

Relatório de Performance RPPS



BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT

30/04/2015

Categoria RPPS: 8IV	Valor da Cota: 1.23	PL (R\$): 18,748,041.87
CNPJ: 20168735000136	Qtde. de Cotas: 851,318.77	% do PL (RPPS): 5.58
Cód. Anbima: 367214	Patrim. RPPS (R\$): 63,300,643.22	Tx. de Adm.: 1.10
Gestão: BANESTES DTVM SA	Saldo RPPS (%): 1.65	Tx. de Perf.: -
Adm.: BANESTES DTVM SA	Saldo RPPS (R\$): 1,046,722.78	Resgate: D+3
CNPJ Gestor: 28156057000101	Índice de Ref.: CDI	Conversão de Cotas: D+1
CNPJ Adm.: 28156057000101		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
INFINITY UNIQUE FI MULTIMERCADO	2.38% (5)	4.93% (15)	15.26% (1)	8.26% (47)	19.51% (2)	DESENQUADRADO
LEME FIC FI MULTIMERCADO CRED PRIVADO	4.62% (1)	5.58% (6)	13.92% (2)	40.09% (1)	2.15% (54)	ENQUADRADO
BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT	1.70% (12)	6.45% (4)	11.35% (3)	- -	7.81% (4)	ENQUADRADO
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.66% (13)	4.14% (24)	9.93% (4)	17.48% (3)	13.09% (3)	ENQUADRADO
ECO HEDGE FI MULT CRED PRIV LONGO PRAZO	1.53% (17)	5.25% (9)	9.26% (5)	15.71% (4)	6.83% (5)	ENQUADRADO
WA US INDEX 500 FI MULTI	1.64% (14)	6.73% (3)	9.04% (6)	23.05% (2)	3.89% (35)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA V MULT CR D PRIV	1.75% (10)	5.24% (10)	8.58% (7)	14.66% (6)	6.55% (6)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA VI MULTI CR D PRIV	1.76% (9)	5.23% (11)	8.58% (8)	14.61% (7)	6.53% (7)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA VIII MULT CRED PRIV	1.56% (16)	4.86% (18)	8.47% (9)	14.57% (10)	6.38% (10)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA IV MULTI CRED PRIV	1.52% (18)	4.98% (12)	8.46% (10)	14.61% (8)	6.45% (8)	ENQUADRADO

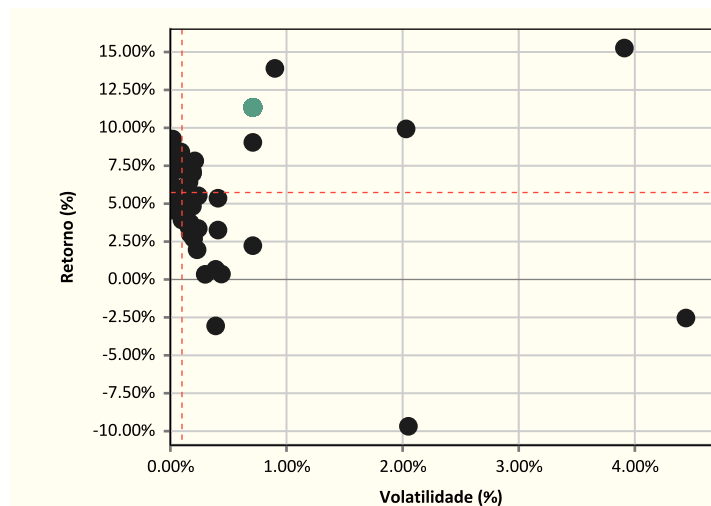
DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.95%	2.83%	5.65%	11.40%	3.78%
IBOVESPA	9.93%	19.87%	2.93%	8.92%	12.44%
IBRX	9.12%	18.69%	2.80%	8.04%	11.71%
IBRX50	9.66%	19.37%	3.14%	9.06%	12.86%
IMA-B	2.44%	2.70%	6.11%	15.56%	5.91%
IRF-M	1.09%	1.35%	4.29%	10.56%	3.16%

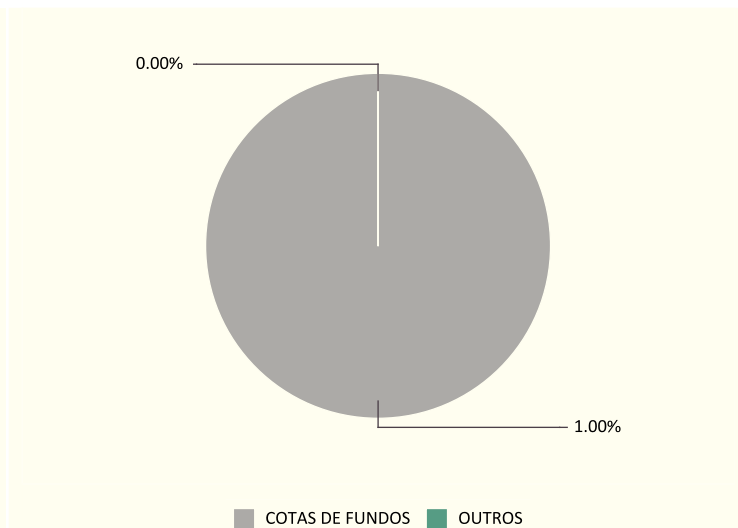
QUADRO DE INDICADORES

		No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Rent. (%)	Fundo	1.70%	6.45%	11.35%		7.81%
	CDI	0.95%	2.83%	5.65%	11.40%	3.78%
	Performance	179.77%	227.83%	200.75%		206.33%
	Sucesso	55.00%	53.33%	51.22%	48.22%	51.85%
Vol.	Fundo	0.82%	0.83%	0.71%		0.81%
	CDI	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
Perf.	Sharpe	0.05	0.07	0.06		0.06
	Semi-Sharpe	0.07	0.10	0.08		0.08
	Beta	-34.82	-59.89	6.75		9.39

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/04/2015



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade da Risk Office, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação. 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. Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.

