

Relatório de Performance RPPS



BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT

30/06/2015

Categoria RPPS: 8IV	Valor da Cota: 1.26	PL (R\$): 19,041,736.27
CNPJ: 20168735000136	Qtde. de Cotas: 851,318.77	% do PL (RPPS): 5.61
Cód. Anbima: 367214	Patrim. RPPS (R\$): 65,356,973.60	Tx. de Adm.: 1.10
Gestão: BANESTES DTVM SA	Saldo RPPS (%): 1.64	Tx. de Perf.: -
Adm.: BANESTES DTVM SA	Saldo RPPS (R\$): 1,068,973.29	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
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
BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT	0.89% (40)	3.87% (12)	10.10% (4)	22.22% (2)	10.10% (4)	ENQUADRADO
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

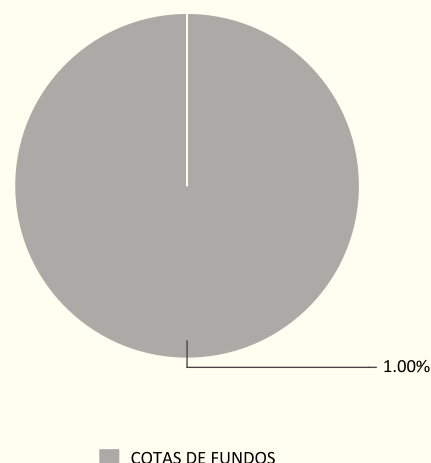
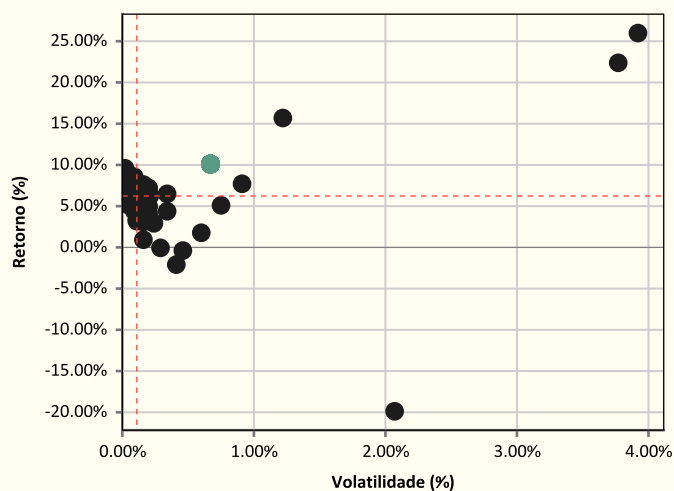
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.07%	3.03%	5.92%	11.82%	5.92%
IBOVESPA	0.61%	3.77%	6.15%	-0.17%	6.15%
IBRX	0.76%	3.94%	6.41%	0.43%	6.41%
IBRX50	0.64%	3.68%	6.71%	0.95%	6.71%
IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%	8.34%
IRF-M	0.32%	3.07%	5.18%	9.68%	5.18%

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

Categoria RPPS: 7III IMA-B	Valor da Cota: 4.44	PL (R\$): 105,004,143.79
CNPJ: 05357507000110	Qtde. de Cotas: 506,449.04	% do PL (RPPS): 2.14
Cód. Anbima: 247960	Patrim. RPPS (R\$): 65,356,973.60	Tx. de Adm.: 0.20
Gestão: BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO	Saldo RPPS (%): 3.44	Tx. de Perf.: -
Adm.: BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO	Saldo RPPS (R\$): 2,249,381.09	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
HSBC FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PRECOS	-0.38% (17)	4.15% (14)	8.82% (1)	11.13% (17)	8.82% (1)	ENQUADRADO
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	-0.51% (19)	5.66% (1)	8.59% (2)	13.64% (2)	8.59% (2)	ENQUADRADO
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

