

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Agosto/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	77.199,61	-0,46%	0,40%	-116,59%
BB Perfil	159.562,03	0,50%	0,40%	127,11%
BB IRF-M	2.109.094,40	-0,96%	0,40%	-241,16%
BB IRF-M1	1.691.669,77	0,40%	0,40%	99,75%
BB IRF-M1	18.599.436,67	0,39%	0,40%	99,02%
BB Perfil	1.053.908,26	0,55%	0,40%	137,75%
Bradesco IRF-M1 TP	3.122.534,90	0,38%	0,40%	95,88%
Caixa IMA-B	2.929.820,78	-0,46%	0,40%	-117,23%
Caixa IRF-M1	24.789.505,42	0,41%	0,40%	102,56%
Caixa Brasil TP	2.604.671,18	0,52%	0,40%	130,62%
TOTAL / MÉDIA	57.137.403,02	0,31%	0,40%	78,54%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B TP	0,14%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	0,28%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	3,69%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	2,96%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	32,55%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	1,84%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	5,46%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	5,13%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	43,39%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,56%	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%
Mai	-0,06%	0,89%	-6,59%
Junho	0,43%	1,75%	24,73%
Julho	0,78%	0,82%	95,51%
Agosto	0,31%	0,40%	78,54%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	3,94%	7,03%	56,02%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 3,94%, enquanto que a meta acumulada no período é de 7,03%, sendo assim o RPPS atingiu 56,02% 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	77.199,61	2.235,83	0,00%
BB Perfil	159.562,03	28,78	0,00%
BB IRF-M	2.109.094,40	41.285,14	0,07%
BB IRF-M1	1.691.669,77	6.266,69	0,01%
BB IRF-M1	18.599.436,67	68.900,52	0,12%
BB Perfil	1.053.908,26	190,12	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	3.122.534,90	11.650,53	0,02%
Caixa IMA-B	2.929.820,78	85.204,00	0,15%
Caixa IRF-M1	24.789.505,42	91.293,73	0,16%
Caixa Brasil TP	2.604.671,18	1.161,18	0,00%
Carteira	57.137.403,02	264.202,26	0,46%

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	-