Relatório de Performance RPPS



BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA

30/04/2015

Categoria RPPS: 7III IMA-B	Valor da Cota: 4.36	PL (R\$): 113,516,152.13
CNPJ: 05357507000110	Qtde. de Cotas: 506,449.04	% do PL (RPPS): 1.95
Cód. Anbima: 247960	Patrim. RPPS (R\$): 63,300,643.22	Tx. de Adm.: 0.20
Gestão: BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO	Saldo RPPS (%): 3.49	Tx. de Perf.: -
Adm.: BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO	Saldo RPPS (R\$): 2,209,423.60	Resgate: D0
CNPJ Gestor: 28127603000178	Índice de Ref.: IMA-B	Conversão de Cotas: D0
CNPJ Adm.: 28127603000178		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	3.79% (1)	3.66% (1)	8.13% (1)	15.37% (8)	6.66% (1)	ENQUADRADO
CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP	2.43% (8)	3.11% (4)	6.52% (2)	16.10% (3)	6.22% (3)	ENQUADRADO
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	2.42% (9)	3.08% (5)	6.46% (3)	15.98% (4)	6.18% (4)	ENQUADRADO
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0.68% (20)	3.32% (2)	6.42% (4)	13.39% (17)	4.52% (18)	ENQUADRADO
BRDESCO FI RF IMA B	2.54% (4)	2.77% (8)	6.41% (5)	15.68% (5)	5.93% (6)	ENQUADRADO
FUNDO DE INV RENDA FIXA IPIRANGA	1.58% (16)	3.13% (3)	6.22% (6)	12.87% (18)	5.07% (15)	ENQUADRADO
BANRISUL PREV MUNICIPAL III FI RF LP	2.64% (2)	2.74% (10)	6.18% (7)	15.39% (7)	5.91% (7)	ENQUADRADO
FUNDO INVEST. RENDA FIXA IMA B ESLOVENIA	0.82% (19)	2.96% (7)	6.12% (8)	24.21% (1)	4.71% (17)	ENQUADRADO
UNIBANCO INDICE DE PRECOS FI RF	2.45% (7)	2.69% (11)	6.02% (9)	15.26% (9)	5.89% (8)	ENQUADRADO
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	2.38% (12)	2.58% (14)	5.95% (10)	14.69% (14)	6.01% (5)	ENQUADRADO

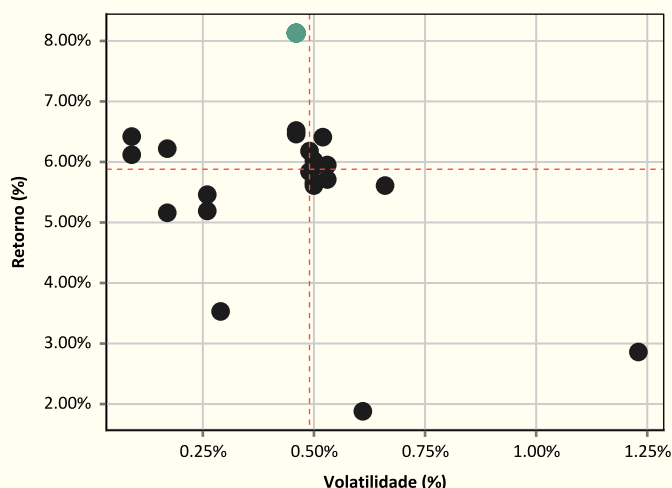
DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.95%	2.83%	5.65%	11.40%	3.78%
IBOVESPA	9.93%	19.87%	2.93%	8.92%	12.44%
IBRX	9.12%	18.69%	2.80%	8.04%	11.71%
IBRX50	9.66%	19.37%	3.14%	9.06%	12.86%
IMA-B	2.44%	2.70%	6.11%	15.56%	5.91%
IRF-M	1.09%	1.35%	4.29%	10.56%	3.16%

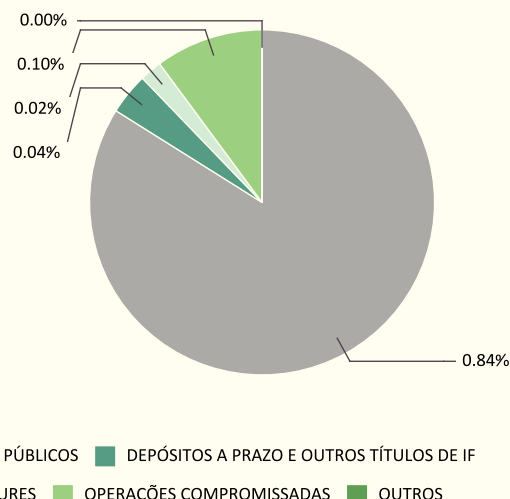
QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	3.79%	3.66%	8.13%	15.37%	6.66%
	IMA-B	2.44%	2.70%	6.11%	15.56%	5.91%
	Performance	1.32%	0.93%	1.90%	-0.16%	0.71%
	Sucesso	55.00%	55.00%	53.66%	50.99%	51.85%
Vol.	Fundo	0.39%	0.44%	0.46%	0.43%	0.43%
	IMA-B	0.42%	0.47%	0.50%	0.57%	0.45%
Perf.	Sharpe	0.17	0.03	0.03	-0.00	0.02
	Semi-Sharpe	0.25	0.05	0.05	-0.00	0.03
	Beta	-0.02	-0.05	0.04	-0.01	-0.06

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/04/2015



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade da Risk Office, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação. 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. Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.

Relatório de Performance RPPS



BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI

30/04/2015

Categoria RPPS: 7IB IMA-B	Valor da Cota: 3.10	PL (R\$): 5,332,883,868.32
CNPJ: 07442078000105	Qtde. de Cotas: 10,493,545.49	% do PL (RPPS): 0.61
Cód. Anbima: 242901	Patrim. RPPS (R\$): 63,300,643.22	Tx. de Adm.: 0.20
Gestão: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (%): 51.41	Tx. de Perf.: -
Adm.: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (R\$): 32,543,590.64	Resgate: 1
CNPJ Gestor: 30822936000169	Índice de Ref.: IMA-B	Conversão de Cotas: 1
CNPJ Adm.: 30822936000169		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	4.84% (1)	4.06% (1)	8.31% (1)	16.51% (1)	7.29% (1)	ENQUADRADO
BRB RENDA FIXA IMA B	3.10% (3)	2.61% (8)	7.24% (2)	16.25% (2)	6.15% (3)	ENQUADRADO
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	2.52% (4)	2.64% (6)	5.97% (3)	15.03% (7)	5.80% (7)	ENQUADRADO
SAFRA IMA FIC FI RF	1.26% (18)	2.87% (2)	5.96% (4)	12.20% (15)	5.14% (12)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	2.47% (5)	2.67% (4)	5.92% (5)	15.21% (4)	5.81% (6)	ENQUADRADO
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	2.19% (12)	2.50% (11)	5.90% (6)	15.18% (5)	6.56% (2)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	2.42% (7)	2.62% (7)	5.89% (7)	15.27% (3)	5.75% (9)	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	2.40% (10)	2.59% (10)	5.88% (8)	15.05% (6)	5.75% (10)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	2.43% (6)	2.69% (3)	5.79% (9)	14.66% (9)	5.89% (4)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	2.41% (8)	2.64% (5)	5.68% (10)	14.43% (10)	5.82% (5)	ENQUADRADO

