

# Relatório de Performance RPPS



## BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT

31/08/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 8IV	<b>Valor da Cota:</b> 1.27962652	<b>PL (R\$):</b> 19,405,066.29
<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> 65,977,524.51	<b>Tx. de Adm.:</b> 1.10
<b>Gestão:</b> BANESTES DTVM SA	<b>Saldo RPPS (%):</b> 1.65	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BANESTES DTVM SA	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 1,089,370.07	<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
BB MULTIMERCADO MOMENTUM PRIVATE FI	34.69% (1)	48.59% (1)	36.18% (1)	40.58% (1)	21.89% (3)	DESENQUADRADO
INFINITY EAGLE FI MULTIMERCADO	2.19% (3)	6.89% (3)	14.18% (2)	5.61% (52)	32.68% (1)	DESENQUADRADO
INFINITY UNIQUE FI MULTIMERCADO	2.76% (2)	7.18% (2)	13.93% (3)	15.28% (14)	29.49% (2)	DESENQUADRADO
PLURAL CAPITAL INST. FI MULTIMERCADO	0.55% (39)	4.70% (4)	9.82% (4)	15.54% (12)	10.93% (16)	ENQUADRADO
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.39% (6)	4.26% (6)	9.32% (5)	18.67% (2)	19.21% (4)	ENQUADRADO
PLURAL CAPITAL INST. FIC FI MULTIMERCADO	0.61% (35)	4.27% (5)	8.99% (6)	14.18% (18)	9.96% (18)	ENQUADRADO
ECO HEDGE FI MULT CRED PRIV LONGO PRAZO	0.99% (23)	3.82% (10)	8.87% (7)	17.24% (4)	12.18% (6)	ENQUADRADO
PLURAL CAPITAL INSTITUC FIC FI MULT II	0.59% (36)	4.22% (7)	8.87% (8)	13.91% (20)	9.80% (19)	ENQUADRADO
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	0.59% (37)	4.08% (8)	8.71% (9)	13.71% (21)	9.63% (20)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA V MULT CR D PRIV	1.11% (15)	3.75% (12)	8.70% (10)	16.11% (5)	11.81% (7)	ENQUADRADO
<b>BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT</b>	<b>0.93% (25)</b>	<b>2.81% (37)</b>	<b>7.24% (20)</b>	<b>18.44% (3)</b>	<b>12.20% (5)</b>	<b>ENQUADRADO</b>

### DADOS DE MERCADO

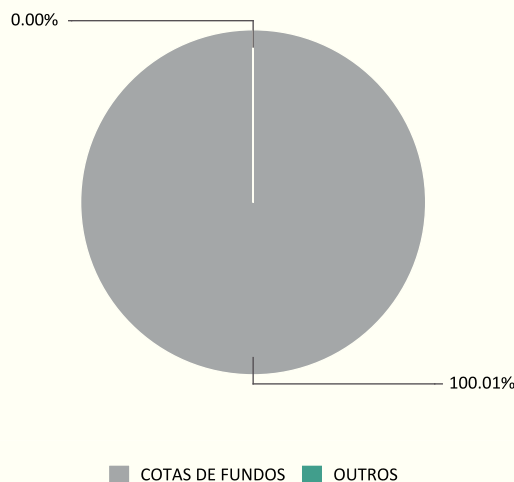
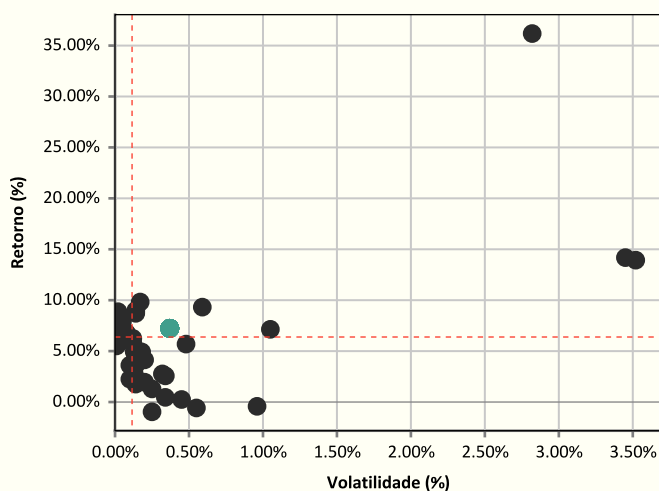
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.11%	3.39%	6.49%	12.35%	8.36%
IBOVESPA	-8.33%	-11.63%	-9.61%	-23.92%	-6.76%
IBRX	-8.25%	-10.73%	-8.39%	-22.28%	-5.73%
IBRX50	-7.98%	-10.87%	-8.98%	-22.65%	-5.49%
IMA-B	-3.11%	-4.07%	0.51%	2.81%	4.20%
IRF-M	-0.85%	0.70%	3.42%	7.15%	5.58%

### QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	0.93%	2.81%	7.24%	18.44%	12.20%
	CDI	1.11%	3.39%	6.49%	12.35%	8.36%
	Performance	84.38%	83.01%	111.66%	149.28%	146.01%
	Sucesso	0.00%	7.69%	29.92%	38.34%	33.73%
Vol.	Fundo	0.00%	0.06%	0.37%	0.56%	0.57%
	CDI	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
Perf.	Sharpe	-14.12	-0.15	0.02	0.04	0.04
	Semi-Sharpe	-31.64	-0.21	0.02	0.05	0.05
	Beta	0.50	-8.75	-8.07	-1.27	-6.96

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

### COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 31/08/2015



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

31/08/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7III IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 4.27743715	<b>PL (R\$):</b> 102,777,279.94
<b>CNPJ:</b> 05357507000110	<b>Qtde. de Cotas:</b> 576,918.77	<b>% do PL (RPPS):</b> 2.40
<b>Cód. Anbima:</b> 247960	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 65,977,524.51	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO	<b>Saldo RPPS (%):</b> 3.74	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 2,467,733.77	<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
LMX IMA B FI RENDA FIXA	-1.02% (3)	2.09% (1)	5.65% (1)	9.66% (3)	8.84% (1)	ENQUADRADO
FUNDO DE INV RENDA FIXA IPIRANGA	-0.27% (1)	1.17% (3)	4.56% (2)	9.45% (4)	7.53% (2)	ENQUADRADO
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	-0.52% (2)	1.40% (2)	4.39% (3)	11.58% (1)	7.32% (3)	ENQUADRADO
WESTERN ASSET RF INDICES RPPS FICFI	-1.51% (4)	-0.82% (4)	2.95% (4)	6.04% (5)	5.71% (4)	ENQUADRADO
<b>BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA</b>	<b>-2.37% (6)</b>	<b>-4.18% (14)</b>	<b>2.49% (5)</b>	<b>5.44% (6)</b>	<b>4.58% (5)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
FI DIFERENCIAL RENDA FIXA LONGO PRAZO	-2.12% (5)	-1.39% (5)	1.10% (6)	10.48% (2)	3.61% (18)	ENQUADRADO
FI EM RF BRB SOLIDEZ	-2.72% (7)	-3.57% (6)	0.81% (7)	2.92% (11)	4.09% (14)	ENQUADRADO
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IMA B LP	-3.04% (11)	-3.94% (7)	0.77% (8)	2.66% (14)	4.12% (11)	ENQUADRADO
BANRISUL PREV MUNICIPAL III FI RF LP	-3.11% (13)	-4.13% (10)	0.68% (9)	3.48% (7)	4.27% (7)	ENQUADRADO
CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP	-2.95% (9)	-4.17% (12)	0.62% (10)	3.37% (8)	4.27% (6)	ENQUADRADO

