

# Relatório de Performance RPPS

BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT

27/02/2015

Categoria RPPS: 8IV

CNPJ: 20168735000136

Cód. Anbima: 367214

Gestão: BANESTES DTVM SA

Adm.: BANESTES DTVM SA

CNPJ Gestor: 28156057000101

CNPJ Adm.: 28156057000101

Valor da Cota: 1.19

Qtde. de Cotas: 851,318.77

Patrim. RPPS (R\$): 60,295,337.99

Saldo RPPS (%): 1.68

Saldo RPPS (R\$): 1,015,788.51

Índice de Ref.: CDI

PL (R\$): 18,193,972.61

% do PL (RPPS): 5.58

Tx. de Adm.: 1.10

Tx. de Perf.: -

Resgate: D+3

Conversão de Cotas: D+1

## FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
WA US INDEX 500 FI MULTI	5.77% (1)	4.46% (3)	10.80% (1)	25.42% (1)	2.96% (10)	ENQUADRADO
<b>BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT</b>	<b>3.30% (4)</b>	<b>5.29% (2)</b>	<b>10.44% (2)</b>	<b>- -</b>	<b>4.62% (4)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
FI FATOR HEDGE ABSOLUTO MULTIMERCADO	-3.52% (63)	-1.20% (59)	8.68% (3)	12.16% (18)	-1.97% (62)	DESENQUADRADO
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0.42% (59)	4.17% (6)	8.56% (4)	15.48% (3)	9.05% (3)	ENQUADRADO
LEME FIC FI MULTIMERCADO CRED PRIVADO	2.64% (7)	-3.31% (61)	7.82% (5)	22.09% (2)	-0.69% (61)	ENQUADRADO
ECO HEDGE FI MULT CRED PRIV LONGO PRAZO	1.51% (18)	4.34% (4)	7.68% (6)	14.63% (5)	3.04% (9)	ENQUADRADO
SAFRA CARTEIRA INSTITUCIONAL FI MULTIM	1.85% (11)	3.85% (12)	7.51% (7)	13.08% (17)	3.08% (8)	ENQUADRADO
MODAL INST FI MULTIMERCADO	1.07% (37)	4.34% (5)	7.36% (8)	11.87% (22)	3.40% (5)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV	1.32% (29)	3.95% (8)	7.01% (9)	13.58% (10)	2.89% (15)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA IV MULTI CRED PRIV	1.50% (19)	3.95% (7)	6.94% (10)	13.56% (12)	2.93% (11)	ENQUADRADO

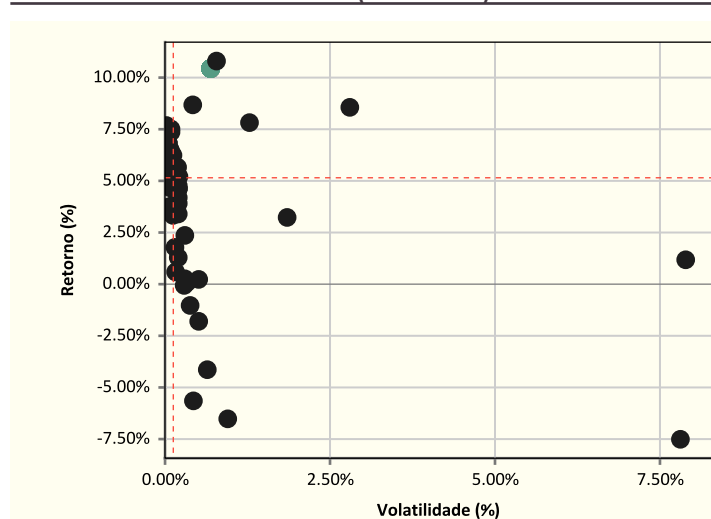
## DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.82%	2.73%	5.51%	10.95%	1.76%
IBOVESPA	9.97%	-5.74%	-15.84%	9.53%	3.15%
IBRX	9.33%	-5.61%	-15.17%	9.26%	2.90%
IBRX50	9.81%	-5.21%	-15.02%	10.26%	3.83%
IMA-B	0.54%	1.70%	2.30%	16.68%	3.68%
IRF-M	0.29%	2.02%	3.61%	11.49%	2.08%

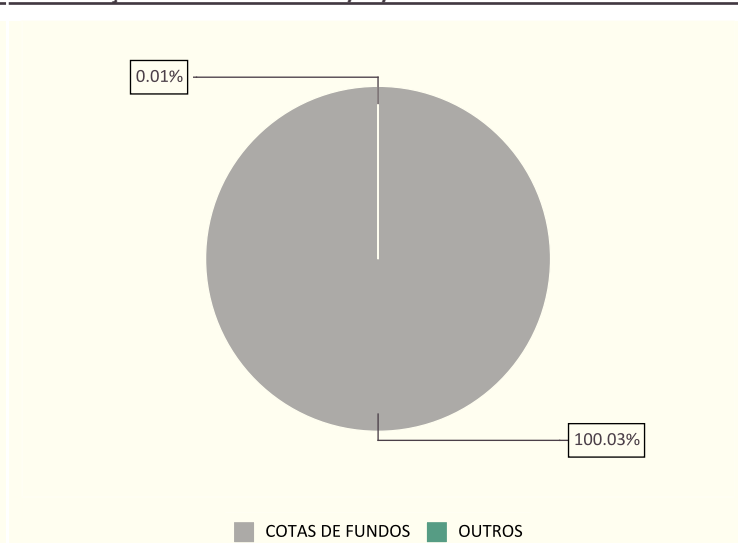
## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Rent. (%)	Fundo	3.30%	5.29%	10.44%	4.62%
	CDI	0.82%	2.73%	5.51%	10.95%
	Performance	403.10%	193.79%	189.54%	263.34%
<b>BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT</b>					
44.44%					
Vol.	Fundo	1.19%	0.87%	0.69%	0.98%
	CDI	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
	Sharpe	0.11	0.05	0.05	0.07
Perf.	Semi-Sharpe	0.16	0.07	0.07	0.10
	Beta	11,531.84	121.91	26.54	142.08

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



## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 27/02/2015



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade do 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 o Risk Office deposita confiança. Entretanto, o 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, por tanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.

