

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE CAMPINAS

Informações referentes a Abril/2015

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Abril/2015				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB Perfil	21.501.137,97	0,62%	0,88%	70,94%
BB IRF-M1	0,00	0,62%	0,88%	70,00%
BB IPCA IV	11.126.986,12	1,42%	0,88%	162,08%
BB IPCA III CP	1.204.157,41	1,39%	0,88%	157,83%
BB IMA-B TP	76.214.805,99	-0,18%	0,88%	-20,95%
BB IMA-B 5+	109.377.672,90	-0,57%	0,88%	-64,35%
Caixa Brasil I 2022 TP	11.149.560,00	1,44%	0,88%	163,28%
Caixa IRF-M1	794,33	0,58%	0,88%	66,51%
Caixa IMA-B 5	15.101.068,78	0,06%	0,88%	6,53%
Caixa IMA-B	107.938.418,74	-0,56%	0,88%	-63,19%
Santander Irf-M1	0,00	0,59%	0,88%	66,64%
Santander IMA-B 5	5.424.470,14	-0,13%	0,88%	-15,03%
Itália FIDC	482.286,95	3,06%	0,88%	347,59%
Master III FIDC	57.952,61	-1,66%	0,88%	-189,27%
Urca CP	3.815.879,79	0,87%	0,88%	98,72%
BTG Pactual IMA-B	1.330.758,55	2,19%	0,88%	249,41%
RB Capital Renda II FII	1.807.861,00	1,40%	0,88%	159,75%
BRB Publico LP	1.058.031,71	0,92%	0,88%	104,82%
TOTAL / MÉDIA	367.591.842,99	0,29%	0,88%	33,41%

A rentabilidade média da carteira foi de 0,29% enquanto que a meta atuarial foi de 0,88%.

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB Perfil	5,85%	20%	Art. 7º, IV
BB IRF-M1	0,00%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB IPCA IV	3,03%	20%	Art. 7º, IV
BB IPCA III CP	0,33%	5%	Art. 7º, VII, "b"
BB IMA-B TP	20,73%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB IMA-B 5+	29,76%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa Brasil I 2022 TP	3,03%	20%	Art. 7º, IV
Caixa IRF-M1	0,00%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa IMA-B 5	4,11%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa IMA-B	29,36%	100%	Art. 7º, I, "b"
Santander Irf-M1	0,00%	100%	Art. 7º, I, "b"
Santander IMA-B 5	1,48%	100%	Art. 7º, I, "b"
Itália FIDC	0,13%	5%	Art. 7º, VII, "a"
Master III FIDC	0,02%	5%	Art. 7º, VII, "a"
Urca CP	1,04%	0%	Ativo em Enquadramento
BTG Pactual IMA-B	0,36%	100%	Art. 7º, I, "b"
RB Capital Renda II FII	0,49%	5%	Art. 8º, VI
BRB Publico LP	0,29%	20%	Art. 7º, IV

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	1,07%	2,58%	41,34%
Fevereiro	0,78%	1,73%	45,06%
Março	0,97%	1,59%	61,17%
Abril	0,29%	0,88%	33,41%
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	3,15%	6,95%	45,31%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 3,15%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,95%, sendo assim o RPPS atingiu 45,31% 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 Perfil	21.501.137,97	57.770,79	0,02%
BB IRF-M1	-	-	-
BB IPCA IV	11.126.986,12	463.469,30	0,13%
BB IPCA III CP	1.204.157,41	6.075,14	0,00%
BB IMA-B TP	76.214.805,99	3.026.767,54	0,82%
BB IMA-B 5+	109.377.672,90	4.304.248,70	1,17%
Caixa Brasil I 2022 TP	11.149.560,00	458.555,04	0,12%
Caixa IRF-M1	794,33	31,02	0,00%
Caixa IMA-B 5	15.101.068,78	2.481,18	0,00%
Caixa IMA-B	107.938.418,74	1.267.523,69	0,34%
Santander Irf-M1	-	-	-
Santander IMA-B 5	5.424.470,14	62.880,07	0,02%
Itália FIDC	482.286,95	0,00	0,00%
Master III FIDC	57.952,61	3.666,55	0,00%
Urca CP	3.815.879,79	27.821,80	0,01%
BTG Pactual IMA-B	1.330.758,55	190,42	0,00%
RB Capital Renda II FII	1.807.861,00	361.299,04	0,10%
BRB Publico LP	1.058.031,71	25.159,18	0,01%
Carteira	367.591.842,99	9.312.926,76	2,53%

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	0,06
BB IRF-M1	-
BB IPCA IV	0,22
BB IPCA III CP	0,01
BB IMA-B TP	0,03
BB IMA-B 5+	0,05
Caixa Brasil I 2022 TP	0,23
Caixa IRF-M1	-
Caixa IMA-B 5	-
Caixa IMA-B	0,03
Santander Irf-M1	-
Santander IMA-B 5	-
Itália FIDC	-
Master III FIDC	-
Urca CP	-
BTG Pactual IMA-B	0,03
RB Capital Renda II FII	-
BRB Publico LP	-