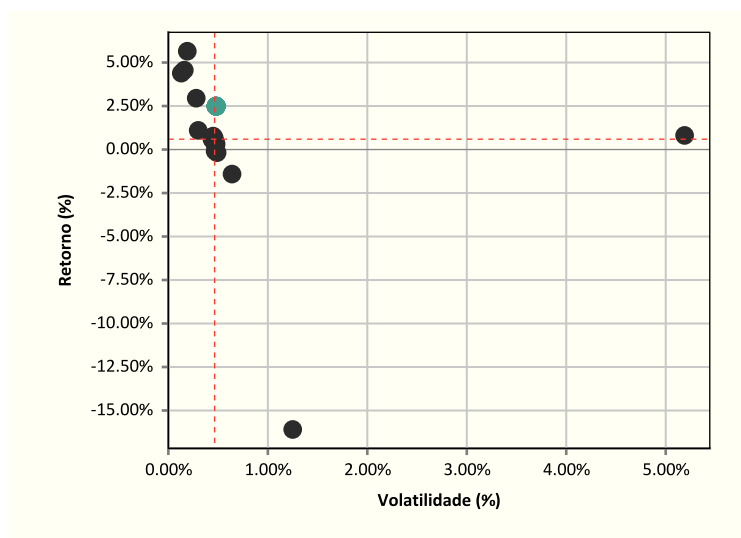
### DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.11%	3.39%	6.49%	12.35%	8.36%
IBOVESPA	-8.33%	-11.63%	-9.61%	-23.92%	-6.76%
IBRX	-8.25%	-10.73%	-8.39%	-22.28%	-5.73%
IBRX50	-7.98%	-10.87%	-8.98%	-22.65%	-5.49%
IMA-B	-3.11%	-4.07%	0.51%	2.81%	4.20%
IRF-M	-0.85%	0.70%	3.42%	7.15%	5.58%

### QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	-2.37%	-4.18%	2.49%	5.44%	4.58%
	IMA-B	-3.11%	-4.07%	0.51%	2.81%	4.20%
	Performance	0.77%	-0.11%	1.97%	2.55%	0.36%
	Sucesso	47.62%	47.69%	50.39%	50.20%	49.40%
Vol.	Fundo	0.50%	0.44%	0.48%	0.48%	0.45%
	IMA-B	0.52%	0.45%	0.46%	0.57%	0.46%
Perf.	Sharpe	0.07	-0.00	0.03	0.02	0.00
	Semi-Sharpe	0.09	-0.00	0.04	0.03	0.01
	Beta	0.21	0.19	0.08	0.02	0.07

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



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

31/08/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 3.04984486	<b>PL (R\$):</b> 4,950,905,293.76
<b>CNPJ:</b> 07442078000105	<b>Qtde. de Cotas:</b> 10,493,545.49	<b>% do PL (RPPS):</b> 0.65
<b>Cód. Anbima:</b> 242901	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 65,977,524.51	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (%):</b> 48.51	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 32,003,685.74	<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	-2.58% (7)	-4.70% (18)	2.94% (1)	4.25% (4)	4.91% (5)	ENQUADRADO
SAFRA IMA FIC FI RF	-1.98% (2)	-1.60% (3)	2.17% (2)	6.39% (1)	5.39% (2)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA I FI	-2.39% (4)	-2.01% (5)	1.29% (3)	4.97% (2)	5.09% (3)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TP IPCA VI FI	-2.43% (5)	-2.00% (4)	1.21% (4)	4.72% (3)	5.00% (4)	ENQUADRADO
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	-6.70% (21)	-3.22% (8)	1.04% (5)	2.43% (7)	5.84% (1)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	-2.54% (6)	-2.16% (6)	0.86% (6)	4.23% (5)	4.56% (6)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	-3.10% (10)	-4.08% (9)	0.56% (7)	2.33% (10)	4.27% (7)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	-3.12% (11)	-4.12% (11)	0.46% (8)	2.12% (12)	4.13% (8)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	-3.07% (8)	-4.16% (12)	0.44% (9)	2.61% (6)	4.06% (9)	ENQUADRADO
BRB RENDA FIXA IMA B	-3.44% (16)	-4.39% (16)	0.44% (10)	1.28% (16)	3.89% (13)	ENQUADRADO

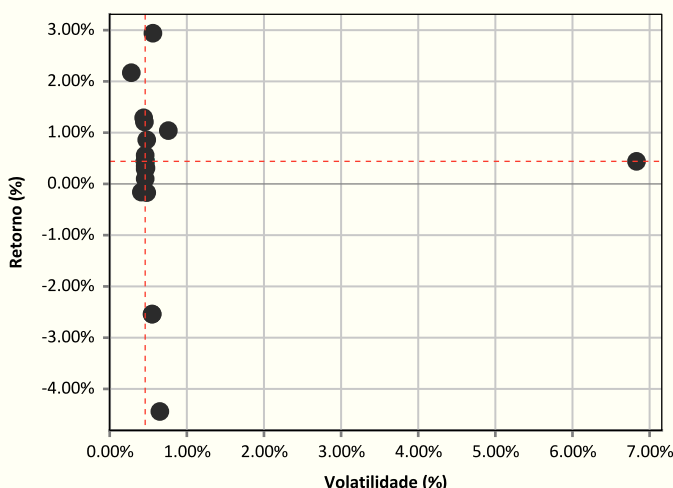
## DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.11%	3.39%	6.49%	12.35%	8.36%
IBOVESPA	-8.33%	-11.63%	-9.61%	-23.92%	-6.76%
IBRX	-8.25%	-10.73%	-8.39%	-22.28%	-5.73%
IBRX50	-7.98%	-10.87%	-8.98%	-22.65%	-5.49%
IMA-B	-3.11%	-4.07%	0.51%	2.81%	4.20%
IRF-M	-0.85%	0.70%	3.42%	7.15%	5.58%

