

Relatório de Performance RPPS

BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT

30/01/2015

Categoria RPPS: 8IV	Valor da Cota: 1.16	PL (R\$): 17,612,835.79
CNPJ: 20168735000136	Qtde. de Cotas: 851,318.77	% do PL (RPPS): 5.58
Cód. Anbima: 367214	Patrim. RPPS (R\$): 58,405,447.21	Tx. de Adm.: 1.10
Gestão: BANESTES DTVM SA	Saldo RPPS (%): 1.68	Tx. de Perf.: -
Adm.: BANESTES DTVM SA	Saldo RPPS (R\$): 983,343.03	Resgate: D+3
CNPJ Gestor: 28156057000101	Índice de Ref.: CDI	Conversão de Cotas: D+1
CNPJ Adm.: 28156057000101		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
BB MULTIMERCADO MOMENTUM PRIVATE FI	6.07% (4)	15.55% (1)	21.68% (1)	-6.18% (63)	6.07% (4)	DESEQUADRADO
FI FATOR HEDGE ABSOLUTO MULTIMERCADO	1.61% (8)	3.40% (12)	12.16% (2)	16.22% (3)	1.61% (8)	DESEQUADRADO
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	8.60% (3)	5.56% (4)	9.97% (3)	15.84% (4)	8.60% (3)	ENQUADRADO
BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT	1.28% (21)	4.61% (5)	9.71% (4)	- -	1.28% (21)	ENQUADRADO
WA US INDEX 500 FI MULTI	-2.66% (62)	2.16% (41)	9.66% (5)	23.78% (1)	-2.66% (62)	ENQUADRADO
LEME FIC FI MULTIMERCADO CRED PRIVADO	-3.25% (64)	7.90% (3)	8.38% (6)	10.25% (36)	-3.25% (64)	ENQUADRADO
MODAL INST FI MULTIMERCADO	2.30% (5)	4.53% (6)	7.18% (7)	11.37% (25)	2.30% (5)	ENQUADRADO
SAFRA CARTEIRA INSTITUCIONAL FI MULTIM	1.21% (25)	3.28% (18)	7.06% (8)	12.00% (16)	1.21% (25)	ENQUADRADO
ECO HEDGE FI MULT CRED PRIV LONGO PRAZO	1.50% (15)	3.81% (7)	6.68% (9)	14.14% (7)	1.50% (15)	ENQUADRADO
GAP CRED PRIV INSTIT II FIC FI MULTIMER	1.52% (13)	3.43% (11)	6.44% (10)	14.36% (6)	1.52% (13)	ENQUADRADO

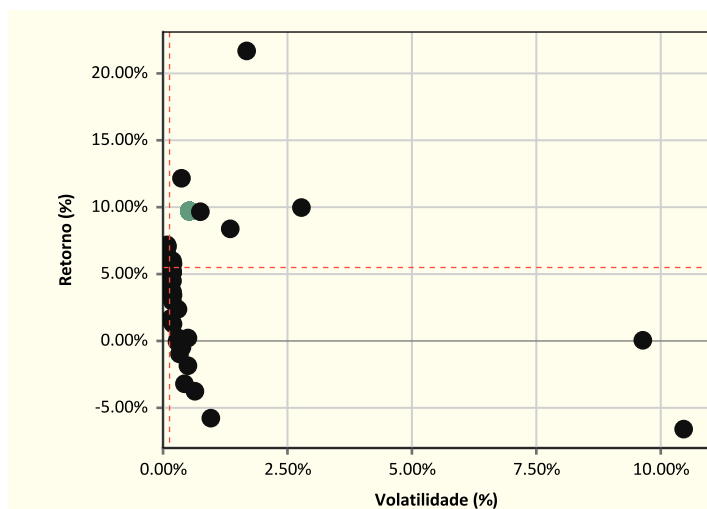
DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.93%	2.75%	5.55%	10.91%	0.93%
IBOVESPA	-6.20%	-14.13%	-15.98%	-1.53%	-6.20%
IBRX	-5.88%	-13.39%	-14.96%	-0.38%	-5.88%
IBRX50	-5.45%	-13.59%	-15.00%	0.28%	-5.45%
IMA-B	3.12%	3.32%	6.65%	21.21%	3.12%
IRF-M	1.79%	2.90%	4.95%	13.59%	1.79%

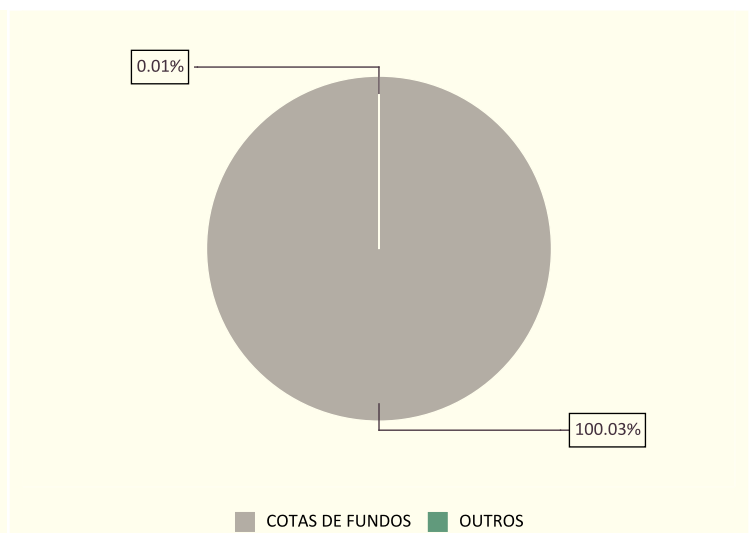
QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Rent. (%)	Fundo	1.28%	4.61%	9.71%	1.28%
	CDI	0.93%	2.75%	5.55%	10.91%
	Performance	137.85%	167.74%	174.83%	137.85%
BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT					
47.62%					
Vol.	Fundo	0.74%	0.58%	0.53%	0.74%
	CDI	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
Perf.	Sharpe	0.02	0.05	0.06	0.02
	Semi-Sharpe	0.03	0.07	0.08	0.03
	Beta	185.10	35.92	9.92	185.10