# Relatório de Performance RPPS

## BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA

27/02/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7III IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 4.17	<b>PL (R\$):</b> 105,989,473.35
<b>CNPJ:</b> 05357507000110	<b>Qtde. de Cotas:</b> 408,535.97	<b>% do PL (RPPS):</b> 1.61
<b>Cód. Anbima:</b> 247960	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 60,295,337.99	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO	<b>Saldo RPPS (%):</b> 2.83	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 1,705,063.80	<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 DIFERENCIAL RENDA FIXA LONGO PRAZO	0.33% (21)	1.73% (11)	9.28% (1)	20.61% (2)	2.49% (21)	ENQUADRADO
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	1.62% (2)	3.69% (1)	6.89% (2)	13.56% (18)	2.80% (18)	ENQUADRADO
FUNDO INVEST. RENDA FIXA IMA B ESLOVENIA	1.02% (4)	3.04% (2)	5.31% (3)	24.49% (1)	2.74% (19)	ENQUADRADO
FUNDO DE INV RENDA FIXA IPIRANGA	0.93% (6)	2.81% (3)	4.67% (4)	13.61% (17)	2.84% (17)	ENQUADRADO
FI EM RF BRB SOLIDEZ	0.96% (5)	2.74% (4)	3.99% (5)	6.95% (22)	3.26% (14)	ENQUADRADO
LMX IMA B FI RENDA FIXA	0.83% (8)	2.32% (6)	3.79% (6)	13.37% (19)	3.02% (16)	ENQUADRADO
WESTERN ASSET RF INDICES RPPS FICFI	0.52% (15)	1.99% (8)	3.00% (7)	12.83% (20)	2.68% (20)	ENQUADRADO
<b>BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA</b>	<b>-0.83% (22)</b>	<b>0.21% (21)</b>	<b>2.88% (8)</b>	<b>12.74% (21)</b>	<b>2.04% (22)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
BANRISUL PREV MUNICIPAL III FI RF LP	0.47% (19)	1.70% (14)	2.78% (9)	16.47% (8)	3.56% (10)	ENQUADRADO
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	0.92% (7)	2.71% (5)	2.74% (10)	16.38% (10)	4.29% (2)	ENQUADRADO

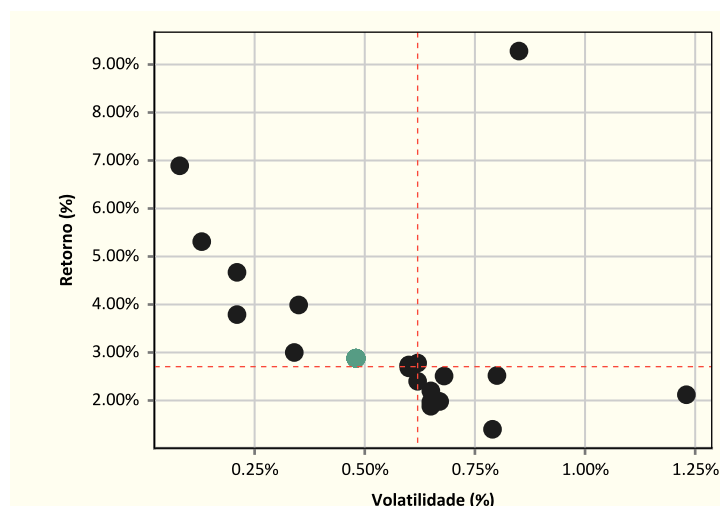
### DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.82%	2.73%	5.51%	10.95%	1.76%
IBOVESPA	9.97%	-5.74%	-15.84%	9.53%	3.15%
IBRX	9.33%	-5.61%	-15.17%	9.26%	2.90%
IBRX50	9.81%	-5.21%	-15.02%	10.26%	3.83%
IMA-B	0.54%	1.70%	2.30%	16.68%	3.68%
IRF-M	0.29%	2.02%	3.61%	11.49%	2.08%

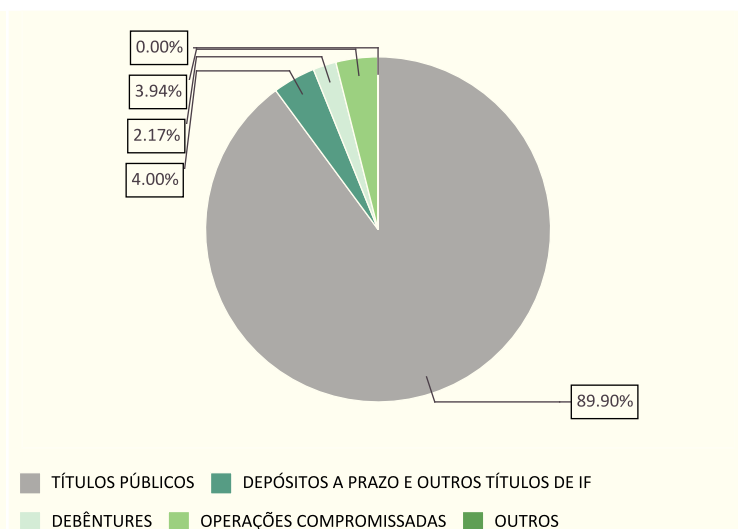
### QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	-0.83%	0.21%	2.88%	12.74%	2.04%
	IMA-B	0.54%	1.70%	2.30%	16.68%	3.68%
	Performance	-136.54%	-146.60%	56.98%	-338.33%	-158.04%
<b>BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA</b>						
50.00%						
Vol.	Fundo	0.29%	0.36%	0.48%	0.39%	0.35%
	IMA-B	0.48%	0.45%	0.65%	0.55%	0.44%
Perf.	Sharpe	-0.27	-0.07	0.01	-0.04	-0.12
	Semi-Sharpe	-0.41	-0.10	0.01	-0.05	-0.18
	Beta	0.10	0.18	-0.00	0.01	0.02

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



### COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 27/02/2015



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade do 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 o Risk Office deposita confiança. Entretanto, o 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, por tanto, 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

