

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SANTOS**

**29/04/2016**

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>756.572.911,36</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>							<b>3,25%</b>	<b>9,61%</b>	<b>13,71%</b>	<b>13,69%</b>	<b>11,41%</b>
<b>META ATUARIAL ( INPC + 6%)</b>										<b>1,13%</b>	<b>3,54%</b>	<b>8,80%</b>	<b>16,42%</b>	<b>5,62%</b>
<b>META ATUARIAL ( IPCA + 6%)</b>										<b>1,10%</b>	<b>3,45%</b>	<b>8,40%</b>	<b>15,84%</b>	<b>5,27%</b>
<b>Títulos Públicos</b>	<b>90.732.436,74</b>	<b>11,99%</b>	<b>10,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	90.732.436,74	11,99%								3,76%	12,20%	18,12%	18,51%	14,72%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>342.812.801,33</b>	<b>45,31%</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	5.297.176,30	0,70%		2.273.907.762,56	0,23%	OK	OK	OK	0,88%	2,76%	7,35%	-	-	4,61%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	29.526.121,31	3,90%		2.035.749.209,56	1,45%	OK	OK	OK	1,54%	4,15%	9,63%	16,52%	6,63%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	6.351.823,26	0,84%		626.791.616,65	1,01%	OK	OK	OK	1,11%	3,71%	8,26%	13,07%	6,07%	
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.604.345,49	0,74%		41.121.309,02	13,63%	OK	OK	OK	1,43%	4,99%	11,32%	-	7,60%	
BTG PACTUAL FI RF IMA B	16.038.409,48	2,12%		158.111.750,13	10,14%	OK	OK	OK	4,02%	12,12%	17,36%	17,27%	14,28%	
CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF	5.423.215,00	0,72%		821.632.248,70	0,66%	OK	OK	OK	0,70%	-0,25%	3,99%	-	1,32%	
CAIXA FI BRASIL 2016 III TP RF	12.818.064,00	1,69%		764.347.747,53	1,68%	OK	OK	OK	0,70%	2,60%	6,96%	-	4,21%	
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	3.186.577,12	0,42%		474.222.680,32	0,67%	OK	OK	OK	2,29%	3,01%	10,00%	-	6,68%	
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	11.137.340,33	1,47%		749.437.686,99	1,49%	OK	OK	OK	3,98%	8,59%	14,30%	10,47%	10,29%	
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	11.460.341,95	1,51%		190.771.727,59	6,01%	OK	OK	OK	4,38%	11,62%	16,80%	9,50%	14,25%	
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	5.469.100,00	0,72%		1.476.963.283,46	0,37%	OK	OK	OK	0,70%	-0,26%	3,98%	-	1,31%	
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	82.390.894,80	10,89%		3.534.413.995,02	2,33%	OK	OK	OK	3,93%	11,93%	16,76%	15,56%	13,93%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	11.141.197,03	1,47%		1.988.823.157,16	0,56%	OK	OK	OK	1,51%	3,78%	9,61%	17,29%	6,82%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	33.221.891,21	4,39%		553.812.299,50	6,00%	OK	OK	OK	3,89%	11,78%	16,71%	16,73%	13,87%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	60.311.793,59	7,97%		1.373.563.086,54	4,39%	OK	OK	OK	1,52%	3,84%	9,72%	17,62%	6,90%	
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	43.434.510,44	5,74%		326.903.835,51	13,29%	OK	OK	OK	3,85%	12,18%	17,62%	16,83%	14,38%	