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/01/2015



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

30/01/2015

Categoria RPPS: 7III IMA-B	Valor da Cota: 4.21	PL (R\$): 106,592,956.02
CNPJ: 05357507000110	Qtde. de Cotas: 408,535.96	% do PL (RPPS): 1.61
Cód. Anbima: 247960	Patrim. RPPS (R\$): 58,405,447.21	Tx. de Adm.: 0.20
Gestão: BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO	Saldo RPPS (%): 2.94	Tx. de Perf.: -
Adm.: BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO	Saldo RPPS (R\$): 1,719,325.96	Resgate: D0
CNPJ Gestor: 28127603000178	Índice de Ref.: IMA-B	Conversão de Cotas: D0
CNPJ Adm.: 28127603000178		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
FI DIFERENCIAL RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.16% (17)	3.13% (11)	13.06% (1)	23.84% (2)	2.16% (17)	ENQUADRADO
BRADESCO FI RF IMA B	3.08% (7)	3.55% (3)	6.73% (2)	20.87% (7)	3.08% (7)	ENQUADRADO
BANRISUL PREV MUNICIPAL III FI RF LP	3.08% (6)	3.34% (4)	6.66% (3)	20.44% (13)	3.08% (6)	ENQUADRADO
CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP	3.01% (9)	3.30% (5)	6.64% (4)	20.67% (10)	3.01% (9)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	3.10% (4)	3.22% (9)	6.61% (5)	21.04% (4)	3.10% (4)	ENQUADRADO
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	3.00% (11)	3.28% (7)	6.58% (6)	20.55% (11)	3.00% (11)	ENQUADRADO
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	2.89% (12)	4.32% (1)	6.57% (7)	18.11% (15)	2.89% (12)	ENQUADRADO
FUNDO INVEST. RENDA FIXA IMA B ESLOVENIA	1.70% (20)	3.07% (12)	6.50% (8)	25.93% (1)	1.70% (20)	ENQUADRADO
UNIBANCO INDICE DE PRECOS FI RF	3.11% (3)	3.25% (8)	6.31% (9)	20.84% (8)	3.11% (3)	ENQUADRADO
MIRAE ASSET IMA B RENDA FIXA FI	3.09% (5)	3.06% (13)	6.30% (10)	20.98% (5)	3.09% (5)	ENQUADRADO

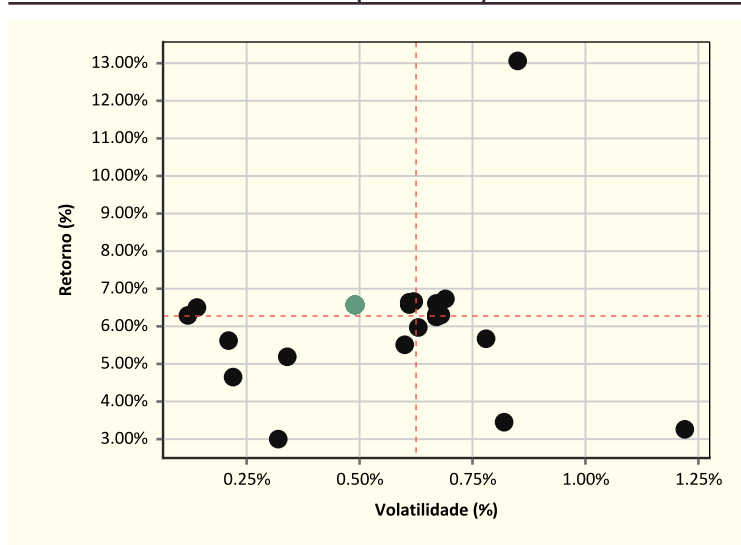
DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.93%	2.75%	5.55%	10.91%	0.93%
IBOVESPA	-6.20%	-14.13%	-15.98%	-1.53%	-6.20%
IBRX	-5.88%	-13.39%	-14.96%	-0.38%	-5.88%
IBRX50	-5.45%	-13.59%	-15.00%	0.28%	-5.45%
IMA-B	3.12%	3.32%	6.65%	21.21%	3.12%
IRF-M	1.79%	2.90%	4.95%	13.59%	1.79%

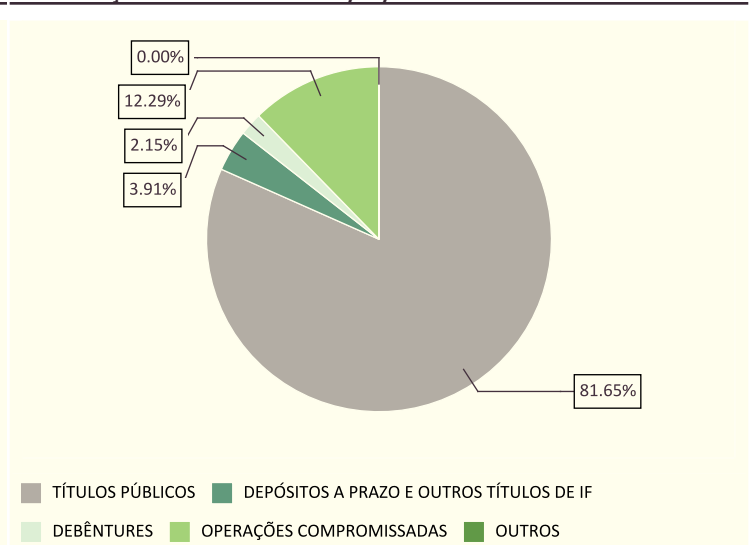
QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	2.89%	4.32%	6.57%	18.11%	2.89%
	IMA-B	3.12%	3.32%	6.65%	21.21%	3.12%
	Performance	-21.79%	96.26%	-6.78%	-255.54%	-21.79%
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA						
42.86%						
Vol.	Fundo	0.38%	0.47%	0.49%	0.39%	0.38%
	IMA-B	0.39%	0.53%	0.67%	0.55%	0.39%
Perf.	Sharpe	-0.03	0.03	-0.00	-0.03	-0.03
	Semi-Sharpe	-0.04	0.05	-0.00	-0.04	-0.04
	Beta	-0.14	0.11	-0.01	0.01	-0.14

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/01/2015



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

30/01/2015

Categoria RPPS: 7IB IMA-B	Valor da Cota: 3.02	PL (R\$): 5,058,128,461.18
CNPJ: 07442078000105	Qtde. de Cotas: 10,493,545.49	% do PL (RPPS): 0.63
Cód. Anbima: 242901	Patrim. RPPS (R\$): 58,405,447.21	Tx. de Adm.: 0.20
Gestão: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (%): 54.27	Tx. de Perf.: -
Adm.: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (R\$): 31,696,961.84	Resgate: 1
CNPJ Gestor: 30822936000169	Índice de Ref.: IMA-B	Conversão de Cotas: 1
CNPJ Adm.: 30822936000169		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	3.28% (8)	3.46% (6)	6.92% (1)	21.38% (3)	3.28% (8)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA I FI	3.33% (6)	3.55% (3)	6.85% (2)	21.00% (5)	3.33% (6)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TP IPCA VI FI	3.33% (7)	3.49% (5)	6.80% (3)	- -	3.33% (7)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	3.05% (18)	3.19% (13)	6.50% (4)	20.86% (6)	3.05% (18)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL FI RF IMA B	3.18% (9)	3.19% (12)	6.48% (5)	21.06% (4)	3.18% (9)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	3.06% (17)	3.16% (14)	6.45% (6)	20.75% (7)	3.06% (17)	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	3.08% (16)	3.21% (11)	6.41% (7)	20.67% (8)	3.08% (16)	ENQUADRADO
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	3.09% (14)	3.25% (10)	6.38% (8)	20.58% (9)	3.09% (14)	ENQUADRADO
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	3.11% (12)	4.09% (2)	6.17% (9)	20.20% (12)	3.11% (12)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	3.12% (10)	3.02% (16)	5.93% (10)	20.53% (10)	3.12% (10)	ENQUADRADO

