

# Relatório de Performance RPPS



## BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT

30/06/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 8IV	<b>Valor da Cota:</b> 1.26	<b>PL (R\$):</b> 19,041,736.27
<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> 65,356,973.60	<b>Tx. de Adm.:</b> 1.10
<b>Gestão:</b> BANESTES DTVM SA	<b>Saldo RPPS (%):</b> 1.64	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BANESTES DTVM SA	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 1,068,973.29	<b>Resgate:</b> D+3
<b>CNPJ Gestor:</b> 28156057000101	<b>Índice de Ref.:</b> CDI	<b>Conversão de Cotas:</b> D+1
<b>CNPJ Adm.:</b> 28156057000101		

### FUNDOS DA CATEGORIA

FUNDO	No Mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	Status
INFINITY EAGLE FI MULTIMERCADO	1.50% (2)	4.34% (3)	25.99% (1)	0.53% (59)	25.99% (1)	DESEQUADRADO
INFINITY UNIQUE FI MULTIMERCADO	1.29% (8)	4.83% (2)	22.38% (2)	8.18% (46)	22.38% (2)	DESEQUADRADO
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.18% (17)	4.00% (8)	15.69% (3)	17.71% (4)	15.69% (3)	ENQUADRADO
<b>BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT</b>	<b>0.89% (40)</b>	<b>3.87% (12)</b>	<b>10.10% (4)</b>	<b>22.22% (2)</b>	<b>10.10% (4)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
ECO HEDGE FI MULT CRED PRIV LONGO PRAZO	1.42% (4)	4.15% (6)	9.59% (5)	16.32% (5)	9.59% (5)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA V MULT CR D PRIV	1.27% (10)	4.23% (5)	9.13% (6)	15.00% (7)	9.13% (6)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA VI MULTI CR D PRIV	1.26% (11)	4.23% (4)	9.11% (7)	14.98% (8)	9.11% (7)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA IV MULTI CRED PRIV	1.26% (12)	3.98% (9)	9.04% (8)	14.95% (9)	9.04% (8)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA III MULT CRED PRIV	1.26% (13)	3.98% (10)	9.03% (9)	14.95% (10)	9.03% (9)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL IPCA VIII MULT CRED PRIV	1.27% (9)	4.10% (7)	9.03% (10)	14.92% (11)	9.03% (10)	ENQUADRADO

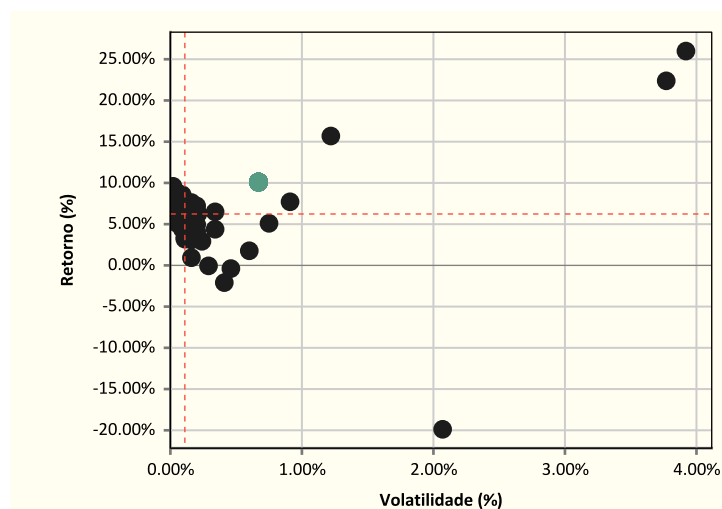
### DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.07%	3.03%	5.92%	11.82%	5.92%
IBOVESPA	0.61%	3.77%	6.15%	-0.17%	6.15%
IBRX	0.76%	3.94%	6.41%	0.43%	6.41%
IBRX50	0.64%	3.68%	6.71%	0.95%	6.71%
IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%	8.34%
IRF-M	0.32%	3.07%	5.18%	9.68%	5.18%

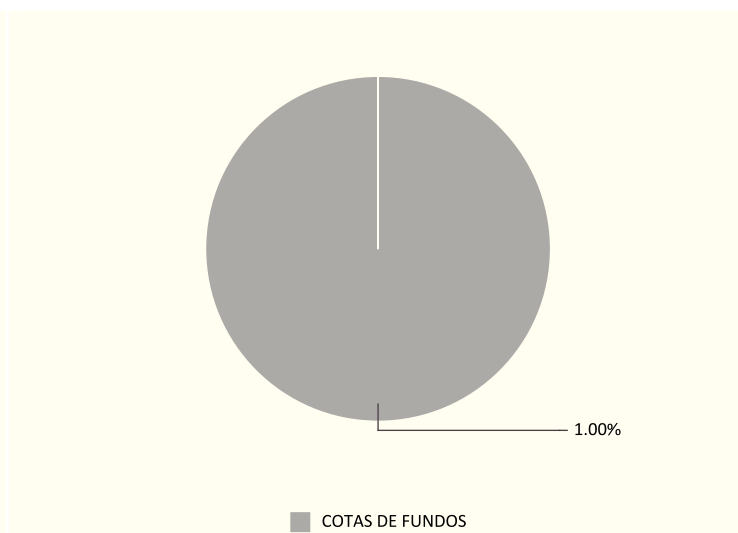
### QUADRO DE INDICADORES

		No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Rent. (%)	Fundo	0.89%	3.87%	10.10%	22.22%	10.10%
	CDI	1.07%	3.03%	5.92%	11.82%	5.92%
	Performance	83.27%	127.70%	170.54%	188.02%	170.54%
	Sucesso	23.81%	40.98%	45.90%	47.43%	45.90%
Vol.	Fundo	0.10%	0.50%	0.67%	0.59%	0.67%
	CDI	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
Perf.	Sharpe	-0.08	0.03	0.05	0.06	0.05
	Semi-Sharpe	-0.12	0.04	0.07	0.09	0.07
	Beta	-70.74	-17.19	-6.26	-1.52	-6.26

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



### COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/06/2015



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade da Risk Office, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação. Os dados de mercado utilizados para verificação do enquadramento foram obtidos junto a fontes públicas nas quais a Risk Office deposita confiança. Entretanto, a Risk Office não se responsabiliza pela acurácia desses dados. Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.

