

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE CAMPINAS

Informações referentes a Dezembro/2015

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Dezembro/2015				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB Perfil	21.800.164,16	0,52%	1,10%	47,46%
BB IPCA IV	11.910.272,16	1,64%	1,10%	149,33%
BB IPCA III CP	1.284.409,15	2,64%	1,10%	240,12%
BB VII TP	14.830.309,21	2,06%	1,10%	187,10%
BB IRF-M1	121.914.852,09	1,13%	1,10%	102,97%
BB IDKA 2	27.948.536,47	0,76%	1,10%	68,71%
Caixa Brasil I 2022 TP	11.922.940,00	1,64%	1,10%	149,14%
Caixa 2016 I TP RF	7.557.788,00	1,67%	1,10%	151,79%
Caixa 2016 III TP	15.814.440,00	1,67%	1,10%	151,74%
Caixa 2016 V TP	10.640.963,56	1,67%	1,10%	151,73%
Caixa IRF-M1	5.493,45	0,77%	1,10%	69,92%
Caixa IDKA 2A	127.872.263,95	0,73%	1,10%	66,82%
Santander FI Irf-M1	0,00	0,77%	1,10%	69,93%
Santander Corporate DI	5.941.285,61	0,32%	1,10%	28,80%
Itália FIDC	655.330,23	13,12%	1,10%	1192,84%
Master III FIDC	41.953,20	0,15%	1,10%	13,70%
Urca CP	3.299.606,33	1,50%	1,10%	136,69%
RB Capital Renda II FII	1.608.186,80	-6,42%	1,10%	-583,61%
BRB Publico LP	1.152.275,17	1,14%	1,10%	103,28%
TOTAL / MÉDIA	386.201.069,54	1,41%	1,10%	128,39%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB Perfil	5,64%	20%	Art. 7º, IV
BB IPCA IV	3,08%	20%	Art. 7º, IV
BB IPCA III CP	0,33%	5%	Art. 7º, VII, "b"
BB VII TP	3,84%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB IRF-M1	31,57%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB IDKA 2	7,24%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa Brasil I 2022 TP	3,09%	20%	Art. 7º, IV
Caixa 2016 I TP RF	1,96%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa 2016 III TP	4,09%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa 2016 V TP	2,76%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa IRF-M1	0,00%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa IDKA 2A	33,11%	100%	Art. 7º, I, "b"
Santander FI Irf-M1	0,00%	100%	Art. 7º, I, "b"
Santander Corporate DI	1,54%	20%	Art. 7º, IV
Itália FIDC	0,17%	5%	Art. 7º, VII, "a"
Master III FIDC	0,01%	5%	Art. 7º, VII, "a"
Urca CP	0,85%	0%	Ativo em Enquadramento
RB Capital Renda II FII	0,42%	5%	Art. 8º, VI
BRB Publico LP	0,30%	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	0,86%	0,39%	222,80%
Setembro	0,91%	0,81%	112,18%
Outubro	1,37%	1,11%	123,45%
Novembro	1,05%	1,35%	77,93%
Dezembro	1,41%	1,10%	128,39%
Acumulado	13,97%	15,90%	87,86%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 13,97%, enquanto que a meta acumulada no período é de 15,9%, sendo assim o RPPS atingiu 87,86% 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	21.800.164,16	6.034,13	0,00%
BB IPCA IV	11.910.272,16	19.148,55	0,00%
BB IPCA III CP	1.284.409,15	57.679,29	0,01%
BB VII TP	14.830.309,21	326.366,55	0,08%
BB IRF-M1	121.914.852,09	396.014,23	0,10%
BB IDKA 2	27.948.536,47	545.101,65	0,14%
Caixa Brasil I 2022 TP	11.922.940,00	311.360,47	0,08%
Caixa 2016 I TP RF	7.557.788,00	210.241,47	0,05%
Caixa 2016 III TP	15.814.440,00	445.232,67	0,12%
Caixa 2016 V TP	10.640.963,56	68.361,18	0,02%
Caixa IRF-M1	5.493,45	16,49	0,00%
Caixa IDKA 2A	127.872.263,95	2.385.762,97	0,62%
Santander FI Irf-M1	0,00	0,00	0,00%
Santander Corporate DI	5.941.285,61	705,51	0,00%
Itália FIDC	655.330,23	73.776,03	0,02%
Master III FIDC	41.953,20	3.156,12	0,00%
Urca CP	3.299.606,33	341.055,37	0,09%
RB Capital Renda II FII	1.608.186,80	0,00	0,00%
BRB Publico LP	1.152.275,17	44,32	0,00%
Carteira	386.201.069,54	3.756.328,42	0,97%

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	0,10
BB IPCA IV	-
BB IPCA III CP	0,06
BB VII TP	0,07
BB IRF-M1	-
BB IDKA 2	0,06
Caixa Brasil I 2022 TP	-
Caixa 2016 I TP RF	0,13
Caixa 2016 III TP	0,13
Caixa 2016 V TP	0,13
Caixa IRF-M1	0,00
Caixa IDKA 2A	0,06
Santander FI Irf-M1	-
Santander Corporate DI	0,05
Itália FIDC	0,06
Master III FIDC	-
Urca CP	0,03
RB Capital Renda II FII	-
BRB Publico LP	-