

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Julho/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	77.557,98	2,29%	0,82%	280,27%
BB Perfil	137.852,33	0,52%	0,82%	63,63%
BB IRF-M	2.129.447,15	1,43%	0,82%	174,66%
BB IRF-M1	1.685.008,22	0,68%	0,82%	82,56%
BB IRF-M1	18.219.690,01	0,67%	0,82%	82,44%
BB Perfil	1.087.521,16	0,52%	0,82%	62,99%
Bradesco IRF-M1	3.110.714,87	0,66%	0,82%	80,17%
Caixa IMA-B	2.943.495,83	2,30%	0,82%	281,32%
Caixa IRF-M1	24.689.154,71	0,68%	0,82%	83,52%
Caixa Brasil TP	2.591.257,49	0,53%	0,82%	65,18%
TOTAL / MÉDIA	56.671.699,75	0,78%	0,82%	95,51%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B TP	0,14%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	0,24%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	3,76%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	2,97%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	32,15%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	1,92%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1	5,49%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	5,19%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	43,57%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,57%	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	0,43%	1,75%	24,73%
Julho	0,78%	0,82%	95,51%
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	3,62%	6,61%	54,72%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 3,62%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,61%, sendo assim o RPPS atingiu 54,72% 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	77.557,98	1.953,29	0,00%
BB Perfil	137.852,33	24,81	0,00%
BB IRF-M	2.129.447,15	36.305,78	0,06%
BB IRF-M1	1.685.008,22	6.018,71	0,01%
BB IRF-M1	18.219.690,01	65.079,23	0,11%
BB Perfil	1.087.521,16	195,70	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	3.110.714,87	11.204,74	0,02%
Caixa IMA-B	2.943.495,83	74.609,67	0,13%
Caixa IRF-M1	24.689.154,71	87.615,47	0,15%
Caixa Brasil TP	2.591.257,49	956,98	0,00%
Carteira	56.671.699,75	243.466,65	0,43%

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	0,06
BB Perfil	-
BB IRF-M	0,04
BB IRF-M1	0,04
BB IRF-M1	0,04
BB Perfil	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,03
Caixa IMA-B	0,06
Caixa IRF-M1	0,04
Caixa Brasil TP	0,00