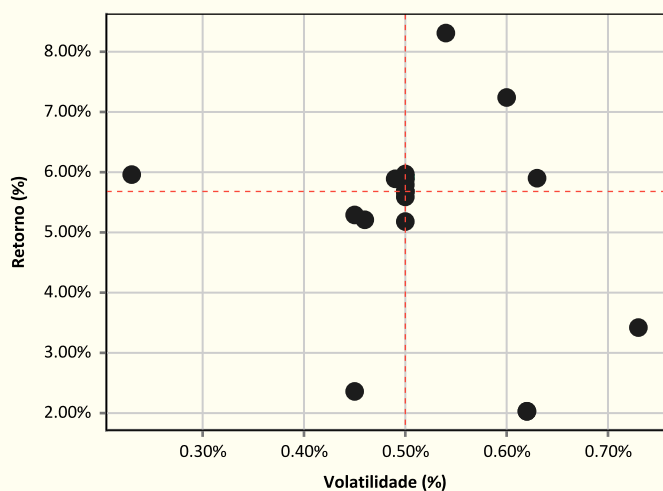
DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.95%	2.83%	5.65%	11.40%	3.78%
IBOVESPA	9.93%	19.87%	2.93%	8.92%	12.44%
IBRX	9.12%	18.69%	2.80%	8.04%	11.71%
IBRX50	9.66%	19.37%	3.14%	9.06%	12.86%
IMA-B	2.44%	2.70%	6.11%	15.56%	5.91%
IRF-M	1.09%	1.35%	4.29%	10.56%	3.16%

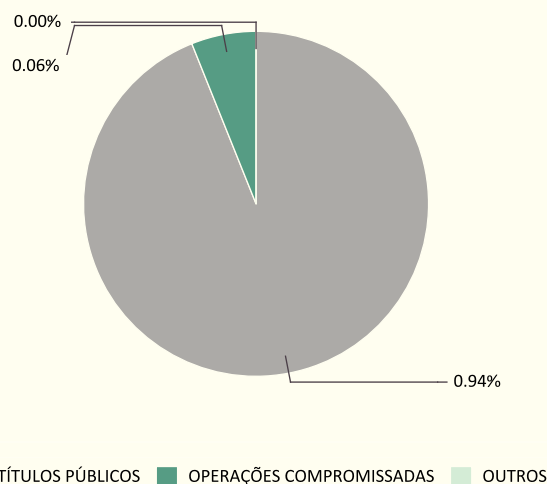
QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	2.47%	2.67%	5.92%	15.21%	5.81%
	IMA-B	2.44%	2.70%	6.11%	15.56%	5.91%
	Performance	0.03%	-0.03%	-0.18%	-0.30%	-0.09%
	Sucesso	50.00%	41.67%	34.15%	35.97%	38.27%
Vol.	Fundo	0.42%	0.47%	0.50%	0.57%	0.45%
	IMA-B	0.42%	0.47%	0.50%	0.57%	0.45%
Perf.	Sharpe	0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00
	Semi-Sharpe	0.01	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00
	Beta	1.01	1.00	1.00	1.00	1.00

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/04/2015



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade da Risk Office, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação. 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. Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.

Relatório de Performance RPPS



BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI

30/04/2015

Categoria RPPS: 7IB IDKA IPCA 3A	Valor da Cota: 1.18	PL (R\$): 928,137,850.48
CNPJ: 19303794000190	Qtde. de Cotas: 2,822,582.67	% do PL (RPPS): 0.36
Cód. Anbima: 359831	Patrim. RPPS (R\$): 63,300,643.22	Tx. de Adm.: 0.15
Gestão: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (%): 5.28	Tx. de Perf.: -
Adm.: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (R\$): 3,339,833.64	Resgate: 0
CNPJ Gestor: 30822936000169	Índice de Ref.: IDKA IPCA 3A	Conversão de Cotas: 0
CNPJ Adm.: 30822936000169		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI	0.51% (1)	2.14% (1)	5.44% (1)	12.38% (1)	4.76% (1)	ENQUADRADO

DADOS DE MERCADO

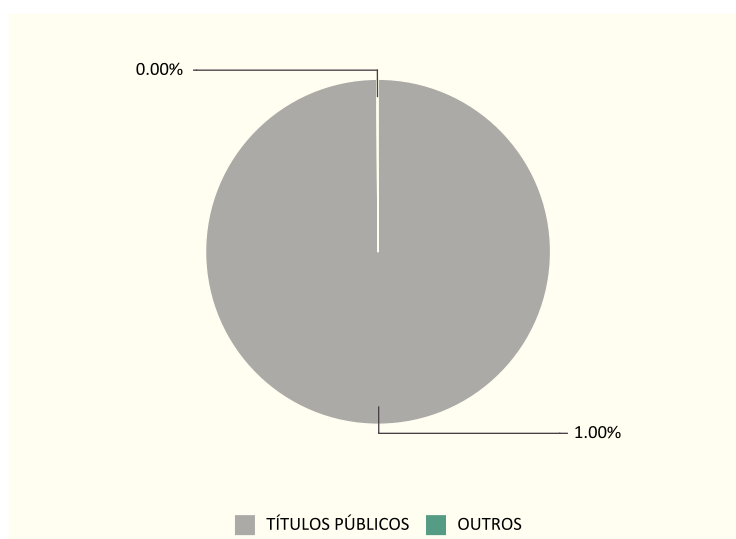
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.95%	2.83%	5.65%	11.40%	3.78%
IBOVESPA	9.93%	19.87%	2.93%	8.92%	12.44%
IBRX	9.12%	18.69%	2.80%	8.04%	11.71%
IBRX50	9.66%	19.37%	3.14%	9.06%	12.86%
IMA-B	2.44%	2.70%	6.11%	15.56%	5.91%
IRF-M	1.09%	1.35%	4.29%	10.56%	3.16%

QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	0.51%	2.14%	5.44%	12.38%	4.76%
	IDKA IPCA 3A	0.39%	2.74%	5.48%	12.12%	4.81%
	Performance	0.13%	-0.58%	-0.04%	0.24%	-0.04%
	Sucesso	60.00%	50.00%	47.15%	45.85%	51.85%
Vol.	Fundo	0.25%	0.25%	0.24%	0.27%	0.24%
	IDKA IPCA 3A	0.27%	0.27%	0.24%	0.24%	0.26%
Perf.	Sharpe	0.03	-0.04	-0.00	0.00	-0.00
	Semi-Sharpe	0.03	-0.05	-0.00	0.00	-0.00
	Beta	0.91	0.82	0.88	0.97	0.81