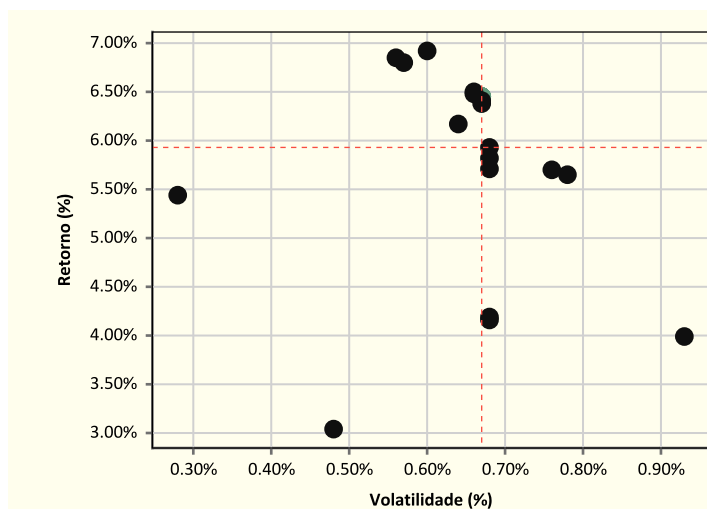
DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.93%	2.75%	5.55%	10.91%	0.93%
IBOVESPA	-6.20%	-14.13%	-15.98%	-1.53%	-6.20%
IBRX	-5.88%	-13.39%	-14.96%	-0.38%	-5.88%
IBRX50	-5.45%	-13.59%	-15.00%	0.28%	-5.45%
IMA-B	3.12%	3.32%	6.65%	21.21%	3.12%
IRF-M	1.79%	2.90%	4.95%	13.59%	1.79%

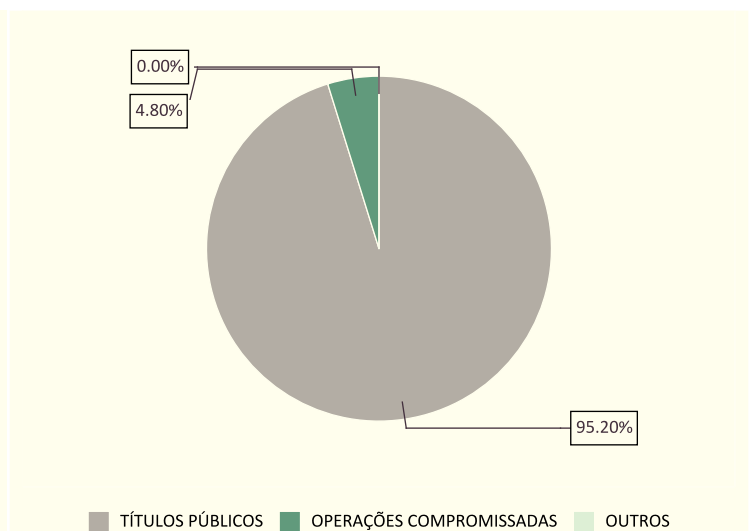
QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	3.06%	3.16%	6.45%	20.75%	3.06%
	IMA-B	3.12%	3.32%	6.65%	21.21%	3.12%
	Performance	-5.55%	-15.16%	-18.33%	-37.80%	-5.55%
	BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	28.57%	26.98%	37.21%	29.76%	28.57%
Vol.	Fundo	0.39%	0.52%	0.67%	0.54%	0.39%
	IMA-B	0.39%	0.53%	0.67%	0.55%	0.39%
Perf.	Sharpe	-0.01	-0.00	-0.00	-0.00	-0.01
	Semi-Sharpe	-0.01	-0.01	-0.00	-0.00	-0.01
	Beta	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/01/2015



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 TIT PUB IPCA II FI

30/01/2015

Categoria RPPS: 7IB IDKA IPCA 3A	Valor da Cota: 1.16	PL (R\$): 934,819,154.16
CNPJ: 19303794000190	Qtde. de Cotas: 2,903,722.57	% do PL (RPPS): 0.36
Cód. Anbima: 359831	Patrim. RPPS (R\$): 58,405,447.21	Tx. de Adm.: 0.15
Gestão: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (%): 5.76	Tx. de Perf.: -
Adm.: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (R\$): 3,363,875.81	Resgate: 0
CNPJ Gestor: 30822936000169	Índice de Ref.: IDKA IPCA 3A	Conversão de Cotas: 0
CNPJ Adm.: 30822936000169		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI	2.57% (1)	3.23% (1)	5.51% (1)	- -	2.57% (1)	ENQUADRADO

DADOS DE MERCADO

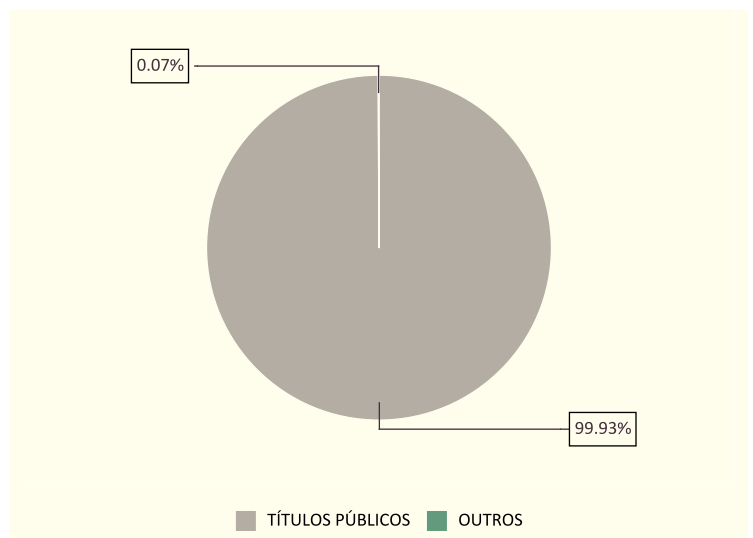
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.93%	2.75%	5.55%	10.91%	0.93%
IBOVESPA	-6.20%	-14.13%	-15.98%	-1.53%	-6.20%
IBRX	-5.88%	-13.39%	-14.96%	-0.38%	-5.88%
IBRX50	-5.45%	-13.59%	-15.00%	0.28%	-5.45%
IMA-B	3.12%	3.32%	6.65%	21.21%	3.12%
IRF-M	1.79%	2.90%	4.95%	13.59%	1.79%

QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Rent. (%)	Fundo	2.57%	3.23%	5.51%	2.57%
	IDKA IPCA 3A	2.02%	2.67%	4.79%	15.72%
	Performance	54.08%	54.64%	68.71%	54.08%
	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI	57.14%	44.44%	46.51%	44.84%
Vol.	Fundo	0.19%	0.22%	0.30%	0.19%
	IDKA IPCA 3A	0.21%	0.21%	0.25%	0.23%
Perf.	Sharpe	0.13	0.04	0.02	0.13
	Semi-Sharpe	0.18	0.06	0.02	0.18
	Beta	0.71	0.96	1.05	0.71

