

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SANTOS**

**30/11/2016**

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>813.480.161,13</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>											
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										<b>-0,97%</b>	<b>1,43%</b>	<b>6,18%</b>	<b>19,84%</b>	<b>18,30%</b>
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										<b>0,56%</b>	<b>1,79%</b>	<b>4,76%</b>	<b>13,83%</b>	<b>12,27%</b>
<b>Títulos Públicos</b>	<b>109.811.632,49</b>	<b>13,50%</b>	<b>100,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PROPRIA SANTOS	109.811.632,49	13,50%								-0,11%	2,24%	6,77%	26,55%	22,90%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>447.209.031,95</b>	<b>54,97%</b>	<b>80,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5 FI	5.937.703,48	0,73%		1.057.039.507,49	0,56%	OK	OK	OK	-2,13%	0,20%	7,13%	27,37%	26,06%	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	4.278.833,14	0,53%		3.528.301.481,04	0,12%	OK	OK	OK	0,29%	3,51%	8,08%	21,68%	21,02%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IX FI	797.013,09	0,10%		342.148.092,56	0,23%	OK	OK	OK	0,68%	2,44%	5,64%	13,94%	12,00%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	15.622.052,90	1,92%		1.077.099.885,41	1,45%	OK	OK	OK	0,30%	2,16%	5,43%	15,84%	13,51%	
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	76.417.181,94	9,39%		568.363.637,11	13,45%	OK	OK	OK	-1,18%	1,01%	6,36%	22,84%	21,06%	
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.836.018,12	0,72%		42.821.185,02	13,63%	OK	OK	OK	-0,09%	1,69%	2,45%	14,72%	12,05%	
BTG PACTUAL FI RF IMA B	17.019.199,15	2,09%		184.125.249,39	9,24%	OK	OK	OK	-1,31%	0,93%	6,30%	23,31%	21,27%	
CAIXA FI BRASIL 2018 II TP RF	4.017.759,68	0,49%		3.069.349.353,56	0,13%	OK	OK	OK	0,62%	2,38%	2,57%	9,61%	7,37%	
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	3.276.409,19	0,40%		817.863.068,60	0,40%	OK	OK	OK	0,10%	2,02%	2,47%	12,62%	9,68%	
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	11.497.833,77	1,41%		777.259.269,64	1,48%	OK	OK	OK	-0,20%	1,19%	2,66%	16,44%	13,86%	
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	11.865.804,21	1,46%		202.589.773,68	5,86%	OK	OK	OK	-1,70%	-0,20%	3,63%	19,63%	18,29%	
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	116.672.992,25	14,34%		4.695.513.366,94	2,48%	OK	OK	OK	-1,17%	1,05%	6,42%	22,85%	21,08%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	11.835.153,52	1,45%		2.052.041.937,49	0,58%	OK	OK	OK	0,37%	2,18%	5,42%	15,84%	13,48%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	35.222.319,38	4,33%		555.694.552,59	6,34%	OK	OK	OK	-1,27%	0,84%	6,16%	22,52%	20,73%	
ITAU INSTITUCIONAL TIT PUBLICOS RF FI	5.919.436,49	0,73%		82.874.626,59	7,14%	OK	OK	OK	-2,46%	-0,37%	2,59%	-	8,84%	
SAFRA IMA FIC FI RF	6.140.295,58	0,75%		318.867.440,51	1,93%	OK	OK	OK	-1,26%	0,91%	6,10%	21,09%	19,20%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	64.142.380,65	7,88%		1.584.955.687,69	4,05%	OK	OK	OK	0,39%	2,23%	5,53%	16,08%	13,69%	