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)

COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/04/2015



Relatório de Performance RPPS



BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI

30/04/2015

Categoria RPPS: 7IV CDI	Valor da Cota: 1.46	PL (R\$): 5,086,494,933.28
CNPJ: 13077418000149	Qtde. de Cotas: 3,811,347.67	% do PL (RPPS): 0.11
Cód. Anbima: 272493	Patrim. RPPS (R\$): 63,300,643.22	Tx. de Adm.: 0.30
Gestão: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (%): 8.79	Tx. de Perf.: -
Adm.: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (R\$): 5,562,852.49	Resgate: 0
CNPJ Gestor: 30822936000169	Índice de Ref.: CDI	Conversão de Cotas: 0
CNPJ Adm.: 30822936000169		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	1.05% (3)	3.19% (1)	6.23% (1)	12.25% (2)	4.25% (4)	ENQUADRADO
CAIXA FIC PATRIMONIO IND PRECOS RF LP	0.81% (67)	2.92% (5)	6.17% (2)	12.91% (1)	4.71% (2)	ENQUADRADO
SAFRA CART CORP RF FC FI	0.87% (61)	2.98% (3)	5.98% (3)	11.90% (4)	4.25% (3)	ENQUADRADO
INFINITY LOTUS FIRF	1.10% (1)	3.15% (2)	5.82% (4)	12.04% (3)	6.56% (1)	ENQUADRADO
HSBC FI REFERENCIADO DI LP	0.96% (11)	2.87% (10)	5.76% (5)	11.58% (8)	3.86% (6)	ENQUADRADO
ITAU REFERENCIADO DI FI	0.96% (12)	2.87% (13)	5.76% (6)	11.64% (5)	3.85% (8)	ENQUADRADO
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	0.97% (6)	2.87% (9)	5.76% (7)	11.62% (7)	3.84% (9)	ENQUADRADO
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0.96% (10)	2.88% (8)	5.75% (8)	11.63% (6)	3.84% (10)	ENQUADRADO
SANTANDER FICFI INSTITUCIONAL REF DI	0.98% (4)	2.88% (7)	5.73% (9)	11.55% (10)	3.85% (7)	ENQUADRADO
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0.96% (8)	2.87% (12)	5.72% (10)	11.55% (11)	3.84% (11)	ENQUADRADO

DADOS DE MERCADO

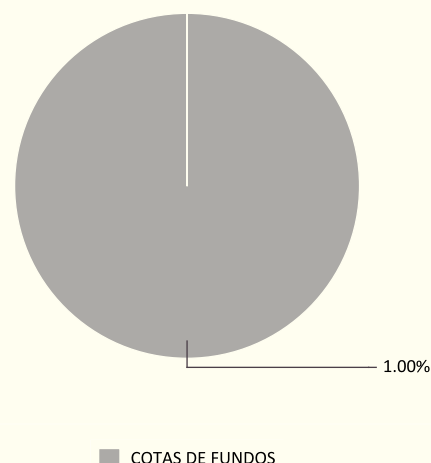
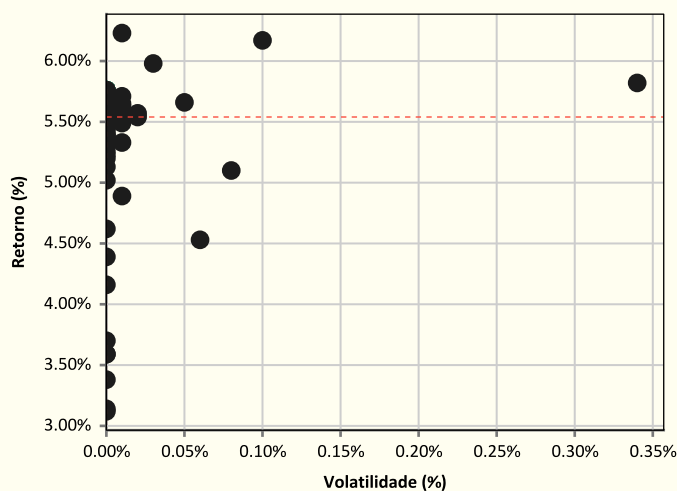
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.95%	2.83%	5.65%	11.40%	3.78%
IBOVESPA	9.93%	19.87%	2.93%	8.92%	12.44%
IBRX	9.12%	18.69%	2.80%	8.04%	11.71%
IBRX50	9.66%	19.37%	3.14%	9.06%	12.86%
IMA-B	2.44%	2.70%	6.11%	15.56%	5.91%
IRF-M	1.09%	1.35%	4.29%	10.56%	3.16%

QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	0.97%	2.87%	5.76%	11.62%	3.84%
	CDI	0.95%	2.83%	5.65%	11.40%	3.78%
	Performance	102.53%	101.61%	101.84%	101.92%	101.52%
	Sucesso	75.00%	65.00%	63.41%	63.24%	64.20%
Vol.	Fundo	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
	CDI	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
Perf.	Sharpe	0.41	0.19	0.17	0.17	0.18
	Semi-Sharpe	0.53	0.27	0.23	0.26	0.26
	Beta	-3.54	0.97	1.08	1.03	0.98

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)

COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 31/03/2015



Relatório de Performance RPPS



CAIXA FI ALIANCA TITULOS PUBLICOS RF

30/04/2015

Categoria RPPS: 7IV CDI	Valor da Cota: 2.71	PL (R\$): 361,895,032.63
CNPJ: 05164358000173	Qtde. de Cotas: 1,543,004.37	% do PL (RPPS): 1.16
Cód. Anbima: 157252	Patrim. RPPS (R\$): 63,300,643.22	Tx. de Adm.: 0.20
Gestão: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (%): 6.61	Tx. de Perf.: -
Adm.: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (R\$): 4,185,416.34	Resgate: 0
CNPJ Gestor: 360305000104	Índice de Ref.: CDI	Conversão de Cotas: 0
CNPJ Adm.: 360305000104		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	1.05% (3)	3.19% (1)	6.23% (1)	12.25% (2)	4.25% (4)	ENQUADRADO
CAIXA FIC PATRIMONIO IND PRECOS RF LP	0.81% (67)	2.92% (5)	6.17% (2)	12.91% (1)	4.71% (2)	ENQUADRADO
SAFRA CART CORP RF FC FI	0.87% (61)	2.98% (3)	5.98% (3)	11.90% (4)	4.25% (3)	ENQUADRADO
INFINITY LOTUS FIRF	1.10% (1)	3.15% (2)	5.82% (4)	12.04% (3)	6.56% (1)	ENQUADRADO
HSBC FI REFERENCIADO DI LP	0.96% (11)	2.87% (10)	5.76% (5)	11.58% (8)	3.86% (6)	ENQUADRADO
ITAU REFERENCIADO DI FI	0.96% (12)	2.87% (13)	5.76% (6)	11.64% (5)	3.85% (8)	ENQUADRADO
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	0.97% (6)	2.87% (9)	5.76% (7)	11.62% (7)	3.84% (9)	ENQUADRADO
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0.96% (10)	2.88% (8)	5.75% (8)	11.63% (6)	3.84% (10)	ENQUADRADO
SANTANDER FICFI INSTITUCIONAL REF DI	0.98% (4)	2.88% (7)	5.73% (9)	11.55% (10)	3.85% (7)	ENQUADRADO
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0.96% (8)	2.87% (12)	5.72% (10)	11.55% (11)	3.84% (11)	ENQUADRADO
CAIXA FI ALIANCA TITULOS PUBLICOS RF	0.88% (57)	2.69% (56)	5.52% (45)	11.20% (31)	3.70% (45)	ENQUADRADO