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA</b>	<b>185.032.885,19</b>	<b>24,46%</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	9.461.716,33	1,25%		1.615.147.667,93	0,59%	OK	OK	OK	1,55%	3,86%	9,71%	17,40%	6,92%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	32.502.721,76	4,30%		936.173.791,27	3,47%	OK	OK	OK	3,89%	11,66%	16,64%	16,80%	13,76%	
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	71.977.532,46	9,51%		569.934.013,63	12,63%	OK	OK	OK	3,94%	11,94%	16,85%	16,66%	14,02%	
BRADESCO FI RF IMA B	49.088.121,85	6,49%		1.051.744.598,04	4,67%	OK	OK	OK	4,08%	11,74%	16,53%	16,62%	13,71%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	6.392.612,56	0,84%		2.261.669.065,17	0,28%	OK	OK	OK	3,66%	11,42%	16,04%	15,83%	13,26%	
ITAU INSTITUCIONAL TIT PUBLICOS RF FI	5.734.905,85	0,76%		50.860.501,13	11,28%	OK	OK	OK	2,01%	4,51%	-	-	8,57%	
SAFRA IMA FIC FI RF	5.795.242,57	0,77%		140.039.455,70	4,14%	OK	OK	OK	3,51%	10,59%	15,43%	18,13%	12,50%	
WA IMABS ATIVO FI RENDA FIXA	4.080.031,80	0,54%		88.840.294,10	4,59%	OK	OK	OK	2,47%	5,56%	12,35%	18,23%	9,86%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>43.178.784,37</b>	<b>5,71%</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	3.151.218,78	0,42%		899.939.542,47	0,35%	OK	OK	OK	0,92%	2,92%	6,11%	12,80%	3,93%	
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	6.768.642,61	0,89%		2.060.123.288,43	0,33%	OK	OK	OK	1,09%	3,30%	6,75%	13,66%	4,50%	
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	3.673.677,95	0,49%		412.905.578,10	0,89%	OK	OK	OK	1,14%	2,78%	6,40%	13,86%	3,95%	
INFINITY LOTUS FIRF	523.623,51	0,07%		49.398.841,49	1,06%	OK	OK	OK	1,17%	3,58%	7,60%	15,37%	4,88%	
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	21.201.143,69	2,80%		412.093.822,38	5,14%	OK	OK	OK	3,37%	9,11%	12,65%	-	10,65%	
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	7.860.477,83	1,04%		5.476.558.296,79	0,14%	OK	OK	OK	1,06%	3,22%	6,64%	13,89%	4,30%	
<b>FIDC</b>			<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>		
<b>FIDC Fechado</b>	<b>10.716.177,91</b>	<b>1,42%</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	1.187.569,26	0,16%		7.966.621,70	14,91%	OK	OK	OK	-0,08%	14,18%	6,43%	14,70%	14,40%	
FIDC LAVORO II MEZ	445.133,05	0,06%		4.106.269,25	10,84%	OK	OK	OK	1,85%	-13,47%	-22,49%	-40,57%	-11,87%	
FIDC LAVORO II SEN	2.709.809,20	0,36%		29.311.337,57	9,24%	OK	OK	OK	1,11%	-14,92%	-24,36%	-44,19%	-13,54%	
FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2	1.311.534,82	0,17%		52.385.436,89	2,50%	OK	OK	OK	1,37%	4,23%	8,73%	18,34%	5,66%	
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	1.090.271,28	0,14%		56.050.147,81	1,95%	OK	OK	OK	1,14%	4,47%	9,74%	16,73%	6,19%	
GAVEA SUL FIDC SEN1	2.281.561,62	0,30%		43.902.748,26	5,20%	OK	OK	OK	1,43%	4,41%	9,10%	19,12%	5,90%	
LIBRA FIDC SENIOR 3	679.673,71	0,09%		18.765.539,83	3,62%	OK	OK	OK	1,08%	4,23%	-	-	5,88%	
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL 6 SENIOR	1.010.624,99	0,13%		61.091.357,29	1,65%	OK	OK	OK	1,11%	4,23%	9,39%	17,86%	5,89%	
<b>Fundo Crédito Privado</b>	<b>19.220.075,10</b>	<b>2,54%</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	19.220.075,10	2,54%		394.039.108,71	4,88%	OK	OK	OK	4,57%	11,42%	18,15%	16,03%	14,22%	