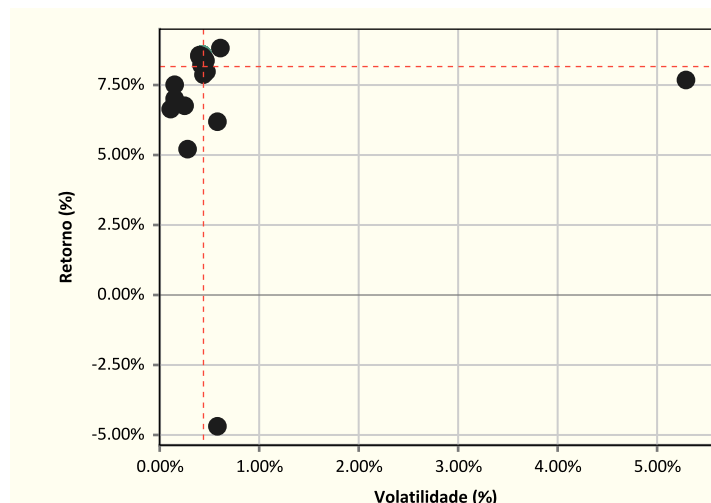
DADOS DE MERCADO

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%

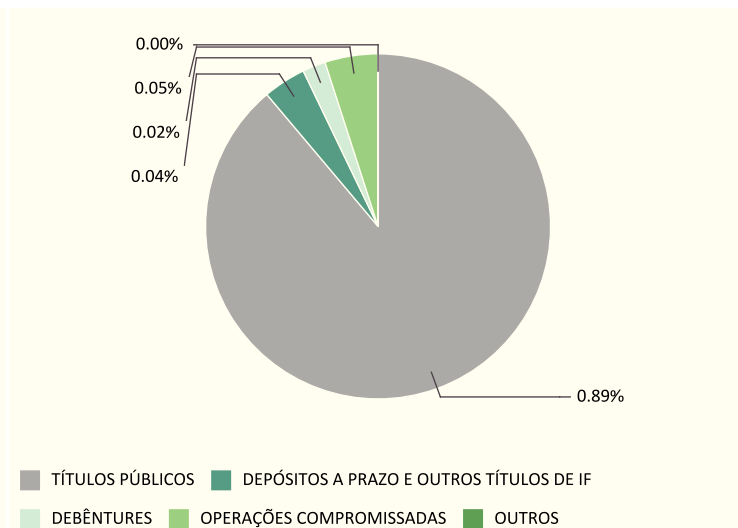
QUADRO DE INDICADORES

	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

Categoria RPPS: 7IB IMA-B	Valor da Cota: 3.17	PL (R\$): 5,459,523,033.35
CNPJ: 07442078000105	Qtde. de Cotas: 10,493,545.49	% do PL (RPPS): 0.61
Cód. Anbima: 242901	Patrim. RPPS (R\$): 65,356,973.60	Tx. de Adm.: 0.20
Gestão: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (%): 50.95	Tx. de Perf.: -
Adm.: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (R\$): 33,300,162.50	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
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

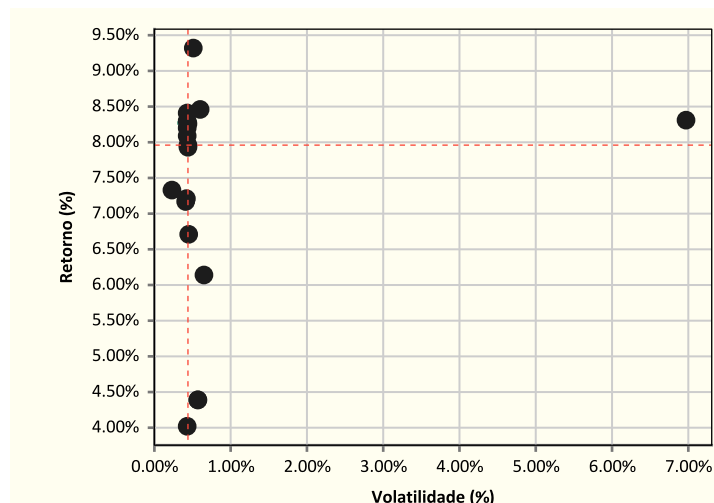
DADOS DE MERCADO

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%

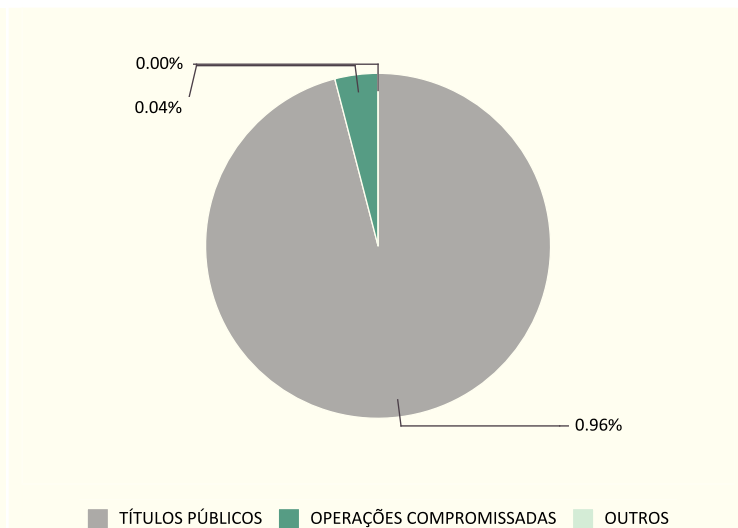
QUADRO DE INDICADORES

	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano	
Rent. (%)	Fundo	-0.28%	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