# Relatório de Performance RPPS



## BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA

30/06/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7III IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 4.44	<b>PL (R\$):</b> 105,004,143.79
<b>CNPJ:</b> 05357507000110	<b>Qtde. de Cotas:</b> 506,449.04	<b>% do PL (RPPS):</b> 2.14
<b>Cód. Anbima:</b> 247960	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 65,356,973.60	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO	<b>Saldo RPPS (%):</b> 3.44	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 2,249,381.09	<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
HSBC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PRECOS	-0.38% (17)	4.15% (14)	8.82% (1)	11.13% (17)	8.82% (1)	ENQUADRADO
<b>BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA</b>	<b>-0.51% (19)</b>	<b>5.66% (1)</b>	<b>8.59% (2)</b>	<b>13.64% (2)</b>	<b>8.59% (2)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
CAIXA FI MASTER BRASIL IMA B RF LP	-0.21% (7)	4.70% (10)	8.57% (3)	13.61% (3)	8.57% (3)	ENQUADRADO
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	-0.22% (8)	4.68% (11)	8.52% (4)	13.49% (6)	8.52% (4)	ENQUADRADO
BANRISUL PREV MUNICIPAL III FI RF LP	-0.22% (9)	5.17% (3)	8.52% (5)	13.53% (5)	8.52% (5)	ENQUADRADO
BRDESCO FI RF IMA B	-0.26% (12)	4.95% (5)	8.43% (6)	13.55% (4)	8.43% (6)	ENQUADRADO
MIRAE ASSET IMA B RENDA FIXA FI	-0.26% (11)	5.19% (2)	8.37% (7)	12.98% (10)	8.37% (7)	ENQUADRADO
UNIBANCO INDICE DE PRECOS FI RF	-0.33% (15)	4.78% (9)	8.30% (8)	12.92% (11)	8.30% (8)	ENQUADRADO
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IMA B LP	-0.17% (6)	4.93% (6)	8.21% (9)	13.23% (8)	8.21% (9)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	-0.29% (14)	4.82% (7)	8.21% (10)	13.16% (9)	8.21% (10)	ENQUADRADO

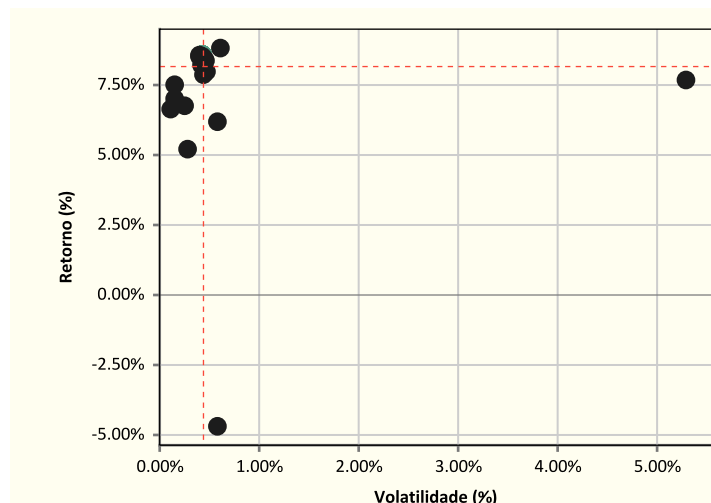
### DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.07%	3.03%	5.92%	11.82%	5.92%
IBOVESPA	0.61%	3.77%	6.15%	-0.17%	6.15%
IBRX	0.76%	3.94%	6.41%	0.43%	6.41%
IBRX50	0.64%	3.68%	6.71%	0.95%	6.71%
IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%	8.34%
IRF-M	0.32%	3.07%	5.18%	9.68%	5.18%

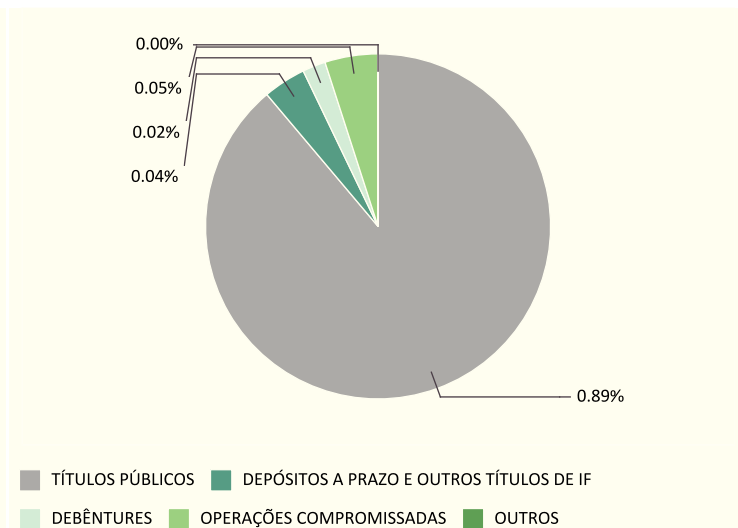
### QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	-0.51%	5.66%	8.59%	13.64%	8.59%
	IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%	8.34%
	Performance	-0.24%	0.83%	0.23%	0.29%	0.23%
	Sucesso	47.62%	49.18%	50.00%	51.78%	50.00%
Vol.	Fundo	0.30%	0.41%	0.43%	0.45%	0.43%
	IMA-B	0.30%	0.41%	0.43%	0.56%	0.43%
Perf.	Sharpe	-0.04	0.03	0.00	0.00	0.00
	Semi-Sharpe	-0.05	0.05	0.01	0.00	0.01
	Beta	-0.04	0.01	-0.04	-0.01	-0.04

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



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



# Relatório de Performance RPPS



## BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI

30/06/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 3.17	<b>PL (R\$):</b> 5,459,523,033.35
<b>CNPJ:</b> 07442078000105	<b>Qtde. de Cotas:</b> 10,493,545.49	<b>% do PL (RPPS):</b> 0.61
<b>Cód. Anbima:</b> 242901	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 65,356,973.60	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (%):</b> 50.95	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 33,300,162.50	<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	-0.69% (19)	6.82% (1)	9.32% (1)	13.92% (1)	9.32% (1)	ENQUADRADO
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	-0.83% (20)	4.00% (14)	8.46% (2)	11.52% (13)	8.46% (2)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	-0.27% (10)	4.86% (5)	8.41% (3)	12.56% (7)	8.41% (3)	ENQUADRADO
BRB RENDA FIXA IMA B	-0.32% (16)	5.19% (3)	8.31% (4)	11.32% (15)	8.31% (4)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	-0.29% (12)	4.80% (7)	8.30% (5)	12.33% (8)	8.30% (5)	ENQUADRADO
<b>BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI</b>	<b>-0.28% (11)</b>	<b>4.85% (6)</b>	<b>8.27% (6)</b>	<b>13.07% (2)</b>	<b>8.27% (6)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	-0.30% (14)	4.90% (4)	8.26% (7)	12.95% (3)	8.26% (7)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B TIT PUB RF LONGO PRAZO	-0.31% (15)	4.76% (8)	8.20% (8)	12.10% (9)	8.20% (8)	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	-0.30% (13)	4.67% (9)	8.09% (9)	12.80% (5)	8.09% (9)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	-0.43% (18)	4.57% (10)	7.96% (10)	12.86% (4)	7.96% (10)	ENQUADRADO

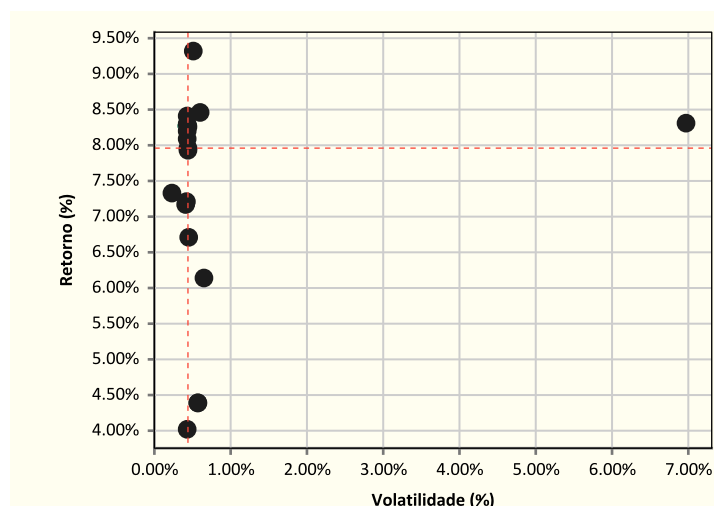
### DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.07%	3.03%	5.92%	11.82%	5.92%
IBOVESPA	0.61%	3.77%	6.15%	-0.17%	6.15%
IBRX	0.76%	3.94%	6.41%	0.43%	6.41%
IBRX50	0.64%	3.68%	6.71%	0.95%	6.71%
IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%	8.34%
IRF-M	0.32%	3.07%	5.18%	9.68%	5.18%