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)

COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/01/2015



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

30/01/2015

Categoria RPPS: 7IV CDI	Valor da Cota: 1.42	PL (R\$): 4,739,335,736.22
CNPJ: 13077418000149	Qtde. de Cotas: 2,385,315.28	% do PL (RPPS): 0.07
Cód. Anbima: 272493	Patrim. RPPS (R\$): 58,405,447.21	Tx. de Adm.: 0.30
Gestão: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (%): 5.79	Tx. de Perf.: -
Adm.: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (R\$): 3,384,199.45	Resgate: 0
CNPJ Gestor: 30822936000169	Índice de Ref.: CDI	Conversão de Cotas: 0
CNPJ Adm.: 30822936000169		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
SAFRA CART CORP RF FC FI	1.23% (5)	2.91% (3)	5.91% (1)	11.46% (4)	1.23% (5)	ENQUADRADO
ITAU REFERENCIADO DI FI	0.95% (14)	2.82% (4)	5.68% (2)	11.17% (6)	0.95% (14)	ENQUADRADO
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0.94% (24)	2.79% (8)	5.67% (3)	11.13% (8)	0.94% (24)	ENQUADRADO
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	0.94% (22)	2.80% (7)	5.67% (4)	11.17% (7)	0.94% (22)	ENQUADRADO
HSBC FI REFERENCIADO DI LP	0.96% (12)	2.81% (5)	5.65% (5)	11.09% (9)	0.96% (12)	ENQUADRADO
BNP PARIBAS TARGUS DI FIC FI REFER	0.94% (26)	2.78% (10)	5.64% (6)	11.05% (14)	0.94% (26)	ENQUADRADO
UNIBANCO INSTITUCIONAL DI FI REF	0.95% (19)	2.81% (6)	5.64% (7)	11.07% (11)	0.95% (19)	ENQUADRADO
SANT FIC FI CORPORATE REF DI	0.94% (27)	2.77% (14)	5.63% (8)	11.05% (13)	0.94% (27)	ENQUADRADO
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0.94% (23)	2.78% (12)	5.61% (9)	11.07% (10)	0.94% (23)	ENQUADRADO
AVANTI FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0.93% (31)	2.78% (11)	5.61% (10)	10.91% (23)	0.93% (31)	ENQUADRADO

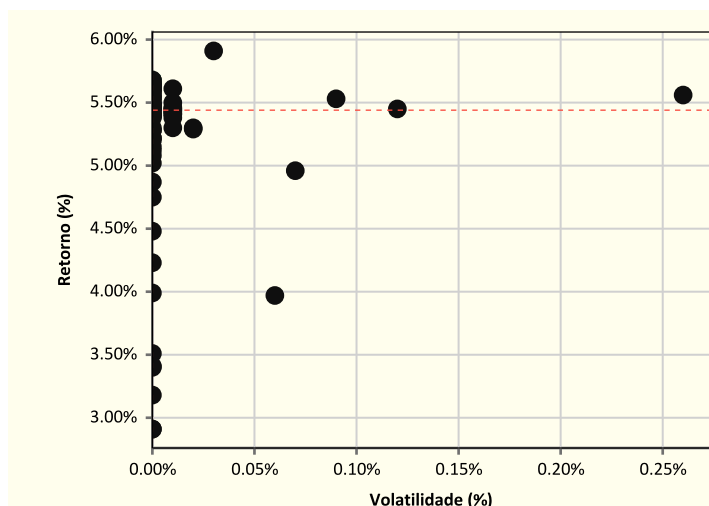
DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.93%	2.75%	5.55%	10.91%	0.93%
IBOVESPA	-6.20%	-14.13%	-15.98%	-1.53%	-6.20%
IBRX	-5.88%	-13.39%	-14.96%	-0.38%	-5.88%
IBRX50	-5.45%	-13.59%	-15.00%	0.28%	-5.45%
IMA-B	3.12%	3.32%	6.65%	21.21%	3.12%
IRF-M	1.79%	2.90%	4.95%	13.59%	1.79%

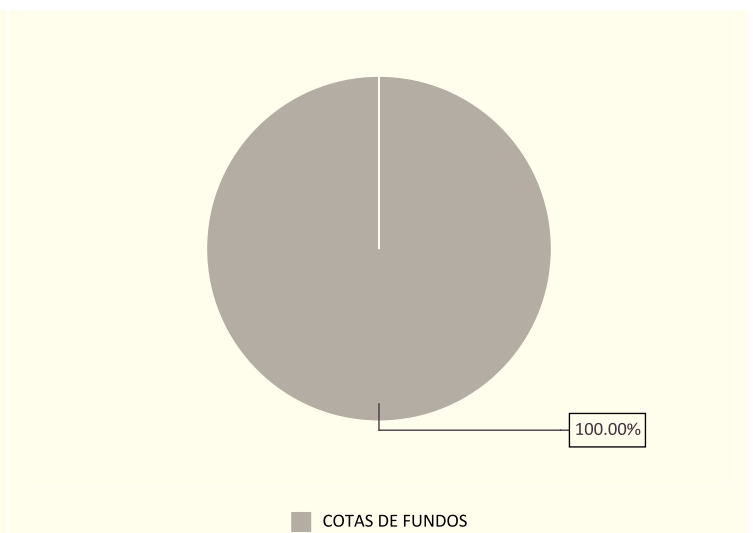
QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	0.94%	2.80%	5.67%	11.17%	0.94%
	CDI	0.93%	2.75%	5.55%	10.91%	0.93%
	Performance	101.21%	102.02%	102.07%	102.37%	101.21%
	BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	61.90%	61.90%	62.02%	64.68%	61.90%
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	0.17	0.18	0.24	0.20
	Semi-Sharpe	0.25	0.24	0.27	0.36	0.25
	Beta	0.36	1.68	1.20	0.97	0.36

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/01/2015



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 ALIANCA TITULOS PUBLICOS RF

