

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Fevereiro/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	17.583.549,59	0,52%	0,82%	64,11%
BB Perfil	1.175.806,56	0,47%	0,82%	57,15%
BB IRF-M	1.699.748,06	1,06%	0,82%	129,45%
BB IRF-M1	1.643.999,85	0,52%	0,82%	64,11%
BB IMA-B TP	77.992,41	0,53%	0,82%	64,71%
BB Perfil	97.654,40	0,44%	0,82%	53,23%
Caixa IMA-B	2.960.040,48	0,54%	0,82%	66,17%
Caixa IRF-M1	23.590.365,33	0,53%	0,82%	65,16%
Caixa Brasil TP	2.113.237,72	0,45%	0,82%	54,61%
Bradesco IRF-M1 TP	3.035.004,60	0,52%	0,82%	63,40%
TOTAL / MÉDIA	53.977.399,00	0,54%	0,82%	66,15%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	32,58%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB Perfil	2,18%	100%	Art. 7º, IV, "a"
BB IRF-M	3,15%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB IRF-M1	3,05%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB IMA-B TP	0,14%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB Perfil	0,18%	100%	Art. 7º, IV, "a"
Caixa IMA-B	5,48%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa IRF-M1	43,70%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa Brasil TP	3,92%	100%	Art. 7º, I, "b"
Bradesco IRF-M1 TP	5,62%	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			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	1,29%	1,69%	76,42%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,29%, enquanto que a meta acumulada no período é de 1,69%, sendo assim o RPPS atingiu 76,42% da meta atuarial.

4. GERENCIAMENTO DE RISCO

4.1 RISCO DE CRÉDITO

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

4.2 RISCO DE MERCADO

4.2.1 VaR - VALUE AT RISK

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

Fundo	Aplicação	VaR	VaR %
BB IRF-M1	17.583.549,59	12.787,35	0,02%
BB Perfil	1.175.806,56	493,13	0,00%
BB IRF-M	1.699.748,06	16.936,76	0,03%
BB IRF-M1	1.643.999,85	1.195,57	0,00%
BB IMA-B TP	77.992,41	1.458,68	0,00%
BB Perfil	97.654,40	40,96	0,00%
Caixa IMA-B	2.960.040,48	55.381,30	0,10%
Caixa IRF-M1	23.590.365,33	17.002,52	0,03%
Caixa Brasil TP	2.113.237,72	495,29	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	3.035.004,60	2.314,06	0,00%
Carteira	53.977.399,00	86.560,11	0,16%

4.2.2 ÍNDICE SHARPE

O Índice Sharpe é um indicador de performance que ajusta 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 IRF-M1	0,05
BB Perfil	0,02
BB IRF-M	0,06
BB IRF-M1	0,05
BB IMA-B TP	0,00
BB Perfil	0,02
Caixa IMA-B	0,00
Caixa IRF-M1	0,06
Caixa Brasil TP	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,05

ORES

eiro/2018

análise do
co cedida
Conexão

presente a
infância e

o retorno
estamento
tidor está