

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE CAMPINAS

Informações referentes a Fevereiro/2014

1. RENTABILIDADE MÉDIA

FEVEREIRO				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M	0,00	0,62%	1,02%	60,97%
BB IRF-M1	150.206.800,96	0,92%	1,02%	90,60%
BB Perfil	9.335.323,71	0,59%	1,02%	57,78%
BB IMA-B	0,00	1,29%	1,02%	126,97%
BB IDKA 2	0,00	0,81%	1,02%	79,22%
BB RPPS Ações	0,00	0,24%	1,02%	24,01%
BB IPCA IV	10.028.092,91	0,28%	1,02%	27,54%
BB IPCA III CP	1.032.298,73	3,78%	1,02%	370,65%
Caixa IRF-M1	36.034.883,67	1,02%	1,02%	99,90%
Caixa Ibovespa	0,00	0,40%	1,02%	39,37%
Caixa Brasil I 2022 TP	10.029.390,00	0,29%	1,02%	28,82%
BTG Pactual IMA-B	1.122.868,05	4,60%	1,02%	451,49%
Diferencial	15.085.786,77	3,01%	1,02%	295,48%
Urca CP	3.903.728,71	3,02%	1,02%	295,76%
Itália FIDC	604.210,23	27,28%	1,02%	2674,33%
Master III FIDC	112.957,53	1834,03%	1,02%	179825,12%
RB Capital Renda II FII	1.818.149,62	4,63%	1,02%	454,19%
TOTAL / MÉDIA	239.314.490,89	1,42%	1,02%	138,74%

A rentabilidade média da carteira foi de 1,42% enquanto que a meta atuarial foi de 1,02%.

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M	0,00%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB IRF-M1	62,77%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB Perfil	3,90%	20%	Art. 7º, IV
BB IMA-B	0,00%	20%	Art. 7º, III
BB IDKA 2	0,00%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB RPPS Ações	0,00%	15%	Art. 8º, III
BB IPCA IV	4,19%	20%	Art. 7º, IV
BB IPCA III CP	0,43%	5%	Art. 7º, VII, "b"
Caixa IRF-M1	15,06%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa Ibovespa	0,00%	20%	Art. 8º, I
Caixa Brasil I 2022 TP	4,19%	20%	Art. 7º, IV
BTG Pactual IMA-B	0,47%	100%	Art. 7º, I, "b"
Diferencial	6,30%	20%	Art. 7º, III
Urca CP	1,63%	0%	Ativo em enquadramento
Itália FIDC	0,25%	5%	Art. 7º, VII, "a"
Master III FIDC	0,05%	5%	Art. 7º, VII, "a"
RB Capital Renda II FII	0,76%	5%	Art. 8º, VI

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,47%	2,37%	-19,67%
Fevereiro	1,42%	1,02%	138,74%
Março			
Abril			
Mai			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,94%	3,41%	27,66%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,94%, enquanto que a meta acumulada no período é de 3,41%, sendo assim o RPPS atingiu 27,66% 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	0,00	0,00	9,33%
BB IDKA 2	0,00	0,00	1,32%
BB IMA-B	0,00	0,00	2,59%
BB IPCA III CP	1.032.298,73	21.753,36	2,11%
BB IRF-M1	150.206.800,96	274.990,18	0,18%
BB IRF-M	0,00	0,00	1,16%
BB Perfil	9.335.323,71	1.970,81	0,02%
BTG Pactual IMA-B	1.122.868,05	30.646,21	2,73%
Caixa Ibovespa	0,00	0,00	10,25%
Caixa IRF-M1	36.034.883,67	69.855,38	0,19%
Diferencial	15.085.786,77	475.143,58	3,15%
Itália FIDC	604.210,23	399.802,63	66,17%
Master III FIDC	112.957,53	5.100.689,71	4515,58%
RB Capital Renda II FII	1.818.149,62	193.756,09	10,66%
Urca CP	3.903.728,71	34.459,40	0,88%
Carteira	239.314.490,89	10.805.670.630,53	4515,26%

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	6,95
BB IRF-M1	8,22
BB Perfil	13,89
BB IMA-B	7,98
BB IDKA 2	9,60
BB RPPS Ações	0,89
BB IPCA III CP	8,35
Caixa IRF-M1	8,73
Caixa Ibovespa	0,61
BTG Pactual IMA-B	8,20
Diferencial	4,19
Urca CP	26,60
Itália FIDC	2,71
Master III FIDC	3,50
RB Capital Renda II FII	3,55