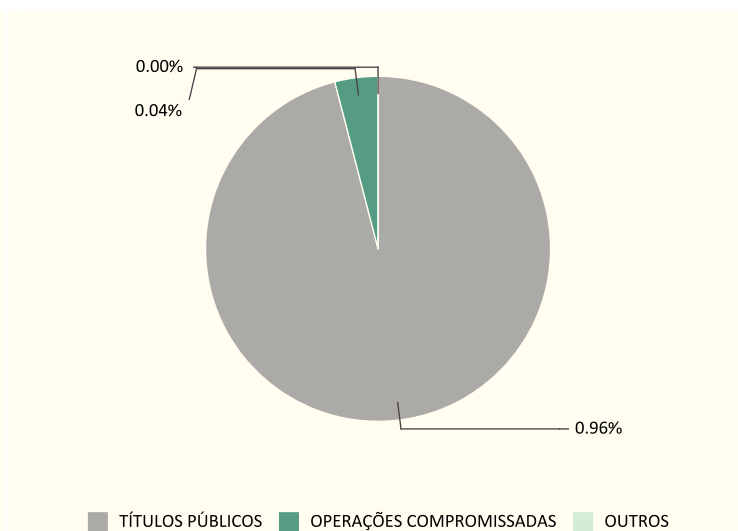
### QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	-0.28%	4.85%	8.27%	13.07%	8.27%
	IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%	8.34%
	Performance	-0.01%	0.06%	-0.06%	-0.21%	-0.06%
	Sucesso	47.62%	47.54%	40.98%	39.92%	40.98%
Vol.	Fundo	0.30%	0.41%	0.43%	0.56%	0.43%
	IMA-B	0.30%	0.41%	0.43%	0.56%	0.43%
Perf.	Sharpe	-0.00	0.00	-0.00	-0.00	-0.00
	Semi-Sharpe	-0.00	0.00	-0.00	-0.00	-0.00
	Beta	0.99	1.00	1.00	1.00	1.00

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



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



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade da Risk Office, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação. Os dados de mercado utilizados para verificação do enquadramento foram obtidos junto a fontes públicas nas quais a Risk Office deposita confiança. Entretanto, a Risk Office não se responsabiliza pela acurácia desses dados. Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.

# Relatório de Performance RPPS



BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI

30/06/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IDKA IPCA 3A	<b>Valor da Cota:</b> 1.21	<b>PL (R\$):</b> 951,362,340.48
<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> 65,356,973.60	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.15
<b>Gestão:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (%):</b> 5.24	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 3,423,405.21	<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	0.64% (1)	3.03% (1)	7.38% (1)	11.46% (1)	7.38% (1)	ENQUADRADO

## DADOS DE MERCADO

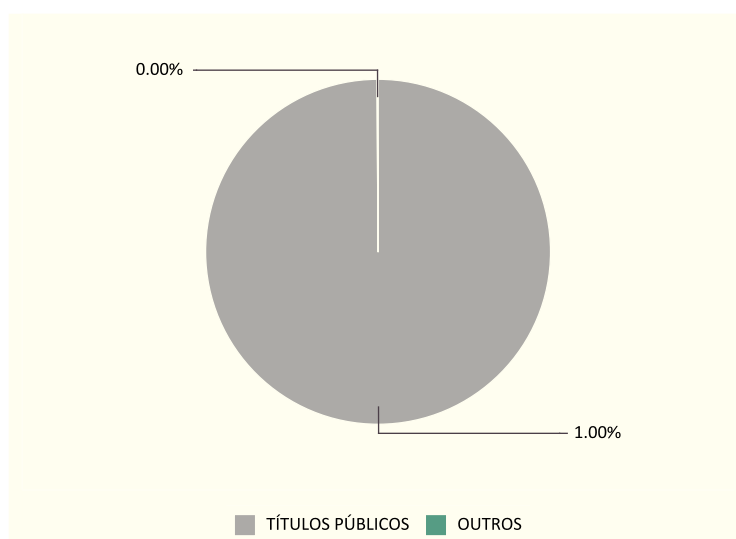
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.07%	3.03%	5.92%	11.82%	5.92%
IBOVESPA	0.61%	3.77%	6.15%	-0.17%	6.15%
IBRX	0.76%	3.94%	6.41%	0.43%	6.41%
IBRX50	0.64%	3.68%	6.71%	0.95%	6.71%
IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%	8.34%
IRF-M	0.32%	3.07%	5.18%	9.68%	5.18%

## QUADRO DE INDICADORES

		No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Rent. (%)	Fundo	0.64%	3.03%	7.38%	11.46%	7.38%
	IDKA IPCA 3A	0.51%	3.08%	7.62%	11.45%	7.62%
	Performance	0.12%	-0.05%	-0.22%	0.01%	-0.22%
	Sucesso	52.38%	54.10%	51.64%	47.43%	51.64%
Vol.	Fundo	0.13%	0.21%	0.22%	0.26%	0.22%
	IDKA IPCA 3A	0.15%	0.23%	0.24%	0.24%	0.24%
Perf.	Sharpe	0.05	-0.00	-0.01	0.00	-0.01
	Semi-Sharpe	0.07	-0.01	-0.01	0.00	-0.01
	Beta	0.84	0.89	0.82	0.96	0.82

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

## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/06/2015



# Relatório de Performance RPPS



## BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI

30/06/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IV CDI	<b>Valor da Cota:</b> 1.49	<b>PL (R\$):</b> 7,007,151,750.44
<b>CNPJ:</b> 13077418000149	<b>Qtde. de Cotas:</b> 4,212,253.77	<b>% do PL (RPPS):</b> 0.09
<b>Cód. Anbima:</b> 272493	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 65,356,973.60	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.30
<b>Gestão:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (%):</b> 9.61	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 6,279,067.69	<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	1.09% (8)	3.24% (3)	8.81% (1)	12.31% (2)	8.81% (1)	ENQUADRADO
CAIXA FIC PATRIMONIO IND PRECOS RF LP	0.56% (76)	2.70% (66)	6.68% (2)	11.65% (28)	6.68% (2)	ENQUADRADO
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	1.13% (2)	3.26% (2)	6.53% (3)	12.72% (1)	6.53% (3)	ENQUADRADO
WA RENDA FIXA ATIVO FI	0.78% (68)	3.26% (1)	6.50% (4)	11.55% (39)	6.50% (4)	ENQUADRADO
SAFRA CART CORP RF FC FI	0.94% (62)	2.95% (38)	6.41% (5)	12.27% (3)	6.41% (5)	ENQUADRADO
<b>BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI</b>	<b>1.09% (7)</b>	<b>3.12% (5)</b>	<b>6.06% (6)</b>	<b>12.07% (4)</b>	<b>6.06% (6)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
HSBC FI REFERENCIADO DI LP	1.09% (6)	3.07% (9)	6.04% (7)	12.02% (7)	6.04% (7)	ENQUADRADO
SANTANDER FICFI INSTITUCIONAL REF DI	1.09% (9)	3.10% (6)	6.03% (8)	12.00% (8)	6.03% (8)	ENQUADRADO
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.09% (4)	3.08% (7)	6.02% (9)	11.99% (9)	6.02% (9)	ENQUADRADO
ITAU REFERENCIADO DI FI	1.08% (11)	3.06% (12)	6.01% (10)	12.04% (6)	6.01% (10)	ENQUADRADO

