

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE CAMPINAS

Informações referentes a Janeiro/2014

1. RENTABILIDADE MÉDIA

JANEIRO				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M	16.905.438,45	-0,22%	2,37%	-9,40%
BB IDKA 2	1.436.814,05	-0,91%	2,37%	-38,53%
BB IMA-B	12.880.793,11	-2,51%	2,37%	-106,22%
BB RPPS Ações	7.072.448,17	-7,91%	2,37%	-334,60%
BB IPCA III CP	994.697,11	-1,32%	2,37%	-55,67%
BB IRF-M1	114.835.291,80	0,36%	2,37%	15,05%
BB Perfil	9.689.913,41	0,31%	2,37%	13,04%
Caixa Ibovespa	441.967,60	-7,85%	2,37%	-331,93%
Caixa IRF-M1	45.115.159,63	0,35%	2,37%	14,93%
BTG Pactual IMA-B	1.073.438,82	-2,67%	2,37%	-112,78%
Diferencial	14.644.455,56	-2,45%	2,37%	-103,58%
Urca CP	3.789.424,43	-0,36%	2,37%	-15,32%
Itália FIDC	483.285,16	-12,72%	2,37%	-537,95%
Master III FIDC	5.840,52	3483,36%	2,37%	147265,76%
RB Capital Renda II FII	1.737.656,63	-8,52%	2,37%	-360,33%
TOTAL / MÉDIA	231.106.624,45	-0,47%	2,37%	-19,67%

A rentabilidade média da carteira foi de -0,47% enquanto que a meta atuarial foi de 2,37%.

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M	7,31%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB IDKA 2	0,62%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB IMA-B	5,57%	20%	Art. 7º, III
BB RPPS Ações	3,06%	15%	Art. 8º, III
BB IPCA III CP	0,43%	5%	Art. 7º, I, "b"
BB IRF-M1	49,69%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB Perfil	4,19%	20%	Art. 7º, IV
Caixa Ibovespa	0,19%	20%	Art. 8º, I
Caixa IRF-M1	19,52%	100%	Art. 7º, I, "b"
BTG Pactual IMA-B	0,46%	100%	Art. 7º, I, "b"
Diferencial	6,34%	20%	Art. 7º, III
Urca CP	1,64%	0%	Ativo em Enquadramento
Itália FIDC	0,21%	5%	Art. 7º, VII, "a"
Master III FIDC	0,00%	5%	Art. 7º, VII, "a"
RB Capital Renda II FII	0,75%	5%	Art. 8º, VI

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,47%	2,37%	-19,67%
Fevereiro			
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,47%	2,37%	-19,67%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,47%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,37%, sendo assim o RPPS atingiu -19,67% 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 fornecida 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 RPPS Ações	7.072.448,17	454.993,66	6,43%
BB IDKA 2	1.436.814,05	14.157,57	0,99%
BB IMA-B	12.880.793,11	343.131,07	2,66%
BB IPCA III CP	994.697,11	19.911,87	2,00%
BB IRF-M1	114.835.291,80	264.436,60	0,23%
BB IRF-M	16.905.438,45	153.793,23	0,91%
BB Perfil	9.689.913,41	1.729,86	0,02%
BTG Pactual IMA-B	1.073.438,82	29.023,21	2,70%
Caixa Ibovespa	441.967,60	35.892,73	8,12%
Caixa IRF-M1	45.115.159,63	109.582,35	0,24%
Diferencial	14.644.455,56	301.267,38	2,06%
Itália FIDC	483.285,16	120.284,88	24,89%
RB Capital Renda II FII	1.737.656,63	209.750,72	12,07%
Urca CP	3.789.424,43	26.221,94	0,69%
Carteira	231.106.624,45	77.178.581,94	33,40%

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-M	-
BB IDKA 2	-
BB IMA-B	-
BB RPPS Ações	-
BB IPCA III CP	-
BB IRF-M1	-
BB Perfil	-
Caixa Ibovespa	-
Caixa IRF-M1	-
BTG Pactual IMA-B	-
Diferencial	-
Urca CP	57,43
Itália FIDC	-
Master III FIDC	-
RB Capital Renda II FII	-