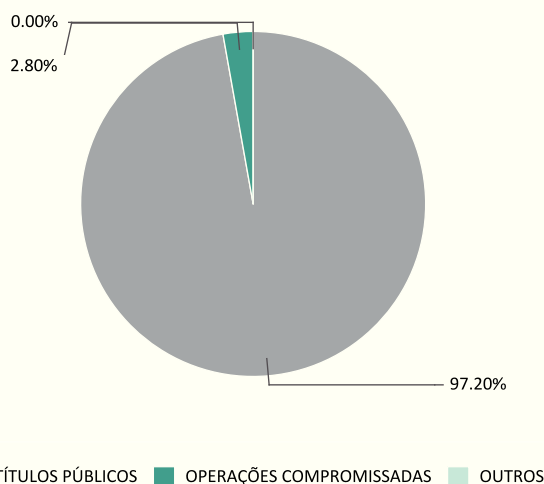
## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	-3.07%	-4.16%	0.44%	2.61%	4.06%
	IMA-B	-3.11%	-4.07%	0.51%	2.81%	4.20%
	Performance	0.04%	-0.09%	-0.07%	-0.20%	-0.14%
	Sucesso	47.62%	41.54%	42.52%	40.32%	40.36%
Vol.	Fundo	0.51%	0.45%	0.46%	0.56%	0.46%
	IMA-B	0.52%	0.45%	0.46%	0.57%	0.46%
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	0.99	0.99	1.00	1.00	1.00

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



## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 31/08/2015



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

31/08/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IDKA IPCA 3A	<b>Valor da Cota:</b> 1.22252215	<b>PL (R\$):</b> 932,078,247.02
<b>CNPJ:</b> 19303794000190	<b>Qtde. de Cotas:</b> 2,743,519.09	<b>% do PL (RPPS):</b> 0.36
<b>Cód. Anbima:</b> 359831	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 65,977,524.51	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.15
<b>Gestão:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (%):</b> 5.08	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 3,354,012.86	<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	-0.88% (1)	1.44% (1)	4.48% (1)	9.42% (1)	8.24% (1)	ENQUADRADO

## DADOS DE MERCADO

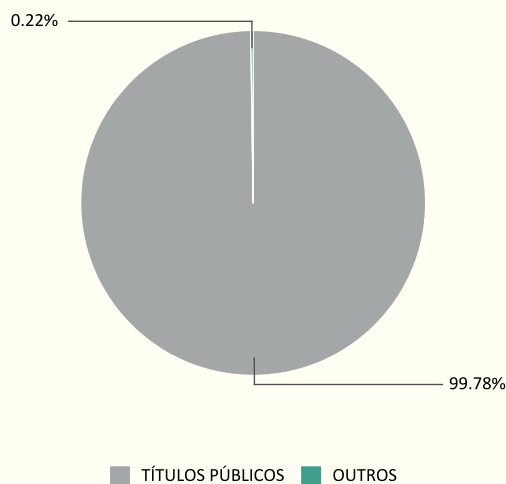
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.11%	3.39%	6.49%	12.35%	8.36%
IBOVESPA	-8.33%	-11.63%	-9.61%	-23.92%	-6.76%
IBRX	-8.25%	-10.73%	-8.39%	-22.28%	-5.73%
IBRX50	-7.98%	-10.87%	-8.98%	-22.65%	-5.49%
IMA-B	-3.11%	-4.07%	0.51%	2.81%	4.20%
IRF-M	-0.85%	0.70%	3.42%	7.15%	5.58%

## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	-0.88%	1.44%	4.48%	9.42%	8.24%
	IDKA IPCA 3A	-0.87%	1.46%	5.05%	9.92%	8.63%
	Performance	-0.01%	-0.02%	-0.54%	-0.46%	-0.36%
	Sucesso	61.90%	49.23%	50.39%	48.22%	50.60%
Vol.	Fundo	0.25%	0.23%	0.23%	0.26%	0.23%
	IDKA IPCA 3A	0.27%	0.26%	0.25%	0.26%	0.26%
Perf.	Sharpe	-0.00	-0.00	-0.02	-0.01	-0.01
	Semi-Sharpe	-0.00	-0.00	-0.02	-0.01	-0.01
	Beta	0.86	0.85	0.87	0.93	0.83

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

## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 31/08/2015



# Relatório de Performance RPPS



## BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI

31/08/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IV CDI	<b>Valor da Cota:</b> 1.525307	<b>PL (R\$):</b> 5,275,034,019.33
<b>CNPJ:</b> 13077418000149	<b>Qtde. de Cotas:</b> 5,653,443.34	<b>% do PL (RPPS):</b> 0.16
<b>Cód. Anbima:</b> 272493	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 65,977,524.51	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.30
<b>Gestão:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (%):</b> 13.07	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 8,623,236.70	<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
INFINITY LOTUS FIRF	1.14% (3)	3.54% (2)	7.00% (1)	12.82% (2)	11.45% (1)	ENQUADRADO
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	1.14% (2)	3.56% (1)	6.98% (2)	13.32% (1)	9.09% (2)	ENQUADRADO
<b>BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI</b>	<b>1.11% (16)</b>	<b>3.44% (11)</b>	<b>6.62% (3)</b>	<b>12.61% (3)</b>	<b>8.52% (3)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
SANTANDER FICFI INSTITUCIONAL REF DI	1.12% (11)	3.45% (7)	6.61% (4)	12.55% (7)	8.51% (5)	ENQUADRADO
CAIXA FI MEGA REF DI LP	1.14% (4)	3.46% (4)	6.60% (5)	12.56% (6)	8.50% (7)	ENQUADRADO
AVANTI FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	1.13% (7)	3.45% (6)	6.60% (6)	12.53% (11)	8.47% (10)	ENQUADRADO
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.13% (10)	3.46% (5)	6.59% (7)	12.54% (9)	8.50% (6)	ENQUADRADO
HSBC FI REFERENCIADO DI LP	1.12% (13)	3.45% (8)	6.59% (8)	12.58% (4)	8.51% (4)	ENQUADRADO
SANT FIC FI CORPORATE REF DI	1.12% (12)	3.44% (10)	6.58% (9)	12.54% (10)	8.47% (9)	ENQUADRADO
ITAU REFERENCIADO DI FI	1.13% (9)	3.43% (12)	6.57% (10)	12.57% (5)	8.48% (8)	ENQUADRADO