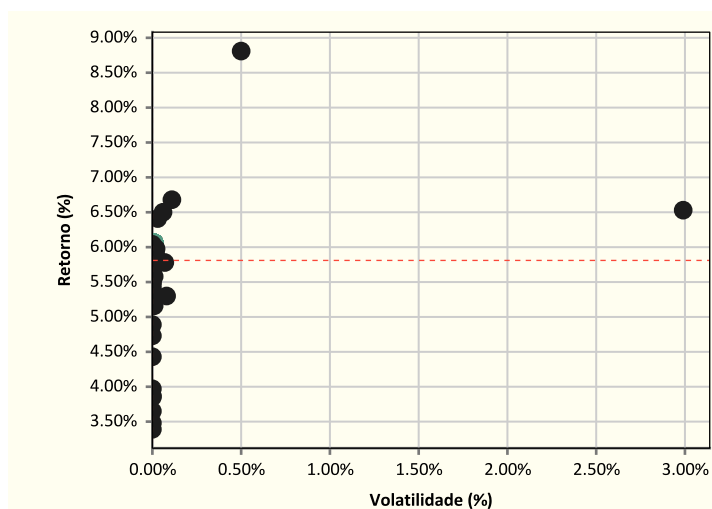
### DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.07%	3.03%	5.92%	11.82%	5.92%
IBOVESPA	0.61%	3.77%	6.15%	-0.17%	6.15%
IBRX	0.76%	3.94%	6.41%	0.43%	6.41%
IBRX50	0.64%	3.68%	6.71%	0.95%	6.71%
IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%	8.34%
IRF-M	0.32%	3.07%	5.18%	9.68%	5.18%

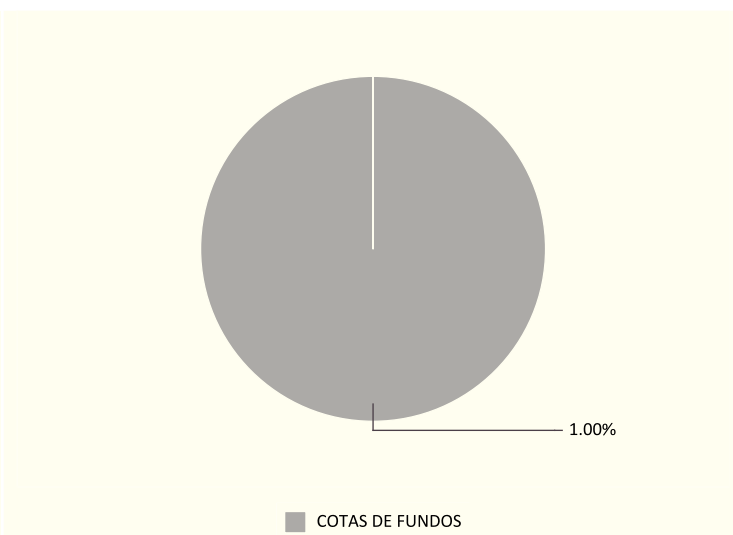
### QUADRO DE INDICADORES

		No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Rent. (%)	Fundo	1.09%	3.12%	6.06%	12.07%	6.06%
	CDI	1.07%	3.03%	5.92%	11.82%	5.92%
	Performance	102.12%	103.20%	102.25%	102.19%	102.25%
	Sucesso	80.95%	80.33%	70.49%	66.40%	70.49%
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	0.72	0.56	0.26	0.17	0.26
	Semi-Sharpe	1.00	0.72	0.35	0.25	0.35
	Beta	1.02	0.87	1.14	1.09	1.14

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



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



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade da Risk Office, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação.

Os dados de mercado utilizados para verificação do enquadramento foram obtidos junto a fontes públicas nas quais a Risk Office deposita confiança. Entretanto, a Risk Office não se responsabiliza pela acurácia desses dados.

Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.

# Relatório de Performance RPPS



## CAIXA FI ALIANCA TITULOS PUBLICOS RF

30/06/2015

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: 2.77

Qtde. de Cotas: 86,644.32

Patrim. RPPS (R\$): 65,356,973.60

Saldo RPPS (%): 0.37

Saldo RPPS (R\$): 239,769.44

Índice de Ref.: CDI

PL (R\$): 339,762,703.36

% do PL (RPPS): 0.07

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
INFINITY LOTUS FIRF	1.09% (8)	3.24% (3)	8.81% (1)	12.31% (2)	8.81% (1)	ENQUADRADO
CAIXA FIC PATRIMONIO IND PRECOS RF LP	0.56% (76)	2.70% (66)	6.68% (2)	11.65% (28)	6.68% (2)	ENQUADRADO
FICFI RF DI LP 1 MILHAO	1.13% (2)	3.26% (2)	6.53% (3)	12.72% (1)	6.53% (3)	ENQUADRADO
WA RENDA FIXA ATIVO FI	0.78% (68)	3.26% (1)	6.50% (4)	11.55% (39)	6.50% (4)	ENQUADRADO
SAFRA CART CORP RF FC FI	0.94% (62)	2.95% (38)	6.41% (5)	12.27% (3)	6.41% (5)	ENQUADRADO
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	1.09% (7)	3.12% (5)	6.06% (6)	12.07% (4)	6.06% (6)	ENQUADRADO
HSBC FI REFERENCIADO DI LP	1.09% (6)	3.07% (9)	6.04% (7)	12.02% (7)	6.04% (7)	ENQUADRADO
SANTANDER FICFI INSTITUCIONAL REF DI	1.09% (9)	3.10% (6)	6.03% (8)	12.00% (8)	6.03% (8)	ENQUADRADO
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.09% (4)	3.08% (7)	6.02% (9)	11.99% (9)	6.02% (9)	ENQUADRADO
ITAU REFERENCIADO DI FI	1.08% (11)	3.06% (12)	6.01% (10)	12.04% (6)	6.01% (10)	ENQUADRADO
CAIXA FI ALIANCA TITULOS PUBLICOS RF	1.00% (55)	2.92% (49)	5.79% (44)	11.55% (37)	5.79% (44)	ENQUADRADO