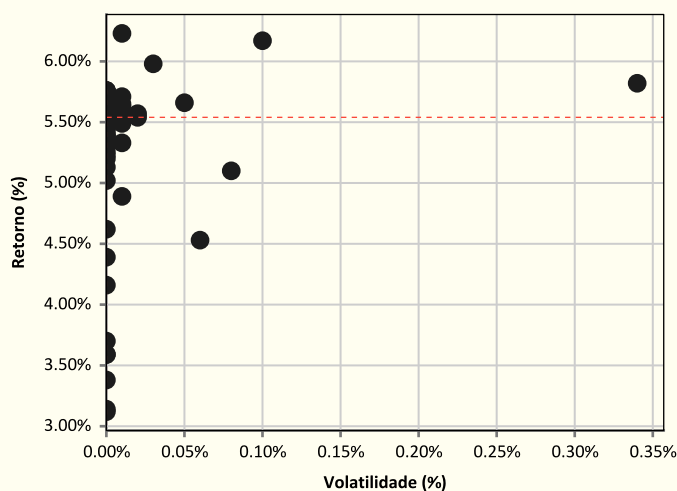
DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.95%	2.83%	5.65%	11.40%	3.78%
IBOVESPA	9.93%	19.87%	2.93%	8.92%	12.44%
IBRX	9.12%	18.69%	2.80%	8.04%	11.71%
IBRX50	9.66%	19.37%	3.14%	9.06%	12.86%
IMA-B	2.44%	2.70%	6.11%	15.56%	5.91%
IRF-M	1.09%	1.35%	4.29%	10.56%	3.16%

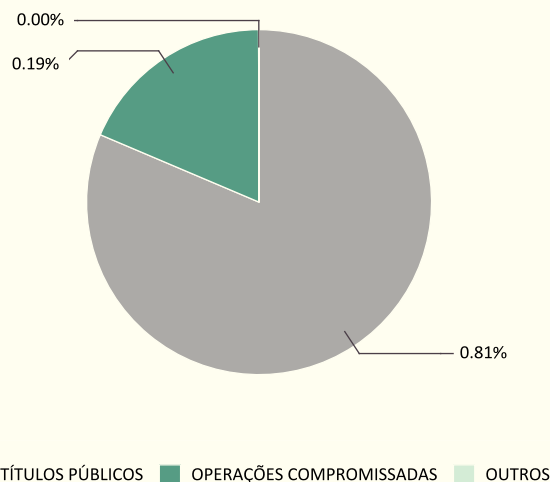
QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Ret. (%)					
Fundo	0.88%	2.69%	5.52%	11.20%	3.70%
CDI	0.95%	2.83%	5.65%	11.40%	3.78%
Performance	93.32%	95.02%	97.58%	98.18%	97.65%
Sucesso	25.00%	41.67%	44.72%	43.87%	45.68%
Vol.					
Fundo	0.01%	0.01%	0.01%	0.01%	0.01%
CDI	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
Perf.					
Sharpe	-0.60	-0.30	-0.14	-0.08	-0.15
Semi-Sharpe	-0.84	-0.35	-0.19	-0.11	-0.18
Beta	-6.78	-0.77	0.32	0.66	-1.03

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/04/2015



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade da Risk Office, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação. 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. Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.

Relatório de Performance RPPS



CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF

30/04/2015

Categoria RPPS: 7IB IMA-B	Valor da Cota: 1.14	PL (R\$): 304,294,890.77
CNPJ: 18598288000103	Qtde. de Cotas: 816,910.12	% do PL (RPPS): 0.31
Cód. Anbima: 359947	Patrim. RPPS (R\$): 63,300,643.22	Tx. de Adm.: 0.20
Gestão: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (%): 1.47	Tx. de Perf.: -
Adm.: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (R\$): 930,147.75	Resgate: 0
CNPJ Gestor: 360305000104	Índice de Ref.: IMA-B	Conversão de Cotas: 0
CNPJ Adm.: 360305000104		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	4.84% (1)	4.06% (1)	8.31% (1)	16.51% (1)	7.29% (1)	ENQUADRADO
BRB RENDA FIXA IMA B	3.10% (3)	2.61% (8)	7.24% (2)	16.25% (2)	6.15% (3)	ENQUADRADO
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	2.52% (4)	2.64% (6)	5.97% (3)	15.03% (7)	5.80% (7)	ENQUADRADO
SAFRA IMA FIC FI RF	1.26% (18)	2.87% (2)	5.96% (4)	12.20% (15)	5.14% (12)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	2.47% (5)	2.67% (4)	5.92% (5)	15.21% (4)	5.81% (6)	ENQUADRADO
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	2.19% (12)	2.50% (11)	5.90% (6)	15.18% (5)	6.56% (2)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	2.42% (7)	2.62% (7)	5.89% (7)	15.27% (3)	5.75% (9)	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	2.40% (10)	2.59% (10)	5.88% (8)	15.05% (6)	5.75% (10)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	2.43% (6)	2.69% (3)	5.79% (9)	14.66% (9)	5.89% (4)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	2.41% (8)	2.64% (5)	5.68% (10)	14.43% (10)	5.82% (5)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	1.84% (13)	-1.29% (19)	2.03% (19)	8.15% (17)	2.09% (18)	ENQUADRADO

