

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE CAMPINAS

Informações referentes a Setembro/2015

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Setembro/2015				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB Perfil	38.508.701,35	0,87%	0,81%	107,41%
BB IPCA IV	11.431.846,08	0,87%	0,81%	107,32%
BB IPCA III CP	1.219.485,34	-0,24%	0,81%	-29,55%
BB VII TP	14.106.402,18	0,78%	0,81%	96,23%
BB IRF-M1	176.132.883,80	0,89%	0,81%	109,94%
Caixa Brasil I 2022 TP	11.444.720,00	0,88%	0,81%	108,48%
Caixa 2016 I TP RF	7.215.152,00	1,50%	0,81%	186,00%
Caixa 2016 III TP	15.097.710,00	1,50%	0,81%	185,87%
Caixa 2016 V TP	10.158.764,28	1,50%	0,81%	186,00%
Caixa IRF-M1	123.351.743,12	0,95%	0,81%	117,42%
Santander Irf-M1	5.740.527,78	0,92%	0,81%	113,65%
Itália FIDC	616.101,97	0,27%	0,81%	33,98%
Master III FIDC	46.738,31	-0,88%	0,81%	-109,21%
Urca CP	3.750.038,07	-4,05%	0,81%	-500,83%
BTG Pactual IMA-B	1.298.487,86	-0,73%	0,81%	-90,79%
RB Capital Renda II FII	1.723.943,87	-3,42%	0,81%	-423,03%
BRB Publico LP	1.115.609,55	1,09%	0,81%	134,51%
TOTAL / MÉDIA	422.958.855,56	0,91%	0,81%	112,18%

A rentabilidade média da carteira foi de 0,91% enquanto que a meta atuarial foi de 0,81%.

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB Perfil	9,10%	20%	Art. 7º, IV
BB IPCA IV	2,70%	20%	Art. 7º, IV
BB IPCA III CP	0,29%	5%	Art. 7º, VII, "b"
BB VII TP	3,34%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB IRF-M1	41,64%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa 2016 I TP RF	1,71%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa 2016 III TP	3,57%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa IRF-M1	29,16%	100%	Art. 7º, I, "b"
Santander Irf-M1	1,36%	100%	Art. 7º, I, "b"
Itália FIDC	0,15%	5%	Art. 7º, VII, "a"
Master III FIDC	0,01%	5%	Art. 7º, VII, "a"
Urca CP	0,89%	0%	Ativo em Enquadramento
RB Capital Renda II FII	0,41%	5%	Art. 8º, VI
BRB Publico LP	0,26%	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	1,32%	1,28%	102,96%
Agosto	0,86%	0,39%	222,80%
Setembro	0,91%	0,81%	112,18%
Outubro			

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	38.508.701,35	8.957,17	0,00%
BB IPCA IV	11.431.846,08	0,00	0,00%
BB IPCA III CP	1.219.485,34	56.867,66	0,01%
BB VII TP	14.106.402,18	359.686,69	0,09%
BB IRF-M1	176.132.883,80	549.212,72	0,13%
Caixa Brasil I 2022 TP	11.444.720,00	562.551,03	0,13%
Caixa 2016 I TP RF	7.215.152,00	201.156,08	0,05%
Caixa 2016 III TP	15.097.710,00	0,00	0,00%
Santander Irf-M1	5.740.527,78	17.698,65	0,00%
Itália FIDC	616.101,97	189.911,00	0,04%
Master III FIDC	46.738,31	3.213,47	0,00%
Urca CP	3.750.038,07	0,00	0,00%
BTG Pactual IMA-B	1.298.487,86	86.829,08	0,02%
RB Capital Renda II FII	1.723.943,87	0,00	0,00%
BRB Publico LP	1.115.609,55	140,30	0,00%
Carteira	422.958.855,56	1.856.317,60	0,44%

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	0,03
BB IPCA III CP	-
BB VII TP	-
BB IRF-M1	-
Caixa Brasil I 2022 TP	-
Caixa 2016 I TP RF	0,03
Caixa 2016 III TP	-
Caixa 2016 V TP	0,03
Caixa IRF-M1	-
Santander Irf-M1	-
Itália FIDC	-
Master III FIDC	-
Urca CP	-
BTG Pactual IMA-B	-
RB Capital Renda II FII	-

Novembro			
Dezembro			
Acumulado	9,71%	11,87%	81,80%

BRB Publico LP	-
----------------	---

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 9,71%, enquanto que a meta acumulada no período é de 11,87%, sendo assim o RPPS atingiu 81,8% da meta atuarial.