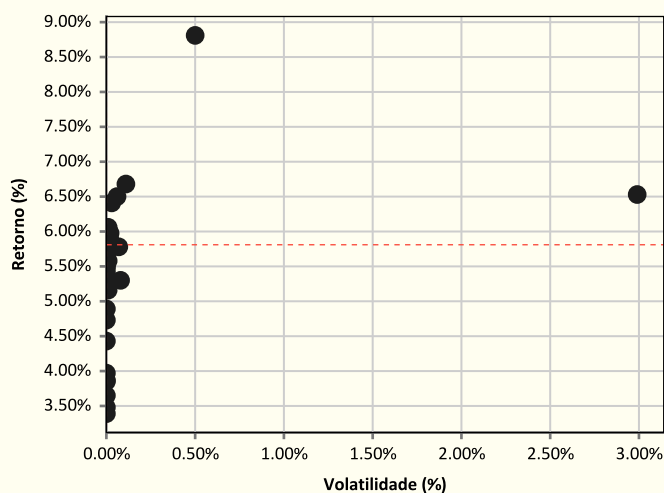
### DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.07%	3.03%	5.92%	11.82%	5.92%
IBOVESPA	0.61%	3.77%	6.15%	-0.17%	6.15%
IBRX	0.76%	3.94%	6.41%	0.43%	6.41%
IBRX50	0.64%	3.68%	6.71%	0.95%	6.71%
IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%	8.34%
IRF-M	0.32%	3.07%	5.18%	9.68%	5.18%

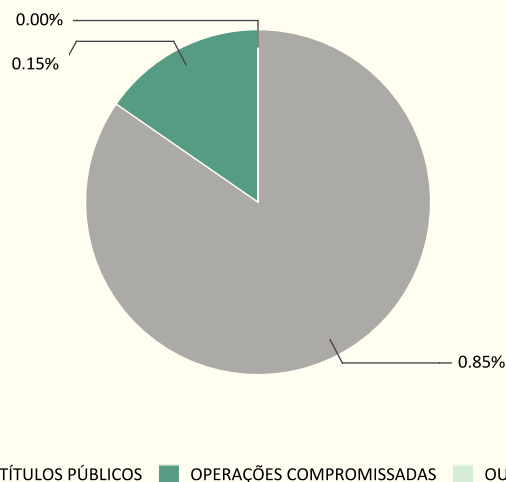
### QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	1.00%	2.92%	5.79%	11.55%	5.79%
	CDI	1.07%	3.03%	5.92%	11.82%	5.92%
	Performance	93.71%	96.50%	97.75%	97.75%	97.75%
	Sucesso	42.86%	40.98%	46.72%	45.06%	46.72%
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	-0.27	-0.19	-0.12	-0.10	-0.12
	Semi-Sharpe	-0.38	-0.27	-0.16	-0.13	-0.16
	Beta	5.05	1.11	0.42	0.84	0.42

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



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



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade da Risk Office, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação.

Os dados de mercado utilizados para verificação do enquadramento foram obtidos junto a fontes públicas nas quais a Risk Office deposita confiança. Entretanto, a Risk Office não se responsabiliza pela acurácia desses dados.

Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.

# Relatório de Performance RPPS



CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF

30/06/2015

Categoria RPPS: 7IB IMA-B  
 CNPJ: 18598288000103  
 Cód. Anbima: 359947  
 Gestão: CAIXA ECONOMICA FEDERAL  
 Adm.: CAIXA ECONOMICA FEDERAL  
 CNPJ Gestor: 360305000104  
 CNPJ Adm.: 360305000104

Valor da Cota: 1.16  
 Qtd. de Cotas: 816,910.12  
 Patrim. RPPS (R\$): 65,356,973.60  
 Saldo RPPS (%): 1.46  
 Saldo RPPS (R\$): 951,149.69  
 Índice de Ref.: IMA-B

PL (R\$): 311,165,599.24  
 % do PL (RPPS): 0.31  
 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
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	-0.69% (19)	6.82% (1)	9.32% (1)	13.92% (1)	9.32% (1)	ENQUADRADO
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	-0.83% (20)	4.00% (14)	8.46% (2)	11.52% (13)	8.46% (2)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	-0.27% (10)	4.86% (5)	8.41% (3)	12.56% (7)	8.41% (3)	ENQUADRADO
BRB RENDA FIXA IMA B	-0.32% (16)	5.19% (3)	8.31% (4)	11.32% (15)	8.31% (4)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	-0.29% (12)	4.80% (7)	8.30% (5)	12.33% (8)	8.30% (5)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	-0.28% (11)	4.85% (6)	8.27% (6)	13.07% (2)	8.27% (6)	ENQUADRADO
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	-0.30% (14)	4.90% (4)	8.26% (7)	12.95% (3)	8.26% (7)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B TIT PUB RF LONGO PRAZO	-0.31% (15)	4.76% (8)	8.20% (8)	12.10% (9)	8.20% (8)	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	-0.30% (13)	4.67% (9)	8.09% (9)	12.80% (5)	8.09% (9)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	-0.43% (18)	4.57% (10)	7.96% (10)	12.86% (4)	7.96% (10)	ENQUADRADO
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	0.29% (4)	4.14% (12)	4.39% (18)	6.31% (17)	4.39% (18)	ENQUADRADO

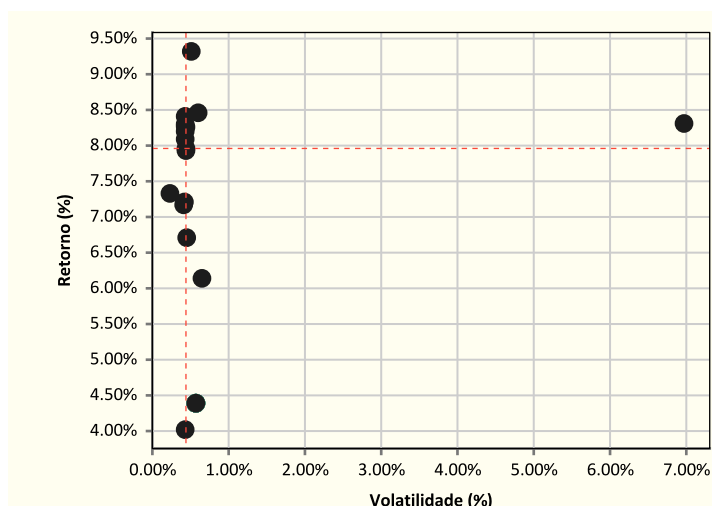
## DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.07%	3.03%	5.92%	11.82%	5.92%
IBOVESPA	0.61%	3.77%	6.15%	-0.17%	6.15%
IBRX	0.76%	3.94%	6.41%	0.43%	6.41%
IBRX50	0.64%	3.68%	6.71%	0.95%	6.71%
IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%	8.34%
IRF-M	0.32%	3.07%	5.18%	9.68%	5.18%