Categoria RPPS: 7IB IDKA IPCA 3A	Valor da Cota: 1.21	PL (R\$): 951,362,340.48
CNPJ: 19303794000190	Qtde. de Cotas: 2,822,582.67	% do PL (RPPS): 0.36
Cód. Anbima: 359831	Patrim. RPPS (R\$): 65,356,973.60	Tx. de Adm.: 0.15
Gestão: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (%): 5.24	Tx. de Perf.: -
Adm.: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (R\$): 3,423,405.21	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	0.64% (1)	3.03% (1)	7.38% (1)	11.46% (1)	7.38% (1)	ENQUADRADO

DADOS DE MERCADO

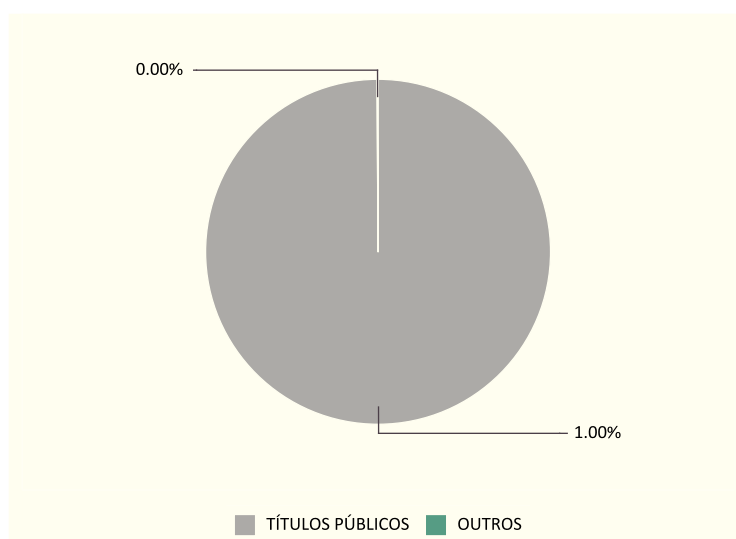
INDICADORES	No mês	Em 3 meses	Em 6 meses	Em 12 meses	No ano
CDI	1.07%	3.03%	5.92%	11.82%	5.92%
IBOVESPA	0.61%	3.77%	6.15%	-0.17%	6.15%
IBRX	0.76%	3.94%	6.41%	0.43%	6.41%
IBRX50	0.64%	3.68%	6.71%	0.95%	6.71%
IMA-B	-0.27%	4.79%	8.34%	13.31%	8.34%
IRF-M	0.32%	3.07%	5.18%	9.68%	5.18%

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

Categoria RPPS: 7IV CDI	Valor da Cota: 1.49	PL (R\$): 7,007,151,750.44
CNPJ: 13077418000149	Qtde. de Cotas: 4,212,253.77	% do PL (RPPS): 0.09
Cód. Anbima: 272493	Patrim. RPPS (R\$): 65,356,973.60	Tx. de Adm.: 0.30
Gestão: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (%): 9.61	Tx. de Perf.: -
Adm.: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Saldo RPPS (R\$): 6,279,067.69	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
INFINITY LOTUS FIR	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

