

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SANTOS**

**29/02/2016**

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	
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>694.111.796,52</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>							<b>1,81%</b>	<b>4,84%</b>	<b>7,04%</b>	<b>8,23%</b>	<b>3,48%</b>
<b>META ATUARIAL ( INPC + 6%)</b>										<b>1,44%</b>	<b>4,91%</b>	<b>9,02%</b>	<b>17,74%</b>	<b>3,47%</b>
<b>META ATUARIAL ( IPCA + 6%)</b>										<b>1,39%</b>	<b>4,68%</b>	<b>8,75%</b>	<b>16,98%</b>	<b>3,18%</b>
<b>Títulos Públicos</b>	<b>72.646.406,37</b>	<b>10,47%</b>	<b>10,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>							<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	72.646.406,37	10,47%								3,06%	7,64%	10,82%	11,36%	5,38%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>291.782.507,88</b>	<b>42,04%</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	5.207.533,47	0,75%		2.235.426.962,66	0,23%	OK	OK	OK	OK	1,02%	4,62%	9,32%	-	2,84%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	28.785.182,50	4,15%		1.984.663.401,10	1,45%	OK	OK	OK	OK	1,54%	6,09%	10,14%	-	3,95%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	6.197.216,65	0,89%		611.535.188,59	1,01%	OK	OK	OK	OK	1,19%	4,77%	6,68%	11,42%	3,49%
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.325.934,72	0,77%		39.078.500,47	13,63%	OK	OK	OK	OK	-0,22%	4,69%	-	-	2,25%
BTG PACTUAL FI RF IMA B	14.624.065,06	2,11%		105.183.844,26	13,90%	OK	OK	OK	OK	2,23%	5,96%	8,78%	8,89%	4,20%
CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF	5.336.945,00	0,77%		808.561.811,58	0,66%	OK	OK	OK	OK	-1,84%	1,37%	6,01%	-	-0,30%
CAIXA FI BRASIL 2016 III TP RF	12.614.172,00	1,82%		752.189.223,44	1,68%	OK	OK	OK	OK	0,96%	-	-	2,54%	-0,30%
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	3.080.734,16	0,44%		457.430.498,39	0,67%	OK	OK	OK	OK	-0,41%	5,89%	8,65%	-	3,13%
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	10.293.780,42	1,48%		675.676.829,03	1,52%	OK	OK	OK	OK	0,36%	4,25%	6,37%	-	1,93%
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	10.188.680,75	1,47%		168.844.418,54	6,03%	OK	OK	OK	OK	-0,77%	2,72%	5,20%	-	1,57%
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	5.382.060,00	0,78%		1.453.458.437,38	0,37%	OK	OK	OK	OK	-1,85%	1,36%	6,00%	-	-0,30%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	75.273.914,80	10,84%		3.243.465.189,93	2,32%	OK	OK	OK	OK	2,27%	5,61%	7,98%	7,80%	4,09%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	10.896.999,31	1,57%		1.859.358.727,98	0,59%	OK	OK	OK	OK	1,50%	6,66%	10,66%	16,35%	4,48%
SANTIFIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	58.967.460,52	8,50%		1.286.007.051,87	4,59%	OK	OK	OK	OK	1,52%	6,71%	10,81%	16,65%	4,52%
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	39.607.828,52	5,71%		243.121.435,61	16,29%	OK	OK	OK	OK	2,30%	6,16%	8,48%	8,28%	4,30%
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKA</b>	<b>196.809.556,22</b>	<b>28,35%</b>	<b>60,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso III, Alínea A</b>							<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	9.248.090,90	1,33%		1.405.005.538,60	0,66%	OK	OK	OK	OK	1,52%	6,67%	10,65%	16,38%	4,51%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	29.752.343,33	4,29%		853.933.240,91	3,48%	OK	OK	OK	OK	2,21%	5,69%	8,65%	9,19%	4,13%