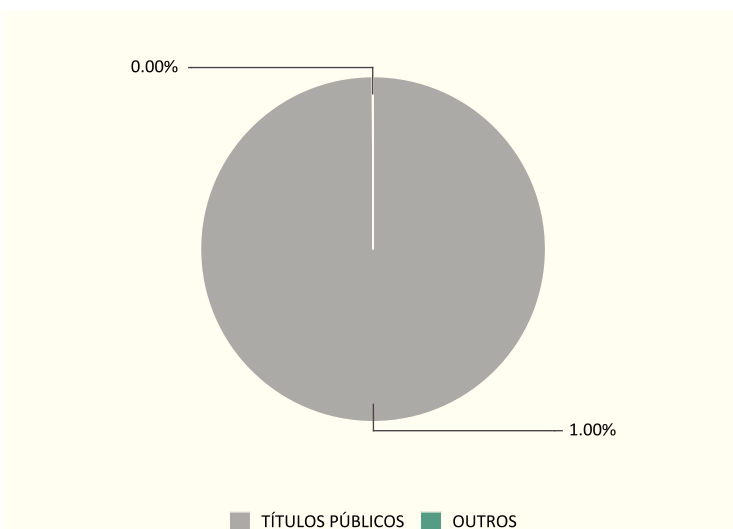
## QUADRO DE INDICADORES

		No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Rent. (%)	Fundo	0.29%	4.14%	4.39%	6.31%	4.39%
	IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%	8.34%
	Performance	0.56%	-0.63%	-3.64%	-6.18%	-3.64%
	Sucesso	57.14%	52.46%	53.28%	49.80%	53.28%
Vol.	Fundo	0.32%	0.46%	0.57%	0.63%	0.57%
	IMA-B	0.30%	0.41%	0.43%	0.56%	0.43%
Perf.	Sharpe	0.08	-0.02	-0.05	-0.04	-0.05
	Semi-Sharpe	0.11	-0.03	-0.07	-0.05	-0.07
	Beta	0.98	1.09	1.12	0.98	1.12

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



## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 30/06/2015



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade da Risk Office, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação. Os dados de mercado utilizados para verificação do enquadramento foram obtidos junto a fontes públicas nas quais a Risk Office deposita confiança. Entretanto, a Risk Office não se responsabiliza pela acurácia desses dados. Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.



# Relatório de Performance RPPS



## CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA

30/06/2015

**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:** 1.23  
**Qtde. de Cotas:** 1,000,000.00  
**Patrim. RPPS (R\$):** 65,356,973.60  
**Saldo RPPS (%):** 1.88  
**Saldo RPPS (R\$):** 1,225,794.00  
**Índice de Ref.:** IBOVESPA

**PL (R\$):** 41,723,042.12  
**% 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
BRDESCO FIA IBOVESPA PLUS	0.64% (5)	3.83% (2)	6.25% (1)	-0.16% (2)	6.25% (1)	ENQUADRADO
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	1.07% (2)	2.67% (12)	5.72% (2)	1.06% (1)	5.72% (2)	ENQUADRADO
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	0.44% (11)	3.27% (5)	5.06% (3)	-0.24% (3)	5.06% (3)	ENQUADRADO
HSBC FI EM ACOES IBOVESPA TOP	0.42% (14)	3.18% (7)	4.86% (4)	-2.18% (11)	4.86% (4)	ENQUADRADO
BRDESCO FIC DE FIA IBOVESPA INDEXADO	0.39% (16)	3.10% (8)	4.72% (5)	-3.12% (13)	4.72% (5)	ENQUADRADO
<b>CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA</b>	<b>0.43% (12)</b>	<b>3.34% (4)</b>	<b>4.60% (6)</b>	<b>-0.34% (4)</b>	<b>4.60% (6)</b>	<b>ENQUADRADO</b>
BB ACOES IBOVESPA INDEXADO FICFI	0.31% (17)	2.83% (9)	4.47% (7)	-2.57% (12)	4.47% (7)	ENQUADRADO
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	0.42% (15)	3.26% (6)	4.42% (8)	-0.43% (5)	4.42% (8)	ENQUADRADO
BRDESCO PRIVATE FIA IBOVESPA ALAVANCADO	0.42% (13)	2.43% (14)	4.42% (9)	-4.31% (15)	4.42% (9)	ENQUADRADO
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	0.70% (3)	2.61% (13)	4.38% (10)	-0.79% (7)	4.38% (10)	ENQUADRADO

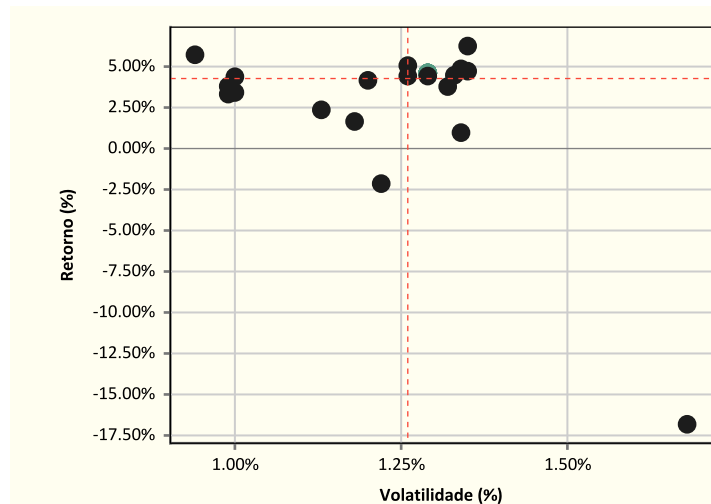
### DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.07%	3.03%	5.92%	11.82%	5.92%
IBOVESPA	0.61%	3.77%	6.15%	-0.17%	6.15%
IBRX	0.76%	3.94%	6.41%	0.43%	6.41%
IBRX50	0.64%	3.68%	6.71%	0.95%	6.71%
IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%	8.34%
IRF-M	0.32%	3.07%	5.18%	9.68%	5.18%

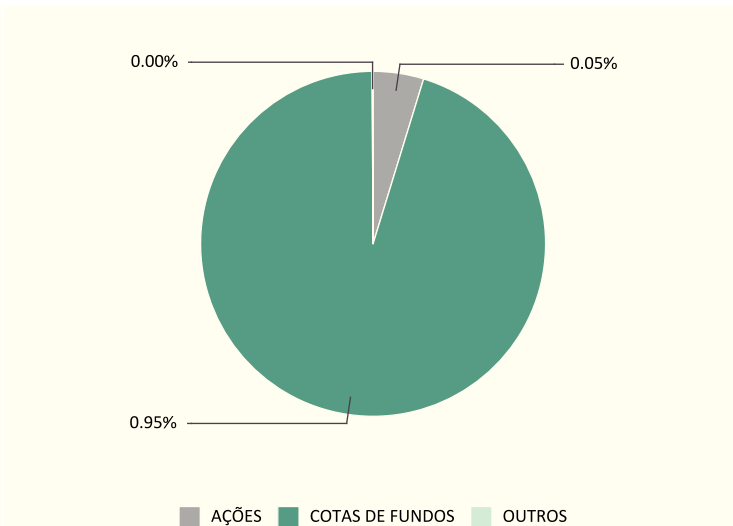
### QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	0.43%	3.34%	4.60%	-0.34%	4.60%
	IBOVESPA	0.61%	3.77%	6.15%	-0.17%	6.15%
	Performance	-0.18%	-0.42%	-1.45%	-0.17%	-1.45%
	Sucesso	47.62%	50.82%	51.64%	52.57%	51.64%
Vol.	Fundo	0.90%	1.06%	1.29%	1.55%	1.29%
	IBOVESPA	1.12%	1.19%	1.35%	1.62%	1.35%
Perf.	Sharpe	-0.01	-0.01	-0.01	-0.00	-0.01
	Semi-Sharpe	-0.01	-0.01	-0.01	-0.00	-0.01
	Beta	0.64	0.82	0.90	0.92	0.90

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



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



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade da Risk Office, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação. Os dados de mercado utilizados para verificação do enquadramento foram obtidos junto a fontes públicas nas quais a Risk Office deposita confiança. Entretanto, a Risk Office não se responsabiliza pela acurácia desses dados. Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.



