

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE CAMPINAS

Informações referentes a Julho/2015

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Julho/2015				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB Perfil	31.026.834,79	0,76%	1,28%	59,52%
BB Fluxo	0,00	1,00%	1,28%	78,35%
BB IPCA IV	11.543.524,63	1,25%	1,28%	97,43%
BB IPCA III CP	1.244.502,51	1,38%	1,28%	107,77%
BB VII TP	14.531.043,39	1,49%	1,28%	116,36%
BB IRF-M1	172.866.446,30	1,25%	1,28%	97,91%
Caixa Brasil I 2022 TP	11.564.810,00	1,21%	1,28%	94,38%
Caixa 2016 I TP RF	7.268.527,00	1,42%	1,28%	110,95%
Caixa 2016 III TP	15.215.355,00	1,42%	1,28%	110,85%
Caixa IRF-M1	120.944.690,43	1,26%	1,28%	98,75%
Santander Irf-M1	5.631.179,63	1,26%	1,28%	98,55%
Itália FIDC	633.151,48	42,97%	1,28%	3355,84%
Master III FIDC	51.590,82	0,10%	1,28%	7,88%
Urca CP	3.954.374,86	1,56%	1,28%	121,93%
BTG Pactual IMA-B	1.349.761,40	-0,70%	1,28%	-54,81%
RB Capital Renda II FII	1.814.606,75	1,05%	1,28%	81,81%
BRB Publico LP	1.091.741,92	1,15%	1,28%	89,79%
TOTAL / MÉDIA	400.732.140,91	1,32%	1,28%	102,96%

A rentabilidade média da carteira foi de 1,32% enquanto que a meta atuarial foi de 1,28%.

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB Perfil	7,74%	20%	Art. 7º, IV
BB Fluxo	0,00%	20%	Art. 7º, IV
BB IPCA IV	2,88%	20%	Art. 7º, IV
BB IPCA III CP	0,31%	5%	Art. 7º, VII, "b"
BB VII TP	3,63%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB IRF-M1	43,14%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa Brasil I 2022 TP	2,89%	20%	Art. 7º, IV
Caixa 2016 I TP RF	1,81%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa 2016 III TP	3,80%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa IRF-M1	30,18%	100%	Art. 7º, I, "b"
Santander Irf-M1	1,41%	100%	Art. 7º, I, "b"
Itália FIDC	0,16%	5%	Art. 7º, VII, "a"
Master III FIDC	0,01%	5%	Art. 7º, VII, "a"
Urca CP	0,99%	0%	Ativo em Enquadramento
BTG Pactual IMA-B	0,34%	100%	Art. 7º, I, "b"
RB Capital Renda II FII	0,45%	5%	Art. 8º, VI
BRB Publico LP	0,27%	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%
Mai	2,44%	0,90%	271,40%
Junho	0,68%	1,14%	59,87%
Julho	1,32%	1,28%	102,96%
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	7,79%	10,54%	73,90%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 7,79%, enquanto que a meta acumulada no período é de 10,54%, sendo assim o RPPS atingiu 73,9% 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	31.026.834,79	8.120,77	0,00%
BB Fluxo		0,00	
BB IPCA IV	11.543.524,63	22.147,60	0,01%
BB IPCA III CP	1.244.502,51	38.135,74	0,01%
BB VII TP	14.531.043,39	0,00	0,00%
BB IRF-M1	172.866.446,30	416.290,06	0,10%
Caixa Brasil I 2022 TP	11.564.810,00	22.631,14	0,01%
Caixa 2016 I TP RF	7.268.527,00	0,00	0,00%
Caixa 2016 III TP	15.215.355,00	0,00	0,00%
Caixa IRF-M1	120.944.690,43	299.917,71	0,07%
Santander Irf-M1	5.631.179,63	13.376,11	0,00%
Itália FIDC	633.151,48	0,00	0,00%

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 Fluxo	-
BB IPCA IV	0,08
BB IPCA III CP	0,00
BB VII TP	0,01
BB IRF-M1	0,02
Caixa Brasil I 2022 TP	0,03
Caixa 2016 I TP RF	0,02
Caixa 2016 III TP	-
Caixa IRF-M1	0,02
Santander Irf-M1	0,01
Itália FIDC	0,44
Master III FIDC	-
Urca CP	0,05
BTG Pactual IMA-B	-
RB Capital Renda II FII	-
BRB Publico LP	-