

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Maio/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	76.086,23	-3,17%	0,89%	-356,25%
BB Perfil	124.321,45	0,46%	0,89%	52,00%
BB IRF-M	2.021.877,66	-1,86%	0,89%	-208,94%
BB IRF-M1	1.665.377,20	0,18%	0,89%	20,42%
BB IRF-M1	17.981.770,41	0,18%	0,89%	20,38%
BB Perfil	1.004.931,04	0,49%	0,89%	55,43%
Bradesco IRF-M1 TP	3.074.945,17	0,17%	0,89%	18,77%
Caixa IMA-B	2.887.647,56	-3,18%	0,89%	-357,40%
Caixa IRF-M1	24.400.421,96	0,19%	0,89%	21,41%
Caixa Brasil TP	2.144.703,37	0,47%	0,89%	52,52%
TOTAL / MÉDIA	55.382.082,05	-0,06%	0,89%	-6,59%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B TP	0,14%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	0,22%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	3,65%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	3,01%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	32,47%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	1,81%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	5,55%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	5,21%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	44,06%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	3,87%	100%	Art. 7º, I, b

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,75%	0,87%	86,25%
Fevereiro	0,54%	0,82%	66,15%
Março	0,67%	0,58%	115,71%
Abril	0,45%	0,71%	63,30%
Maio	-0,06%	0,89%	-6,59%
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,37%	3,92%	60,40%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,37%, enquanto que a meta acumulada no período é de 3,92%, sendo assim o RPPS atingiu 60,4% da meta atuarial.

4. GERENCIAMENTO DE RISCO

4.1 RISCO DE CRÉDITO

Caso o RPPS detenha fundos com Crédito Privado, a análise do crédito será feita a parte através da análise de avaliação de risco cedida por empresas com sede no país e fornecidas pelo RPPS para a Conexão Consultores.

4.2 RISCO DE MERCADO

4.2.1 VaR - VALUE AT RISK

O VaR representa o valor monetário das perdas no valor presente a que uma carteira está sujeita, a um determinado nível de confiança e dentro de um horizonte de tempo.

Fundo	Aplicação	VaR	VaR %
BB IMA-B TP	76.086,23	1.477,33	0,00%
BB Perfil	124.321,45	20,77	0,00%
BB IRF-M	2.021.877,66	21.872,11	0,04%
BB IRF-M1	1.665.377,20	2.701,87	0,00%
BB IRF-M1	17.981.770,41	29.173,21	0,05%
BB Perfil	1.004.931,04	167,91	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	3.074.945,17	5.143,25	0,01%
Caixa IMA-B	2.887.647,56	56.151,67	0,10%
Caixa IRF-M1	24.400.421,96	39.792,67	0,07%
Caixa Brasil TP	2.144.703,37	417,51	0,00%
Carteira	55.382.082,05	129.142,20	0,23%

4.2.2 ÍNDICE SHARPE

O Índice Sharpe é um indicador de performance que ajusta o retorno ao risco, ou seja, ele avalia se um determinado fundo de investimento apresenta uma rentabilidade ponderada ao risco que o investidor está exposto.

Fundo	Sharpe
BB IMA-B TP	-
BB Perfil	-
BB IRF-M	-
BB IRF-M1	-
BB IRF-M1	-
BB Perfil	-
Bradesco IRF-M1 TP	-
Caixa IMA-B	-
Caixa IRF-M1	-
Caixa Brasil TP	-