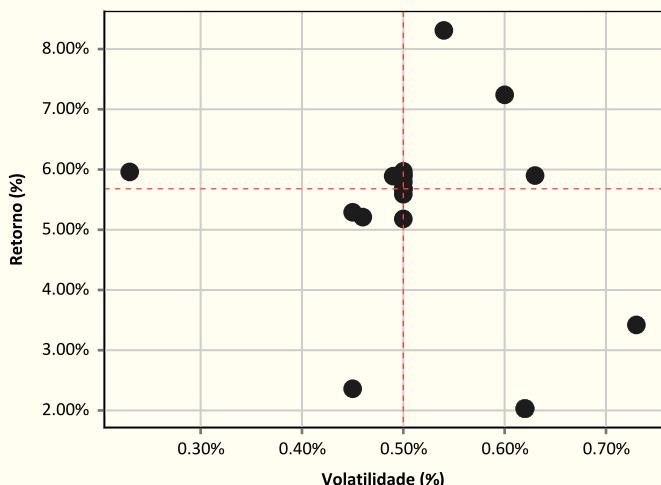
DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.95%	2.83%	5.65%	11.40%	3.78%
IBOVESPA	9.93%	19.87%	2.93%	8.92%	12.44%
IBRX	9.12%	18.69%	2.80%	8.04%	11.71%
IBRX50	9.66%	19.37%	3.14%	9.06%	12.86%
IMA-B	2.44%	2.70%	6.11%	15.56%	5.91%
IRF-M	1.09%	1.35%	4.29%	10.56%	3.16%

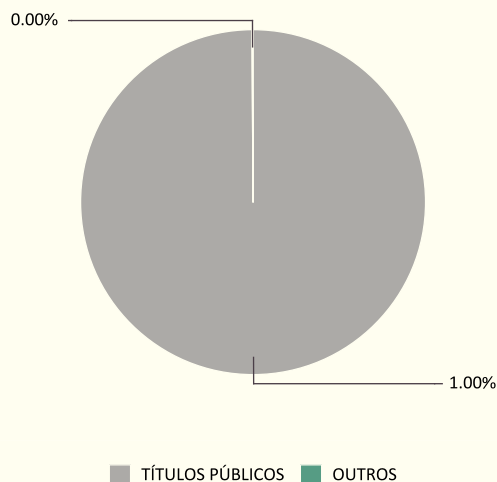
QUADRO DE INDICADORES

		No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Rent. (%)	Fundo	1.84%	-1.29%	2.03%	8.15%	2.09%
	IMA-B	2.44%	2.70%	6.11%	15.56%	5.91%
	Performance	-0.59%	-3.89%	-3.85%	-6.41%	-3.61%
	Sucesso	55.00%	53.33%	52.85%	49.41%	54.32%
Vol.	Fundo	0.54%	0.69%	0.62%	0.63%	0.63%
	IMA-B	0.42%	0.47%	0.50%	0.57%	0.45%
Perf.	Sharpe	-0.05	-0.10	-0.05	-0.04	-0.07
	Semi-Sharpe	-0.07	-0.12	-0.07	-0.06	-0.09
	Beta	1.24	1.19	1.09	0.99	1.17

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/04/2015



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade da Risk Office, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação. 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. Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.

Relatório de Performance RPPS



CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA

30/04/2015

Categoria RPPS: 81 IBOVESPA
CNPJ: 13058816000118
Cód. Anbima: 344672
Gestão: CAIXA ECONOMICA FEDERAL
Adm.: CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ Gestor: 360305000104
CNPJ Adm.: 360305000104

Valor da Cota: 1.30
Qtde. de Cotas: 1,000,000.00
Patrim. RPPS (R\$): 63,300,643.22
Saldo RPPS (%): 2.05
Saldo RPPS (R\$): 1,298,382.00
Índice de Ref.: IBOVESPA

PL (R\$): 46,222,431.95
% do PL (RPPS): 2.81
Tx. de Adm.: 0.50
Tx. de Perf.: -
Resgate: 4
Conversão de Cotas: 1

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
SANT FIC FI VALOR INST IBOVESPA ACOES	5.56% (19)	15.39% (15)	4.74% (1)	9.49% (1)	8.76% (10)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	5.53% (20)	15.70% (13)	4.28% (2)	8.05% (6)	8.66% (11)	ENQUADRADO
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INST ACOES	9.61% (5)	18.54% (8)	3.79% (3)	8.07% (5)	11.50% (2)	ENQUADRADO
CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA	9.46% (6)	19.66% (2)	3.58% (4)	8.33% (3)	10.80% (6)	ENQUADRADO
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	9.40% (9)	19.60% (3)	3.33% (5)	8.26% (4)	10.63% (7)	ENQUADRADO
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	6.72% (14)	16.66% (10)	3.06% (6)	7.11% (7)	8.56% (13)	ENQUADRADO
BRDESCO FIA IBOVESPA PLUS	9.95% (1)	19.94% (1)	3.02% (7)	8.74% (2)	12.52% (1)	ENQUADRADO
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	5.98% (16)	15.30% (16)	2.58% (8)	6.57% (10)	7.91% (16)	ENQUADRADO
ITAU FOF RPI 30 MASTER ACOES FI	5.75% (17)	15.40% (14)	2.03% (9)	7.07% (8)	8.28% (14)	ENQUADRADO
HSBC FI EM ACOES IBOVESPA TOP	9.67% (4)	19.07% (5)	1.80% (10)	6.61% (9)	11.46% (3)	ENQUADRADO

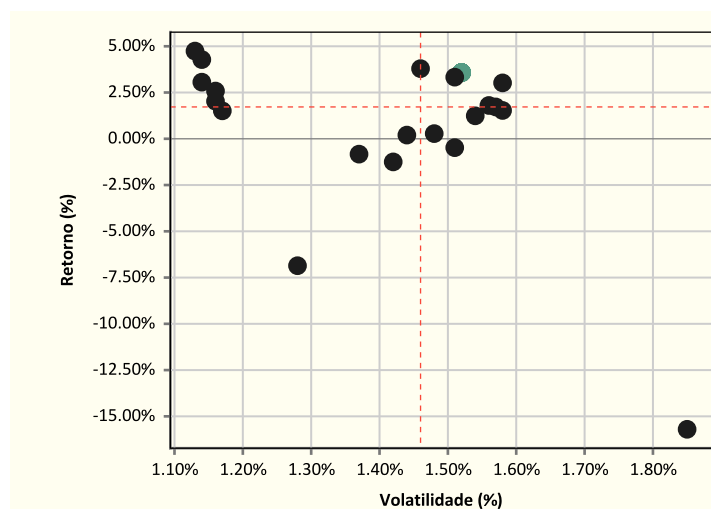
DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.95%	2.83%	5.65%	11.40%	3.78%
IBOVESPA	9.93%	19.87%	2.93%	8.92%	12.44%
IBRX	9.12%	18.69%	2.80%	8.04%	11.71%
IBRX50	9.66%	19.37%	3.14%	9.06%	12.86%
IMA-B	2.44%	2.70%	6.11%	15.56%	5.91%
IRF-M	1.09%	1.35%	4.29%	10.56%	3.16%