30/01/2015

Categoria RPPS: 7IV CDI	Valor da Cota: 2.64	PL (R\$): 454,918,107.76
CNPJ: 05164358000173	Qtde. de Cotas: 1,308,292.77	% do PL (RPPS): 0.76
Cód. Anbima: 157252	Patrim. RPPS (R\$): 58,405,447.21	Tx. de Adm.: 0.20
Gestão: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (%): 5.92	Tx. de Perf.: -
Adm.: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (R\$): 3,455,855.35	Resgate: 0
CNPJ Gestor: 360305000104	Índice de Ref.: CDI	Conversão de Cotas: 0
CNPJ Adm.: 360305000104		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
SAFRA CART CORP RF FC FI	1.23% (5)	2.91% (3)	5.91% (1)	11.46% (4)	1.23% (5)	ENQUADRADO
ITAU REFERENCIADO DI FI	0.95% (14)	2.82% (4)	5.68% (2)	11.17% (6)	0.95% (14)	ENQUADRADO
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0.94% (24)	2.79% (8)	5.67% (3)	11.13% (8)	0.94% (24)	ENQUADRADO
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	0.94% (22)	2.80% (7)	5.67% (4)	11.17% (7)	0.94% (22)	ENQUADRADO
HSBC FI REFERENCIADO DI LP	0.96% (12)	2.81% (5)	5.65% (5)	11.09% (9)	0.96% (12)	ENQUADRADO
BNP PARIBAS TARGUS DI FIC FI REFER	0.94% (26)	2.78% (10)	5.64% (6)	11.05% (14)	0.94% (26)	ENQUADRADO
UNIBANCO INSTITUCIONAL DI FI REF	0.95% (19)	2.81% (6)	5.64% (7)	11.07% (11)	0.95% (19)	ENQUADRADO
SANT FIC FI CORPORATE REF DI	0.94% (27)	2.77% (14)	5.63% (8)	11.05% (13)	0.94% (27)	ENQUADRADO
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0.94% (23)	2.78% (12)	5.61% (9)	11.07% (10)	0.94% (23)	ENQUADRADO
AVANTI FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0.93% (31)	2.78% (11)	5.61% (10)	10.91% (23)	0.93% (31)	ENQUADRADO
CAIXA FI ALIANCA TITULOS PUBLICOS RF	0.98% (9)	2.76% (17)	5.45% (32)	10.93% (20)	0.98% (9)	ENQUADRADO

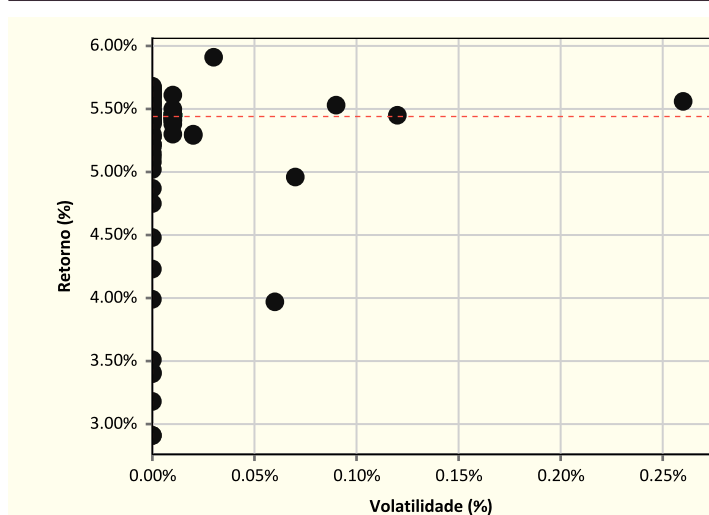
DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.93%	2.75%	5.55%	10.91%	0.93%
IBOVESPA	-6.20%	-14.13%	-15.98%	-1.53%	-6.20%
IBRX	-5.88%	-13.39%	-14.96%	-0.38%	-5.88%
IBRX50	-5.45%	-13.59%	-15.00%	0.28%	-5.45%
IMA-B	3.12%	3.32%	6.65%	21.21%	3.12%
IRF-M	1.79%	2.90%	4.95%	13.59%	1.79%

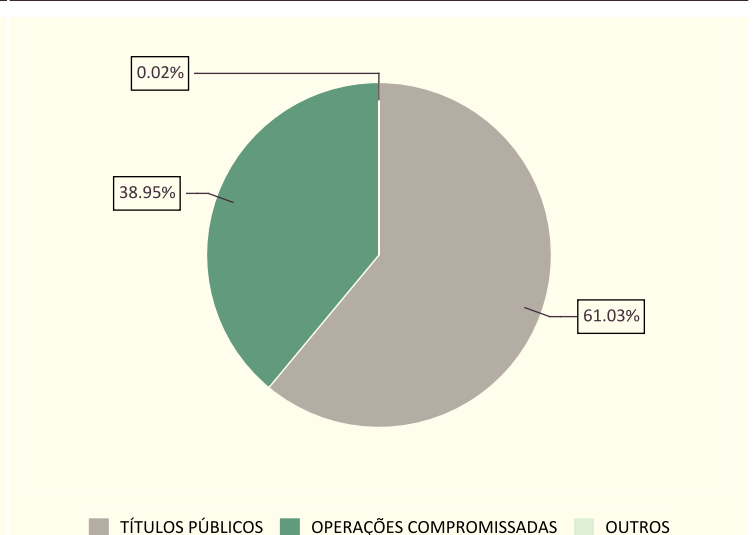
QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Ret. (%)					
Fundo	0.98%	2.76%	5.45%	10.93%	0.98%
CDI	0.93%	2.75%	5.55%	10.91%	0.93%
Performance	105.55%	100.28%	98.17%	100.19%	105.55%
CAIXA FI ALIANCA TITULOS PUBLICOS RF	57.14%	47.62%	43.41%	45.24%	57.14%
Vol.					
Fundo	0.01%	0.01%	0.01%	0.01%	0.01%
CDI	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
Perf.					
Sharpe	0.42	0.02	-0.07	0.01	0.42
Semi-Sharpe	0.61	0.02	-0.10	0.01	0.61
Beta	-2.50	1.02	1.48	0.56	-2.50

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/01/2015



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

30/01/2015

Categoria RPPS: 7IB IMA-B	Valor da Cota: 1.15	PL (R\$): 308,280,087.05
CNPJ: 18598288000103	Qtde. de Cotas: 816,910.12	% do PL (RPPS): 0.31
Cód. Anbima: 359947	Patrim. RPPS (R\$): 58,405,447.21	Tx. de Adm.: 0.20
Gestão: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (%): 1.61	Tx. de Perf.: -
Adm.: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (R\$): 942,329.51	Resgate: 0
CNPJ Gestor: 360305000104	Índice de Ref.: IMA-B	Conversão de Cotas: 0
CNPJ Adm.: 360305000104		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	3.28% (8)	3.46% (6)	6.92% (1)	21.38% (3)	3.28% (8)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA I FI	3.33% (6)	3.55% (3)	6.85% (2)	21.00% (5)	3.33% (6)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TP IPCA VI FI	3.33% (7)	3.49% (5)	6.80% (3)	- -	3.33% (7)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	3.05% (18)	3.19% (13)	6.50% (4)	20.86% (6)	3.05% (18)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL FI RF IMA B	3.18% (9)	3.19% (12)	6.48% (5)	21.06% (4)	3.18% (9)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	3.06% (17)	3.16% (14)	6.45% (6)	20.75% (7)	3.06% (17)	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	3.08% (16)	3.21% (11)	6.41% (7)	20.67% (8)	3.08% (16)	ENQUADRADO
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	3.09% (14)	3.25% (10)	6.38% (8)	20.58% (9)	3.09% (14)	ENQUADRADO
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	3.11% (12)	4.09% (2)	6.17% (9)	20.20% (12)	3.11% (12)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	3.12% (10)	3.02% (16)	5.93% (10)	20.53% (10)	3.12% (10)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	3.42% (4)	3.37% (7)	4.19% (16)	15.44% (14)	3.42% (4)	ENQUADRADO

