

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Julho/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	8.359.794,55	0,68%	0,74%	91,45%
BB Perfil	3.679.211,07	0,52%	0,74%	70,48%
BB IRF-M1	3.963.205,47	0,68%	0,74%	91,45%
BB Perfil	693.378,03	0,52%	0,74%	70,48%
Caixa IRF-M1	15.546.320,09	0,68%	0,74%	92,52%
Caixa Ref. DI LP	5.061.471,62	0,52%	0,74%	71,06%
Bradesco IRF-M1 TP	2.029.769,29	0,66%	0,74%	88,81%
NTN-B - 2024	1.468.806,33	1,35%	0,74%	182,78%
NTN-B - 2024	1.719.499,75	1,35%	0,74%	182,78%
Santander Ativo FIC FI	802.378,35	0,51%	0,74%	68,48%
TOTAL / MÉDIA	43.323.834,55	0,69%	0,74%	93,46%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	19,30%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	8,49%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M1	9,15%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	1,60%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	35,88%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	11,68%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	4,69%	100%	Art. 7º, I, b
NTN-B - 2024	3,39%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,97%	100%	Art. 7º, I, a
Santander Ativo FIC FI	1,85%	20%	Art. 7º, IV, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,63%	0,70%	89,63%
Fevereiro	0,53%	0,73%	72,05%
Março	0,62%	0,50%	124,16%
Abril	0,50%	0,63%	79,74%
Maio	0,25%	0,81%	30,41%
Junho	0,55%	1,67%	32,70%
Julho	0,69%	0,74%	93,46%
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	3,81%	5,91%	64,49%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 3,81%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,91%, sendo assim o RPPS atingiu 64,49% 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 IRF-M1	8.359.794,55	29.860,49	0,07%
BB Perfil	3.679.211,07	662,07	0,00%
BB IRF-M1	3.963.205,47	14.156,24	0,03%
BB Perfil	693.378,03	124,77	0,00%
Caixa IRF-M1	15.546.320,09	55.169,90	0,13%
Caixa Ref. DI LP	5.061.471,62	440,89	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	2.029.769,29	7.311,19	0,02%
NTN-B - 2024	1.468.806,33	43.474,10	0,10%
NTN-B - 2024	1.719.499,75	50.894,19	0,12%
Santander Ativo FIC FI	802.378,35	8.973,35	0,02%
Carteira	43.323.834,55	183.999,10	0,42%

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 IRF-M1	0,04
BB Perfil	-
BB IRF-M1	0,04
BB Perfil	-
Caixa IRF-M1	0,04
Caixa Ref. DI LP	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,03
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
Santander Ativo FIC FI	-