27/02/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 3.04	<b>PL (R\$):</b> 5,264,278,809.90
<b>CNPJ:</b> 07442078000105	<b>Qtde. de Cotas:</b> 10,493,545.48	<b>% do PL (RPPS):</b> 0.61
<b>Cód. Anbima:</b> 242901	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 60,295,337.99	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (%):</b> 52.85	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 31,864,688.14	<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
SAFRA IMA FIC FI RF	0.93% (1)	2.64% (1)	4.13% (1)	12.30% (14)	3.15% (14)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA I FI	0.41% (11)	2.26% (2)	3.63% (2)	15.60% (11)	3.75% (3)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TP IPCA VI FI	0.41% (12)	2.22% (3)	3.47% (3)	- -	3.74% (4)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	0.38% (13)	2.13% (4)	3.34% (4)	15.88% (8)	3.67% (6)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL FI RF IMA B	0.56% (3)	1.70% (6)	2.25% (5)	16.38% (4)	3.76% (2)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	0.51% (9)	1.58% (10)	2.24% (6)	16.40% (3)	3.58% (12)	ENQUADRADO
<b>BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI</b>	<b>0.53% (6)</b>	<b>1.59% (9)</b>	<b>2.16% (7)</b>	<b>16.29% (5)</b>	<b>3.61% (9)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	0.51% (8)	1.59% (8)	2.08% (8)	16.18% (6)	3.60% (10)	ENQUADRADO
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	0.48% (10)	1.63% (7)	1.94% (9)	16.03% (7)	3.58% (11)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	0.55% (4)	1.45% (11)	1.76% (10)	15.86% (9)	3.68% (5)	ENQUADRADO

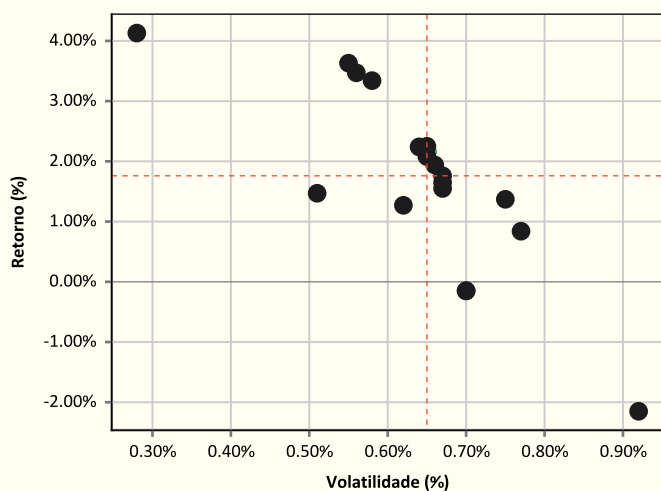
## DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.82%	2.73%	5.51%	10.95%	1.76%
IBOVESPA	9.97%	-5.74%	-15.84%	9.53%	3.15%
IBRX	9.33%	-5.61%	-15.17%	9.26%	2.90%
IBRX50	9.81%	-5.21%	-15.02%	10.26%	3.83%
IMA-B	0.54%	1.70%	2.30%	16.68%	3.68%
IRF-M	0.29%	2.02%	3.61%	11.49%	2.08%

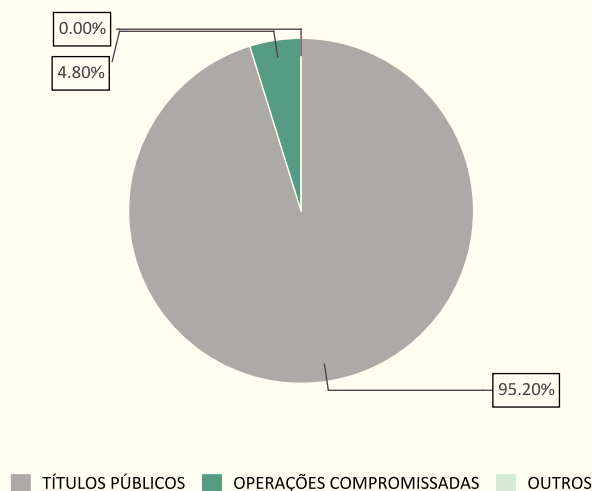
## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	0.53%	1.59%	2.16%	16.29%	3.61%
	IMA-B	0.54%	1.70%	2.30%	16.68%	3.68%
	Performance	-1.41%	-11.13%	-13.08%	-33.94%	-6.96%
	<b>BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI</b>	<b>38.89%</b>	<b>31.15%</b>	<b>38.10%</b>	<b>31.20%</b>	<b>33.33%</b>
Vol.	Fundo	0.48%	0.45%	0.65%	0.55%	0.44%
	IMA-B	0.48%	0.45%	0.65%	0.55%	0.44%
Perf.	Sharpe	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00
	Semi-Sharpe	-0.00	-0.01	-0.00	-0.00	-0.01
	Beta	0.99	1.00	1.00	1.00	0.99

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



## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/01/2015



# Relatório de Performance RPPS

BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI

27/02/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IDKA IPCA 3A	<b>Valor da Cota:</b> 1.17	<b>PL (R\$):</b> 917,821,193.22
<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> 60,295,337.99	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.15
<b>Gestão:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (%):</b> 5.48	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 3,302,709.94	<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	1.00% (1)	3.01% (1)	4.73% (1)	13.64% (1)	3.60% (1)	ENQUADRADO

## DADOS DE MERCADO

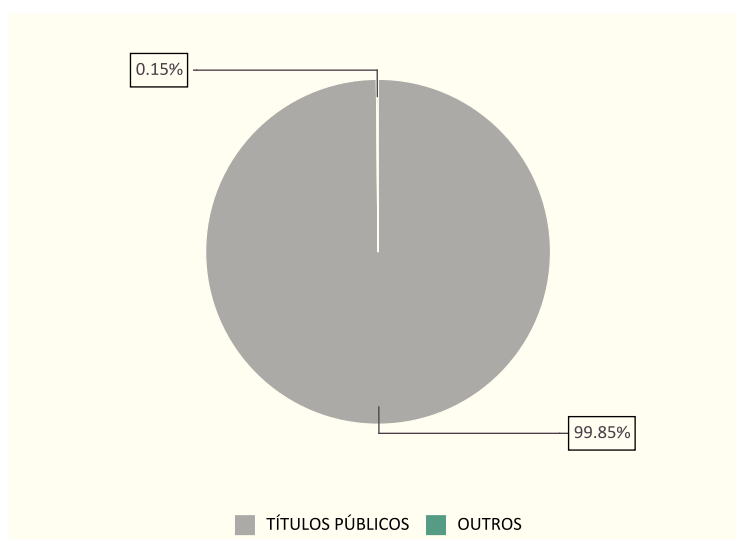
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.82%	2.73%	5.51%	10.95%	1.76%
IBOVESPA	9.97%	-5.74%	-15.84%	9.53%	3.15%
IBRX	9.33%	-5.61%	-15.17%	9.26%	2.90%
IBRX50	9.81%	-5.21%	-15.02%	10.26%	3.83%
IMA-B	0.54%	1.70%	2.30%	16.68%	3.68%
IRF-M	0.29%	2.02%	3.61%	11.49%	2.08%

## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
<b>Rent. (%)</b>					
Fundo	1.00%	3.01%	4.73%	13.64%	3.60%
IDKA IPCA 3A	1.37%	2.87%	4.64%	13.07%	3.41%
Performance	-36.03%	14.37%	8.50%	50.50%	17.86%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI	44.44%	47.54%	46.03%	44.80%	51.28%
<b>Vol.</b>					
Fundo	0.29%	0.23%	0.29%	0.26%	0.24%
IDKA IPCA 3A	0.33%	0.25%	0.27%	0.23%	0.27%
<b>Perf.</b>					
Sharpe	-0.07	0.01	0.00	0.01	0.02
Semi-Sharpe	-0.11	0.01	0.00	0.01	0.03
Beta	0.75	0.80	0.99	1.01	0.74

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

## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 27/02/2015



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade do 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 o Risk Office deposita confiança. Entretanto, o 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, por tanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.