### DADOS DE MERCADO

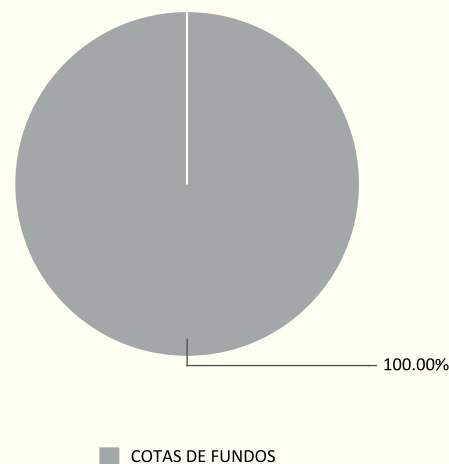
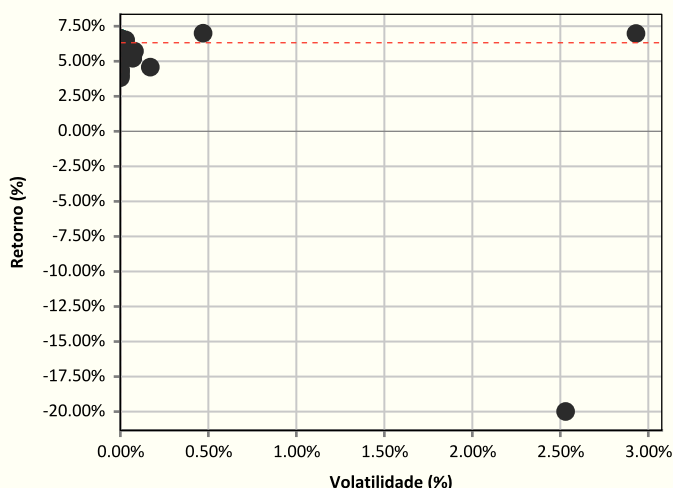
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.11%	3.39%	6.49%	12.35%	8.36%
IBOVESPA	-8.33%	-11.63%	-9.61%	-23.92%	-6.76%
IBRX	-8.25%	-10.73%	-8.39%	-22.28%	-5.73%
IBRX50	-7.98%	-10.87%	-8.98%	-22.65%	-5.49%
IMA-B	-3.11%	-4.07%	0.51%	2.81%	4.20%
IRF-M	-0.85%	0.70%	3.42%	7.15%	5.58%

### QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	1.11%	3.44%	6.62%	12.61%	8.52%
	CDI	1.11%	3.39%	6.49%	12.35%	8.36%
	Performance	100.58%	101.46%	102.08%	102.07%	101.96%
	Sucesso	57.14%	70.77%	71.65%	65.61%	69.28%
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	0.16	0.36	0.30	0.16	0.23
	Semi-Sharpe	0.22	0.50	0.37	0.22	0.29
	Beta	-0.32	0.81	0.94	1.03	1.01

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

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



# Relatório de Performance RPPS



## CAIXA FI ALIANCA TITULOS PUBLICOS RF

31/08/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IV CDI	<b>Valor da Cota:</b> 2.829274	<b>PL (R\$):</b> 361,106,798.94
<b>CNPJ:</b> 05164358000173	<b>Qtde. de Cotas:</b> 201,345.55	<b>% do PL (RPPS):</b> 0.16
<b>Cód. Anbima:</b> 157252	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 65,977,524.51	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (%):</b> 0.86	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 569,661.73	<b>Resgate:</b> 0
<b>CNPJ Gestor:</b> 360305000104	<b>Índice de Ref.:</b> CDI	<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
INFINITY LOTUS FIRF	1.14% (3)	3.54% (2)	7.00% (1)	12.82% (2)	11.45% (1)	ENQUADRADO
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	1.14% (2)	3.56% (1)	6.98% (2)	13.32% (1)	9.09% (2)	ENQUADRADO
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	1.11% (16)	3.44% (11)	6.62% (3)	12.61% (3)	8.52% (3)	ENQUADRADO
SANTANDER FICFI INSTITUCIONAL REF DI	1.12% (11)	3.45% (7)	6.61% (4)	12.55% (7)	8.51% (5)	ENQUADRADO
CAIXA FI MEGA REF DI LP	1.14% (4)	3.46% (4)	6.60% (5)	12.56% (6)	8.50% (7)	ENQUADRADO
AVANTI FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	1.13% (7)	3.45% (6)	6.60% (6)	12.53% (11)	8.47% (10)	ENQUADRADO
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.13% (10)	3.46% (5)	6.59% (7)	12.54% (9)	8.50% (6)	ENQUADRADO
HSBC FI REFERENCIADO DI LP	1.12% (13)	3.45% (8)	6.59% (8)	12.58% (4)	8.51% (4)	ENQUADRADO
SANT FIC FI CORPORATE REF DI	1.12% (12)	3.44% (10)	6.58% (9)	12.54% (10)	8.47% (9)	ENQUADRADO
ITAU REFERENCIADO DI FI	1.13% (9)	3.43% (12)	6.57% (10)	12.57% (5)	8.48% (8)	ENQUADRADO
CAIXA FI ALIANCA TITULOS PUBLICOS RF	1.02% (60)	3.26% (50)	6.24% (48)	12.09% (38)	8.16% (42)	ENQUADRADO

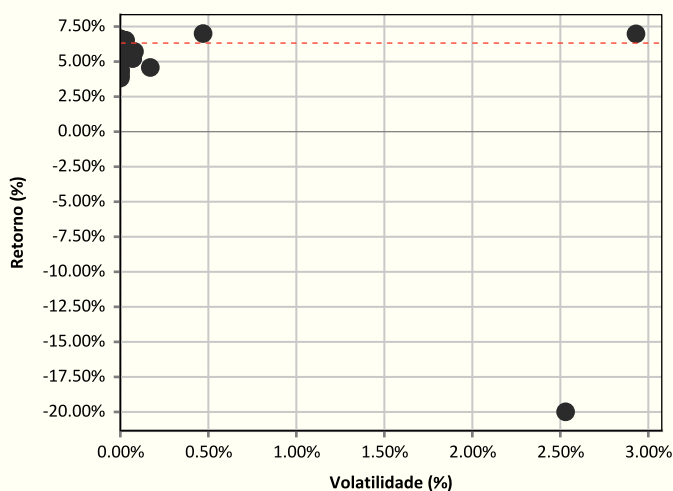
### DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.11%	3.39%	6.49%	12.35%	8.36%
IBOVESPA	-8.33%	-11.63%	-9.61%	-23.92%	-6.76%
IBRX	-8.25%	-10.73%	-8.39%	-22.28%	-5.73%
IBRX50	-7.98%	-10.87%	-8.98%	-22.65%	-5.49%
IMA-B	-3.11%	-4.07%	0.51%	2.81%	4.20%
IRF-M	-0.85%	0.70%	3.42%	7.15%	5.58%