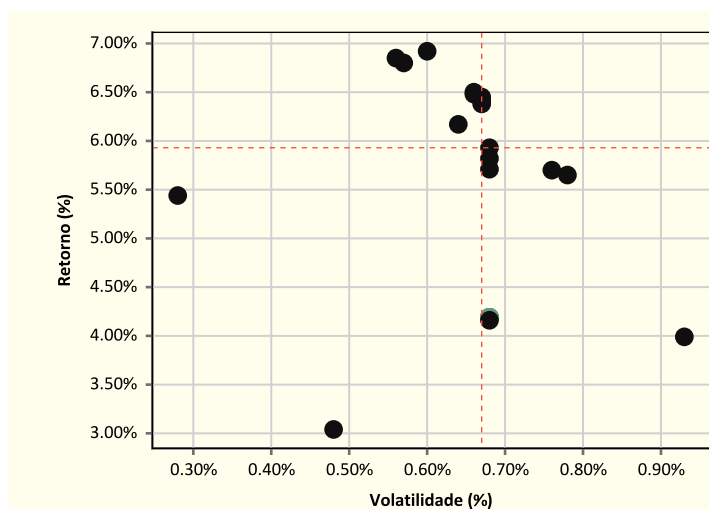
DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.93%	2.75%	5.55%	10.91%	0.93%
IBOVESPA	-6.20%	-14.13%	-15.98%	-1.53%	-6.20%
IBRX	-5.88%	-13.39%	-14.96%	-0.38%	-5.88%
IBRX50	-5.45%	-13.59%	-15.00%	0.28%	-5.45%
IMA-B	3.12%	3.32%	6.65%	21.21%	3.12%
IRF-M	1.79%	2.90%	4.95%	13.59%	1.79%

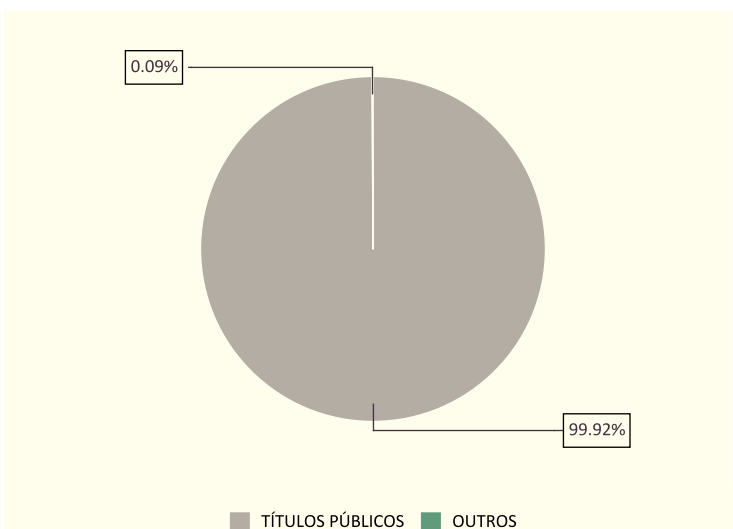
QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	3.42%	3.37%	4.19%	15.44%	3.42%
	IMA-B	3.12%	3.32%	6.65%	21.21%	3.12%
	Performance	29.66%	4.36%	-230.32%	-475.35%	29.66%
	CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	57.14%	52.38%	48.84%	48.81%	57.14%
Vol.	Fundo	0.42%	0.55%	0.68%	0.60%	0.42%
	IMA-B	0.39%	0.53%	0.67%	0.55%	0.39%
Perf.	Sharpe	0.03	0.00	-0.03	-0.03	0.03
	Semi-Sharpe	0.05	0.00	-0.04	-0.04	0.05
	Beta	1.04	1.02	0.93	0.98	1.04

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/01/2015



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

30/01/2015

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: 1.09
 Qtde. de Cotas: 1,000,000.00
 Patrim. RPPS (R\$): 58,405,447.21
 Saldo RPPS (%): 1.86
 Saldo RPPS (R\$): 1,085,050.00
 Índice de Ref.: IBOVESPA

PL (R\$): 39,170,313.49
 % 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	-5.75% (1)	-9.24% (1)	-9.23% (1)	1.31% (1)	-5.75% (1)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	-6.09% (3)	-9.86% (2)	-11.61% (2)	-1.04% (6)	-6.09% (3)	ENQUADRADO
ITAU FOF RPI 30 MASTER ACOES FI	-6.16% (4)	-11.58% (4)	-12.23% (3)	-0.05% (3)	-6.16% (4)	ENQUADRADO
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-6.41% (10)	-11.03% (3)	-12.33% (4)	-0.74% (4)	-6.41% (10)	ENQUADRADO
ITAU FOF RPI 30 ACOES FICFI	-6.25% (6)	-11.87% (6)	-12.87% (5)	-1.22% (7)	-6.25% (6)	ENQUADRADO
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	-6.94% (16)	-11.66% (5)	-13.85% (6)	-0.86% (5)	-6.94% (16)	ENQUADRADO
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	-5.94% (2)	-12.44% (7)	-14.75% (7)	-1.26% (8)	-5.94% (2)	ENQUADRADO
BRADESCO FIC DE FIA IBOVESPA ATIVO	-6.26% (7)	-13.54% (9)	-15.70% (8)	-3.36% (13)	-6.26% (7)	ENQUADRADO
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	-6.19% (5)	-14.11% (12)	-16.03% (9)	-1.75% (9)	-6.19% (5)	ENQUADRADO
CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA	-7.41% (17)	-13.44% (8)	-16.04% (10)	-1.80% (10)	-7.41% (17)	ENQUADRADO

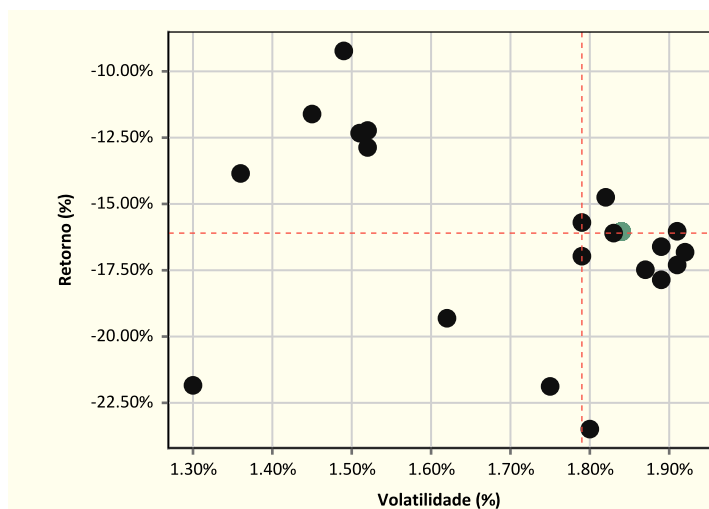
DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.93%	2.75%	5.55%	10.91%	0.93%
IBOVESPA	-6.20%	-14.13%	-15.98%	-1.53%	-6.20%
IBRX	-5.88%	-13.39%	-14.96%	-0.38%	-5.88%
IBRX50	-5.45%	-13.59%	-15.00%	0.28%	-5.45%
IMA-B	3.12%	3.32%	6.65%	21.21%	3.12%
IRF-M	1.79%	2.90%	4.95%	13.59%	1.79%