# Relatório de Performance RPPS

BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI

27/02/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IV CDI	<b>Valor da Cota:</b> 1.43	<b>PL (R\$):</b> 5,011,152,825.79
<b>CNPJ:</b> 13077418000149	<b>Qtde. de Cotas:</b> 3,086,366.71	<b>% do PL (RPPS):</b> 0.09
<b>Cód. Anbima:</b> 272493	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 60,295,337.99	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.30
<b>Gestão:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (%):</b> 7.32	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 4,415,260.54	<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
SAFRA CART CORP RF FC FI	0.99% (2)	3.02% (2)	5.83% (1)	11.56% (2)	2.24% (3)	ENQUADRADO
CAIXA FIC PATRIMONIO IND PRECOS RF LP	1.08% (1)	3.27% (1)	5.76% (2)	12.87% (1)	2.84% (2)	ENQUADRADO
ITAU REFERENCIADO DI FI	0.83% (8)	2.79% (5)	5.64% (3)	11.21% (4)	1.80% (11)	ENQUADRADO
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0.84% (7)	2.78% (8)	5.63% (4)	11.18% (5)	1.78% (16)	ENQUADRADO
HSBC FI REFERENCIADO DI LP	0.83% (9)	2.79% (6)	5.62% (5)	11.13% (7)	1.80% (9)	ENQUADRADO
<b>BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI</b>	<b>0.83% (11)</b>	<b>2.81% (4)</b>	<b>5.62% (6)</b>	<b>11.17% (6)</b>	<b>1.78% (19)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
BNP PARIBAS TARGUS DI FIC FI REFER	0.83% (15)	2.76% (14)	5.60% (7)	11.11% (11)	1.77% (22)	ENQUADRADO
UNIBANCO INSTITUCIONAL DI FI REF	0.83% (17)	2.78% (7)	5.60% (8)	11.13% (8)	1.78% (17)	ENQUADRADO
SANT FIC FI CORPORATE REF DI	0.83% (10)	2.76% (13)	5.59% (9)	11.11% (10)	1.78% (21)	ENQUADRADO
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0.84% (5)	2.77% (9)	5.58% (10)	11.11% (9)	1.79% (14)	ENQUADRADO

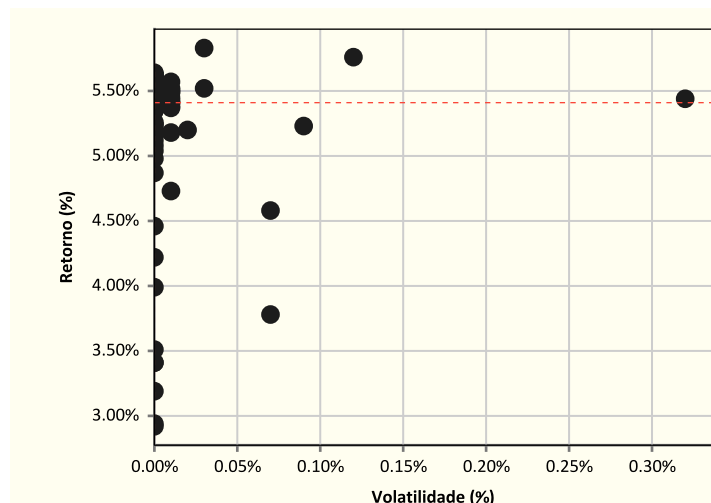
## DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.82%	2.73%	5.51%	10.95%	1.76%
IBOVESPA	9.97%	-5.74%	-15.84%	9.53%	3.15%
IBRX	9.33%	-5.61%	-15.17%	9.26%	2.90%
IBRX50	9.81%	-5.21%	-15.02%	10.26%	3.83%
IMA-B	0.54%	1.70%	2.30%	16.68%	3.68%
IRF-M	0.29%	2.02%	3.61%	11.49%	2.08%

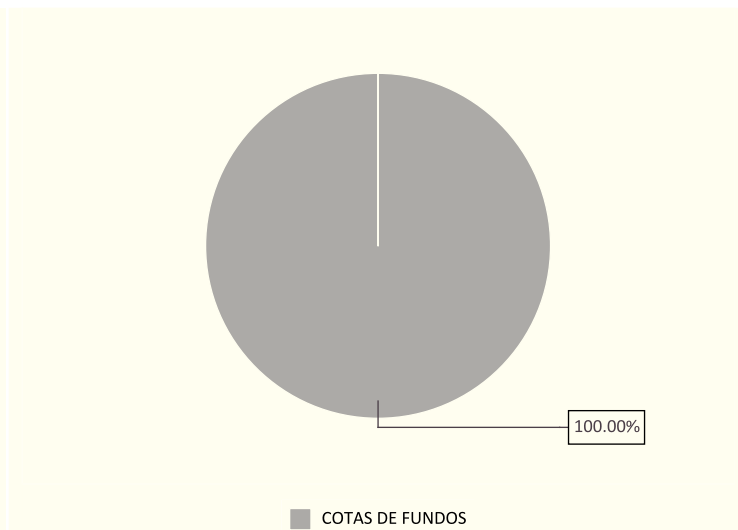
## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	0.83%	2.81%	5.62%	11.17%	1.78%
	CDI	0.82%	2.73%	5.51%	10.95%	1.76%
	Performance	101.65%	103.06%	101.94%	102.01%	101.42%
	<b>BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI</b>	<b>61.11%</b>	<b>62.30%</b>	<b>59.52%</b>	<b>63.60%</b>	<b>61.54%</b>
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	0.20	0.32	0.16	0.19	0.19
	Semi-Sharpe	0.29	0.52	0.24	0.30	0.27
	Beta	76.42	0.67	1.13	1.09	0.76