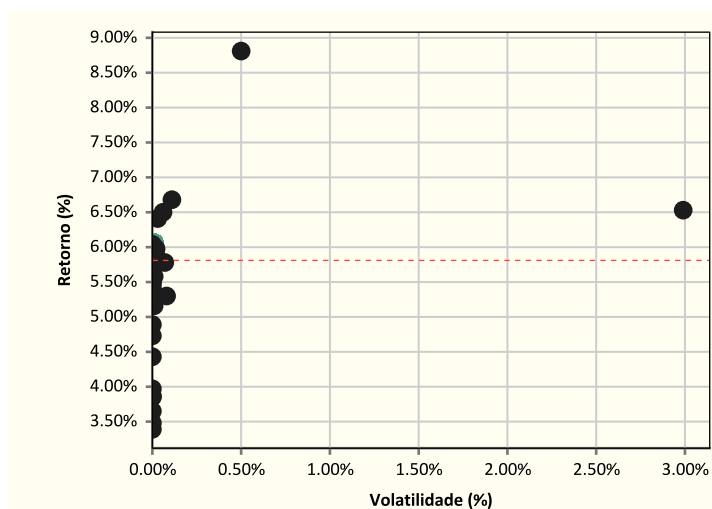
DADOS DE MERCADO

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%

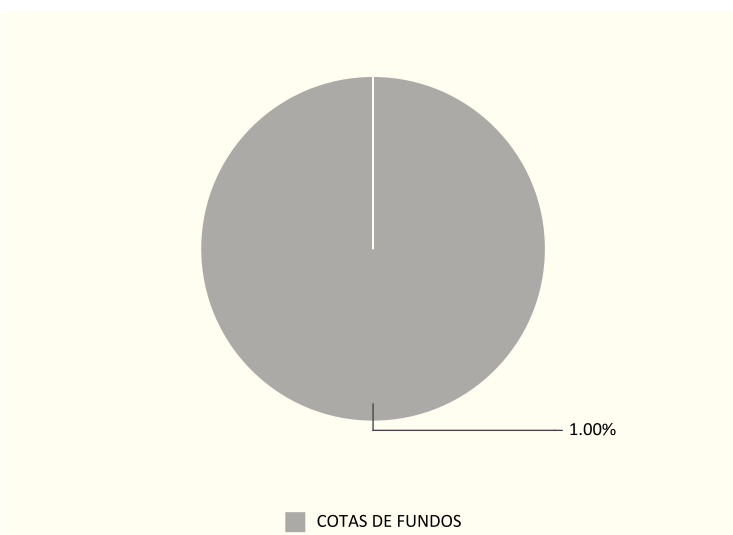
QUADRO DE INDICADORES

		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	Valor da Cota: 2.77	PL (R\$): 339,762,703.36
CNPJ: 05164358000173	Qtde. de Cotas: 86,644.32	% do PL (RPPS): 0.07
Cód. Anbima: 157252	Patrim. RPPS (R\$): 65,356,973.60	Tx. de Adm.: 0.20
Gestão: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (%): 0.37	Tx. de Perf.: -
Adm.: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (R\$): 239,769.44	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
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

