

**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE
CAMPINAS**

Informações referentes a Outubro/2015

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Outubro/2015				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB Perfil	42.294.407,02	0,94%	1,11%	84,65%
BB IPCA IV	11.566.512,47	1,18%	1,11%	106,13%
BB IPCA III CP	1.241.330,44	1,79%	1,11%	161,39%
BB VII TP	14.424.684,88	2,26%	1,11%	203,28%
BB IRF-M1	143.762.676,55	1,28%	1,11%	115,34%
Caixa Brasil I 2022 TP	11.579.280,00	1,18%	1,11%	105,93%
Caixa 2016 I TP RF	7.363.433,00	2,06%	1,11%	185,16%
Caixa 2016 III TP	15.407.910,00	2,05%	1,11%	185,11%
Caixa 2016 V TP	10.367.419,43	2,05%	1,11%	185,05%
Caixa IRF-M1	124.967.641,86	1,30%	1,11%	116,78%
Santander Irf-M1	5.815.998,90	1,31%	1,11%	118,45%
Itália FIDC	610.585,81	0,96%	1,11%	86,56%
Master III FIDC	45.375,93	2,04%	1,11%	183,79%
Urca CP	3.768.828,16	0,50%	1,11%	45,14%
BTG Pactual IMA-B	1.329.744,63	2,41%	1,11%	216,88%
RB Capital Renda II FII	1.775.211,57	3,69%	1,11%	332,87%
BRB Publico LP	1.127.121,87	1,03%	1,11%	92,97%
TOTAL / MÉDIA	397.448.162,52	1,37%	1,11%	123,45%

A rentabilidade média da carteira foi de 1,37% enquanto que a meta atuarial foi de 1,11%.

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB Perfil	10,64%	20%	Art. 7º, IV
BB IPCA IV	2,91%	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	36,17%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa Brasil I 2022 TP	2,91%	20%	Art. 7º, IV
Caixa 2016 I TP RF	1,85%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa 2016 III TP	3,88%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa 2016 V TP	2,61%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa IRF-M1	31,44%	100%	Art. 7º, I, "b"
Santander Irf-M1	1,46%	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	0,95%	0%	Ativo em Enquadramento
BTG Pactual IMA-B	0,33%	100%	Art. 7º, I, "b"
RB Capital Renda II FII	0,45%	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%
Maio	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	1,37%	1,11%	123,45%
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	11,21%	13,11%	85,52%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 11,21%, enquanto que a meta acumulada no período é de 13,11%, sendo assim o RPPS atingiu 85,52% 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	42.294.407,02	9.144,83	0,00%
BB IPCA IV	11.566.512,47	11.009,66	0,00%
BB IPCA III CP	1.241.330,44	59.401,67	0,01%
BB VII TP	14.424.684,88	364.625,54	0,09%
BB IRF-M1	143.762.676,55	513.528,73	0,13%
Caixa Brasil I 2022 TP	11.579.280,00	293.849,62	0,07%
Caixa 2016 I TP RF	7.363.433,00	205.594,99	0,05%
Caixa 2016 III TP	15.407.910,00	463.209,12	0,12%
Caixa 2016 V TP	10.367.419,43	79.349,17	0,02%
Caixa IRF-M1	124.967.641,86	417.618,44	0,11%
Santander Irf-M1	5.815.998,90	20.310,81	0,01%
Itália FIDC	610.585,81	190.097,16	0,05%
Master III FIDC	45.375,93	3.407,63	0,00%
Urca CP	3.768.828,16	390.263,47	0,10%
BTG Pactual IMA-B	1.329.744,63	90.271,56	0,02%
RB Capital Renda II FII	1.775.211,57	0,00	0,00%
BRB Publico LP	1.127.121,87	100,36	0,00%
Carteira	397.448.162,52	1.814.389,96	0,46%

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	0,05
BB IPCA IV	0,07
BB IPCA III CP	1,27
BB VII TP	0,04
BB IRF-M1	0,03
Caixa Brasil I 2022 TP	0,07
Caixa 2016 I TP RF	0,12
Caixa 2016 III TP	0,12
Caixa 2016 V TP	0,12
Caixa IRF-M1	0,03
Santander Irf-M1	0,03
Itália FIDC	-
Master III FIDC	-
Urca CP	-
BTG Pactual IMA-B	0,02
RB Capital Renda II FII	-
BRB Publico LP	-