SANTOS

29/04/2016

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>756.572.911,36</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>							<b>3,25%</b>	<b>9,61%</b>	<b>13,71%</b>	<b>13,69%</b>	<b>11,41%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										1,13%	3,54%	8,80%	16,42%	5,62%
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										1,10%	3,45%	8,40%	15,84%	5,27%
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>16.479.170,74</b>	<b>2,18%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.518.289,66	0,47%		451.781.669,58	0,78%	OK	OK	OK	2,59%	-0,76%	-7,25%	-11,42%	-8,72%	
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	7.619.350,34	1,01%		109.243.908,43	6,97%	OK	OK	OK	3,69%	16,59%	7,98%	-5,92%	11,86%	
ITAU RPI ACOES IBOVSPA ATIVO FICFI	5.341.530,74	0,71%		476.650.663,82	1,12%	OK	OK	OK	5,64%	20,82%	12,96%	-1,91%	16,57%	
<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>16.157.259,55</b>	<b>2,14%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	14.390.176,38	1,90%		124.133.022,48	11,59%	OK	OK	OK	5,12%	16,58%	11,14%	1,90%	15,99%	
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	1.767.083,17	0,23%		67.146.068,45	2,63%	OK	OK	OK	3,23%	-0,06%	-4,59%	-8,98%	-7,08%	
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>23.300.287,65</b>	<b>3,08%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CAPITANIA MULTI CRED PRIV FIC FI MULT	1.086.837,60	0,14%		248.606.009,93	0,44%	OK	OK	OK	1,05%	3,85%	6,74%	14,76%	4,40%	
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	308.742,19	0,04%		13.542.764,28	2,28%	OK	OK	OK	-0,89%	1,89%	5,95%	15,19%	2,97%	
SAFRA CARTEIRA INSTIT PREMIUM FI MULT	4.397.928,74	0,58%		336.189.614,48	1,31%	OK	OK	OK	1,41%	3,82%	7,84%	14,32%	5,20%	
SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV	3.408.229,34	0,45%		444.733.670,54	0,77%	OK	OK	OK	1,08%	2,38%	5,98%	13,84%	3,47%	
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.574.357,70	0,47%		33.525.891,61	10,66%	OK	OK	OK	1,55%	-0,76%	3,51%	10,83%	0,93%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	7.464.422,45	0,99%		138.239.755,91	5,40%	OK	OK	OK	1,23%	10,22%	5,35%	11,78%	3,61%	
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULT	3.059.769,63	0,40%		98.535.348,32	3,11%	OK	OK	OK	1,29%	2,97%	7,91%	17,95%	5,28%	
<b>Fundos de Participações</b>	<b>5.624.148,12</b>	<b>0,74%</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	548.580,63	0,07%		22.272.374,05	2,46%	OK	OK	OK	-0,74%	-14,22%	-	-	-14,15%	
FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA	13.190,34	0,00%		698.874,19	1,89%	OK	OK	OK	-44,05%	-70,02%	-81,46%	-89,57%	-75,59%	
FIP LSH	4.656.199,62	0,62%		387.950.494,09	1,20%	OK	OK	OK	16,47%	16,40%	15,64%	13,84%	15,71%	
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	406.177,53	0,05%		222.504.050,05	0,18%	OK	OK	OK	0,32%	-0,11%	2,51%	-26,46%	0,53%	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>3.318.884,65</b>	<b>0,44%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
DOMO FII	1.160.000,00	0,15%		170.606.532,68	0,68%	OK	OK	OK	0,17%	8,41%	17,89%	-1,69%	-0,85%	
VECTOR LAJES FII	2.158.884,65	0,29%		31.376.185,18	6,88%	OK	OK	OK	0,71%	2,59%	4,10%	5,49%	4,96%	

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.