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



## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/01/2015



# Relatório de Performance RPPS

CAIXA FI ALIANCA TITULOS PUBLICOS RF

27/02/2015

Categoria RPPS: 7IV CDI

CNPJ: 05164358000173

Cód. Anbima: 157252

Gestão: CAIXA ECONOMICA FEDERAL

Adm.: CAIXA ECONOMICA FEDERAL

CNPJ Gestor: 360305000104

CNPJ Adm.: 360305000104

Valor da Cota: 2.66

Qtde. de Cotas: 1,460,356.04

Patrim. RPPS (R\$): 60,295,337.99

Saldo RPPS (%): 6.45

Saldo RPPS (R\$): 3,889,050.80

Índice de Ref.: CDI

PL (R\$): 439,402,438.59

% do PL (RPPS): 0.89

Tx. de Adm.: 0.20

Tx. de Perf.: -

Resgate: 0

Conversão de Cotas: 0

## FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
SAFRA CART CORP RF FC FI	0.99% (2)	3.02% (2)	5.83% (1)	11.56% (2)	2.24% (3)	ENQUADRADO
CAIXA FIC PATRIMONIO IND PRECOS RF LP	1.08% (1)	3.27% (1)	5.76% (2)	12.87% (1)	2.84% (2)	ENQUADRADO
ITAU REFERENCIADO DI FI	0.83% (8)	2.79% (5)	5.64% (3)	11.21% (4)	1.80% (11)	ENQUADRADO
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0.84% (7)	2.78% (8)	5.63% (4)	11.18% (5)	1.78% (16)	ENQUADRADO
HSBC FI REFERENCIADO DI LP	0.83% (9)	2.79% (6)	5.62% (5)	11.13% (7)	1.80% (9)	ENQUADRADO
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	0.83% (11)	2.81% (4)	5.62% (6)	11.17% (6)	1.78% (19)	ENQUADRADO
BNP PARIBAS TARGUS DI FIC FI REFER	0.83% (15)	2.76% (14)	5.60% (7)	11.11% (11)	1.77% (22)	ENQUADRADO
UNIBANCO INSTITUCIONAL DI FI REF	0.83% (17)	2.78% (7)	5.60% (8)	11.13% (8)	1.78% (17)	ENQUADRADO
SANT FIC FI CORPORATE REF DI	0.83% (10)	2.76% (13)	5.59% (9)	11.11% (10)	1.78% (21)	ENQUADRADO
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0.84% (5)	2.77% (9)	5.58% (10)	11.11% (9)	1.79% (14)	ENQUADRADO
CAIXA FI ALIANCA TITULOS PUBLICOS RF	0.82% (25)	2.73% (23)	5.51% (20)	10.85% (23)	1.81% (8)	ENQUADRADO

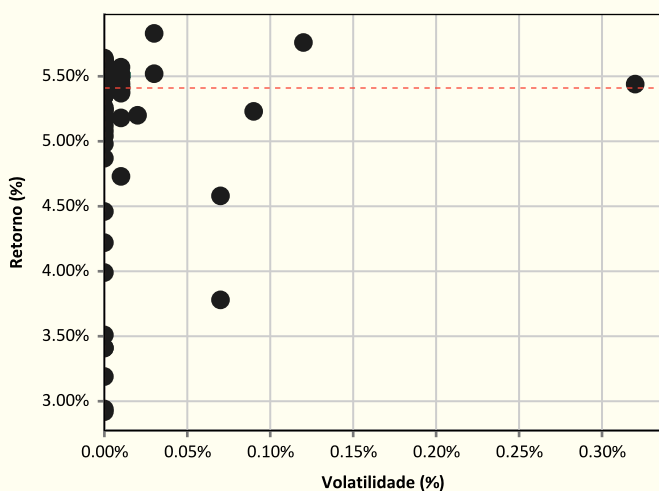
## DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.82%	2.73%	5.51%	10.95%	1.76%
IBOVESPA	9.97%	-5.74%	-15.84%	9.53%	3.15%
IBRX	9.33%	-5.61%	-15.17%	9.26%	2.90%
IBRX50	9.81%	-5.21%	-15.02%	10.26%	3.83%
IMA-B	0.54%	1.70%	2.30%	16.68%	3.68%
IRF-M	0.29%	2.02%	3.61%	11.49%	2.08%

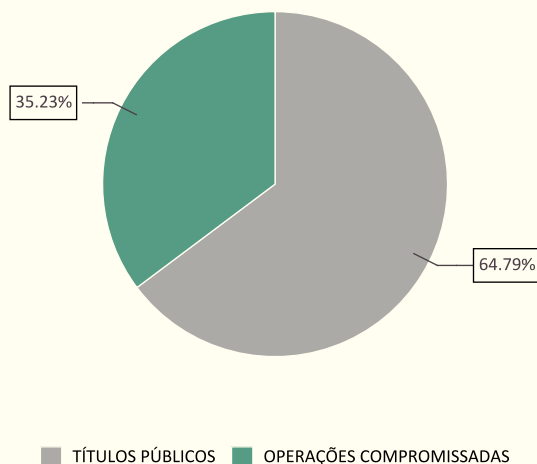
## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
<b>Ret. (%)</b>					
Fundo	0.82%	2.73%	5.51%	10.85%	1.81%
CDI	0.82%	2.73%	5.51%	10.95%	1.76%
Performance	99.83%	100.20%	99.95%	99.03%	102.88%
CAIXA FI ALIANCA TITULOS PUBLICOS RF	55.56%	49.18%	48.41%	43.20%	56.41%
<b>Vol.</b>					
Fundo	0.00%	0.01%	0.01%	0.01%	0.01%
CDI	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
<b>Perf.</b>					
Sharpe	-0.02	0.01	-0.00	-0.04	0.23
Semi-Sharpe	-0.02	0.02	-0.00	-0.06	0.33
Beta	136.38	0.89	1.01	1.20	-1.77

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



## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 27/02/2015



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade do 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 o Risk Office deposita confiança. Entretanto, o 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, por tanto, 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