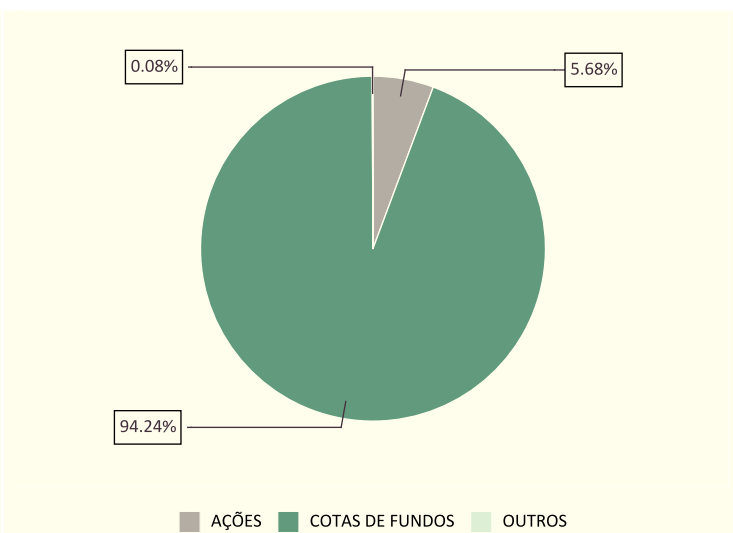
QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	-7.41%	-13.44%	-16.04%	-1.80%	-7.41%
	IBOVESPA	-6.20%	-14.13%	-15.98%	-1.53%	-6.20%
	Performance	-128.79%	80.83%	-7.18%	-26.79%	-128.79%
CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA						
Vol.	Fundo	1.61%	1.70%	1.84%	1.55%	1.61%
	IBOVESPA	1.67%	1.76%	1.91%	1.61%	1.67%
Perf.	Sharpe	-0.04	0.01	-0.00	-0.00	-0.04
	Semi-Sharpe	-0.06	0.01	-0.00	-0.00	-0.06
	Beta	0.95	0.93	0.93	0.91	0.95

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/01/2015



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 FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS

30/01/2015

Categoria RPPS: 8III IDIV	Valor da Cota: 0.98	PL (R\$): 299,921,198.02
CNPJ: 15154441000115	Qtde. de Cotas: 3,497,256.96	% do PL (RPPS): 1.14
Cód. Anbima: 311383	Patrim. RPPS (R\$): 58,405,447.21	Tx. de Adm.: 1.72
Gestão: VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA	Saldo RPPS (%): 5.87	Tx. de Perf.: 20% que exceder 100% do Outros
Adm.: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (R\$): 3,425,496.74	Resgate: 33
CNPJ Gestor: 10917835000164	Índice de Ref.: IDIV	Conversão de Cotas: 30
CNPJ Adm.: 360305000104		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
FI FATOR ACOES DIVIDENDOS	-1.70% (1)	-4.36% (2)	-3.98% (1)	5.74% (7)	-1.70% (1)	ENQUADRADO
CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FIA	-5.60% (11)	-4.99% (4)	-4.54% (2)	9.35% (1)	-5.60% (11)	ENQUADRADO
FIA PETREO DIVIDENDOS	-3.70% (7)	-6.74% (9)	-4.71% (3)	-0.27% (12)	-3.70% (7)	DESENQUADRADO
VINCI GAS DIVIDENDOS FI EM ACOES	-3.13% (4)	-5.22% (6)	-4.92% (4)	7.98% (2)	-3.13% (4)	ENQUADRADO
CSHG DIVIDENDOS FIC FI EM ACOES	-5.98% (13)	-9.59% (10)	-5.36% (5)	2.36% (10)	-5.98% (13)	DESENQUADRADO
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	-5.74% (12)	-5.40% (7)	-5.39% (6)	6.73% (3)	-5.74% (12)	ENQUADRADO
LMX PACTUAL DIVIDENDOS FI DE ACOES	-2.03% (2)	-3.71% (1)	-5.44% (7)	6.12% (6)	-2.03% (2)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	-3.25% (5)	-4.93% (3)	-5.86% (8)	6.49% (4)	-3.25% (5)	ENQUADRADO
FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	-3.27% (6)	-5.00% (5)	-6.00% (9)	6.25% (5)	-3.27% (6)	ENQUADRADO
WA DIVIDEND YIELD FIA	-2.80% (3)	-6.15% (8)	-7.67% (10)	2.46% (9)	-2.80% (3)	ENQUADRADO

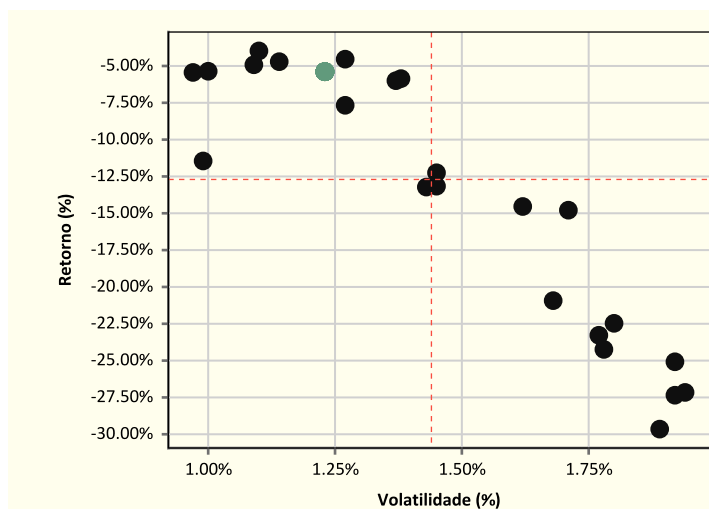
DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.93%	2.75%	5.55%	10.91%	0.93%
IBOVESPA	-6.20%	-14.13%	-15.98%	-1.53%	-6.20%
IBRX	-5.88%	-13.39%	-14.96%	-0.38%	-5.88%
IBRX50	-5.45%	-13.59%	-15.00%	0.28%	-5.45%
IMA-B	3.12%	3.32%	6.65%	21.21%	3.12%
IRF-M	1.79%	2.90%	4.95%	13.59%	1.79%

