

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SANTOS**

**31/05/2016**

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>756.795.089,28</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>							<b>0,01%</b>	<b>7,68%</b>	<b>12,89%</b>	<b>11,95%</b>	<b>11,42%</b>
<b>META ATUARIAL ( INPC + 6%)</b>										<b>1,47%</b>	<b>3,57%</b>	<b>8,66%</b>	<b>16,41%</b>	<b>7,17%</b>
<b>META ATUARIAL ( IPCA + 6%)</b>										<b>1,27%</b>	<b>3,33%</b>	<b>8,16%</b>	<b>15,88%</b>	<b>6,61%</b>
<b>Títulos Públicos</b>	<b>89.079.741,60</b>	<b>11,77%</b>	<b>10,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	89.079.741,60	11,77%								0,34%	9,23%	17,58%	16,09%	15,11%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>414.790.333,78</b>	<b>54,81%</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%		2.304.430.217,74	0,23%	OK	OK	OK	OK	1,34%	3,09%	7,85%	15,89%	6,02%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	29.526.121,31	3,90%		2.055.328.062,34	1,44%	OK	OK	OK	OK	0,96%	3,56%	9,87%	15,49%	7,65%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	6.351.823,26	0,84%		633.239.185,10	1,00%	OK	OK	OK	OK	1,03%	3,55%	8,49%	12,83%	7,16%
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	71.977.532,46	9,51%		510.762.525,80	14,09%	OK	OK	OK	OK	-0,18%	9,29%	15,50%	13,47%	13,82%
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.604.345,49	0,74%		41.795.247,47	13,41%	OK	OK	OK	OK	1,64%	6,95%	11,97%	-	9,36%
BTG PACTUAL FI RF IMA B	16.038.409,48	2,12%		146.717.298,13	10,93%	OK	OK	OK	OK	-0,17%	9,49%	16,01%	14,21%	14,09%
CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF	5.423.215,00	0,72%		833.553.607,40	0,65%	OK	OK	OK	OK	1,45%	3,09%	4,50%	9,66%	2,79%
CAIXA FI BRASIL 2016 III TP RF	12.818.064,00	1,69%		775.437.094,36	1,65%	OK	OK	OK	OK	1,45%	3,09%	7,48%	-	5,72%
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	3.186.577,12	0,42%		515.957.454,75	0,62%	OK	OK	OK	OK	0,34%	3,79%	9,90%	-	7,04%
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	11.137.340,33	1,47%		753.618.894,07	1,48%	OK	OK	OK	OK	0,56%	8,80%	13,42%	8,95%	10,90%
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	11.460.341,95	1,51%		190.599.508,87	6,01%	OK	OK	OK	OK	-0,09%	12,38%	15,44%	6,03%	14,15%
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	5.469.100,00	0,72%		1.498.399.854,12	0,36%	OK	OK	OK	OK	1,45%	3,09%	4,50%	9,66%	2,78%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	82.390.894,80	10,89%		3.682.205.959,51	2,24%	OK	OK	OK	OK	-0,14%	9,30%	15,43%	12,56%	13,77%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	11.141.197,03	1,47%		2.067.128.113,06	0,54%	OK	OK	OK	OK	0,76%	3,02%	9,88%	16,33%	7,64%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	33.221.891,21	4,39%		554.101.836,84	6,00%	OK	OK	OK	OK	-0,13%	9,20%	15,40%	13,70%	13,72%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	60.311.793,59	7,97%		1.448.240.247,55	4,16%	OK	OK	OK	OK	0,78%	3,08%	10,00%	16,63%	7,74%
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	43.434.510,44	5,74%		336.963.873,41	12,89%	OK	OK	OK	OK	0,04%	9,70%	16,46%	14,17%	14,42%
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA</b>	<b>114.930.225,80</b>	<b>15,19%</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%		1.669.843.094,94	0,57%	OK	OK	OK	OK	0,79%	3,12%	10,00%	16,41%	7,77%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	32.502.721,76	4,29%		942.098.546,61	3,45%	OK	OK	OK	OK	-0,14%	9,09%	15,30%	13,70%	13,60%
BRADESCO FI RF IMA B	49.088.121,85	6,49%		1.087.721.973,29	4,51%	OK	OK	OK	OK	-0,15%	9,19%	15,16%	13,46%	13,54%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	6.392.612,56	0,84%		2.183.514.885,24	0,29%	OK	OK	OK	OK	0,02%	9,11%	14,65%	13,11%	13,28%
ITAU INSTITUCIONAL TIT PUBLICOS RF FI	7.609.778,92	1,01%		49.858.978,74	15,26%	OK	OK	OK	OK	-2,28%	0,31%	-	-	6,09%
SAFRA IMA FIC FI RF	5.795.242,57	0,77%		168.228.024,80	3,44%	OK	OK	OK	OK	-0,14%	8,12%	14,12%	15,81%	12,34%
WA IMABS ATIVO FI RENDA FIXA	4.080.031,80	0,54%		99.181.561,21	4,11%	OK	OK	OK	OK	0,38%	3,80%	12,43%	16,27%	10,27%
<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%		993.396.712,91	0,32%	OK	OK	OK	OK	1,07%	3,08%	6,18%	12,96%	5,04%
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	6.768.642,61	0,89%		2.099.683.671,03	0,32%	OK	OK	OK	OK	1,08%	3,38%	6,81%	13,75%	5,62%
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	3.673.677,95	0,49%		409.105.164,63	0,90%	OK	OK	OK	OK	1,14%	2,86%	6,43%	13,96%	5,13%
INFINITY LOTUS FIRF	523.623,51	0,07%		45.036.462,69	1,16%	OK	OK	OK	OK	1,17%	3,71%	7,59%	15,54%	6,11%
ITAU INSTT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	21.201.143,69	2,80%		486.829.541,64	4,35%	OK	OK	OK	OK	0,12%	7,45%	11,86%	-	10,78%
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	7.860.477,83	1,04%		5.526.417.375,86	0,14%	OK	OK	OK	OK	1,12%	3,35%	6,70%	14,02%	5,47%
<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%		7.967.737,09	14,90%	OK	OK	OK	OK	0,01%	14,19%	5,00%	13,28%	14,41%
FIDC LAVORO II MEZ	445.133,05	0,06%		4.186.167,33	10,63%	OK	OK	OK	OK	1,95%	5,95%	-22,42%	-40,44%	-10,15%
FIDC LAVORO II SEN	2.709.809,20	0,36%		29.739.296,48	9,11%	OK	OK	OK	OK	1,46%	3,70%	-24,42%	-44,02%	-12,28%
FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2	1.311.534,82	0,17%		38.031.572,38	3,45%	OK	OK	OK	OK	-27,40%	-25,30%	-22,13%	-15,18%	-23,29%
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	1.090.271,28	0,14%		56.816.234,54	1,92%	OK	OK	OK	OK	1,37%	4,06%	9,66%	16,81%	7,65%
GAVEA SUL FIDC SEN1	2.281.561,62	0,30%		44.560.350,07	5,12%	OK	OK	OK	OK	1,50%	4,56%	9,18%	19,32%	7,49%
UBRA FIDC SENIOR 3	679.673,71	0,09%		20.145.529,49	3,37%	OK	OK	OK	OK	-	-	-	-	-
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL 6 SENIOR	1.010.624,99	0,13%		61.959.354,80	1,63%	OK	OK	OK	OK	1,42%	3,92%	9,30%	18,12%	7,39%
<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%		387.972.833,97	4,95%	OK	OK	OK	OK	-0,26%	8,30%	16,50%	12,74%	13,92%