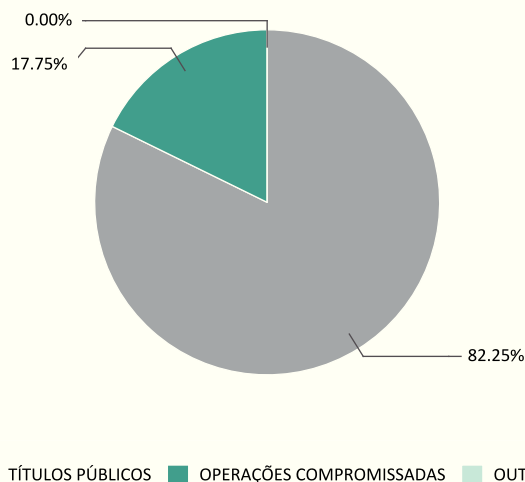
### QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
<b>Ret. (%)</b>					
Fundo	1.02%	3.26%	6.24%	12.09%	8.16%
CDI	1.11%	3.39%	6.49%	12.35%	8.36%
Performance	91.76%	96.25%	96.19%	97.87%	97.64%
Sucesso	42.86%	44.62%	43.31%	45.85%	46.39%
<b>Vol.</b>					
Fundo	0.01%	0.01%	0.01%	0.01%	0.01%
CDI	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
<b>Perf.</b>					
Sharpe	-0.29	-0.15	-0.16	-0.09	-0.11
Semi-Sharpe	-0.38	-0.20	-0.23	-0.13	-0.15
Beta	-0.02	1.37	1.20	0.83	0.66

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



### COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 31/08/2015



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

31/08/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 1.095234	<b>PL (R\$):</b> 292,700,827.68
<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> 65,977,524.51	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (%):</b> 1.36	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 894,707.74	<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	-2.58% (7)	-4.70% (18)	2.94% (1)	4.25% (4)	4.91% (5)	ENQUADRADO
SAFRA IMA FIC FI RF	-1.98% (2)	-1.60% (3)	2.17% (2)	6.39% (1)	5.39% (2)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA I FI	-2.39% (4)	-2.01% (5)	1.29% (3)	4.97% (2)	5.09% (3)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TP IPCA VI FI	-2.43% (5)	-2.00% (4)	1.21% (4)	4.72% (3)	5.00% (4)	ENQUADRADO
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	-6.70% (21)	-3.22% (8)	1.04% (5)	2.43% (7)	5.84% (1)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	-2.54% (6)	-2.16% (6)	0.86% (6)	4.23% (5)	4.56% (6)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	-3.10% (10)	-4.08% (9)	0.56% (7)	2.33% (10)	4.27% (7)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	-3.12% (11)	-4.12% (11)	0.46% (8)	2.12% (12)	4.13% (8)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	-3.07% (8)	-4.16% (12)	0.44% (9)	2.61% (6)	4.06% (9)	ENQUADRADO
BRB RENDA FIXA IMA B	-3.44% (16)	-4.39% (16)	0.44% (10)	1.28% (16)	3.89% (13)	ENQUADRADO
<b>CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF</b>	<b>-5.65% (20)</b>	<b>-5.66% (20)</b>	<b>-2.54% (18)</b>	<b>-2.69% (18)</b>	<b>-1.80% (18)</b>	<b>ENQUADRADO</b>

## DADOS DE MERCADO

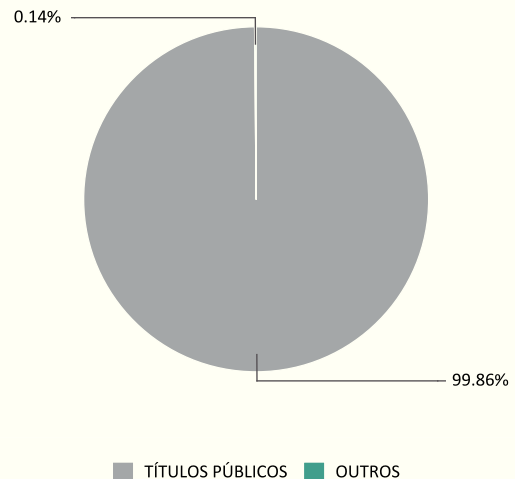
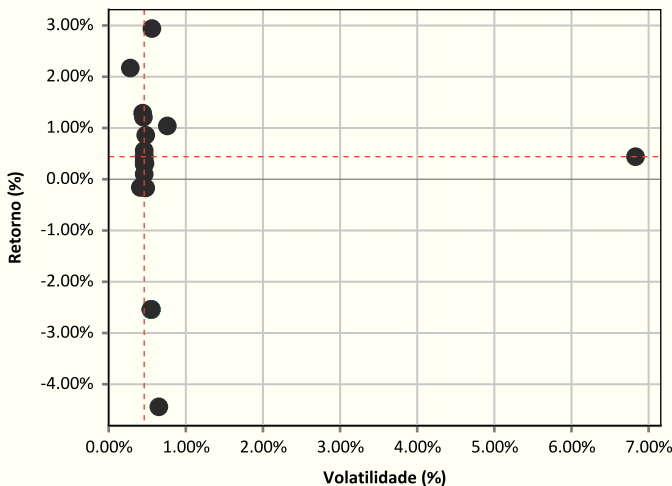
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.11%	3.39%	6.49%	12.35%	8.36%
IBOVESPA	-8.33%	-11.63%	-9.61%	-23.92%	-6.76%
IBRX	-8.25%	-10.73%	-8.39%	-22.28%	-5.73%
IBRX50	-7.98%	-10.87%	-8.98%	-22.65%	-5.49%
IMA-B	-3.11%	-4.07%	0.51%	2.81%	4.20%
IRF-M	-0.85%	0.70%	3.42%	7.15%	5.58%

## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	-5.65%	-5.66%	-2.54%	-2.69%	-1.80%
	IMA-B	-3.11%	-4.07%	0.51%	2.81%	4.20%
	Performance	-2.62%	-1.65%	-3.03%	-5.36%	-5.76%
	Sucesso	38.10%	53.85%	52.76%	51.38%	53.01%
Vol.	Fundo	0.69%	0.55%	0.55%	0.63%	0.59%
	IMA-B	0.52%	0.45%	0.46%	0.57%	0.46%
Perf.	Sharpe	-0.18	-0.05	-0.04	-0.03	-0.06
	Semi-Sharpe	-0.23	-0.06	-0.06	-0.05	-0.08
	Beta	0.73	0.94	1.04	0.99	1.06

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

## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 31/08/2015



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

31/08/2015

**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:** 1.090903  
**Qtde. de Cotas:** 1,000,000.00  
**Patrim. RPPS (R\$):** 65,977,524.51  
**Saldo RPPS (%):** 1.65  
**Saldo RPPS (R\$):** 1,090,903.00  
**Índice de Ref.:** IBOVESPA