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	46.392.726,57	5,70%		411.356.617,15	11,28%	OK	OK	OK	-0,98%	1,31%	6,77%	24,35%	22,17%	
WA IMAB5 ATIVO FI RENDA FIXA	4.317.918,83	0,53%		131.533.820,29	3,28%	OK	OK	OK	-0,35%	1,97%	5,43%	18,54%	16,26%	
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA</b>	<b>114.229.165,99</b>	<b>14,04%</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	10.064.280,77	1,24%		2.054.584.718,81	0,49%	OK	OK	OK	0,38%	2,23%	5,54%	16,09%	13,73%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	45.111.004,78	5,55%		1.117.652.616,05	4,04%	OK	OK	OK	-1,21%	1,06%	6,49%	22,78%	20,97%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	52.238.262,41	6,42%		1.246.063.372,24	4,19%	OK	OK	OK	-1,27%	1,09%	6,58%	22,74%	21,01%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	6.815.618,03	0,84%		2.318.860.060,89	0,29%	OK	OK	OK	-1,15%	1,18%	6,59%	22,21%	20,75%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>37.627.490,40</b>	<b>4,63%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	3.103.157,89	0,38%		1.245.469.406,59	0,25%	OK	OK	OK	0,98%	3,04%	6,56%	13,15%	11,93%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VIII FI	6.837.023,68	0,84%		674.670.713,77	1,01%	OK	OK	OK	1,02%	3,20%	6,54%	15,58%	14,17%	
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	776.702,72	0,10%		406.712.312,04	0,19%	OK	OK	OK	0,88%	3,05%	7,00%	13,88%	12,49%	
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP	249.060,34	0,03%		1.929.411.757,18	0,01%	OK	OK	OK	1,02%	3,19%	6,78%	14,06%	12,79%	
INFINITY LOTUS FIRF	568.982,60	0,07%		70.035.639,61	0,81%	OK	OK	OK	1,10%	3,44%	7,41%	15,56%	13,97%	
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	22.792.798,28	2,80%		1.204.251.368,16	1,89%	OK	OK	OK	-0,23%	2,59%	7,38%	20,12%	18,96%	
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	3.299.764,89	0,41%		5.701.023.646,78	0,06%	OK	OK	OK	1,06%	3,25%	6,93%	14,09%	12,77%	
<b>FIDC</b>			<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>		
<b>FIDC Fechado</b>	<b>6.422.308,54</b>	<b>0,79%</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	776.481,73	0,10%		5.208.905,59	14,91%	OK	OK	OK	-22,85%	-34,53%	-34,63%	-31,36%	-25,20%	
FIDC LAVORO II MEZ	226.522,57	0,03%		2.089.628,41	10,84%	OK	OK	OK	-18,54%	-39,59%	-50,08%	-61,28%	-55,15%	
FIDC LAVORO II SEN	1.296.430,28	0,16%		14.023.166,51	9,24%	OK	OK	OK	-19,31%	-41,33%	-52,85%	-64,36%	-58,64%	
FIDC MULT SILVERADO MAXIMUM II SR2	111.990,54	0,01%		4.473.135,95	2,50%	OK	OK	OK	-2,68%	-0,04%	1,47%	10,41%	8,77%	
FIDC MULTISSETORIAL VALE SENIOR 5	538.179,78	0,07%		27.667.477,81	1,95%	OK	OK	OK	0,91%	2,81%	6,67%	16,98%	14,83%	
GAVEA SUL FIDC-SEN1	2.532.795,66	0,31%		48.737.097,28	5,20%	OK	OK	OK	1,40%	4,38%	9,37%	19,41%	17,56%	
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL 6 SENIOR	939.907,98	0,12%		61.327.138,98	1,53%	OK	OK	OK	0,86%	2,61%	6,03%	15,90%	13,88%	
<b>Fundo Crédito Privado</b>	<b>20.547.459,42</b>	<b>2,53%</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	20.547.459,42	2,53%		359.398.390,46	5,72%	OK	OK	OK	-1,45%	1,26%	7,19%	24,87%	22,11%	



# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SANTOS**

**30/11/2016**

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>813.480.161,13</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>							<b>-0,97%</b>	<b>1,43%</b>	<b>6,18%</b>	<b>19,84%</b>	<b>18,30%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										<b>0,56%</b>	<b>1,79%</b>	<b>4,76%</b>	<b>13,83%</b>	<b>12,27%</b>
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										<b>0,67%</b>	<b>2,00%</b>	<b>4,85%</b>	<b>13,41%</b>	<b>11,78%</b>
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>18.641.684,89</b>	<b>2,29%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.990.696,78	0,49%		517.941.687,49	0,77%	OK	OK	OK	-6,79%	5,81%	23,44%	2,35%	3,54%	
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	8.624.644,88	1,06%		80.790.164,23	10,68%	OK	OK	OK	-6,35%	3,64%	20,35%	23,71%	26,62%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	6.026.343,23	0,74%		488.574.057,83	1,23%	OK	OK	OK	-6,07%	2,45%	18,77%	28,70%	31,52%	
<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>16.977.358,10</b>	<b>2,09%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FI ACOES	15.013.664,12	1,85%		168.690.995,68	8,90%	OK	OK	OK	-9,25%	-4,68%	6,13%	17,23%	19,79%	
GERACAO FUTURO SELECAO FIA	1.963.693,97	0,24%		71.619.206,40	2,74%	OK	OK	OK	-10,79%	-0,68%	20,56%	2,93%	3,26%	
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>33.096.905,03</b>	<b>4,07%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CAPITANIA MULTI CRED PRIV FIC FI MULT	1.178.605,48	0,14%		150.198.546,85	0,78%	OK	OK	OK	0,80%	2,91%	6,90%	14,59%	13,21%	
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.426.542,76	0,18%		17.813.379,90	8,01%	OK	OK	OK	1,49%	5,17%	8,50%	16,97%	15,25%	
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULT	4.729.049,84	0,58%		532.670.142,34	0,89%	OK	OK	OK	0,46%	2,84%	6,36%	14,76%	13,12%	
SUL AMERICA CRED ATIVO FI MULT CRED PRIV	3.711.711,67	0,46%		409.273.009,64	0,91%	OK	OK	OK	1,34%	3,96%	7,86%	14,29%	12,68%	
SUL AMERICA HIGH YIELD FI MULT CRED PRIV	3.730.389,19	0,46%		35.428.614,84	10,53%	OK	OK	OK	0,79%	3,43%	5,76%	7,00%	5,33%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	8.574.382,76	1,05%		134.389.379,80	6,38%	OK	OK	OK	4,50%	4,48%	11,75%	19,39%	19,02%	
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULT	6.461.628,97	0,79%		215.071.603,00	3,00%	OK	OK	OK	1,05%	4,33%	9,02%	17,62%	15,87%	
XP LONG SHORT FI MULTIMERCADO	3.284.594,36	0,40%		640.456.424,06	0,51%	OK	OK	OK	0,38%	4,19%	10,25%	27,14%	24,65%	
<b>Fundos de Participações</b>	<b>5.644.073,51</b>	<b>0,69%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRASIL ENERGIA RENOVAVEL FIP	402.985,29	0,05%		220.755.341,48	0,18%	OK	OK	OK	-0,61%	-0,60%	-0,52%	2,31%	-0,26%	
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	591.961,03	0,07%		24.033.618,92	2,46%	OK	OK	OK	-0,71%	0,59%	-4,81%	-18,88%	-18,95%	
FIP LSH	4.649.127,19	0,57%		417.287.862,63	1,11%	OK	OK	OK	-0,02%	-0,05%	-0,13%	15,49%	15,53%	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>3.273.050,80</b>	<b>0,40%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
DOMO FII	1.094.000,00	0,13%		178.874.554,55	0,61%	OK	OK	OK	-11,77%	4,79%	-7,29%	13,96%	-6,50%	
VECTOR LAJES FII	2.179.050,80	0,27%		32.682.223,64	6,67%	OK	OK	OK	-0,14%	0,84%	1,71%	7,66%	8,56%	

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.