# Relatório de Performance RPPS



FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF

30/06/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 1.02	<b>PL (R\$):</b> 241,607,189.85
<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> 65,356,973.60	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (%):</b> 6.54	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 4,277,526.17	<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	-0.69% (19)	6.82% (1)	9.32% (1)	13.92% (1)	9.32% (1)	ENQUADRADO
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	-0.83% (20)	4.00% (14)	8.46% (2)	11.52% (13)	8.46% (2)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	-0.27% (10)	4.86% (5)	8.41% (3)	12.56% (7)	8.41% (3)	ENQUADRADO
BRB RENDA FIXA IMA B	-0.32% (16)	5.19% (3)	8.31% (4)	11.32% (15)	8.31% (4)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	-0.29% (12)	4.80% (7)	8.30% (5)	12.33% (8)	8.30% (5)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	-0.28% (11)	4.85% (6)	8.27% (6)	13.07% (2)	8.27% (6)	ENQUADRADO
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	-0.30% (14)	4.90% (4)	8.26% (7)	12.95% (3)	8.26% (7)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B TIT PUB RF LONGO PRAZO	-0.31% (15)	4.76% (8)	8.20% (8)	12.10% (9)	8.20% (8)	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	-0.30% (13)	4.67% (9)	8.09% (9)	12.80% (5)	8.09% (9)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	-0.43% (18)	4.57% (10)	7.96% (10)	12.86% (4)	7.96% (10)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF	0.54% (2)	- -	- -	- -	- -	ENQUADRADO

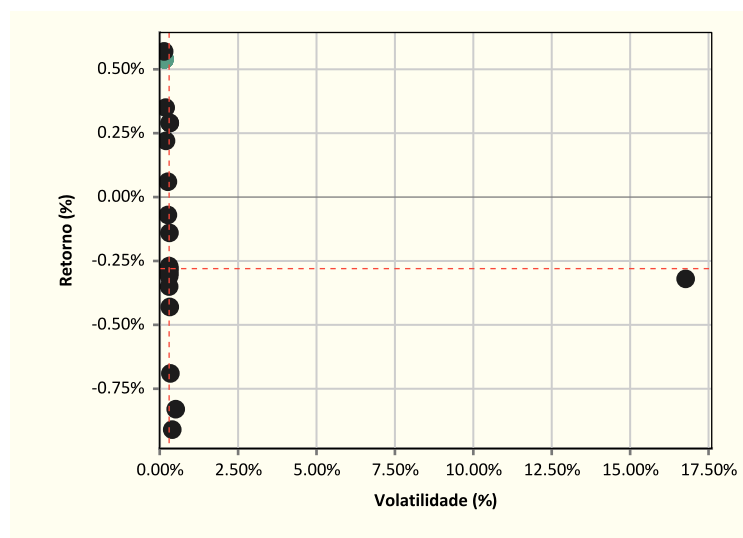
## DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.07%	3.03%	5.92%	11.82%	5.92%
IBOVESPA	0.61%	3.77%	6.15%	-0.17%	6.15%
IBRX	0.76%	3.94%	6.41%	0.43%	6.41%
IBRX50	0.64%	3.68%	6.71%	0.95%	6.71%
IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%	8.34%
IRF-M	0.32%	3.07%	5.18%	9.68%	5.18%

## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
Rent. (%)	Fundo	0.54%			
	IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%
	Performance	0.81%			
	Sucesso	57.14%	32.79%	16.39%	7.91%
Vol.	Fundo	0.15%			
	IMA-B	0.30%	0.41%	0.43%	0.56%
Perf.	Sharpe	0.26			
	Semi-Sharpe	0.40			
	Beta	0.43			

## DISPERSÃO: FUNDO X CATEGORIA (No Mês)



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade da Risk Office, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação. Os dados de mercado utilizados para verificação do enquadramento foram obtidos junto a fontes públicas nas quais a Risk Office deposita confiança. Entretanto, a Risk Office não se responsabiliza pela acurácia desses dados. Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.

# Relatório de Performance RPPS



FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP

30/06/2015

<b>Categoria RPPS:</b> 7IB IMA-B	<b>Valor da Cota:</b> 1.81	<b>PL (R\$):</b> 4,353,258,839.50
<b>CNPJ:</b> 10740658000193	<b>Qtde. de Cotas:</b> 4,128,168.30	<b>% do PL (RPPS):</b> 0.17
<b>Cód. Anbima:</b> 244120	<b>Patrim. RPPS (R\$):</b> 65,356,973.60	<b>Tx. de Adm.:</b> 0.20
<b>Gestão:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (%):</b> 11.42	<b>Tx. de Perf.:</b> -
<b>Adm.:</b> CAIXA ECONOMICA FEDERAL	<b>Saldo RPPS (R\$):</b> 7,462,225.63	<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	-0.69% (19)	6.82% (1)	9.32% (1)	13.92% (1)	9.32% (1)	ENQUADRADO
HSBC FI REGIMES DE PREVID RF ATIVO IPCA	-0.83% (20)	4.00% (14)	8.46% (2)	11.52% (13)	8.46% (2)	ENQUADRADO
SANT FI IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP	-0.27% (10)	4.86% (5)	8.41% (3)	12.56% (7)	8.41% (3)	ENQUADRADO
BRB RENDA FIXA IMA B	-0.32% (16)	5.19% (3)	8.31% (4)	11.32% (15)	8.31% (4)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B INST TIT PUBL RF LP	-0.29% (12)	4.80% (7)	8.30% (5)	12.33% (8)	8.30% (5)	ENQUADRADO
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	-0.28% (11)	4.85% (6)	8.27% (6)	13.07% (2)	8.27% (6)	ENQUADRADO
BRAD INST FIC FI RF IMA B TIT PUBLICOS	-0.30% (14)	4.90% (4)	8.26% (7)	12.95% (3)	8.26% (7)	ENQUADRADO
SANT FIC FI IMA B TIT PUB RF LONGO PRAZO	-0.31% (15)	4.76% (8)	8.20% (8)	12.10% (9)	8.20% (8)	ENQUADRADO
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	-0.30% (13)	4.67% (9)	8.09% (9)	12.80% (5)	8.09% (9)	ENQUADRADO
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	-0.43% (18)	4.57% (10)	7.96% (10)	12.86% (4)	7.96% (10)	ENQUADRADO