**PL (R\$):** 37,131,672.79  
**% do PL (RPPS):** 2.94  
**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
GERACAO FIA PROGRAMADO	-6.57% (4)	-2.89% (1)	2.89% (1)	-16.40% (2)	-2.62% (2)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	-5.85% (2)	-6.21% (2)	-3.47% (2)	-14.25% (1)	-1.89% (1)	ENQUADRADO
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	-6.33% (3)	-7.48% (3)	-4.81% (3)	-17.58% (3)	-4.10% (3)	ENQUADRADO
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-6.67% (5)	-7.99% (4)	-6.13% (4)	-18.56% (4)	-5.44% (5)	ENQUADRADO
ITAU FOF RPI 30 MASTER ACOES FI	-6.94% (6)	-8.14% (5)	-6.54% (5)	-18.76% (5)	-5.24% (4)	ENQUADRADO
ITAU FOF RPI 30 ACOES FICFI	-7.03% (7)	-8.42% (6)	-7.06% (6)	-19.78% (6)	-5.88% (6)	ENQUADRADO
BRADESCO FIC DE FIA IBOVESPA ATIVO	-7.93% (11)	-10.34% (7)	-7.82% (7)	-24.18% (11)	-7.20% (11)	ENQUADRADO
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	-7.12% (8)	-10.50% (9)	-8.40% (8)	-22.84% (8)	-6.93% (10)	ENQUADRADO
<b>CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA</b>	<b>-7.24% (10)</b>	<b>-10.62% (10)</b>	<b>-8.49% (9)</b>	<b>-22.87% (9)</b>	<b>-6.91% (9)</b>	ENQUADRADO
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	-7.18% (9)	-10.38% (8)	-8.82% (10)	-22.83% (7)	-6.25% (7)	ENQUADRADO

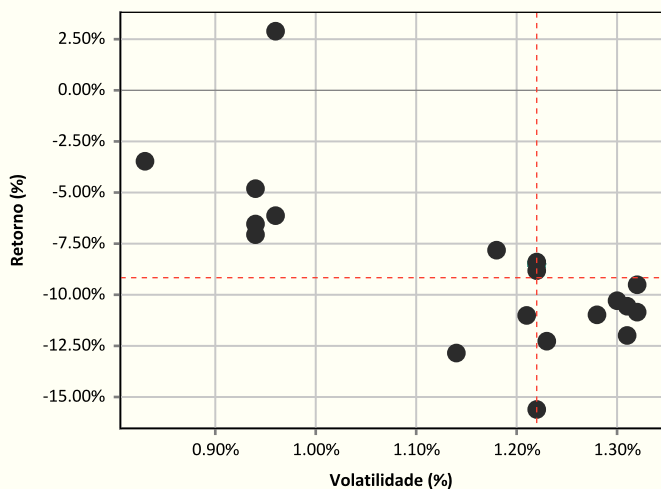
### DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.11%	3.39%	6.49%	12.35%	8.36%
IBOVESPA	-8.33%	-11.63%	-9.61%	-23.92%	-6.76%
IBRX	-8.25%	-10.73%	-8.39%	-22.28%	-5.73%
IBRX50	-7.98%	-10.87%	-8.98%	-22.65%	-5.49%
IMA-B	-3.11%	-4.07%	0.51%	2.81%	4.20%
IRF-M	-0.85%	0.70%	3.42%	7.15%	5.58%

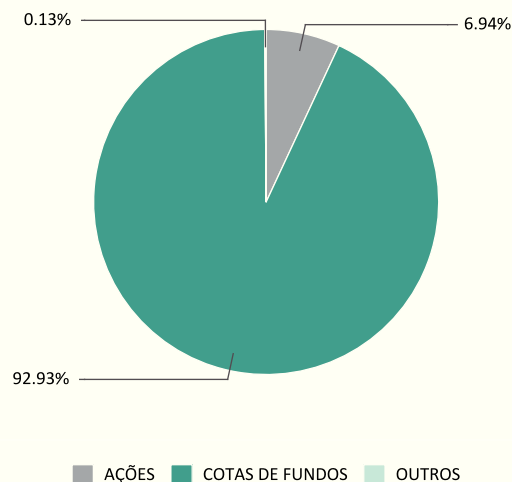
### QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	-7.24%	-10.62%	-8.49%	-22.87%	-6.91%
	IBOVESPA	-8.33%	-11.63%	-9.61%	-23.92%	-6.76%
	Performance	1.19%	1.14%	1.25%	1.39%	-0.16%
	Sucesso	66.67%	50.77%	53.54%	54.15%	51.81%
Vol.	Fundo	1.61%	1.21%	1.22%	1.58%	1.31%
	IBOVESPA	1.66%	1.33%	1.32%	1.66%	1.38%
Perf.	Sharpe	0.04	0.01	0.01	0.00	-0.00
	Semi-Sharpe	0.06	0.02	0.01	0.01	-0.00
	Beta	0.95	0.83	0.87	0.92	0.90

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



### COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 31/08/2015





# Relatório de Performance RPPS



## CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS

31/08/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 8III IDIV	<b>Valor da Cota:</b> 0.952969	<b>PL (R\$):</b> 291,803,057.73
<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> 65,977,524.51	<b>Tx. de Adm.:</b> 1.72
<b>Gestão:</b> VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA	<b>Saldo RPPS (%):</b> 5.05	<b>Tx. de Perf.:</b> 20% que exceder 100% do Outros
<b>Adm.:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 3,332,777.47	<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
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	-6.75% (4)	-2.53% (1)	4.08% (1)	-12.52% (7)	-1.97% (4)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	-6.34% (1)	-5.81% (2)	-2.58% (2)	-7.50% (2)	2.04% (1)	ENQUADRADO
FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	-6.35% (2)	-5.84% (3)	-2.61% (3)	-7.67% (3)	1.97% (2)	ENQUADRADO
FI FATOR ACOES DIVIDENDOS	-7.35% (8)	-8.60% (9)	-4.36% (4)	-5.87% (1)	0.39% (3)	ENQUADRADO
CSHG DIVIDENDOS FIC FI EM ACOES	-6.40% (3)	-6.16% (4)	-4.80% (5)	-12.73% (8)	-8.50% (13)	DESENQUADRADO
BB TOP ACOES DIVIDENDOS FIA	-8.14% (12)	-7.88% (6)	-5.62% (6)	-16.64% (11)	-3.78% (5)	ENQUADRADO
BB ACOES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	-9.27% (15)	-9.20% (11)	-6.43% (7)	-18.34% (13)	-9.16% (14)	ENQUADRADO
BB ACOES DIVIDENDOS FICFIA	-8.30% (13)	-8.36% (8)	-6.58% (8)	-18.33% (12)	-5.06% (7)	ENQUADRADO
CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FIA	-7.20% (5)	-8.26% (7)	-7.22% (9)	-10.70% (4)	-7.25% (9)	ENQUADRADO
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM ACOES	-7.39% (10)	-7.06% (5)	-7.89% (10)	-12.24% (5)	-6.09% (8)	ENQUADRADO
<b>CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS</b>	<b>-7.33% (7)</b>	<b>-8.67% (10)</b>	<b>-8.02% (12)</b>	<b>-12.24% (6)</b>	<b>-8.30% (12)</b>	<b>ENQUADRADO</b>

