

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Junho/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	75.819,01	-0,35%	1,75%	-20,04%
BB Perfil	137.138,27	0,46%	1,75%	26,03%
BB IRF-M	2.022.172,99	0,01%	1,75%	0,83%
BB IRF-M1	1.673.700,62	0,50%	1,75%	28,51%
BB IRF-M1	18.071.641,76	0,50%	1,75%	28,51%
BB Perfil	1.117.589,89	0,46%	1,75%	26,47%
Bradesco IRF-M1 TP	3.090.439,22	0,50%	1,75%	28,75%
Caixa IMA-B	2.877.254,97	-0,36%	1,75%	-20,53%
Caixa IRF-M1	24.521.541,60	0,50%	1,75%	28,32%
Caixa Brasil TP	2.360.482,05	0,48%	1,75%	27,38%
TOTAL / MÉDIA	55.947.780,38	0,43%	1,75%	24,73%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B TP	0,14%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	0,25%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	3,61%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	2,99%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	32,30%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	2,00%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	5,52%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	5,14%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	43,83%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,22%	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%
Maior	-0,06%	0,89%	-6,59%
Junho	0,43%	1,75%	24,73%
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,81%	5,74%	48,97%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,81%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,74%, sendo assim o RPPS atingiu 48,97% 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	75.819,01	1.859,45	0,00%
BB Perfil	137.138,27	24,03	0,00%
BB IRF-M	2.022.172,99	32.820,42	0,06%
BB IRF-M1	1.673.700,62	5.802,53	0,01%
BB IRF-M1	18.071.641,76	62.652,31	0,11%
BB Perfil	1.117.589,89	195,84	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	3.090.439,22	10.779,90	0,02%
Caixa IMA-B	2.877.254,97	70.995,55	0,13%
Caixa IRF-M1	24.521.541,60	84.430,23	0,15%
Caixa Brasil TP	2.360.482,05	836,55	0,00%
Carteira	55.947.780,38	230.979,02	0,41%

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	-