

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE CAMPINAS

Informações referentes a Junho/2015

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Junho/2015				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB Perfil	12.003.214,16	0,60%	1,14%	52,59%
BB Fluxo	7.122.573,54	1,00%	1,14%	87,83%
BB IPCA IV	11.401.278,41	1,36%	1,14%	119,08%
BB IPCA III CP	1.227.562,90	0,25%	1,14%	22,08%
BB VII TP	14.317.707,25	0,57%	1,14%	49,90%
BB IMA-B TP	0,00	0,31%	1,14%	27,53%
BB IRF-M1	170.726.019,54	0,53%	1,14%	46,65%
BB IMA-B 5+	0,00	-0,23%	1,14%	-20,58%
Caixa Brasil I 2022 TP	11.426.720,00	1,36%	1,14%	118,93%
Caixa 2016 I TP RF	7.166.712,00	1,17%	1,14%	103,05%
Caixa 2016 III TP	15.002.400,00	0,02%	1,14%	1,40%
Caixa IRF-M1	119.409.564,52	0,45%	1,14%	39,81%
Caixa IMA-B 5	0,00	0,41%	1,14%	35,67%
Caixa IMA-B	0,00	0,24%	1,14%	20,80%
Santander IMA-B 5	0,00	0,46%	1,14%	40,21%
Santander Irf-M1	5.561.002,66	0,41%	1,14%	36,04%
Itália FIDC	459.119,52	1,06%	1,14%	92,57%
Master III FIDC	53.190,82	-0,65%	1,14%	-57,39%
Urca CP	3.893.585,70	0,92%	1,14%	80,50%
BTG Pactual IMA-B	1.359.301,12	-0,35%	1,14%	-31,03%
RB Capital Renda II FII	1.807.861,00	1,29%	1,14%	113,50%
BRB Publico LP	1.079.333,01	1,04%	1,14%	91,17%
TOTAL / MÉDIA	384.017.146,15	0,68%	1,14%	59,87%

A rentabilidade média da carteira foi de 0,68% enquanto que a meta atuarial foi de 1,14%.

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB Perfil	3,13%	20%	Art. 7º, IV
BB Fluxo	1,85%	20%	Art. 7º, IV
BB IPCA IV	2,97%	20%	Art. 7º, IV
BB IPCA III CP	0,32%	5%	Art. 7º, VII, "b"
BB VII TP	3,73%	20%	Art. 7º, IV
BB IMA-B TP	0,00%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB IRF-M1	44,46%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB IMA-B 5+	0,00%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa Brasil I 2022 TP	2,98%	20%	Art. 7º, IV
Caixa 2016 I TP RF	1,87%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa 2016 III TP	3,91%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa IRF-M1	31,09%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa IMA-B 5	0,00%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa IMA-B	0,00%	100%	Art. 7º, I, "b"
Santander IMA-B 5	0,00%	100%	Art. 7º, I, "b"
Santander Irf-M1	1,45%	100%	Art. 7º, I, "b"
Itália FIDC	0,12%	5%	Art. 7º, VII, "a"
Master III FIDC	0,01%	5%	Art. 7º, VII, "a"
Urca CP	1,01%	0%	Ativo em Enquadramento
BTG Pactual IMA-B	0,35%	100%	Art. 7º, I, "b"
RB Capital Renda II FII	0,47%	5%	Art. 8º, VI
BRB Publico LP	0,28%	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%
Maior	2,44%	0,90%	271,40%
Junho	0,68%	1,14%	59,87%
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	6,39%	9,15%	69,86%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 6,39%, enquanto que a meta acumulada no período é de 9,15%, sendo assim o RPPS atingiu 69,86% 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	12.003.214,16	4.111,96	0,00%
BB Fluxo	7.122.573,54	1.211,61	0,00%
BB IPCA IV	11.401.278,41	23.940,85	0,01%
BB IPCA III CP	1.227.562,90	36.821,04	0,01%
BB VII TP	14.317.707,25	0,00	0,00%
BB IMA-B TP	-	-	-
BB IRF-M1	170.726.019,54	454.557,71	0,12%
BB IMA-B 5+	-	-	-
Caixa Brasil I 2022 TP	11.426.720,00	294.193,44	0,08%
Caixa 2016 I TP RF	7.166.712,00	0,00	0,00%
Caixa 2016 III TP	15.002.400,00	0,00	0,00%
Caixa IRF-M1	119.409.564,52	320.038,99	0,08%
Caixa IMA-B 5	-	-	-
Caixa IMA-B	-	-	-
Santander IMA-B 5	-	-	-
Santander Irf-M1	5.561.002,66	14.420,18	0,00%
Itália FIDC	459.119,52	0,00	0,00%
Master III FIDC	53.190,82	10.697,92	0,00%
Urca CP	3.893.585,70	0,00	0,00%
BTG Pactual IMA-B	1.359.301,12	54.123,57	0,01%
RB Capital Renda II FII	1.807.861,00	0,00	0,00%
BRB Publico LP	1.079.333,01	174,76	0,00%
Carteira	384.017.146,15	912.376,98	0,24%

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	0,13
BB Fluxo	-
BB IPCA IV	0,07
BB IPCA III CP	-
BB VII TP	-
BB IMA-B TP	-
BB IRF-M1	-
BB IMA-B 5+	-
Caixa Brasil I 2022 TP	0,07
Caixa 2016 I TP RF	0,01
Caixa 2016 III TP	-
Caixa IRF-M1	-
Caixa IMA-B 5	-
Caixa IMA-B	-
Santander IMA-B 5	-
Santander Irf-M1	-
Itália FIDC	-
Master III FIDC	-
Urca CP	0,00
BTG Pactual IMA-B	-