

# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE CAMPINAS

Informações referentes a Janeiro/2015

## 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Janeiro/2015				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB Perfil	66.953.091,28	0,81%	2,58%	31,39%
BB IRF-M1	116.749.558,67	1,00%	2,58%	38,53%
BB IPCA IV	10.910.690,64	1,48%	2,58%	57,38%
BB IPCA III CP	1.173.158,79	2,39%	2,58%	92,58%
Caixa Brasil I 2022 TP	10.917.320,00	1,47%	2,58%	56,88%
Caixa IRF-M1	120.667.821,42	1,05%	2,58%	40,57%
Santander Irf-M1	5.314.040,70	1,07%	2,58%	41,22%
Itália FIDC	490.791,91	1,21%	2,58%	46,98%
Master III FIDC	78.594,89	-0,29%	2,58%	-11,10%
Urca CP	3.720.117,58	1,17%	2,58%	45,14%
BTG Pactual IMA-B	1.299.459,78	3,18%	2,58%	122,85%
BRB Publico LP	1.833.764,68	3,41%	2,58%	132,10%
RB Capital Renda II FII	1.029.590,70	0,91%	2,58%	35,09%
TOTAL / MÉDIA	341.138.001,04	1,07%	2,58%	41,34%

A rentabilidade média da carteira foi de 1,07% enquanto que a meta atuarial foi de 2,58%.

## 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB Perfil	19,63%	20%	Art. 7º, IV
BB IRF-M1	34,22%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB IPCA IV	3,20%	20%	Art. 7º, IV
BB IPCA III CP	0,34%	5%	Art. 7º, VII, "b"
Caixa Brasil I 2022 TP	3,20%	20%	Art. 7º, IV
Caixa IRF-M1	35,37%	100%	Art. 7º, I, "b"
Santander Irf-M1	1,56%	100%	Art. 7º, I, "b"
Itália FIDC	0,14%	5%	Art. 7º, VII, "a"
Master III FIDC	0,02%	5%	Art. 7º, VII, "a"
Urca CP	1,09%	0%	Ativo em Enquadramento
BTG Pactual IMA-B	0,38%	100%	Art. 7º, I, "b"
BRB Publico LP	0,54%	20%	Art. 7º, IV
RB Capital Renda II FII	0,30%	5%	Art. 8º, VI

## 3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	1,07%	2,58%	41,34%
Fevereiro			
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	1,07%	2,58%	41,34%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,07%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,58%, sendo assim o RPPS atingiu 41,34% 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	66.953.091,28	30.494,31	0,01%
BB IRF-M1	116.749.558,67	212.387,36	0,06%
BB IPCA IV	10.910.690,64	14.558,60	0,00%
BB IPCA III CP	1.173.158,79	32.630,48	0,01%
Caixa Brasil I 2022 TP	10.917.320,00	14.756,80	0,00%
Caixa IRF-M1	120.667.821,42	225.775,65	0,07%
Santander Irf-M1	5.314.040,70	9.964,27	0,00%
Itália FIDC	490.791,91	114.023,09	0,03%
Master III FIDC	78.594,89	4.446,97	0,00%
Urca CP	3.720.117,58	19.684,98	0,01%
BTG Pactual IMA-B	1.299.459,78	78.839,19	0,02%
BRB Publico LP	1.833.764,68	255,44	0,00%
Carteira	341.138.001,04	532.015,44	0,16%

#### 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	-
BB IRF-M1	-
BB IPCA IV	-
BB IPCA III CP	-
Caixa Brasil I 2022 TP	-
Caixa IRF-M1	-
Santander Irf-M1	-
Itália FIDC	-
Master III FIDC	-
Urca CP	-
BTG Pactual IMA-B	-
BRB Publico LP	-
RB Capital Renda II FII	-