

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Outubro/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	82.524,06	7,07%	0,94%	752,97%
BB Perfil	171.533,39	0,53%	0,94%	56,51%
BB IRF-M	2.231.012,80	3,56%	0,94%	378,62%
BB IRF-M1	1.717.560,99	0,93%	0,94%	99,56%
BB IRF-M1	18.884.103,39	0,93%	0,94%	99,56%
BB Perfil	1.046.723,70	0,53%	0,94%	56,53%
Bradesco IRF-M1 TP	3.170.048,55	0,90%	0,94%	95,94%
Caixa IMA-B	3.403.400,53	6,56%	0,94%	698,27%
Caixa IRF-M1	25.557.496,96	0,93%	0,94%	99,46%
Caixa Brasil TP	2.630.932,09	0,54%	0,94%	57,43%
TOTAL / MÉDIA	58.895.336,46	1,32%	0,94%	140,63%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B TP	0,14%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	0,29%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	3,79%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	2,92%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	32,06%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	1,78%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	5,38%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	5,78%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	43,39%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,47%	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	0,57%	0,97%	58,63%
Outubro	1,32%	0,94%	140,63%
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	5,91%	9,08%	65,06%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 5,91%, enquanto que a meta acumulada no período é de 9,08%, sendo assim o RPPS atingiu 65,06% 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	82.524,06	2.597,69	0,00%
BB Perfil	171.533,39	42,09	0,00%
BB IRF-M	2.231.012,80	44.336,10	0,08%
BB IRF-M1	1.717.560,99	4.787,23	0,01%
BB IRF-M1	18.884.103,39	52.634,21	0,09%
BB Perfil	1.046.723,70	256,81	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	3.170.048,55	9.011,03	0,02%
Caixa IMA-B	3.403.400,53	107.834,90	0,18%
Caixa IRF-M1	25.557.496,96	70.272,25	0,12%
Caixa Brasil TP	2.630.932,09	1.168,36	0,00%
Carteira	58.895.336,46	256.460,40	0,44%

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	0,13
BB Perfil	-
BB IRF-M	0,09
BB IRF-M1	0,08
BB IRF-M1	0,08
BB Perfil	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,08
Caixa IMA-B	0,13
Caixa IRF-M1	0,08
Caixa Brasil TP	-