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SANTOS**

**31/05/2016**

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>756.795.089,28</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>							<b>0,01%</b>	<b>7,68%</b>	<b>12,89%</b>	<b>11,95%</b>	<b>11,42%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										<b>1,47%</b>	<b>3,57%</b>	<b>8,66%</b>	<b>16,41%</b>	<b>7,17%</b>
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										<b>1,27%</b>	<b>3,33%</b>	<b>8,16%</b>	<b>15,88%</b>	<b>6,61%</b>
<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	0,46%		414.133.328,09	0,85%	OK	OK	OK	-8,11%	-10,73%	-17,08%	-15,78%	-16,13%	
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	7.619.350,34	1,01%		103.025.445,47	7,40%	OK	OK	OK	-5,95%	5,54%	2,79%	-7,32%	5,21%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	5.341.530,74	0,71%		446.376.375,43	1,20%	OK	OK	OK	-5,01%	10,20%	8,36%	-2,15%	10,74%	
<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>2,13%</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%		121.447.681,47	11,85%	OK	OK	OK	-2,69%	11,64%	10,46%	2,00%	12,87%	
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	1.767.083,17	0,23%		61.753.724,48	2,86%	OK	OK	OK	-7,83%	-9,87%	-14,62%	-12,55%	-14,35%	
<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%		232.947.096,64	0,47%	OK	OK	OK	1,44%	3,78%	7,19%	14,73%	5,91%	
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	308.742,19	0,04%		14.189.824,62	2,18%	OK	OK	OK	3,17%	4,26%	7,81%	17,53%	6,23%	
SAFRA CARTEIRA INSTIT PREMIUM FI MULT	4.397.928,74	0,58%		396.385.927,46	1,11%	OK	OK	OK	1,10%	3,69%	7,89%	13,97%	6,36%	
SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV	3.408.229,34	0,45%		430.606.827,91	0,79%	OK	OK	OK	0,96%	2,34%	5,95%	13,71%	4,46%	
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.574.357,70	0,47%		33.069.865,72	10,81%	OK	OK	OK	-1,32%	-3,16%	1,17%	8,14%	-0,41%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	7.464.422,45	0,99%		138.467.242,97	5,39%	OK	OK	OK	2,79%	11,81%	6,83%	12,47%	6,50%	
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULT	3.059.769,63	0,40%		105.251.058,41	2,91%	OK	OK	OK	0,95%	3,24%	7,88%	17,56%	6,28%	
<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%		22.093.004,27	2,48%	OK	OK	OK	-0,81%	-7,72%	-14,78%	-	-14,85%	
FIP CAIXA INTEGRACAO LOGISTICA	13.190,34	0,00%		156.020,19	8,45%	OK	OK	OK	-77,68%	-91,29%	-95,39%	-97,50%	-94,55%	
FIP LSH	4.656.199,62	0,62%		387.846.900,89	1,20%	OK	OK	OK	-0,03%	16,40%	15,64%	13,84%	15,67%	
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	406.177,53	0,05%		221.902.124,33	0,18%	OK	OK	OK	-0,27%	-0,33%	2,84%	-26,30%	0,26%	
<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%		170.769.765,26	0,68%	OK	OK	OK	1,72%	1,72%	22,92%	-6,35%	0,85%	
VECTOR LAJES FII	2.158.884,65	0,29%		31.537.215,04	6,85%	OK	OK	OK	0,51%	2,44%	4,63%	5,67%	5,50%	

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.