

# Relatório de Performance RPPS



## BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT

29/05/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 8IV	<b>Valor da Cota:</b> 1.24	<b>PL (R\$):</b> 18,874,230.09
<b>CNPJ:</b> 20168735000136	<b>Qtde. de Cotas:</b> 851,318.77	<b>% do PL (RPPS):</b> 5.61
<b>Cód. Anbima:</b> 367214	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 64,535,671.34	<b>Tx. de Adm.:</b> 1.10
<b>Gestão:</b> BANESTES DTVM SA	<b>Saldo RPPS (%):</b> 1.64	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BANESTES DTVM SA	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 1,059,569.76	<b>Resgate:</b> D+3
<b>CNPJ Gestor:</b> 28156057000101	<b>Índice de Ref.:</b> CDI	<b>Conversão de Cotas:</b> D+1
<b>CNPJ Adm.:</b> 28156057000101		

### FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
INFINITY UNIQUE FI MULTIMERCADO	1.09% (29)	6.30% (3)	13.75% (1)	7.92% (47)	20.82% (2)	DESENQUADRADO
<b>BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT</b>	<b>1.23% (10)</b>	<b>4.31% (18)</b>	<b>9.82% (2)</b>	<b>24.37% (2)</b>	<b>9.13% (5)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
ECO HEDGE FI MULT CRED PRIV LONGO PRAZO	1.14% (23)	4.87% (5)	9.42% (3)	15.76% (5)	8.05% (6)	ENQUADRADO
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.11% (27)	4.85% (6)	9.22% (4)	17.44% (4)	14.34% (3)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA V MULT CR D PRIV	1.15% (21)	4.77% (7)	8.88% (5)	14.68% (9)	7.77% (7)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA VI MULTI CR D PRIV	1.14% (22)	4.76% (8)	8.87% (6)	14.64% (12)	7.75% (8)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA IV MULTI CRED PRIV	1.15% (19)	4.62% (10)	8.75% (7)	14.65% (10)	7.68% (9)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA III MULTI CRED PRIV	1.15% (20)	4.61% (11)	8.75% (8)	14.65% (11)	7.68% (10)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA VIII MULT CRED PRIV	1.21% (13)	4.71% (9)	8.65% (9)	14.73% (7)	7.66% (11)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV	1.13% (24)	4.51% (13)	8.65% (10)	14.69% (8)	7.54% (12)	ENQUADRADO

### DADOS DE MERCADO

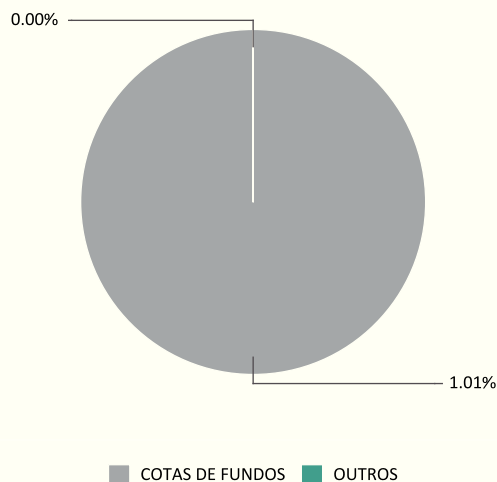
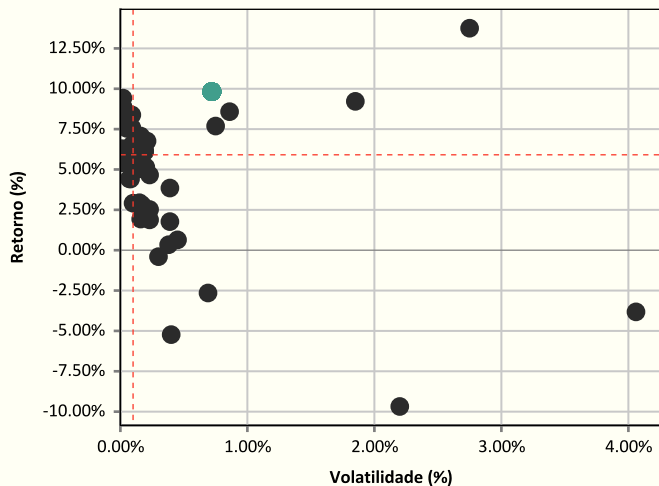
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.98%	3.00%	5.81%	11.54%	4.81%
IBOVESPA	-6.17%	2.28%	-3.59%	2.97%	5.51%
IBRX	-5.47%	2.62%	-3.13%	3.28%	5.60%
IBRX50	-6.05%	2.13%	-3.19%	3.99%	6.04%
IMA-B	2.57%	4.78%	6.56%	13.68%	8.63%
IRF-M	1.63%	2.71%	4.78%	10.33%	4.84%

### QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	1.23%	4.31%	9.82%	24.37%	9.13%
	CDI	0.98%	3.00%	5.81%	11.54%	4.81%
	Performance	124.75%	143.78%	169.17%	211.20%	190.03%
	Sucesso	45.00%	53.23%	49.59%	49.21%	50.50%
Vol.	Fundo	0.27%	0.52%	0.72%	0.59%	0.73%
	CDI	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
Perf.	Sharpe	0.04	0.04	0.04	0.07	0.05
	Semi-Sharpe	0.07	0.06	0.06	0.10	0.08
	Beta	2,837.07	-14.39	10.46	-0.44	-0.24

### DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)

### COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM -29/05/2015



# Relatório de Performance RPPS



## BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA

29/05/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7III IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 4.46	<b>PL (R\$):</b> 109,266,490.67
<b>CNPJ:</b> 05357507000110	<b>Qtde. de Cotas:</b> 506,449.04	<b>% do PL (RPPS):</b> 2.07
<b>Cód. Anbima:</b> 247960	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 64,535,671.34	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO	<b>Saldo RPPS (%):</b> 3.50	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 2,260,823.68	<b>Resgate:</b> D0
<b>CNPJ Gestor:</b> 28127603000178	<b>Índice de Ref.:</b> IMA-B	<b>Conversão de Cotas:</b> D0
<b>CNPJ Adm.:</b> 28127603000178		

### FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
FI EM RF BRB SOLIDEZ	2.40% (14)	4.54% (11)	7.40% (1)	9.74% (21)	7.95% (14)	ENQUADRADO
<b>BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA</b>	<b>2.33% (16)</b>	<b>6.96% (1)</b>	<b>7.18% (2)</b>	<b>15.04% (3)</b>	<b>9.14% (2)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP	2.43% (12)	5.00% (4)	6.93% (3)	14.12% (5)	8.80% (3)	ENQUADRADO
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	2.43% (13)	4.97% (5)	6.88% (4)	14.01% (6)	8.76% (4)	ENQUADRADO
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	2.36% (15)	4.04% (13)	6.86% (5)	12.43% (16)	8.51% (10)	ENQUADRADO
BANRISUL PREV MUNICIPAL III FI RF LP	2.69% (3)	5.01% (3)	6.80% (6)	13.86% (8)	8.76% (5)	ENQUADRADO
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	1.25% (19)	2.95% (20)	6.75% (7)	13.64% (9)	5.83% (20)	ENQUADRADO
BRADESCO FI RF IMA B	2.63% (5)	4.85% (7)	6.64% (8)	13.94% (7)	8.72% (6)	ENQUADRADO
UNIBANCO INDICE DE PRECOS FI RF	2.62% (6)	4.81% (8)	6.60% (9)	13.39% (11)	8.66% (7)	ENQUADRADO
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IMA B LP	2.65% (4)	4.90% (6)	6.49% (10)	13.31% (12)	8.40% (12)	ENQUADRADO

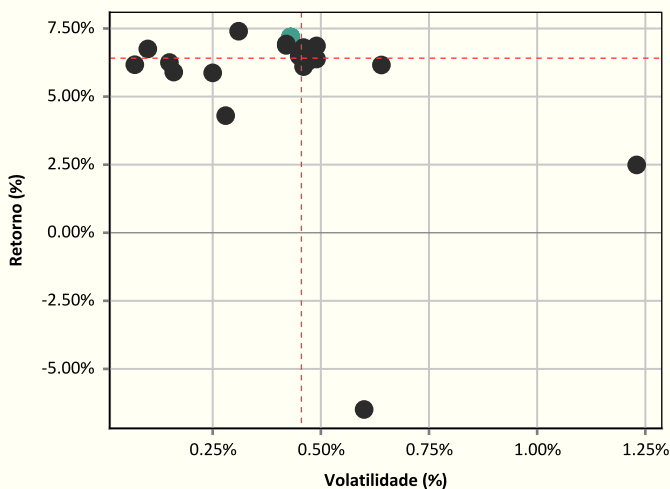
### DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.98%	3.00%	5.81%	11.54%	4.81%
IBOVESPA	-6.17%	2.28%	-3.59%	2.97%	5.51%
IBRX	-5.47%	2.62%	-3.13%	3.28%	5.60%
IBRX50	-6.05%	2.13%	-3.19%	3.99%	6.04%
IMA-B	2.57%	4.78%	6.56%	13.68%	8.63%
IRF-M	1.63%	2.71%	4.78%	10.33%	4.84%

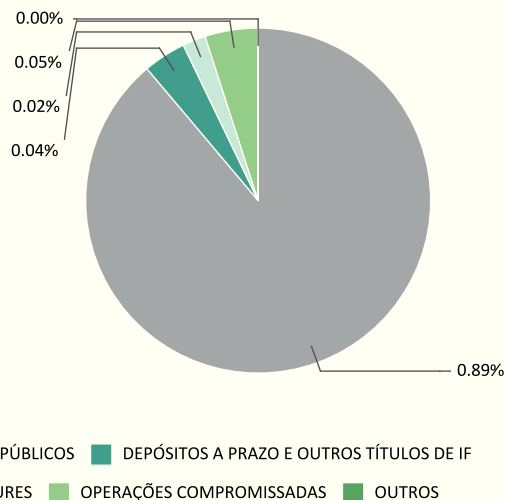
### QUADRO DE INDICADORES

		No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Rent. (%)	Fundo	2.33%	6.96%	7.18%	15.04%	9.14%
	IMA-B	2.57%	4.78%	6.56%	13.68%	8.63%
	Performance	-0.24%	2.09%	0.59%	1.20%	0.47%
	Sucesso	45.00%	53.23%	51.22%	51.19%	50.50%
Vol.	Fundo	0.50%	0.49%	0.43%	0.45%	0.44%
	IMA-B	0.47%	0.46%	0.46%	0.58%	0.45%
Perf.	Sharpe	-0.02	0.07	0.01	0.01	0.01
	Semi-Sharpe	-0.04	0.10	0.02	0.01	0.02
	Beta	-0.03	-0.09	0.05	-0.02	-0.05

### DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



### COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 29/05/2015



# Relatório de Performance RPPS



## BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI

29/05/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 3.18	<b>PL (R\$):</b> 5,560,845,470.22
<b>CNPJ:</b> 07442078000105	<b>Qtde. de Cotas:</b> 10,493,545.49	<b>% do PL (RPPS):</b> 0.60
<b>Cód. Anbima:</b> 242901	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 64,535,671.34	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (%):</b> 51.74	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 33,393,296.15	<b>Resgate:</b> 1
<b>CNPJ Gestor:</b> 30822936000169	<b>Índice de Ref.:</b> IMA-B	<b>Conversão de Cotas:</b> 1
<b>CNPJ Adm.:</b> 30822936000169		

### FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	2.60% (8)	8.01% (1)	7.69% (1)	15.30% (1)	10.08% (1)	ENQUADRADO
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	2.63% (5)	4.41% (11)	6.60% (2)	12.62% (9)	9.37% (2)	ENQUADRADO
SAFRA IMA FIC FI RF	1.86% (17)	3.82% (13)	6.56% (3)	12.32% (12)	7.10% (15)	ENQUADRADO
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	2.63% (3)	4.84% (5)	6.55% (4)	13.31% (4)	8.59% (6)	ENQUADRADO
<b>BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI</b>	<b>2.61% (7)</b>	<b>4.80% (6)</b>	<b>6.46% (5)</b>	<b>13.42% (2)</b>	<b>8.58% (7)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	2.65% (2)	4.84% (4)	6.36% (6)	12.97% (7)	8.70% (3)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	2.53% (9)	4.68% (9)	6.33% (7)	13.31% (3)	8.43% (9)	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	2.52% (10)	4.65% (10)	6.31% (8)	13.17% (5)	8.42% (10)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	2.63% (4)	4.78% (7)	6.25% (9)	12.73% (8)	8.61% (5)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL FI RF IMA B	2.51% (11)	4.39% (12)	6.16% (10)	13.07% (6)	8.31% (11)	ENQUADRADO

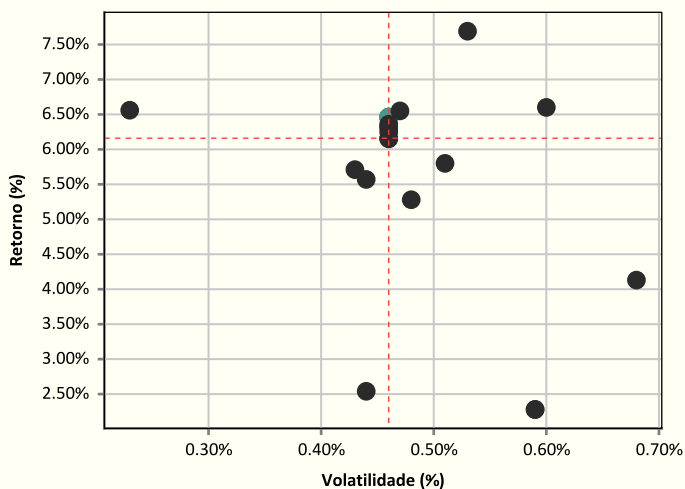
### DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.98%	3.00%	5.81%	11.54%	4.81%
IBOVESPA	-6.17%	2.28%	-3.59%	2.97%	5.51%
IBRX	-5.47%	2.62%	-3.13%	3.28%	5.60%
IBRX50	-6.05%	2.13%	-3.19%	3.99%	6.04%
IMA-B	2.57%	4.78%	6.56%	13.68%	8.63%
IRF-M	1.63%	2.71%	4.78%	10.33%	4.84%

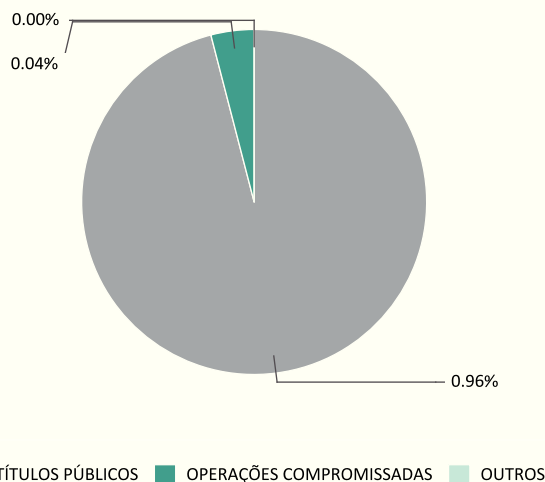
### QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	2.61%	4.80%	6.46%	13.42%	8.58%
	IMA-B	2.57%	4.78%	6.56%	13.68%	8.63%
	Performance	0.04%	0.02%	-0.09%	-0.23%	-0.05%
	Sucesso	45.00%	43.55%	37.40%	37.70%	39.60%
Vol.	Fundo	0.47%	0.47%	0.46%	0.57%	0.46%
	IMA-B	0.47%	0.46%	0.46%	0.58%	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	1.00	1.01	1.00	1.00	1.00

### DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



### COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 29/05/2015



# Relatório de Performance RPPS



BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI

29/05/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IDKA IPCA 3A	<b>Valor da Cota:</b> 1.21	<b>PL (R\$):</b> 945,339,483.24
<b>CNPJ:</b> 19303794000190	<b>Qtde. de Cotas:</b> 2,822,582.67	<b>% do PL (RPPS):</b> 0.36
<b>Cód. Anbima:</b> 359831	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 64,535,671.34	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.15
<b>Gestão:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (%):</b> 5.27	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 3,401,732.41	<b>Resgate:</b> 0
<b>CNPJ Gestor:</b> 30822936000169	<b>Índice de Ref.:</b> IDKA IPCA 3A	<b>Conversão de Cotas:</b> 0
<b>CNPJ Adm.:</b> 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	1.85% (1)	3.00% (1)	6.10% (1)	11.76% (1)	6.70% (1)	ENQUADRADO

## DADOS DE MERCADO

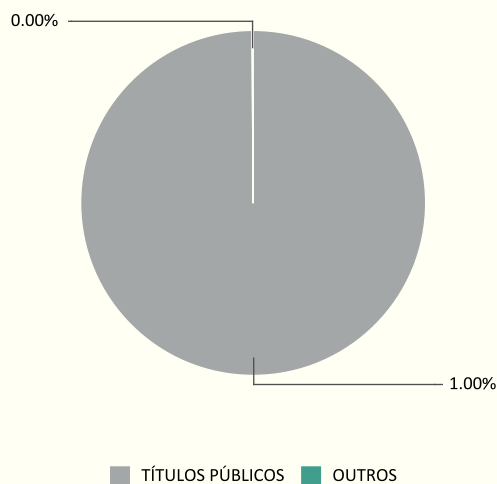
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.98%	3.00%	5.81%	11.54%	4.81%
IBOVESPA	-6.17%	2.28%	-3.59%	2.97%	5.51%
IBRX	-5.47%	2.62%	-3.13%	3.28%	5.60%
IBRX50	-6.05%	2.13%	-3.19%	3.99%	6.04%
IMA-B	2.57%	4.78%	6.56%	13.68%	8.63%
IRF-M	1.63%	2.71%	4.78%	10.33%	4.84%

## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	1.85%	3.00%	6.10%	11.76%	6.70%
	IDKA IPCA 3A	2.16%	3.53%	6.50%	12.33%	7.07%
	Performance	-0.30%	-0.52%	-0.38%	-0.50%	-0.34%
	Sucesso	50.00%	51.61%	49.59%	46.43%	51.49%
Vol.	Fundo	0.22%	0.23%	0.23%	0.27%	0.23%
	IDKA IPCA 3A	0.24%	0.24%	0.25%	0.25%	0.26%
Perf.	Sharpe	-0.07	-0.04	-0.01	-0.01	-0.01
	Semi-Sharpe	-0.10	-0.05	-0.02	-0.01	-0.02
	Beta	0.88	0.88	0.84	0.98	0.82

## DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)

## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM -29/05/2015



# Relatório de Performance RPPS



## BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI

29/05/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IV CDI	<b>Valor da Cota:</b> 1.47	<b>PL (R\$):</b> 5,253,431,415.19
<b>CNPJ:</b> 13077418000149	<b>Qtde. de Cotas:</b> 3,811,346.21	<b>% do PL (RPPS):</b> 0.11
<b>Cód. Anbima:</b> 272493	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 64,535,671.34	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.30
<b>Gestão:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (%):</b> 8.71	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 5,620,275.91	<b>Resgate:</b> 0
<b>CNPJ Gestor:</b> 30822936000169	<b>Índice de Ref.:</b> CDI	<b>Conversão de Cotas:</b> 0
<b>CNPJ Adm.:</b> 30822936000169		

### FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
CAIXA FIC PATRIMONIO IND PRECOS RF LP	1.31% (2)	3.15% (4)	6.52% (1)	12.02% (4)	6.09% (2)	ENQUADRADO
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	1.05% (6)	3.30% (3)	6.39% (2)	12.41% (1)	5.34% (5)	ENQUADRADO
WA RENDA FIXA ATIVO FI	1.38% (1)	3.56% (1)	6.37% (3)	11.54% (19)	5.68% (3)	ENQUADRADO
SAFRA CART CORP RF FC FI	1.11% (5)	3.11% (5)	6.22% (4)	12.12% (2)	5.41% (4)	ENQUADRADO
<b>BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI</b>	<b>1.03% (8)</b>	<b>3.08% (6)</b>	<b>5.98% (5)</b>	<b>11.78% (5)</b>	<b>4.91% (6)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
HSBC FI REFERENCIADO DI LP	1.00% (22)	3.04% (10)	5.91% (6)	11.72% (8)	4.90% (8)	ENQUADRADO
INFINITY LOTUS FIRF	1.02% (10)	3.35% (2)	5.91% (7)	12.11% (3)	7.64% (1)	ENQUADRADO
ITAU REFERENCIADO DI FI	0.99% (24)	3.03% (13)	5.91% (8)	11.77% (6)	4.88% (10)	ENQUADRADO
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	1.00% (21)	3.04% (9)	5.90% (9)	11.77% (7)	4.88% (11)	ENQUADRADO
SANTANDER FICFI INSTITUCIONAL REF DI	1.00% (20)	3.06% (7)	5.90% (10)	11.70% (9)	4.89% (9)	ENQUADRADO

### DADOS DE MERCADO

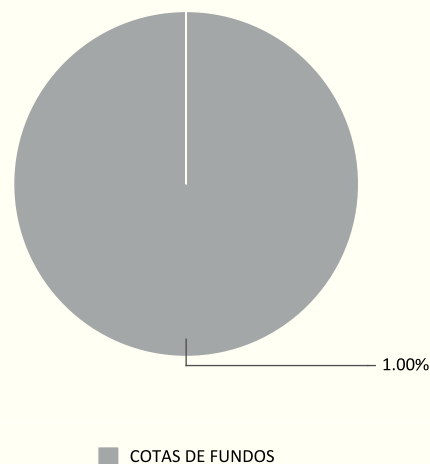
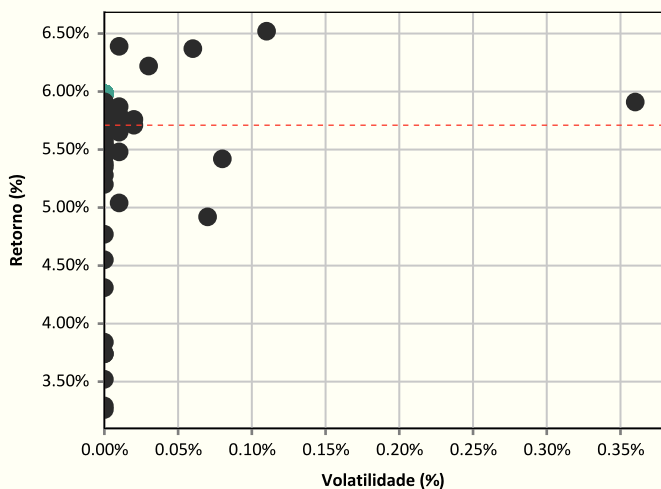
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.98%	3.00%	5.81%	11.54%	4.81%
IBOVESPA	-6.17%	2.28%	-3.59%	2.97%	5.51%
IBRX	-5.47%	2.62%	-3.13%	3.28%	5.60%
IBRX50	-6.05%	2.13%	-3.19%	3.99%	6.04%
IMA-B	2.57%	4.78%	6.56%	13.68%	8.63%
IRF-M	1.63%	2.71%	4.78%	10.33%	4.84%

### QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	1.03%	3.08%	5.98%	11.78%	4.91%
	CDI	0.98%	3.00%	5.81%	11.54%	4.81%
	Performance	104.93%	102.71%	102.92%	102.08%	102.26%
	Sucesso	85.00%	72.58%	67.48%	64.29%	68.32%
Vol.	Fundo	0.00%	0.00%	0.00%	0.01%	0.00%
	CDI	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
Perf.	Sharpe	0.95	0.34	0.30	0.17	0.26
	Semi-Sharpe	1.39	0.45	0.44	0.25	0.36
	Beta	2.99	1.67	1.03	1.13	1.26

### DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)

### COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 31/03/2015



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

29/05/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 1.16	<b>PL (R\$):</b> 310,267,172.74
<b>CNPJ:</b> 18598288000103	<b>Qtde. de Cotas:</b> 816,910.12	<b>% do PL (RPPS):</b> 0.31
<b>Cód. Anbima:</b> 359947	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 64,535,671.34	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (%):</b> 1.47	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 948,403.24	<b>Resgate:</b> 0
<b>CNPJ Gestor:</b> 360305000104	<b>Índice de Ref.:</b> IMA-B	<b>Conversão de Cotas:</b> 0
<b>CNPJ Adm.:</b> 360305000104		

## FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	2.60% (8)	8.01% (1)	7.69% (1)	15.30% (1)	10.08% (1)	ENQUADRADO
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	2.63% (5)	4.41% (11)	6.60% (2)	12.62% (9)	9.37% (2)	ENQUADRADO
SAFRA IMA FIC FI RF	1.86% (17)	3.82% (13)	6.56% (3)	12.32% (12)	7.10% (15)	ENQUADRADO
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	2.63% (3)	4.84% (5)	6.55% (4)	13.31% (4)	8.59% (6)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	2.61% (7)	4.80% (6)	6.46% (5)	13.42% (2)	8.58% (7)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	2.65% (2)	4.84% (4)	6.36% (6)	12.97% (7)	8.70% (3)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	2.53% (9)	4.68% (9)	6.33% (7)	13.31% (3)	8.43% (9)	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	2.52% (10)	4.65% (10)	6.31% (8)	13.17% (5)	8.42% (10)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	2.63% (4)	4.78% (7)	6.25% (9)	12.73% (8)	8.61% (5)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL FI RF IMA B	2.51% (11)	4.39% (12)	6.16% (10)	13.07% (6)	8.31% (11)	ENQUADRADO
<b>CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF</b>	<b>1.96% (15)</b>	<b>3.31% (15)</b>	<b>2.28% (19)</b>	<b>6.14% (17)</b>	<b>4.09% (18)</b>	<b>ENQUADRADO</b>

## DADOS DE MERCADO

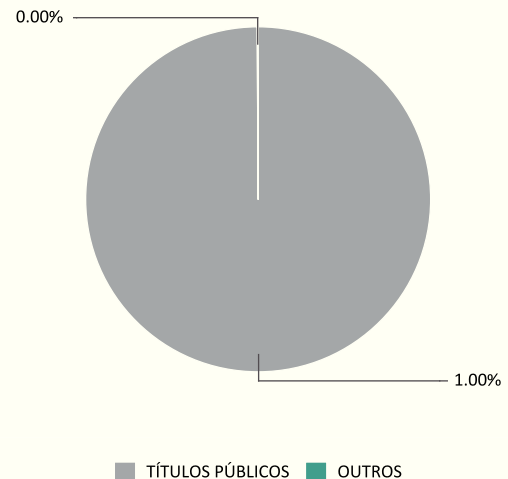
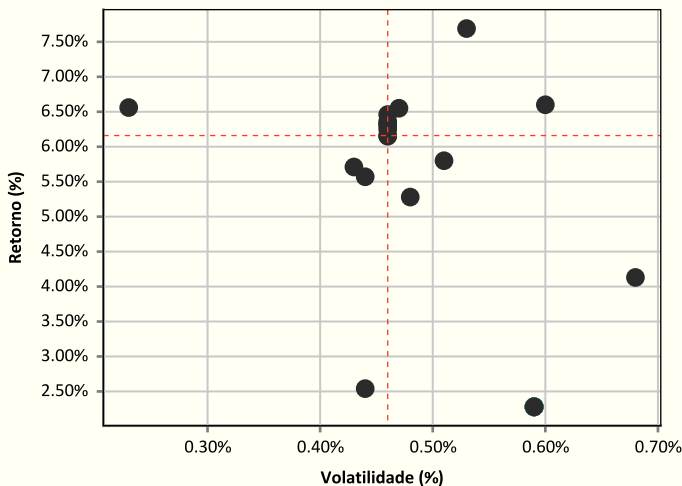
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.98%	3.00%	5.81%	11.54%	4.81%
IBOVESPA	-6.17%	2.28%	-3.59%	2.97%	5.51%
IBRX	-5.47%	2.62%	-3.13%	3.28%	5.60%
IBRX50	-6.05%	2.13%	-3.19%	3.99%	6.04%
IMA-B	2.57%	4.78%	6.56%	13.68%	8.63%
IRF-M	1.63%	2.71%	4.78%	10.33%	4.84%

## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	1.96%	3.31%	2.28%	6.14%	4.09%
	IMA-B	2.57%	4.78%	6.56%	13.68%	8.63%
	Performance	-0.59%	-1.40%	-4.01%	-6.64%	-4.18%
	Sucesso	45.00%	51.61%	52.85%	48.81%	52.48%
Vol.	Fundo	0.50%	0.54%	0.59%	0.64%	0.61%
	IMA-B	0.47%	0.46%	0.46%	0.58%	0.45%
Perf.	Sharpe	-0.06	-0.04	-0.06	-0.04	-0.07
	Semi-Sharpe	-0.09	-0.06	-0.07	-0.06	-0.09
	Beta	1.03	1.13	1.12	0.99	1.14

## DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)

## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 29/05/2015



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

29/05/2015

**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:** 1.22  
**Qtde. de Cotas:** 1,000,000.00  
**Patrim. RPPS (R\$):** 64,535,671.34  
**Saldo RPPS (%):** 1.89  
**Saldo RPPS (R\$):** 1,220,563.00  
**Índice de Ref.:** IBOVESPA

**PL (R\$):** 40,826,790.81  
**% do PL (RPPS):** 2.99  
**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
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	-3.73% (3)	2.92% (2)	-1.60% (1)	3.38% (1)	4.60% (2)	ENQUADRADO
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	-6.19% (14)	1.74% (10)	-2.98% (2)	2.71% (3)	4.60% (3)	ENQUADRADO
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	-4.52% (4)	2.88% (3)	-3.31% (3)	1.95% (6)	3.65% (10)	ENQUADRADO
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	-6.17% (13)	2.31% (7)	-3.51% (4)	2.86% (2)	5.57% (1)	ENQUADRADO
<b>CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA</b>	<b>-5.99% (11)</b>	<b>2.39% (5)</b>	<b>-3.97% (5)</b>	<b>2.50% (4)</b>	<b>4.16% (6)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-4.77% (7)	2.01% (8)	-3.99% (6)	1.53% (8)	2.76% (15)	ENQUADRADO
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	-6.00% (12)	2.35% (6)	-4.13% (7)	2.33% (5)	3.99% (8)	ENQUADRADO
BRADESCO FIC DE FIA IBOVESPA ATIVO	-4.74% (6)	2.81% (4)	-4.23% (8)	0.57% (10)	3.50% (12)	ENQUADRADO
ITAU FOF RPI 30 MASTER ACOES FI	-4.74% (5)	1.73% (11)	-4.34% (9)	1.67% (7)	3.16% (13)	ENQUADRADO
BRADESCO PRIVATE FIA IBOVESPA ALAVANCADO	-5.38% (10)	1.84% (9)	-4.42% (10)	-1.57% (15)	3.98% (9)	ENQUADRADO

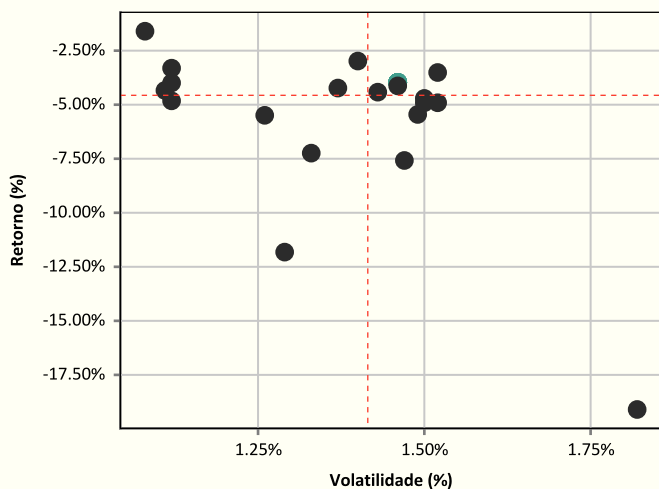
### DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.98%	3.00%	5.81%	11.54%	4.81%
IBOVESPA	-6.17%	2.28%	-3.59%	2.97%	5.51%
IBRX	-5.47%	2.62%	-3.13%	3.28%	5.60%
IBRX50	-6.05%	2.13%	-3.19%	3.99%	6.04%
IMA-B	2.57%	4.78%	6.56%	13.68%	8.63%
IRF-M	1.63%	2.71%	4.78%	10.33%	4.84%

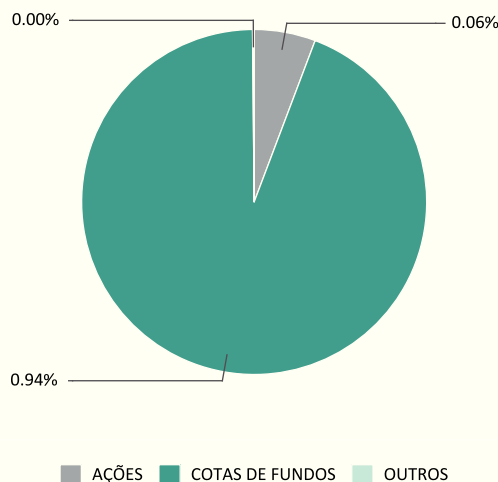
### QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	-5.99%	2.39%	-3.97%	2.50%	4.16%
	IBOVESPA	-6.17%	2.28%	-3.59%	2.97%	5.51%
	Performance	0.19%	0.11%	-0.39%	-0.45%	-1.28%
	Sucesso	60.00%	56.45%	54.47%	52.38%	52.48%
Vol.	Fundo	1.19%	1.22%	1.46%	1.56%	1.36%
	IBOVESPA	1.16%	1.30%	1.52%	1.62%	1.40%
Perf.	Sharpe	0.01	0.00	-0.00	-0.00	-0.01
	Semi-Sharpe	0.01	0.00	-0.00	-0.00	-0.01
	Beta	1.00	0.90	0.92	0.94	0.94

### DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



### COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/04/2015



# Relatório de Performance RPPS



## CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS

29/05/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 8III IDIV	<b>Valor da Cota:</b> 1.04	<b>PL (R\$):</b> 319,518,942.05
<b>CNPJ:</b> 15154441000115	<b>Qtde. de Cotas:</b> 3,497,256.96	<b>% do PL (RPPS):</b> 1.14
<b>Cód. Anbima:</b> 311383	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 64,535,671.34	<b>Tx. de Adm.:</b> 1.72
<b>Gestão:</b> VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA	<b>Saldo RPPS (%):</b> 5.65	<b>Tx. de Perf.:</b> 20% que exceder 100% do Outros
<b>Adm.:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 3,649,328.18	<b>Resgate:</b> 33
<b>CNPJ Gestor:</b> 10917835000164	<b>Índice de Ref.:</b> IDIV	<b>Conversão de Cotas:</b> 30
<b>CNPJ Adm.:</b> 360305000104		

### FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
FI FATOR ACOES DIVIDENDOS	-0.81% (2)	4.64% (2)	4.38% (1)	12.12% (1)	9.84% (1)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	-3.57% (8)	3.43% (3)	3.18% (2)	8.40% (2)	8.33% (2)	ENQUADRADO
FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	-3.55% (7)	3.42% (4)	3.12% (3)	8.20% (3)	8.29% (3)	ENQUADRADO
LMX DIVIDENDOS FI DE ACOES	-2.99% (6)	1.40% (10)	0.39% (4)	3.23% (9)	3.51% (7)	ENQUADRADO
<b>CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS</b>	<b>-0.11% (1)</b>	<b>0.72% (13)</b>	<b>-0.11% (5)</b>	<b>3.36% (8)</b>	<b>0.42% (13)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FIA	-3.97% (12)	1.14% (12)	-0.39% (6)	5.42% (4)	1.11% (10)	ENQUADRADO
BB TOP ACOES DIVIDENDOS FIA	-3.69% (10)	2.45% (7)	-1.26% (7)	3.85% (6)	4.45% (5)	ENQUADRADO
FIA PETREO DIVIDENDOS	-5.03% (16)	-0.51% (14)	-2.14% (8)	3.55% (7)	2.15% (8)	DESENQUADRADO
BB ACOES DIVIDENDOS FICFIA	-3.85% (11)	1.94% (8)	-2.24% (9)	1.76% (10)	3.60% (6)	ENQUADRADO
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM ACOES	-3.60% (9)	-0.90% (17)	-2.51% (10)	5.21% (5)	1.04% (11)	ENQUADRADO

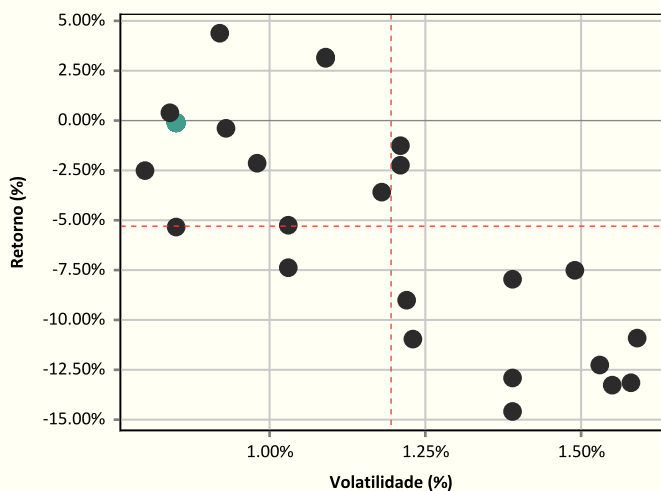
### DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.98%	3.00%	5.81%	11.54%	4.81%
IBOVESPA	-6.17%	2.28%	-3.59%	2.97%	5.51%
IBRX	-5.47%	2.62%	-3.13%	3.28%	5.60%
IBRX50	-6.05%	2.13%	-3.19%	3.99%	6.04%
IMA-B	2.57%	4.78%	6.56%	13.68%	8.63%
IRF-M	1.63%	2.71%	4.78%	10.33%	4.84%

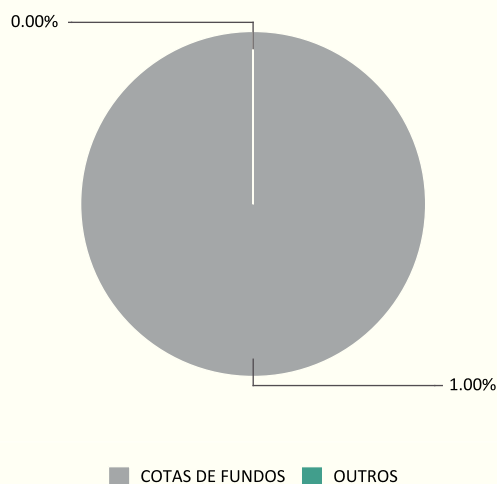
### QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	-0.11%	0.72%	-0.11%	3.36%	0.42%
	IDIV	-6.97%	-0.26%	-13.03%	-17.05%	-2.40%
	Performance	7.37%	0.97%	14.85%	24.61%	2.88%
	Sucesso	70.00%	56.45%	56.10%	56.35%	56.44%
Vol.	Fundo	0.14%	0.58%	0.85%	1.00%	0.82%
	IDIV	1.61%	1.61%	1.73%	1.75%	1.64%
Perf.	Sharpe	2.62	0.03	0.13	0.09	0.03
	Semi-Sharpe	3.73	0.04	0.19	0.12	0.05
	Beta	0.01	0.17	0.32	0.43	0.30

### DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



### COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 29/05/2015





# Relatório de Performance RPPS



FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF

29/05/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 1.01	<b>PL (R\$):</b> 240,312,372.56
<b>CNPJ:</b> 21918953000103	<b>Qtde. de Cotas:</b> 4,193,311.89	<b>% do PL (RPPS):</b> 1.77
<b>Cód. Anbima:</b> 394769	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 64,535,671.34	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (%):</b> 6.59	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 4,254,601.34	<b>Resgate:</b> 0
<b>CNPJ Gestor:</b> 360305000104	<b>Índice de Ref.:</b> IMA-B	<b>Conversão de Cotas:</b> 0
<b>CNPJ Adm.:</b> 360305000104		

## FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	2.60% (8)	8.01% (1)	7.69% (1)	15.30% (1)	10.08% (1)	ENQUADRADO
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	2.63% (5)	4.41% (11)	6.60% (2)	12.62% (9)	9.37% (2)	ENQUADRADO
SAFRA IMA FIC FI RF	1.86% (17)	3.82% (13)	6.56% (3)	12.32% (12)	7.10% (15)	ENQUADRADO
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	2.63% (3)	4.84% (5)	6.55% (4)	13.31% (4)	8.59% (6)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	2.61% (7)	4.80% (6)	6.46% (5)	13.42% (2)	8.58% (7)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	2.65% (2)	4.84% (4)	6.36% (6)	12.97% (7)	8.70% (3)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	2.53% (9)	4.68% (9)	6.33% (7)	13.31% (3)	8.43% (9)	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	2.52% (10)	4.65% (10)	6.31% (8)	13.17% (5)	8.42% (10)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	2.63% (4)	4.78% (7)	6.25% (9)	12.73% (8)	8.61% (5)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL FI RF IMA B	2.51% (11)	4.39% (12)	6.16% (10)	13.07% (6)	8.31% (11)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF	- -	- -	- -	- -	- -	ENQUADRADO

## DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.98%	3.00%	5.81%	11.54%	4.81%
IBOVESPA	-6.17%	2.28%	-3.59%	2.97%	5.51%
IBRX	-5.47%	2.62%	-3.13%	3.28%	5.60%
IBRX50	-6.05%	2.13%	-3.19%	3.99%	6.04%
IMA-B	2.57%	4.78%	6.56%	13.68%	8.63%
IRF-M	1.63%	2.71%	4.78%	10.33%	4.84%

## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo					
	IMA-B	2.57%	4.78%	6.56%	13.68%	8.63%
	Performance					
	Sucesso	40.00%	12.90%	6.50%	3.17%	7.92%
Vol.	Fundo					
	IMA-B	0.47%	0.46%	0.46%	0.58%	0.45%
Perf.	Sharpe					
	Semi-Sharpe					
	Beta					

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

29/05/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 1.82	<b>PL (R\$):</b> 4,363,556,105.58
<b>CNPJ:</b> 10740658000193	<b>Qtde. de Cotas:</b> 4,128,168.31	<b>% do PL (RPPS):</b> 0.17
<b>Cód. Anbima:</b> 244120	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 64,535,671.34	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (%):</b> 11.61	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 7,494,202.45	<b>Resgate:</b> 0
<b>CNPJ Gestor:</b> 360305000104	<b>Índice de Ref.:</b> IMA-B	<b>Conversão de Cotas:</b> 0
<b>CNPJ Adm.:</b> 360305000104		

## FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	2.60% (8)	8.01% (1)	7.69% (1)	15.30% (1)	10.08% (1)	ENQUADRADO
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	2.63% (5)	4.41% (11)	6.60% (2)	12.62% (9)	9.37% (2)	ENQUADRADO
SAFRA IMA FIC FI RF	1.86% (17)	3.82% (13)	6.56% (3)	12.32% (12)	7.10% (15)	ENQUADRADO
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	2.63% (3)	4.84% (5)	6.55% (4)	13.31% (4)	8.59% (6)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	2.61% (7)	4.80% (6)	6.46% (5)	13.42% (2)	8.58% (7)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	2.65% (2)	4.84% (4)	6.36% (6)	12.97% (7)	8.70% (3)	ENQUADRADO
<b>FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP</b>	<b>2.53% (9)</b>	<b>4.68% (9)</b>	<b>6.33% (7)</b>	<b>13.31% (3)</b>	<b>8.43% (9)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	2.52% (10)	4.65% (10)	6.31% (8)	13.17% (5)	8.42% (10)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	2.63% (4)	4.78% (7)	6.25% (9)	12.73% (8)	8.61% (5)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL FI RF IMA B	2.51% (11)	4.39% (12)	6.16% (10)	13.07% (6)	8.31% (11)	ENQUADRADO

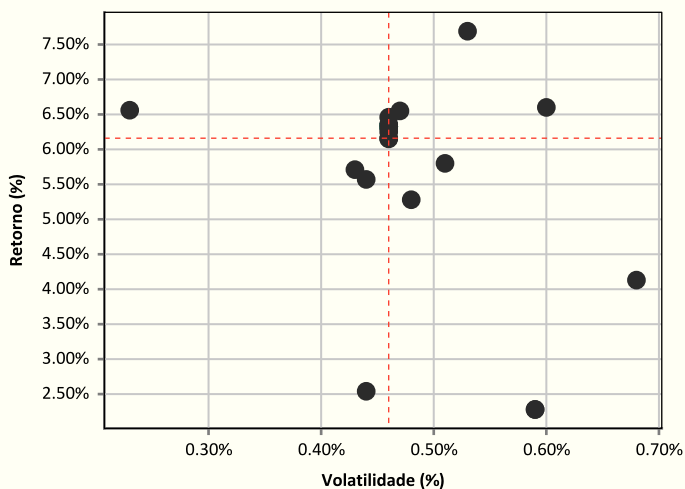
## DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.98%	3.00%	5.81%	11.54%	4.81%
IBOVESPA	-6.17%	2.28%	-3.59%	2.97%	5.51%
IBRX	-5.47%	2.62%	-3.13%	3.28%	5.60%
IBRX50	-6.05%	2.13%	-3.19%	3.99%	6.04%
IMA-B	2.57%	4.78%	6.56%	13.68%	8.63%
IRF-M	1.63%	2.71%	4.78%	10.33%	4.84%

## QUADRO DE INDICADORES

		No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Rent. (%)	Fundo	2.53%	4.68%	6.33%	13.31%	8.43%
	IMA-B	2.57%	4.78%	6.56%	13.68%	8.63%
	Performance	-0.04%	-0.09%	-0.21%	-0.32%	-0.19%
	Sucesso	55.00%	51.61%	50.41%	49.21%	50.50%
Vol.	Fundo	0.50%	0.48%	0.46%	0.57%	0.46%
	IMA-B	0.47%	0.46%	0.46%	0.58%	0.45%
Perf.	Sharpe	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00
	Semi-Sharpe	-0.01	-0.00	-0.01	-0.00	-0.01
	Beta	1.06	1.02	1.01	0.99	1.01

## DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 29/05/2015