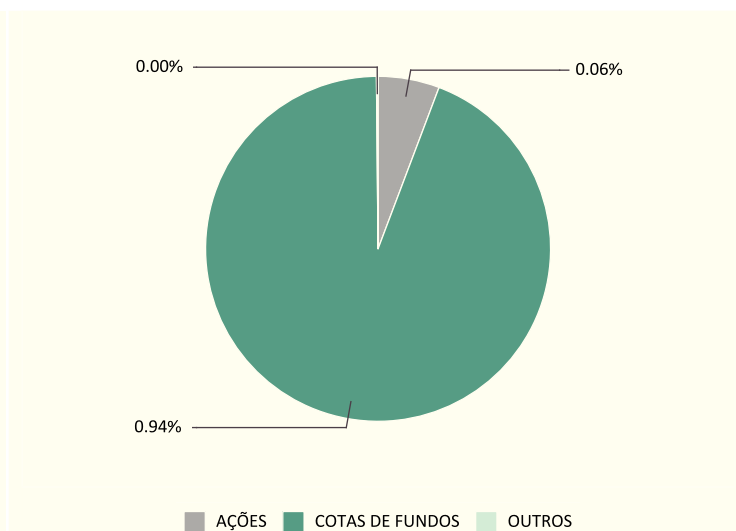
QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	9.46%	19.66%	3.58%	8.33%	10.80%
	IBOVESPA	9.93%	19.87%	2.93%	8.92%	12.44%
	Performance	-0.43%	-0.18%	0.63%	-0.54%	-1.46%
	Sucesso	45.00%	53.33%	55.28%	52.57%	50.62%
Vol.	Fundo	0.93%	1.25%	1.52%	1.55%	1.38%
	IBOVESPA	1.15%	1.31%	1.58%	1.61%	1.43%
Perf.	Sharpe	-0.02	-0.00	0.00	-0.00	-0.01
	Semi-Sharpe	-0.03	-0.00	0.00	-0.00	-0.02
	Beta	0.78	0.91	0.92	0.93	0.93

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/04/2015



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade da Risk Office, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação. 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. Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.

Relatório de Performance RPPS



CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS

30/04/2015

Categoria RPPS: 8III IDIV	Valor da Cota: 1.04	PL (R\$): 319,875,344.60
CNPJ: 15154441000115	Qtde. de Cotas: 3,497,256.96	% do PL (RPPS): 1.14
Cód. Anbima: 311383	Patrim. RPPS (R\$): 63,300,643.22	Tx. de Adm.: 1.72
Gestão: VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA	Saldo RPPS (%): 5.77	Tx. de Perf.: 20% que exceder 100% do Outros
Adm.: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (R\$): 3,653,398.99	Resgate: 33
CNPJ Gestor: 10917835000164	Índice de Ref.: IDIV	Conversão de Cotas: 30
CNPJ Adm.: 360305000104		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	5.21% (15)	16.11% (3)	10.39% (1)	13.41% (2)	12.34% (1)	ENQUADRADO
FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	5.20% (16)	16.07% (4)	10.28% (2)	13.16% (3)	12.28% (2)	ENQUADRADO
FI FATOR ACOES DIVIDENDOS	4.35% (21)	12.65% (11)	7.75% (3)	15.54% (1)	10.74% (3)	ENQUADRADO
CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FIA	6.05% (9)	11.54% (15)	5.97% (4)	11.64% (4)	5.29% (12)	ENQUADRADO
LMX DIVIDENDOS FI DE ACOES	4.73% (19)	8.92% (20)	4.87% (5)	7.98% (7)	6.70% (9)	ENQUADRADO
FIA PETREO DIVIDENDOS	4.94% (18)	11.69% (14)	4.16% (6)	8.02% (6)	7.56% (7)	DESENQUADRADO
BB TOP ACOES DIVIDENDOS FIA	7.04% (7)	14.59% (6)	3.23% (7)	7.96% (8)	8.45% (5)	ENQUADRADO
WA DIVIDEND YIELD FIA	5.57% (13)	9.36% (19)	2.64% (8)	7.68% (9)	6.30% (10)	ENQUADRADO
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM ACOES	3.36% (23)	8.21% (22)	2.56% (9)	9.43% (5)	4.82% (13)	ENQUADRADO
BB ACOES DIVIDENDOS FICFIA	6.87% (8)	14.04% (9)	2.21% (10)	5.78% (11)	7.75% (6)	ENQUADRADO
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	1.68% (24)	6.65% (23)	0.89% (12)	4.61% (13)	0.53% (23)	ENQUADRADO

DADOS DE MERCADO

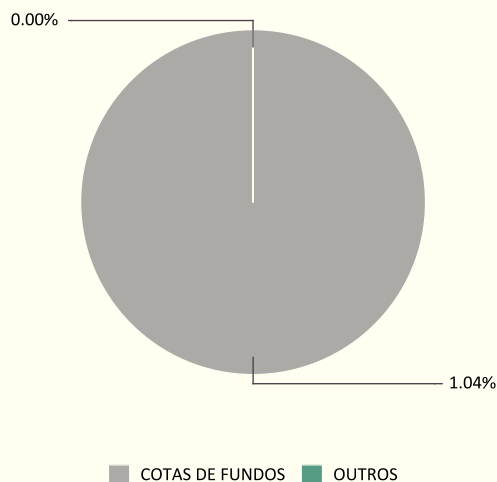
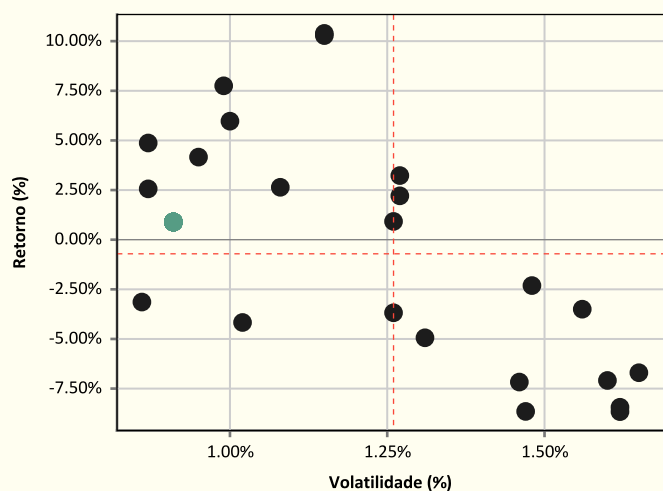
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.95%	2.83%	5.65%	11.40%	3.78%
IBOVESPA	9.93%	19.87%	2.93%	8.92%	12.44%
IBRX	9.12%	18.69%	2.80%	8.04%	11.71%
IBRX50	9.66%	19.37%	3.14%	9.06%	12.86%
IMA-B	2.44%	2.70%	6.11%	15.56%	5.91%
IRF-M	1.09%	1.35%	4.29%	10.56%	3.16%

