

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE CAMPINAS

Informações referentes a Novembro/2014

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Novembro/2014				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB Perfil	41.560.096,36	0,66%	0,93%	70,78%
BB IRF-M1	122.416.020,69	0,77%	0,93%	82,83%
BB IPCA IV	10.623.191,90	0,88%	0,93%	94,64%
BB IPCA III CP	1.148.885,22	1,15%	0,93%	123,42%
BB Fluxo	0,00	0,27%	0,93%	28,53%
Caixa Brasil I 2022 TP	10.629.740,00	0,87%	0,93%	93,24%
Caixa IRF-M1	118.354.871,43	0,78%	0,93%	83,97%
Santander Irf-M1	5.211.858,20	0,78%	0,93%	83,58%
Itália FIDC	489.881,56	0,63%	0,93%	67,92%
Master III FIDC	84.531,10	-0,11%	0,93%	-12,32%
Urca CP	3.662.510,90	0,67%	0,93%	72,48%
BTG Pactual IMA-B	1.284.974,80	2,04%	0,93%	219,65%
RB Capital Renda II FII	1.754.164,83	-9,05%	0,93%	-973,21%
BRB Publico LP	1.010.928,79	0,81%	0,93%	87,58%
TOTAL / MÉDIA	318.231.655,78	0,72%	0,93%	77,89%

A rentabilidade média da carteira foi de 0,72% enquanto que a meta atuarial foi de 0,93%.

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB Perfil	13,06%	20%	Art. 7º, IV
BB IRF-M1	38,47%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB IPCA IV	3,34%	20%	Art. 7º, IV
BB IPCA III CP	0,36%	5%	Art. 7º, VII, "b"
BB Fluxo	0,00%	20%	Art. 7º, IV
Caixa Brasil I 2022 TP	3,34%	20%	Art. 7º, IV
Caixa IRF-M1	37,19%	100%	Art. 7º, I, "b"
Santander Irf-M1	1,64%	100%	Art. 7º, I, "b"
Itália FIDC	0,15%	5%	Art. 7º, VII, "a"
Master III FIDC	0,03%	5%	Art. 7º, VII, "a"
Urca CP	1,15%	0%	Ativo em Enquadramento
BTG Pactual IMA-B	0,40%	100%	Art. 7º, I, "b"
RB Capital Renda II FII	0,55%	5%	Art. 8º, VI
BRB Publico LP	0,32%	20%	Art. 7º, IV

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,46%	2,37%	-19,48%
Fevereiro	1,42%	1,02%	139,20%
Março	0,78%	1,22%	64,01%
Abril	0,97%	0,98%	99,26%
Mai	1,68%	0,55%	307,09%
Junho	0,28%	0,41%	69,89%
Julho	1,01%	1,09%	92,33%
Agosto	1,20%	0,43%	280,70%
Setembro	0,12%	0,64%	19,43%
Outubro	0,79%	0,91%	87,39%
Novembro	0,72%	0,93%	77,89%
Dezembro			
Acumulado	8,84%	11,04%	80,07%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 8,84%, enquanto que a meta acumulada no período é de 11,04%, sendo assim o RPPS atingiu 80,07% 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 IPCA III CP	1.148.885,22	25.964,81	2,26%
BB Fluxo	0,00	0,00	0,02%
BB IRF-M1	122.416.020,69	97.932,82	0,08%
BB Perfil	41.560.096,36	16.624,04	0,04%
BB IPCA IV	10.623.191,90	8.498,55	0,08%
BRB Publico LP	1.010.928,79	0,00	0,00%
BTG Pactual IMA-B	1.284.974,80	64.377,24	5,01%
Caixa Brasil I 2022 TP	10.629.740,00	9.566,77	0,09%
Caixa IRF-M1	118.354.871,43	94.683,90	0,08%
Itália FIDC	489.881,56	179.541,59	36,65%
Master III FIDC	84.531,10	2.426,04	2,87%
RB Capital Renda II FII	1.754.164,83	-	-
Santander Irf-M1	5.211.858,20	4.169,49	0,08%
Urca CP	3.662.510,90	12.818,79	0,35%
Carteira	318.231.655,78	519.676,09	0,16%

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 Perfil	-
BB IRF-M1	-
BB IPCA IV	-
BB IPCA III CP	0,85
BB Fluxo	-
Caixa Brasil I 2022 TP	1,36
Caixa IRF-M1	-
Santander Irf-M1	-
Itália FIDC	-
Master III FIDC	-
Urca CP	0,11
BTG Pactual IMA-B	1,59
RB Capital Renda II FII	-
BRB Publico LP	-