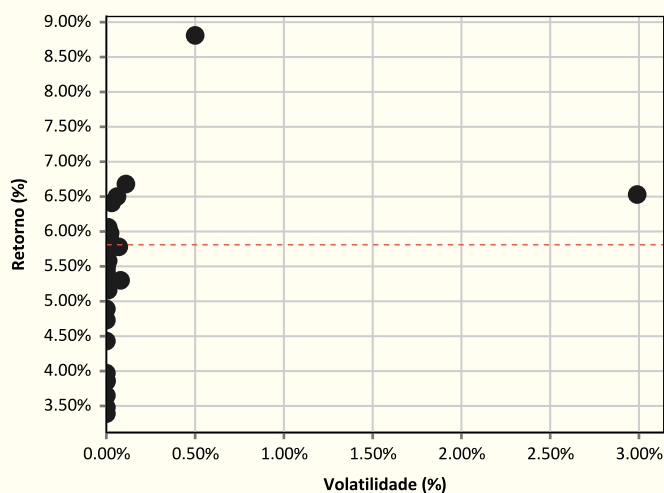
DADOS DE MERCADO

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%

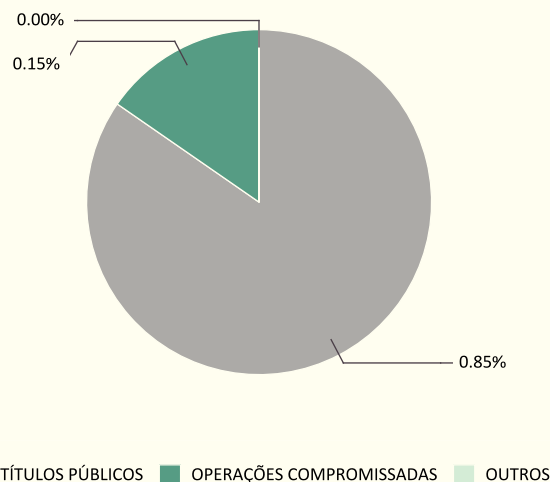
QUADRO DE INDICADORES

		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

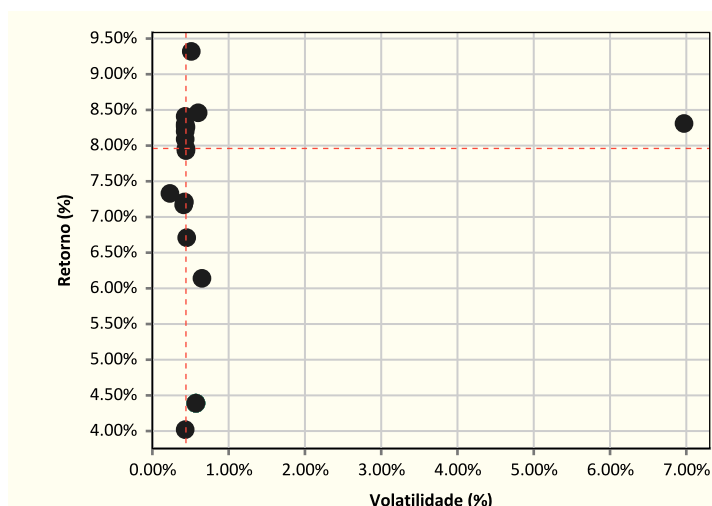
DADOS DE MERCADO

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%

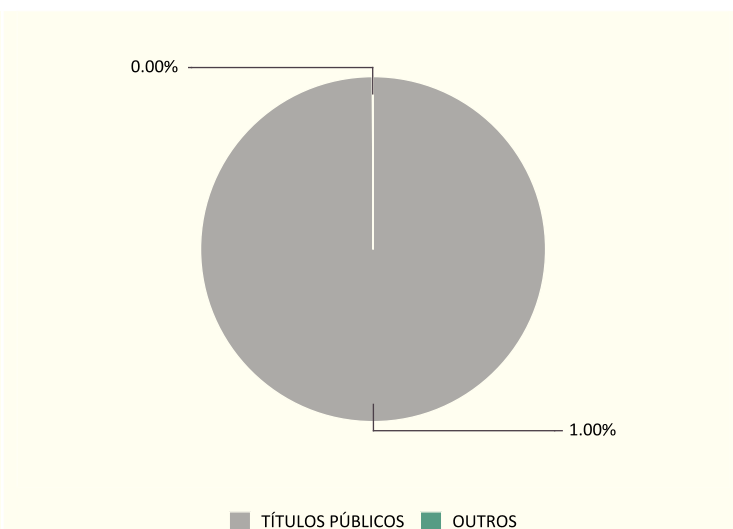
QUADRO DE INDICADORES

		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
CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA	0.43% (12)	3.34% (4)	4.60% (6)	-0.34% (4)	4.60% (6)	ENQUADRADO
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