QUADRO DE INDICADORES

		No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Rent. (%)	Fundo	1.68%	6.65%	0.89%	4.61%	0.53%
	IDIV	11.84%	18.11%	-9.15%	-13.40%	4.91%
	Performance	-9.08%	-9.70%	11.06%	20.80%	-4.18%
	Sucesso	40.00%	48.33%	54.47%	55.34%	53.09%
Vol.	Fundo	0.35%	0.73%	0.91%	1.01%	0.91%
	IDIV	1.45%	1.54%	1.76%	1.72%	1.64%
Perf.	Sharpe	-1.36	-0.23	0.09	0.07	-0.06
	Semi-Sharpe	-6.01	-0.35	0.13	0.10	-0.08
	Beta	0.04	0.27	0.37	0.46	0.37

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)

COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/04/2015



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade da Risk Office, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação. 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. Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.

Relatório de Performance RPPS



FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP

30/04/2015

Categoria RPPS: 7IB IMA-B	Valor da Cota: 1.77	PL (R\$): 4,203,302,606.79
CNPJ: 10740658000193	Qtde. de Cotas: 4,128,168.29	% do PL (RPPS): 0.17
Cód. Anbima: 244120	Patrim. RPPS (R\$): 63,300,643.22	Tx. de Adm.: 0.20
Gestão: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (%): 11.55	Tx. de Perf.: -
Adm.: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (R\$): 7,309,421.47	Resgate: 0
CNPJ Gestor: 360305000104	Índice de Ref.: IMA-B	Conversão de Cotas: 0
CNPJ Adm.: 360305000104		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	4.84% (1)	4.06% (1)	8.31% (1)	16.51% (1)	7.29% (1)	ENQUADRADO
BRB RENDA FIXA IMA B	3.10% (3)	2.61% (8)	7.24% (2)	16.25% (2)	6.15% (3)	ENQUADRADO
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	2.52% (4)	2.64% (6)	5.97% (3)	15.03% (7)	5.80% (7)	ENQUADRADO
SAFRA IMA FIC FI RF	1.26% (18)	2.87% (2)	5.96% (4)	12.20% (15)	5.14% (12)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	2.47% (5)	2.67% (4)	5.92% (5)	15.21% (4)	5.81% (6)	ENQUADRADO
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	2.19% (12)	2.50% (11)	5.90% (6)	15.18% (5)	6.56% (2)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	2.42% (7)	2.62% (7)	5.89% (7)	15.27% (3)	5.75% (9)	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	2.40% (10)	2.59% (10)	5.88% (8)	15.05% (6)	5.75% (10)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	2.43% (6)	2.69% (3)	5.79% (9)	14.66% (9)	5.89% (4)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	2.41% (8)	2.64% (5)	5.68% (10)	14.43% (10)	5.82% (5)	ENQUADRADO

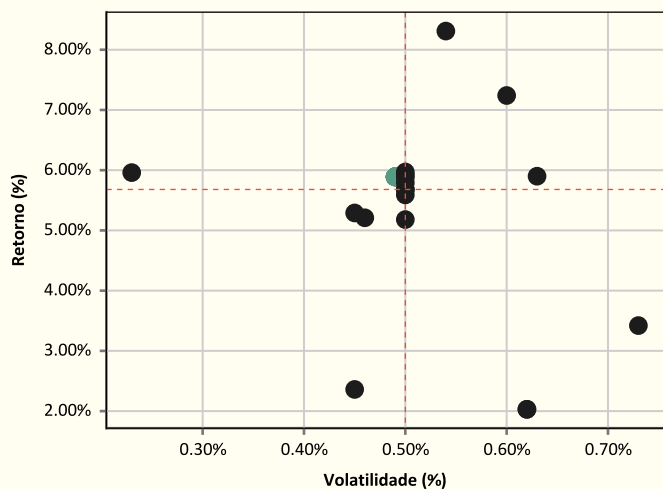
DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.95%	2.83%	5.65%	11.40%	3.78%
IBOVESPA	9.93%	19.87%	2.93%	8.92%	12.44%
IBRX	9.12%	18.69%	2.80%	8.04%	11.71%
IBRX50	9.66%	19.37%	3.14%	9.06%	12.86%
IMA-B	2.44%	2.70%	6.11%	15.56%	5.91%
IRF-M	1.09%	1.35%	4.29%	10.56%	3.16%

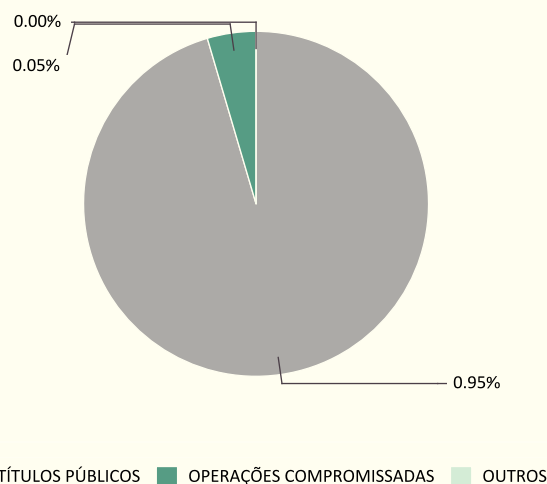
QUADRO DE INDICADORES

		No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Rent. (%)	Fundo	2.42%	2.62%	5.89%	15.27%	5.75%
	IMA-B	2.44%	2.70%	6.11%	15.56%	5.91%
	Performance	-0.01%	-0.08%	-0.21%	-0.24%	-0.14%
	Sucesso	50.00%	48.33%	48.78%	49.41%	49.38%
Vol.	Fundo	0.43%	0.47%	0.49%	0.56%	0.45%
	IMA-B	0.42%	0.47%	0.50%	0.57%	0.45%
Perf.	Sharpe	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00
	Semi-Sharpe	-0.00	-0.00	-0.01	-0.00	-0.01
	Beta	1.02	1.00	0.99	0.99	0.99

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/04/2015



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade da Risk Office, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação. 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. Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.