27/02/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 1.12	<b>PL (R\$):</b> 300,340,315.36
<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> 60,295,337.99	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (%):</b> 1.52	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 918,059.93	<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
SAFRA IMA FIC FI RF	0.93% (1)	2.64% (1)	4.13% (1)	12.30% (14)	3.15% (14)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA I FI	0.41% (11)	2.26% (2)	3.63% (2)	15.60% (11)	3.75% (3)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TP IPCA VI FI	0.41% (12)	2.22% (3)	3.47% (3)	- -	3.74% (4)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	0.38% (13)	2.13% (4)	3.34% (4)	15.88% (8)	3.67% (6)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL FI RF IMA B	0.56% (3)	1.70% (6)	2.25% (5)	16.38% (4)	3.76% (2)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	0.51% (9)	1.58% (10)	2.24% (6)	16.40% (3)	3.58% (12)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	0.53% (6)	1.59% (9)	2.16% (7)	16.29% (5)	3.61% (9)	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	0.51% (8)	1.59% (8)	2.08% (8)	16.18% (6)	3.60% (10)	ENQUADRADO
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	0.48% (10)	1.63% (7)	1.94% (9)	16.03% (7)	3.58% (11)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	0.55% (4)	1.45% (11)	1.76% (10)	15.86% (9)	3.68% (5)	ENQUADRADO
<b>CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF</b>	<b>-2.58% (19)</b>	<b>-0.99% (18)</b>	<b>-0.15% (18)</b>	<b>10.18% (15)</b>	<b>0.76% (19)</b>	<b>ENQUADRADO</b>

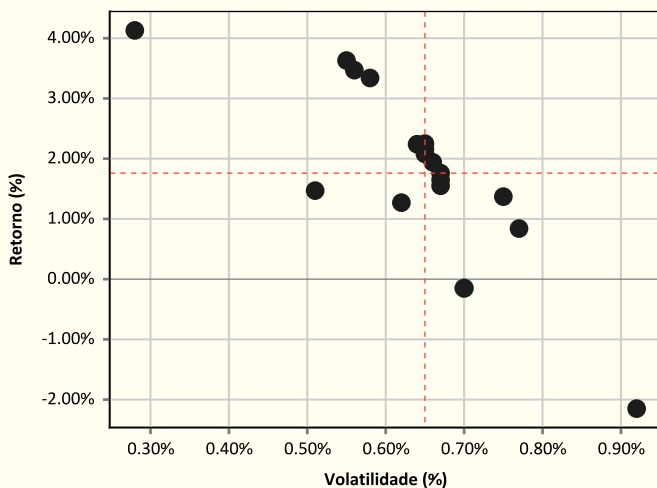
## DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.82%	2.73%	5.51%	10.95%	1.76%
IBOVESPA	9.97%	-5.74%	-15.84%	9.53%	3.15%
IBRX	9.33%	-5.61%	-15.17%	9.26%	2.90%
IBRX50	9.81%	-5.21%	-15.02%	10.26%	3.83%
IMA-B	0.54%	1.70%	2.30%	16.68%	3.68%
IRF-M	0.29%	2.02%	3.61%	11.49%	2.08%

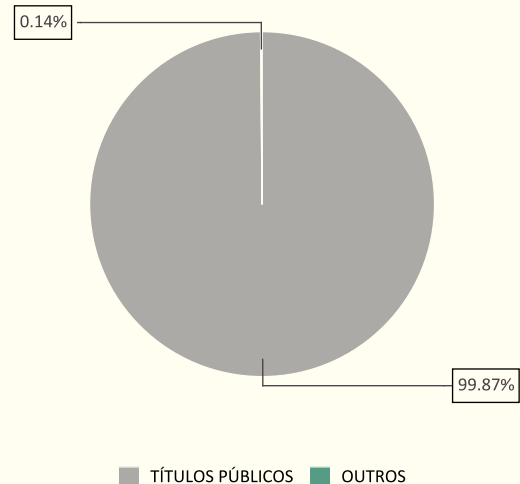
## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	-2.58%	-0.99%	-0.15%	10.18%	0.76%
	IMA-B	0.54%	1.70%	2.30%	16.68%	3.68%
	Performance	-310.20%	-264.74%	-239.58%	-557.19%	-281.45%
	CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	50.00%	54.10%	50.00%	48.00%	53.85%
Vol.	Fundo	0.91%	0.64%	0.70%	0.61%	0.71%
	IMA-B	0.48%	0.45%	0.65%	0.55%	0.44%
Perf.	Sharpe	-0.19	-0.07	-0.03	-0.04	-0.10
	Semi-Sharpe	-0.24	-0.09	-0.04	-0.05	-0.13
	Beta	1.21	1.10	0.97	0.98	1.16

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



## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 27/02/2015



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade do 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 o Risk Office deposita confiança. Entretanto, o 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, por tanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.

# Relatório de Performance RPPS

CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA

27/02/2015

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: 1.19  
 Qtde. de Cotas: 1,000,000.00  
 Patrim. RPPS (R\$): 60,295,337.99  
 Saldo RPPS (%): 1.98  
 Saldo RPPS (R\$): 1,192,059.00  
 Índice de Ref.: IBOVESPA

PL (R\$): 43,033,345.72  
 % do PL (RPPS): 2.77  
 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	7.59% (17)	-4.64% (3)	-10.70% (1)	9.03% (2)	1.40% (11)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	8.22% (12)	-4.39% (1)	-11.16% (2)	7.64% (6)	1.63% (9)	ENQUADRADO
ITAU FOF RPI 30 MASTER ACOES FI	8.06% (14)	-5.97% (6)	-13.08% (3)	7.52% (7)	1.40% (12)	ENQUADRADO
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	7.64% (16)	-5.88% (5)	-13.24% (4)	6.72% (11)	0.74% (16)	ENQUADRADO
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	8.26% (11)	-6.02% (7)	-13.42% (5)	7.24% (9)	0.75% (15)	ENQUADRADO
ITAU FOF RPI 30 ACOES FICFI	8.01% (15)	-6.22% (10)	-13.69% (6)	6.32% (12)	1.26% (13)	ENQUADRADO
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	9.30% (8)	-4.63% (2)	-15.37% (7)	8.66% (3)	2.82% (2)	ENQUADRADO
CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA	9.86% (2)	-6.21% (9)	-15.72% (8)	7.98% (4)	1.72% (8)	ENQUADRADO
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	9.84% (3)	-6.33% (12)	-15.77% (9)	7.71% (5)	1.60% (10)	ENQUADRADO
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	10.00% (1)	-5.69% (4)	-15.86% (10)	9.30% (1)	3.19% (1)	ENQUADRADO