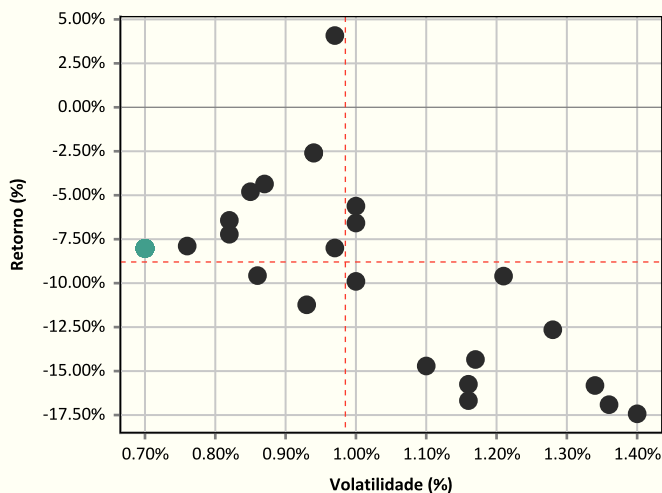
### DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.11%	3.39%	6.49%	12.35%	8.36%
IBOVESPA	-8.33%	-11.63%	-9.61%	-23.92%	-6.76%
IBRX	-8.25%	-10.73%	-8.39%	-22.28%	-5.73%
IBRX50	-7.98%	-10.87%	-8.98%	-22.65%	-5.49%
IMA-B	-3.11%	-4.07%	0.51%	2.81%	4.20%
IRF-M	-0.85%	0.70%	3.42%	7.15%	5.58%

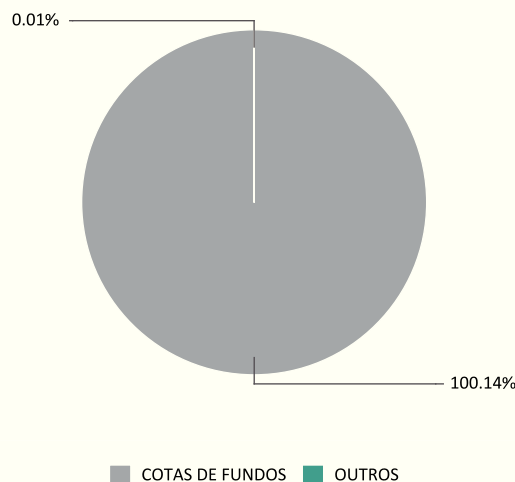
### QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
<b>Ret. (%)</b>					
Fundo	-7.33%	-8.67%	-8.02%	-12.24%	-8.30%
IDIV	-11.08%	-16.30%	-16.51%	-41.88%	-18.31%
Performance	4.21%	9.11%	10.17%	51.00%	12.26%
Sucesso	52.38%	56.92%	56.69%	58.89%	56.63%
<b>Vol.</b>					
Fundo	1.07%	0.79%	0.70%	1.01%	0.81%
IDIV	1.88%	1.47%	1.55%	1.80%	1.58%
<b>Perf.</b>					
Sharpe	0.18	0.17	0.11	0.16	0.09
Semi-Sharpe	0.30	0.24	0.16	0.23	0.12
Beta	0.46	0.39	0.27	0.43	0.33

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



### COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 31/08/2015



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 2018 IV TP RF

31/08/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 0.998727	<b>PL (R\$):</b> 236,549,092.95
<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> 65,977,524.51	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (%):</b> 6.35	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 4,187,973.80	<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	-2.58% (7)	-4.70% (18)	2.94% (1)	4.25% (4)	4.91% (5)	ENQUADRADO
SAFRA IMA FIC FI RF	-1.98% (2)	-1.60% (3)	2.17% (2)	6.39% (1)	5.39% (2)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA I FI	-2.39% (4)	-2.01% (5)	1.29% (3)	4.97% (2)	5.09% (3)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TP IPCA VI FI	-2.43% (5)	-2.00% (4)	1.21% (4)	4.72% (3)	5.00% (4)	ENQUADRADO
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	-6.70% (21)	-3.22% (8)	1.04% (5)	2.43% (7)	5.84% (1)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	-2.54% (6)	-2.16% (6)	0.86% (6)	4.23% (5)	4.56% (6)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	-3.10% (10)	-4.08% (9)	0.56% (7)	2.33% (10)	4.27% (7)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	-3.12% (11)	-4.12% (11)	0.46% (8)	2.12% (12)	4.13% (8)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	-3.07% (8)	-4.16% (12)	0.44% (9)	2.61% (6)	4.06% (9)	ENQUADRADO
BRB RENDA FIXA IMA B	-3.44% (16)	-4.39% (16)	0.44% (10)	1.28% (16)	3.89% (13)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF	-4.00% (17)	-1.57% (2)	-	-	-	ENQUADRADO

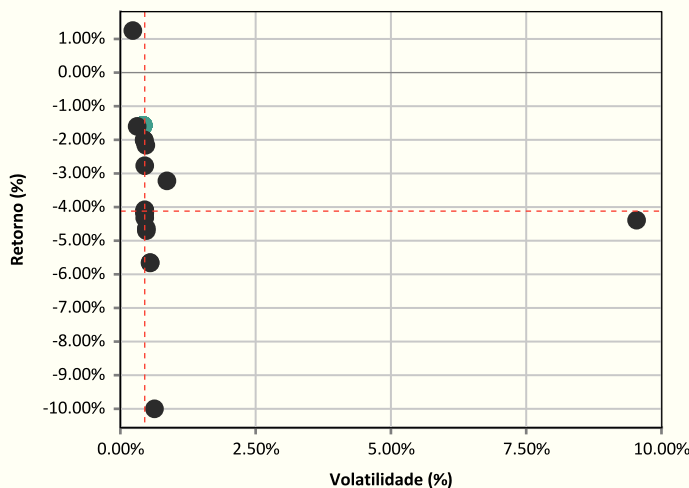
## DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.11%	3.39%	6.49%	12.35%	8.36%
IBOVESPA	-8.33%	-11.63%	-9.61%	-23.92%	-6.76%
IBRX	-8.25%	-10.73%	-8.39%	-22.28%	-5.73%
IBRX50	-7.98%	-10.87%	-8.98%	-22.65%	-5.49%
IMA-B	-3.11%	-4.07%	0.51%	2.81%	4.20%
IRF-M	-0.85%	0.70%	3.42%	7.15%	5.58%