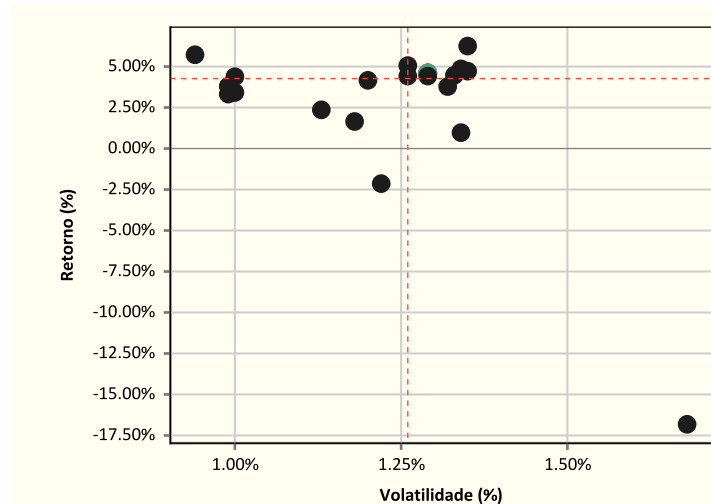
DADOS DE MERCADO

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%

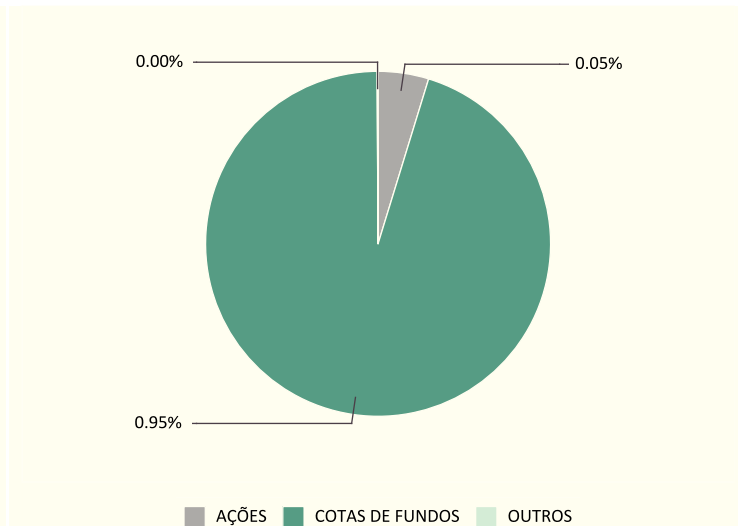
QUADRO DE INDICADORES

		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

Categoria RPPS: 7IB IMA-B	Valor da Cota: 1.02	PL (R\$): 241,607,189.85
CNPJ: 21918953000103	Qtde. de Cotas: 4,193,311.89	% do PL (RPPS): 1.77
Cód. Anbima: 394769	Patrim. RPPS (R\$): 65,356,973.60	Tx. de Adm.: 0.20
Gestão: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (%): 6.54	Tx. de Perf.: -
Adm.: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (R\$): 4,277,526.17	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
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

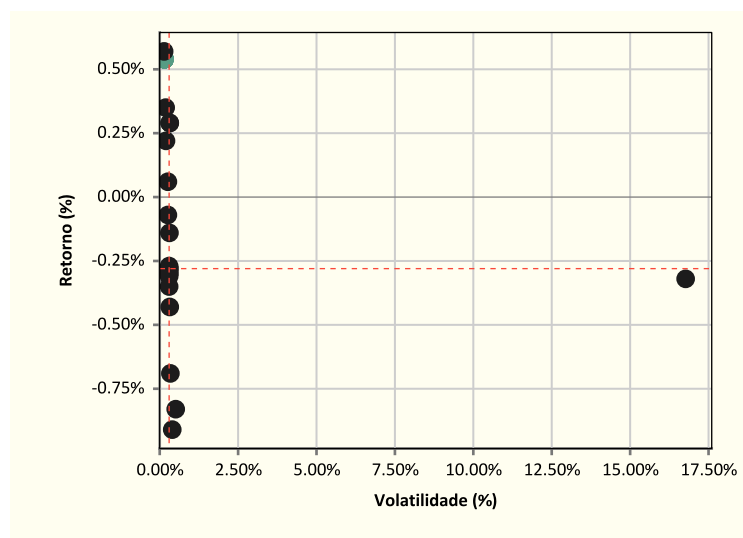
DADOS DE MERCADO

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

Categoria RPPS: 7IB IMA-B	Valor da Cota: 1.81	PL (R\$): 4,353,258,839.50
CNPJ: 10740658000193	Qtde. de Cotas: 4,128,168.30	% do PL (RPPS): 0.17
Cód. Anbima: 244120	Patrim. RPPS (R\$): 65,356,973.60	Tx. de Adm.: 0.20
Gestão: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (%): 11.42	Tx. de Perf.: -
Adm.: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Saldo RPPS (R\$): 7,462,225.63	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
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

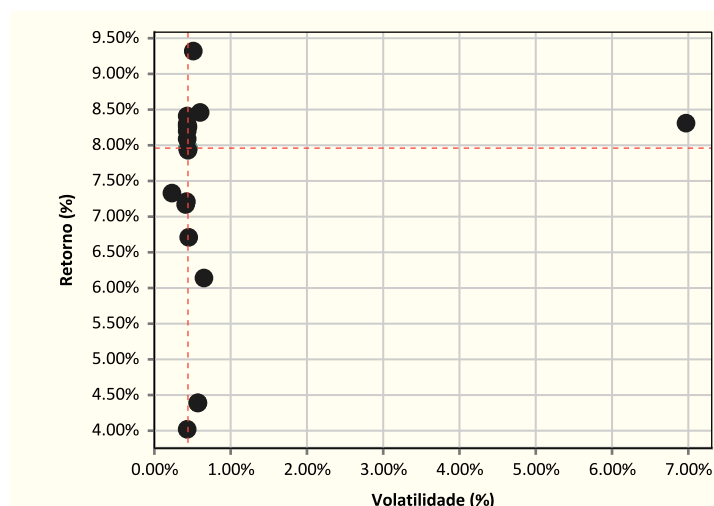
DADOS DE MERCADO

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