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	65.743.361,20	9,47%		502.646.344,08	13,08%	OK	OK	OK	OK	2,24%	5,68%	8,51%	8,84%	4,15%
BRADERCO FI RF IMA B	44.885.495,31	6,47%		1.023.242.068,86	4,39%	OK	OK	OK	OK	2,17%	5,46%	8,47%	8,94%	3,98%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	5.860.071,22	0,84%		2.278.219.411,08	0,26%	OK	OK	OK	OK	2,14%	5,08%	8,20%	8,82%	3,82%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	30.381.094,34	4,38%		505.340.287,48	6,01%	OK	OK	OK	OK	2,22%	5,68%	8,65%	8,96%	4,13%
ITAU INSTITUCIONAL TIT PUBLICOS RF FI	5.586.607,87	0,80%		48.551.841,01	11,51%	OK	OK	OK	OK	1,81%	-	-	-	-
SAFRA IMA FIC FI RF	5.352.492,04	0,77%		162.712.554,48	3,29%	OK	OK	OK	OK	2,14%	5,55%	8,85%	11,20%	3,91%
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>48.592.638,98</b>	<b>7,00%</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	3.383.274,02	0,49%		1.063.661.047,03	0,32%	OK	OK	OK	OK	0,91%	3,01%	6,21%	12,67%	1,90%
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	399.875,19	0,06%		6.776.832.147,31	0,01%	OK	OK	OK	OK	0,97%	3,23%	6,67%	13,74%	2,03%
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	13.060.246,39	1,88%		2.004.630.276,20	0,65%	OK	OK	OK	OK	1,00%	3,32%	6,54%	13,22%	2,17%
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	3.612.264,15	0,52%		524.993.642,93	0,69%	OK	OK	OK	OK	1,07%	3,48%	6,98%	14,45%	2,21%
INFINITY LOTUS FIRF	510.792,52	0,07%		41.528.220,37	1,23%	OK	OK	OK	OK	1,04%	3,74%	7,60%	15,14%	2,31%
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	19.755.560,29	2,85%		296.860.310,50	6,65%	OK	OK	OK	OK	1,67%	4,11%	6,85%	-	3,10%
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	7.870.626,44	1,13%		5.193.537.692,26	0,15%	OK	OK	OK	OK	0,98%	3,23%	6,66%	13,67%	2,04%
<b>FIDC</b>			<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>							<b>Alocação:</b>	
<b>FIDC Fechado</b>	<b>10.650.768,11</b>	<b>1,53%</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	1.040.099,69	0,15%		6.977.346,41	14,91%	OK	OK	OK	OK	0,00%	-8,05%	-4,79%	-	0,19%
FIDC EMPIRICA GOAL ONE SUB SENIOR4	247.669,60	0,04%		12.141.589,88	2,04%	OK	OK	OK	OK	1,34%	-	-	-	-48,62%
FIDC LAVORO II MEZ	428.303,39	0,06%		3.951.018,84	10,84%	OK	OK	OK	OK	-16,74%	-26,78%	-46,97%	-40,81%	-15,20%
FIDC LAVORO II SEN	2.651.161,80	0,38%		28.676.963,12	9,24%	OK	OK	OK	OK	-16,76%	-27,12%	-48,04%	-43,46%	-15,41%
FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2	1.850.384,99	0,27%		73.908.236,80	2,50%	OK	OK	OK	OK	1,30%	-16,60%	-13,00%	-	-17,84%
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	1.062.020,07	0,15%		54.597.746,20	1,95%	OK	OK	OK	OK	1,76%	5,38%	9,44%	18,15%	3,44%
GAVEA SUL FIDC SEN1	2.214.717,96	0,32%		42.616.515,14	5,20%	OK	OK	OK	OK	1,35%	4,42%	9,10%	-	2,80%
LIBRA FIDC SENIOR 3	1.156.410,61	0,17%		31.928.069,64	3,62%	OK	OK	OK	OK	1,74%	-	-	-	3,35%
<b>Fundo Crédito Privado</b>	<b>17.700.552,02</b>	<b>2,55%</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	17.700.552,02	2,55%		395.842.943,53	4,47%	OK	OK	OK	OK	2,61%	7,57%	10,15%	8,78%	5,19%