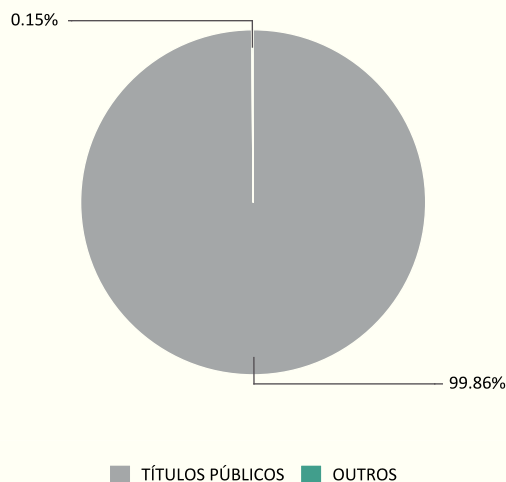
## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Rent. (%)	Fundo	-4.00%	-1.57%		
	IMA-B	-3.11%	-4.07%	0.51%	2.81%
	Performance	-0.91%	2.61%		
	Sucesso	52.38%	56.92%	35.43%	17.79%
Vol.	Fundo	0.62%	0.42%		
	IMA-B	0.52%	0.45%	0.46%	0.57%
Perf.	Sharpe	-0.07	0.10		
	Semi-Sharpe	-0.08	0.11		
	Beta	0.06	0.32		

## DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 3 Meses)



## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 31/08/2015



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

31/08/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 1.731251	<b>PL (R\$):</b> 3,971,882,522.76
<b>CNPJ:</b> 10740658000193	<b>Qtde. de Cotas:</b> 4,128,168.30	<b>% do PL (RPPS):</b> 0.18
<b>Cód. Anbima:</b> 244120	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 65,977,524.51	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (%):</b> 10.83	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 7,146,895.50	<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	-2.58% (7)	-4.70% (18)	2.94% (1)	4.25% (4)	4.91% (5)	ENQUADRADO
SAFRA IMA FIC FI RF	-1.98% (2)	-1.60% (3)	2.17% (2)	6.39% (1)	5.39% (2)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA I FI	-2.39% (4)	-2.01% (5)	1.29% (3)	4.97% (2)	5.09% (3)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TP IPCA VI FI	-2.43% (5)	-2.00% (4)	1.21% (4)	4.72% (3)	5.00% (4)	ENQUADRADO
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	-6.70% (21)	-3.22% (8)	1.04% (5)	2.43% (7)	5.84% (1)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	-2.54% (6)	-2.16% (6)	0.86% (6)	4.23% (5)	4.56% (6)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	-3.10% (10)	-4.08% (9)	0.56% (7)	2.33% (10)	4.27% (7)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	-3.12% (11)	-4.12% (11)	0.46% (8)	2.12% (12)	4.13% (8)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	-3.07% (8)	-4.16% (12)	0.44% (9)	2.61% (6)	4.06% (9)	ENQUADRADO
BRB RENDA FIXA IMA B	-3.44% (16)	-4.39% (16)	0.44% (10)	1.28% (16)	3.89% (13)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	-3.39% (15)	-4.63% (17)	-0.17% (16)	2.07% (13)	3.40% (15)	ENQUADRADO

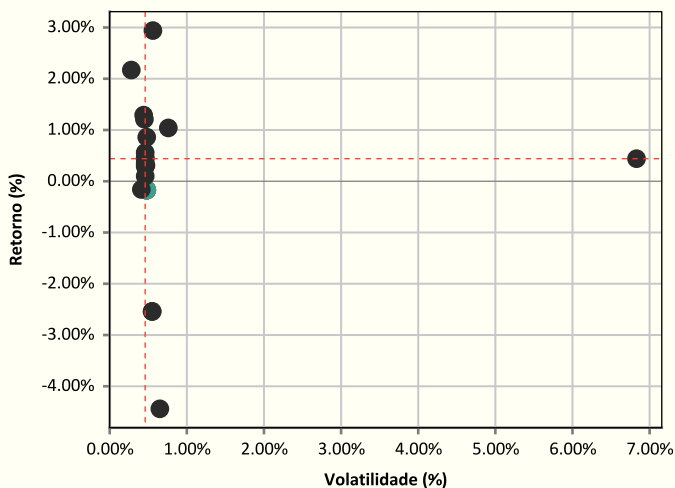
## DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.11%	3.39%	6.49%	12.35%	8.36%
IBOVESPA	-8.33%	-11.63%	-9.61%	-23.92%	-6.76%
IBRX	-8.25%	-10.73%	-8.39%	-22.28%	-5.73%
IBRX50	-7.98%	-10.87%	-8.98%	-22.65%	-5.49%
IMA-B	-3.11%	-4.07%	0.51%	2.81%	4.20%
IRF-M	-0.85%	0.70%	3.42%	7.15%	5.58%

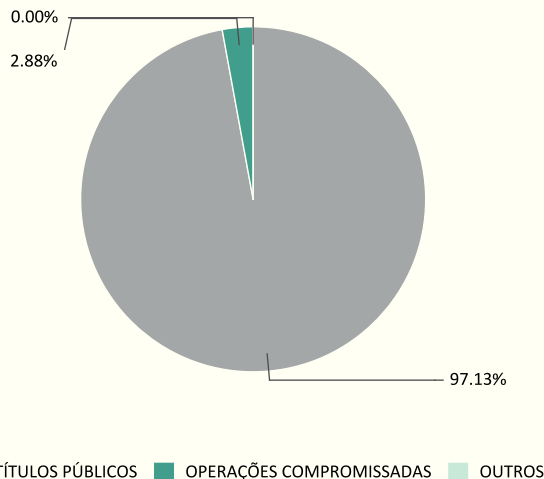
## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	-3.39%	-4.63%	-0.17%	2.07%	3.40%
	IMA-B	-3.11%	-4.07%	0.51%	2.81%	4.20%
	Performance	-0.29%	-0.58%	-0.67%	-0.73%	-0.77%
	Sucesso	42.86%	44.62%	48.03%	49.41%	48.19%
Vol.	Fundo	0.55%	0.48%	0.48%	0.57%	0.47%
	IMA-B	0.52%	0.45%	0.46%	0.57%	0.46%
Perf.	Sharpe	-0.03	-0.02	-0.01	-0.01	-0.01
	Semi-Sharpe	-0.03	-0.02	-0.01	-0.01	-0.01
	Beta	1.06	1.06	1.04	1.00	1.03

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



## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 31/07/2015



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.