK	OK	1,24%	2,37%	-1,35%	5,44%	7,29%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	28.749.254,70	4,50%		480.101.137,18	5,99%	OK	OK	OK	1,00%	2,14%	-1,47%	4,75%	6,82%
SAFRA IMA FIC FI RF	5.070.971,32	0,79%		160.931.973,02	3,15%	OK	OK	OK	1,00%	2,57%	1,47%	8,13%	8,68%
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>47.846.346,26</b>	<b>7,49%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>					<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB RPPS RENDA FIXA FLUXO FIC FI	5.257.704,32	0,82%		839.985.668,09	0,63%	OK	OK	OK	1,00%	3,16%	6,39%	12,17%	11,16%
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	3.564.076,42	0,56%		5.898.203.717,69	0,06%	OK	OK	OK	1,06%	3,39%	6,88%	13,27%	12,14%
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	13.615.680,33	2,13%		1.891.591.564,40	0,72%	OK	OK	OK	1,02%	3,14%	6,49%	12,59%	11,56%
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	3.490.933,13	0,55%		426.967.019,23	0,82%	OK	OK	OK	1,11%	3,45%	7,07%	13,92%	12,79%
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	13.687.541,75	2,14%		269.808.924,07	5,07%	OK	OK	OK	0,82%	2,55%	-	-	-
SANT FIC FI CORPORATE REF DI	8.230.410,30	1,29%		5.104.446.693,00	0,16%	OK	OK	OK	1,07%	3,37%	6,87%	13,15%	12,07%
<b>FIDC</b>			<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>					<b>Alocação:</b>		
<b>FIDC Fechado</b>	<b>12.669.425,64</b>	<b>1,98%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea A</b>					<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BELSUL 500 FDO DE INVEST EM DIR CRED SR	1.131.184,80	0,18%		7.588.376,64	14,91%	OK	OK	OK	1,38%	3,60%	7,88%	-	-
FIDC LAVORO II	3.637.859,25	0,57%		39.349.826,01	9,24%	OK	OK	OK	1,54%	-28,67%	-25,93%	-18,52%	-19,68%
FIDC LAVORO II 2 MEZ	584.968,43	0,09%		5.396.224,54	10,84%	OK	OK	OK	1,85%	-27,51%	-23,23%	-15,27%	-16,67%
FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2	2.307.607,11	0,36%		88.620.559,89	2,60%	OK	OK	OK	1,37%	4,39%	8,93%	-	-
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	1.093.309,01	0,17%		56.206.289,49	1,95%	OK	OK	OK	1,44%	4,11%	6,52%	17,45%	15,88%
GAVEA SUL FIDC MULT LP SR	2.121.071,81	0,33%		40.814.537,27	5,20%	OK	OK	OK	1,43%	4,56%	9,29%	-	-
GOAL FIDC MULTISSETORIAL LP_SEN IV*	474.652,21	0,07%		-	-	OK	OK	OK	-	-	-	-	-
LIBRA FIDC SENIOR 3 MULTISSETORIAL*	1.318.773,03	0,21%		-	-	OK	OK	OK	-	-	-	-	-
<b>Fundo Crédito Privado</b>	<b>16.454.913,06</b>	<b>2,58%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea B</b>					<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
HSBC FI RF CRED PRIV LP NILO	16.454.913,06	2,58%		381.779.230,48	4,31%	OK	OK	OK	1,15%	1,39%	-3,23%	3,20%	5,69%

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SANTOS**

**30/11/2015**

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>638.946.260,02</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>						<b>0,80%</b>	<b>2,16%</b>	<b>-0,78%</b>	<b>4,59%</b>	<b>6,51%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)									<b>1,60%</b>	<b>3,91%</b>	<b>7,13%</b>	<b>17,63%</b>	<b>16,33%</b>
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)									<b>1,50%</b>	<b>3,89%</b>	<b>7,14%</b>	<b>17,10%</b>	<b>15,64%</b>
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>15.553.204,27</b>	<b>2,43%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>					<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.898.918,77	0,61%		512.942.417,54	0,76%	OK	OK	OK	2,78%	3,97%	1,57%	-5,79%	1,85%
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	6.971.746,81	1,09%		125.319.147,65	5,56%	OK	OK	OK	-1,20%	-3,86%	-9,84%	-12,82%	-6,54%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	4.682.538,70	0,73%		432.759.917,92	1,08%	OK	OK	OK	-0,98%	-3,27%	-9,70%	-13,30%	-7,21%
<b>Fundos de Índices de Ações</b>			<b>20,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso II</b>					<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
<b>Fundos de Ações</b>	<b>25.312.310,35</b>	<b>3,96%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>					<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB ACOES CONSUMO FICFI	5.447.855,49	0,85%		80.769.652,81	6,74%	OK	OK	OK	-3,90%	-6,58%	-10,33%	-12,15%	-6,76%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	12.677.328,16	1,98%		1.444.220.839,65	0,88%	OK	OK	OK	-2,09%	-6,37%	-7,65%	-4,51%	0,98%
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	1.907.723,00	0,30%		74.981.364,71	2,54%	OK	OK	OK	3,01%	5,34%	2,43%	-6,04%	-1,21%
ITAU CONSUMO ACOES FI	5.279.403,71	0,83%		23.747.287,83	22,23%	OK	OK	OK	-3,83%	-6,12%	-10,04%	-11,37%	-5,98%
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>15.938.630,09</b>	<b>2,49%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>					<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CAPITANIA MULTI CRED PRIV FIC FI MULT	1.028.577,18	0,16%		325.499.128,60	0,32%	OK	OK	OK	1,02%	3,30%	7,04%	14,72%	13,89%
SAFRA CARTEIRA INSTIT PREMIUM FI MULT	3.177.308,50	0,50%		181.360.604,11	1,75%	OK	OK	OK	1,05%	3,17%	5,63%	13,84%	12,97%
SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV	1.064.397,61	0,17%		352.862.761,03	0,30%	OK	OK	OK	0,99%	3,74%	7,32%	14,02%	12,95%
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.486.355,43	0,55%		29.854.980,73	11,68%	OK	OK	OK	0,96%	3,63%	6,90%	13,27%	12,66%
WA US INDEX 500 FI MULTI	7.181.991,37	1,12%		196.079.706,00	3,66%	OK	OK	OK	1,37%	7,95%	5,28%	13,37%	11,74%
<b>Fundos de Participações</b>	<b>5.068.937,25</b>	<b>0,79%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>					<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP*	585.645,72	0,09%		-		OK	OK	OK	-	-	-	-	-
FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA	63.918,59	0,01%		3.386.649,94	1,89%	OK	OK	OK	-10,17%	-30,47%	-45,72%	-62,18%	-60,22%
FIP LSH	4.025.488,60	0,63%		327.817.006,00	1,23%	OK	OK	OK	-0,02%	-0,96%	-1,56%	-2,95%	-2,65%
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	393.884,34	0,06%		215.769.839,80	0,18%	OK	OK	OK	-0,59%	-27,11%	-28,33%	-60,07%	-59,94%
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>4.292.035,64</b>	<b>0,67%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>					<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
DOMO FII	2.187.546,16	0,34%		191.410.289,31	1,14%	OK	OK	OK	-2,44%	-17,95%	-23,81%	-31,43%	-27,28%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	2.104.489,48	0,33%		30.141.390,43	6,98%	OK	OK	OK	0,00%	0,89%	1,00%	3,74%	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.