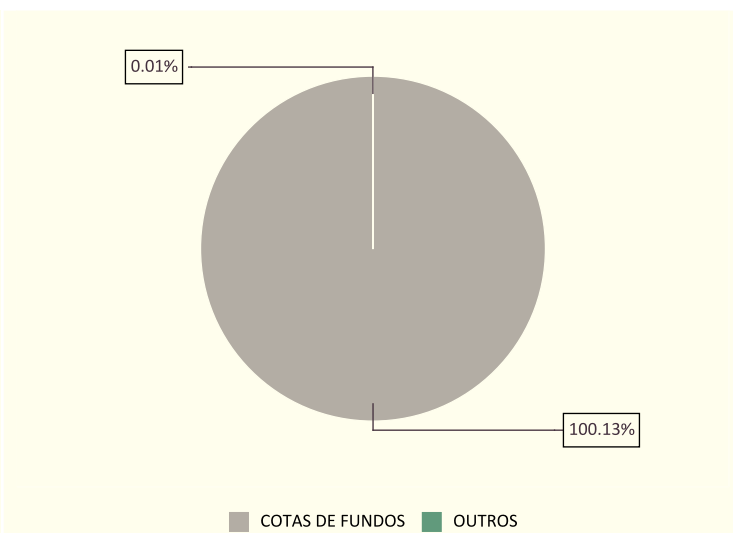
QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	-5.74%	-5.40%	-5.39%	6.73%	-5.74%
	IDIV	-11.18%	-23.08%	-31.86%	-21.50%	-11.18%
	Performance	611.89%	2,298.99%	3,884.79%	3,596.88%	611.89%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS						
Vol.	Fundo	1.25%	1.05%	1.23%	1.03%	1.25%
	IDIV	1.73%	1.88%	1.99%	1.66%	1.73%
Perf.	Sharpe	0.23	0.31	0.21	0.12	0.23
	Semi-Sharpe	0.32	0.45	0.30	0.17	0.32
	Beta	0.59	0.44	0.52	0.52	0.59

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/01/2015



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

FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP

30/01/2015

Categoria RPPS: 7IB IMA-B	Valor da Cota: 1.73	PL (R\$): 4,013,605,262.98
CNPJ: 10740658000193	Qtde. de Cotas: 4,128,168.31	% do PL (RPPS): 0.18
Cód. Anbima: 244120	Patrim. RPPS (R\$): 58,405,447.21	Tx. de Adm.: 0.20
Gestão: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (%): 12.20	Tx. de Perf.: -
Adm.: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (R\$): 7,122,840.67	Resgate: 0
CNPJ Gestor: 360305000104	Índice de Ref.: IMA-B	Conversão de Cotas: 0
CNPJ Adm.: 360305000104		

FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	3.28% (8)	3.46% (6)	6.92% (1)	21.38% (3)	3.28% (8)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA I FI	3.33% (6)	3.55% (3)	6.85% (2)	21.00% (5)	3.33% (6)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF TP IPCA VI FI	3.33% (7)	3.49% (5)	6.80% (3)	- -	3.33% (7)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	3.05% (18)	3.19% (13)	6.50% (4)	20.86% (6)	3.05% (18)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL FI RF IMA B	3.18% (9)	3.19% (12)	6.48% (5)	21.06% (4)	3.18% (9)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	3.06% (17)	3.16% (14)	6.45% (6)	20.75% (7)	3.06% (17)	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	3.08% (16)	3.21% (11)	6.41% (7)	20.67% (8)	3.08% (16)	ENQUADRADO
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	3.09% (14)	3.25% (10)	6.38% (8)	20.58% (9)	3.09% (14)	ENQUADRADO
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	3.11% (12)	4.09% (2)	6.17% (9)	20.20% (12)	3.11% (12)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	3.12% (10)	3.02% (16)	5.93% (10)	20.53% (10)	3.12% (10)	ENQUADRADO

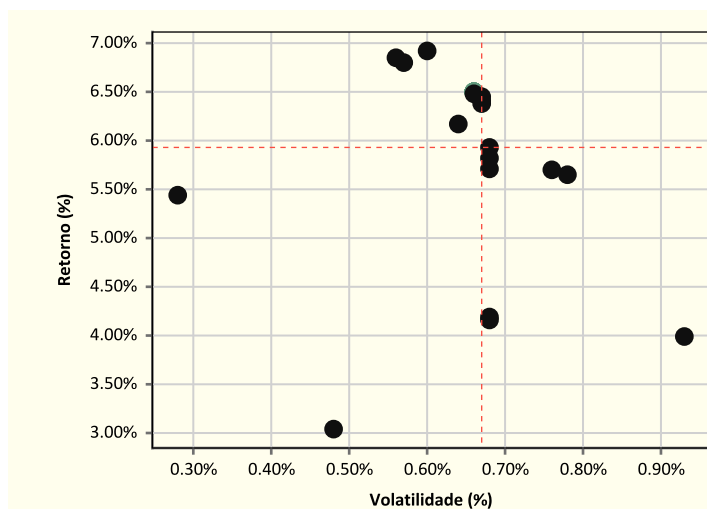
DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	0.93%	2.75%	5.55%	10.91%	0.93%
IBOVESPA	-6.20%	-14.13%	-15.98%	-1.53%	-6.20%
IBRX	-5.88%	-13.39%	-14.96%	-0.38%	-5.88%
IBRX50	-5.45%	-13.59%	-15.00%	0.28%	-5.45%
IMA-B	3.12%	3.32%	6.65%	21.21%	3.12%
IRF-M	1.79%	2.90%	4.95%	13.59%	1.79%

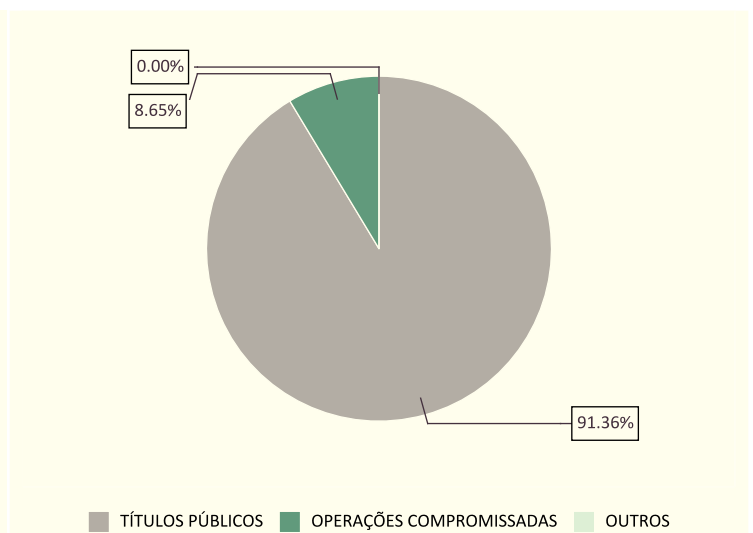
QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	3.05%	3.19%	6.50%	20.86%	3.05%
	IMA-B	3.12%	3.32%	6.65%	21.21%	3.12%
	Performance	-6.12%	-12.66%	-13.58%	-28.17%	-6.12%
	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	52.38%	49.21%	51.16%	48.41%	52.38%
Vol.	Fundo	0.38%	0.52%	0.66%	0.54%	0.38%
	IMA-B	0.39%	0.53%	0.67%	0.55%	0.39%
Perf.	Sharpe	-0.01	-0.00	-0.00	-0.00	-0.01
	Semi-Sharpe	-0.01	-0.01	-0.00	-0.00	-0.01
	Beta	0.97	0.99	0.98	0.99	0.97

DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (Em 6 Meses)



COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/01/2015



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.