SANTOS

29/02/2016

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
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>694.111.796,52</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>							<b>1,81%</b>	<b>4,84%</b>	<b>7,04%</b>	<b>8,23%</b>	<b>3,48%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										<b>1,44%</b>	<b>4,91%</b>	<b>9,02%</b>	<b>17,74%</b>	<b>3,47%</b>
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										<b>1,39%</b>	<b>4,68%</b>	<b>8,75%</b>	<b>16,98%</b>	<b>3,18%</b>
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>15.015.664,40</b>	<b>2,16%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>							<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.621.304,06	0,52%		463.694.123,55	0,78%	OK	OK	OK	2,15%	-7,12%	-2,86%	-0,05%	-6,05%	
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	6.789.779,53	0,98%		115.629.873,12	5,87%	OK	OK	OK	3,89%	-2,61%	-5,09%	-9,66%	-0,32%	
ITAU RPI ACOES IBOVSPA ATIVO FICFI	4.604.580,82	0,66%		427.720.493,39	1,08%	OK	OK	OK	4,15%	-1,66%	-3,50%	-9,42%	0,49%	
<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>14.349.772,59</b>	<b>2,07%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>							<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	12.542.634,81	1,81%		230.960.692,02	5,43%	OK	OK	OK	1,61%	-1,06%	-6,14%	-3,82%	1,10%	
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	1.807.137,78	0,26%		69.866.070,43	2,59%	OK	OK	OK	2,20%	-5,27%	0,28%	2,50%	-4,97%	
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>18.289.247,21</b>	<b>2,63%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>							<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>
CAPITANIA MULTI CRED PRIV FIC FI MULT	1.062.350,71	0,15%		305.552.961,50	0,35%	OK	OK	OK	1,51%	3,28%	6,71%	14,72%	2,05%	
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	305.497,98	0,04%		9.152.230,04	3,34%	OK	OK	OK	0,82%	3,40%	8,12%	18,20%	1,89%	
SAFRA CARTEIRA INSTIT PREMIUM FI MULT	3.306.129,41	0,48%		264.893.447,18	1,25%	OK	OK	OK	1,23%	4,05%	7,46%	13,94%	2,57%	
SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV	1.101.978,99	0,16%		439.260.851,28	0,25%	OK	OK	OK	1,00%	3,53%	7,34%	14,86%	2,08%	
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.642.127,61	0,52%		33.769.047,20	10,79%	OK	OK	OK	1,13%	4,47%	8,31%	15,01%	2,84%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	6.862.424,64	0,99%		151.820.707,32	4,52%	OK	OK	OK	1,33%	-4,45%	4,13%	3,70%	-4,74%	
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULT	2.008.737,87	0,29%		61.546.977,60	3,26%	OK	OK	OK	0,69%	4,50%	8,44%	19,10%	2,95%	
<b>Fundos de Participações</b>	<b>4.996.405,99</b>	<b>0,72%</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	557.106,54	0,08%		276.053.260,94	0,20%	OK	OK	OK	-7,79%	-7,65%	-	-	-7,72%	
FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA	33.814,18	0,00%		1.791.603,74	1,89%	OK	OK	OK	-23,14%	-47,10%	-63,05%	-76,44%	-37,43%	
FIP LSH	3.999.057,07	0,58%		333.197.949,41	1,20%	OK	OK	OK	-0,02%	-0,66%	-1,60%	-2,85%	-0,62%	
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	406.428,20	0,06%		222.641.367,56	0,18%	OK	OK	OK	-0,04%	3,18%	-24,71%	-58,59%	0,60%	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>3.278.276,74</b>	<b>0,47%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>							<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>
DOMO FII	1.160.000,00	0,17%		171.120.094,59	0,68%	OK	OK	OK	0,11%	-10,60%	-10,50%	-10,35%	0,24%	
VECTOR LAJES FII	2.118.276,74	0,31%		30.786.009,37	6,88%	OK	OK	OK	0,66%	2,14%	3,69%	4,63%	2,99%	

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.