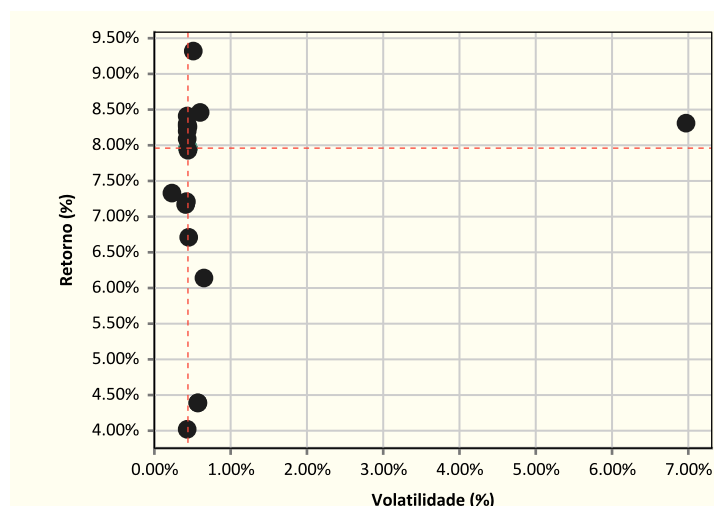
## DADOS DE MERCADO

INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.07%	3.03%	5.92%	11.82%	5.92%
IBOVESPA	0.61%	3.77%	6.15%	-0.17%	6.15%
IBRX	0.76%	3.94%	6.41%	0.43%	6.41%
IBRX50	0.64%	3.68%	6.71%	0.95%	6.71%
IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%	8.34%
IRF-M	0.32%	3.07%	5.18%	9.68%	5.18%

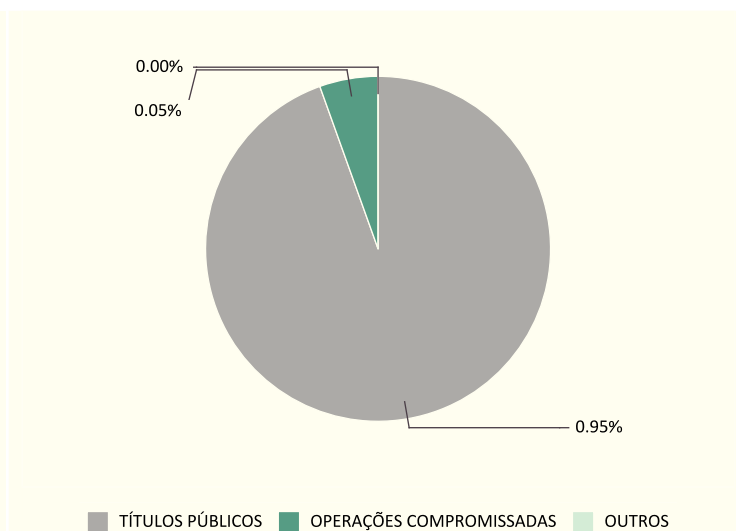
## QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	-0.43%	4.57%	7.96%	12.86%	7.96%
	IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%	8.34%
	Performance	-0.16%	-0.22%	-0.34%	-0.39%	-0.34%
	Sucesso	42.86%	49.18%	49.18%	49.41%	49.18%
Vol.	Fundo	0.32%	0.42%	0.44%	0.56%	0.44%
	IMA-B	0.30%	0.41%	0.43%	0.56%	0.43%
Perf.	Sharpe	-0.02	-0.01	-0.01	-0.00	-0.01
	Semi-Sharpe	-0.03	-0.01	-0.01	-0.00	-0.01
	Beta	1.06	1.04	1.01	0.99	1.01

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



## COMPOSIÇÃO CARTEIRA CVM - 29/05/2015



As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade da Risk Office, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação. Os dados de mercado utilizados para verificação do enquadramento foram obtidos junto a fontes públicas nas quais a Risk Office deposita confiança. Entretanto, a Risk Office não se responsabiliza pela acurácia desses dados. Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**ITAPEMIRIM**

**30/06/2015**

Fundo	Valor Investido R\$	% Recursos	Limite PI	PL Fundo	% PL Fundo	Adequação Fundo	Diversificação		Rentabilidades					
							RPPS	Fundo	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	No Ano	
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>65.356.973,60</b>	<b>100,00%</b>	<b>154,00%</b>							<b>-0,01%</b>	<b>4,23%</b>	<b>7,34%</b>	<b>11,52%</b>	<b>7,34%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										1,26%	3,99%	9,96%	15,87%	9,96%
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										1,28%	3,76%	9,31%	15,43%	9,31%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>49.414.469,20</b>	<b>75,61%</b>	<b>80,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B</b>							<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	33.300.162,50	50,95%		5.459.523.033,35	0,61%	OK	OK	OK	-0,28%	4,85%	8,27%	13,07%	8,27%	8,27%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI	3.423.405,21	5,24%		951.362.340,48	0,36%	OK	OK	OK	0,64%	3,03%	7,38%	11,46%	7,38%	7,38%
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	4.277.526,17	6,54%		241.607.189,85	1,77%	OK	OK	OK	0,54%	-	-	-	-	-
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	951.149,69	1,46%		311.165.599,24	0,31%	OK	OK	OK	0,29%	4,14%	4,39%	6,31%	4,39%	4,39%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	7.462.225,63	11,42%		4.353.258.839,50	0,17%	OK	OK	OK	-0,43%	4,57%	7,96%	12,86%	7,96%	7,96%
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDIA</b>	<b>2.249.381,09</b>	<b>3,44%</b>	<b>20,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso III, Alínea A</b>							<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	2.249.381,09	3,44%		105.004.143,79	2,14%	OK	OK	OK	-0,51%	5,66%	8,59%	13,64%	8,59%	8,59%
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>6.518.837,13</b>	<b>9,97%</b>	<b>20,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>							<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	6.279.067,69	9,61%		7.007.151.750,44	0,09%	OK	OK	OK	1,09%	3,12%	6,06%	12,07%	6,06%	6,06%
CAIXA FI ALIANCA TITULOS PUBLICOS RF	239.769,44	0,37%		339.762.703,36	0,07%	OK	OK	OK	1,00%	2,92%	5,79%	11,55%	5,79%	5,79%
<b>Fundo Crédito Privado</b>			<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea B</b>							<b>Alocação:</b>	
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>1.225.794,00</b>	<b>1,88%</b>	<b>10,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>							<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>
CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA	1.225.794,00	1,88%		41.723.042,12	2,94%	OK	OK	OK	0,43%	3,34%	4,60%	-0,34%	4,60%	4,60%
<b>Fundos de Ações</b>	<b>3.636.007,14</b>	<b>5,56%</b>	<b>10,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>							<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.636.007,14	5,56%		318.352.569,76	1,14%	OK	OK	OK	-0,37%	1,20%	0,05%	-0,48%	0,05%	0,05%
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>1.068.973,29</b>	<b>1,64%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>							<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>
BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT	1.068.973,29	1,64%		19.041.736,27	5,61%	OK	OK	OK	0,89%	3,87%	10,10%	22,22%	10,10%	10,10%
<b>Fundos de Participações</b>			<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>							<b>Alocação:</b>	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>1.243.511,75</b>	<b>1,90%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>							<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII*	1.243.511,75	1,90%		153.323.637,82	0,81%	OK	OK	OK	0,86%	3,86%	2,81%	-4,56%	2,81%	2,81%

1 - As informações utilizadas na geração deste enquadramento foram obtidas junto ao RPPS que administra o plano e aos seus prestadores de serviços, não sendo de responsabilidade da Risk Office quaisquer erros decorrentes de ruídos ou falhas de informação;  
 2 - 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;  
 3 - Adicionalmente, é preciso ressaltar que este relatório é confidencial, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não deve, portanto, ser utilizado para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização;  
 4 - Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

\* Todas as informações foram retiradas do portal CVM dia 16/07/2015 às 10:00 hrs.