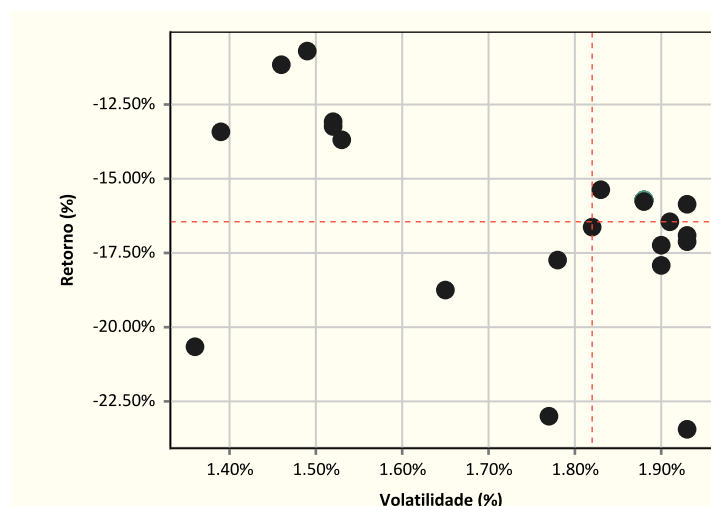
## DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.82%	2.73%	5.51%	10.95%	1.76%
IBOVESPA	9.97%	-5.74%	-15.84%	9.53%	3.15%
IBRX	9.33%	-5.61%	-15.17%	9.26%	2.90%
IBRX50	9.81%	-5.21%	-15.02%	10.26%	3.83%
IMA-B	0.54%	1.70%	2.30%	16.68%	3.68%
IRF-M	0.29%	2.02%	3.61%	11.49%	2.08%

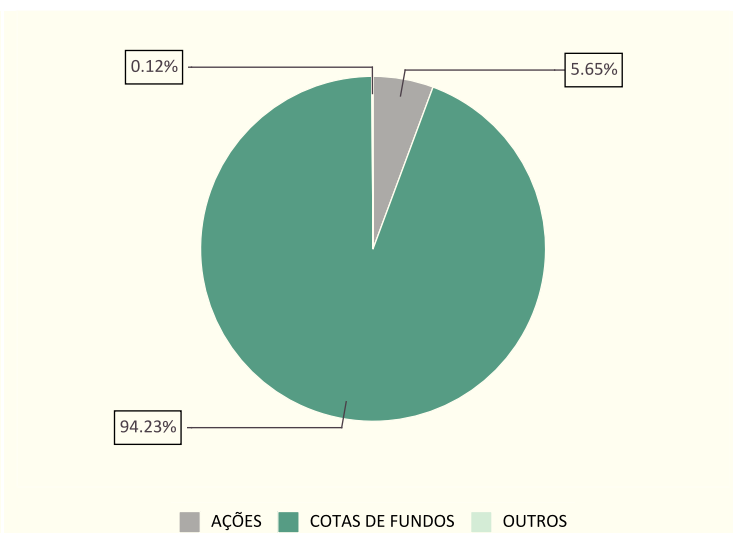
## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	9.86%	-6.21%	-15.72%	7.98%	1.72%
	IBOVESPA	9.97%	-5.74%	-15.84%	9.53%	3.15%
	Performance	-9.69%	-50.05%	13.99%	-141.74%	-138.35%
<b>CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA</b>						
Vol.	Fundo	1.32%	1.66%	1.88%	1.56%	1.55%
	IBOVESPA	1.20%	1.71%	1.93%	1.61%	1.53%
Perf.	Sharpe	-0.00	-0.00	0.00	-0.00	-0.02
	Semi-Sharpe	-0.01	-0.01	0.00	-0.01	-0.03
	Beta	1.04	0.94	0.94	0.92	0.98

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



## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 27/02/2015





# Relatório de Performance RPPS

CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS

27/02/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 8III IDIV	<b>Valor da Cota:</b> 1.04	<b>PL (R\$):</b> 317,249,200.93
<b>CNPJ:</b> 15154441000115	<b>Qtde. de Cotas:</b> 3,497,256.95	<b>% do PL (RPPS):</b> 1.14
<b>Cód. Anbima:</b> 311383	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 60,295,337.99	<b>Tx. de Adm.:</b> 1.72
<b>Gestão:</b> VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA	<b>Saldo RPPS (%):</b> 6.01	<b>Tx. de Perf.:</b> 20% que exceder 100% do Outros
<b>Adm.:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 3,623,406.51	<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	6.78% (14)	-0.25% (2)	-1.58% (1)	13.43% (3)	4.97% (1)	ENQUADRADO
CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FIA	5.90% (16)	-1.51% (6)	-3.75% (2)	13.09% (4)	-0.03% (14)	ENQUADRADO
<b>CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS</b>	<b>5.78% (17)</b>	<b>-0.82% (4)</b>	<b>-4.58% (3)</b>	<b>10.41% (7)</b>	<b>-0.30% (16)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM ACOES	5.25% (19)	-1.62% (7)	-4.72% (4)	11.35% (5)	1.96% (7)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	8.25% (8)	-0.24% (1)	-5.05% (5)	15.78% (1)	4.74% (2)	ENQUADRADO
FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	8.24% (9)	-0.29% (3)	-5.19% (6)	15.52% (2)	4.71% (3)	ENQUADRADO
LMX DIVIDENDOS FI DE ACOES	4.20% (22)	-1.00% (5)	-5.91% (7)	10.51% (6)	2.08% (6)	ENQUADRADO
FIA PETREO DIVIDENDOS	6.61% (15)	-1.64% (8)	-6.21% (8)	9.23% (9)	2.67% (5)	DESENQUADRADO
CSHG DIVIDENDOS FIC FI EM ACOES	2.22% (24)	-8.70% (17)	-8.33% (9)	2.98% (15)	-3.89% (23)	DESENQUADRADO
WA DIVIDEND YIELD FIA	4.23% (21)	-4.40% (11)	-9.16% (10)	8.14% (10)	1.31% (11)	ENQUADRADO

## DADOS DE MERCADO

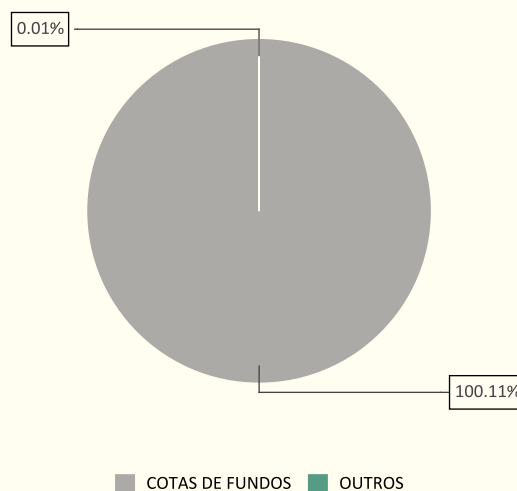
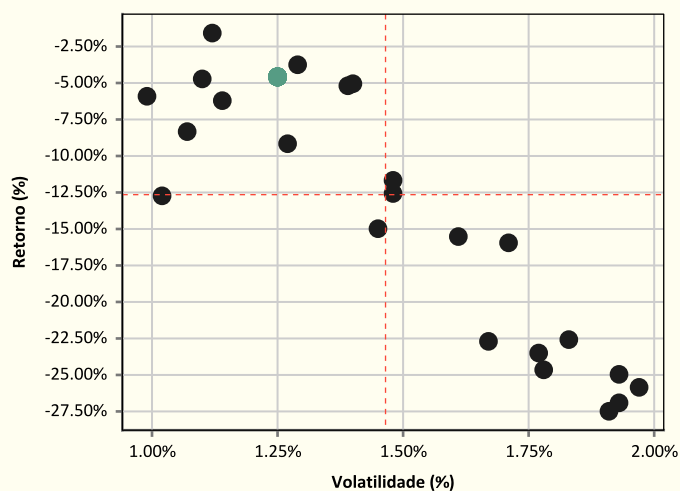
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.82%	2.73%	5.51%	10.95%	1.76%
IBOVESPA	9.97%	-5.74%	-15.84%	9.53%	3.15%
IBRX	9.33%	-5.61%	-15.17%	9.26%	2.90%
IBRX50	9.81%	-5.21%	-15.02%	10.26%	3.83%
IMA-B	0.54%	1.70%	2.30%	16.68%	3.68%
IRF-M	0.29%	2.02%	3.61%	11.49%	2.08%

## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	5.78%	-0.82%	-4.58%	10.41%	-0.30%
	IDIV	10.17%	-12.80%	-30.38%	-11.56%	-2.15%
	Performance	-398.30%	1,374.18%	3,706.13%	2,484.08%	189.22%
<b>CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS</b>						
44.44%						
Vol.	Fundo	0.75%	1.05%	1.25%	1.03%	1.09%
	IDIV	1.41%	1.84%	2.02%	1.67%	1.68%
Perf.	Sharpe	-0.30	0.20	0.20	0.09	0.04
	Semi-Sharpe	-0.42	0.29	0.29	0.12	0.06
	Beta	0.28	0.44	0.52	0.50	0.48

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

## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 27/02/2015



# Relatório de Performance RPPS

FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP

27/02/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 1.73	<b>PL (R\$):</b> 4,110,897,182.74
<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> 60,295,337.99	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (%):</b> 11.87	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 7,158,966.28	<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
SAFRA IMA FIC FI RF	0.93% (1)	2.64% (1)	4.13% (1)	12.30% (14)	3.15% (14)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA I FI	0.41% (11)	2.26% (2)	3.63% (2)	15.60% (11)	3.75% (3)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TP IPCA VI FI	0.41% (12)	2.22% (3)	3.47% (3)	- -	3.74% (4)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	0.38% (13)	2.13% (4)	3.34% (4)	15.88% (8)	3.67% (6)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL FI RF IMA B	0.56% (3)	1.70% (6)	2.25% (5)	16.38% (4)	3.76% (2)	ENQUADRADO
<b>FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP</b>	<b>0.51% (9)</b>	<b>1.58% (10)</b>	<b>2.24% (6)</b>	<b>16.40% (3)</b>	<b>3.58% (12)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	0.53% (6)	1.59% (9)	2.16% (7)	16.29% (5)	3.61% (9)	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	0.51% (8)	1.59% (8)	2.08% (8)	16.18% (6)	3.60% (10)	ENQUADRADO
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	0.48% (10)	1.63% (7)	1.94% (9)	16.03% (7)	3.58% (11)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	0.55% (4)	1.45% (11)	1.76% (10)	15.86% (9)	3.68% (5)	ENQUADRADO

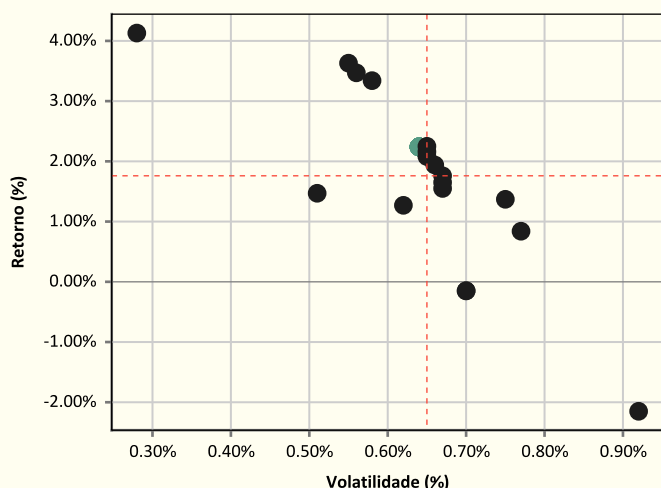
## DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.82%	2.73%	5.51%	10.95%	1.76%
IBOVESPA	9.97%	-5.74%	-15.84%	9.53%	3.15%
IBRX	9.33%	-5.61%	-15.17%	9.26%	2.90%
IBRX50	9.81%	-5.21%	-15.02%	10.26%	3.83%
IMA-B	0.54%	1.70%	2.30%	16.68%	3.68%
IRF-M	0.29%	2.02%	3.61%	11.49%	2.08%

## QUADRO DE INDICADORES

		No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Rent. (%)	Fundo	0.51%	1.58%	2.24%	16.40%	3.58%
	IMA-B	0.54%	1.70%	2.30%	16.68%	3.68%
	Performance	-3.60%	-12.12%	-5.69%	-24.60%	-9.71%
	<b>FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP</b>	<b>44.44%</b>	<b>49.18%</b>	<b>50.79%</b>	<b>48.80%</b>	<b>48.72%</b>
Vol.	Fundo	0.47%	0.44%	0.64%	0.55%	0.43%
	IMA-B	0.48%	0.45%	0.65%	0.55%	0.44%
Perf.	Sharpe	-0.00	-0.00	-0.00	-0.00	-0.01
	Semi-Sharpe	-0.01	-0.01	-0.00	-0.00	-0.01
	Beta	0.98	0.99	0.98	0.99	0.98

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



## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/01/2015

