

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE CAMPINAS

Informações referentes a Novembro/2015

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Novembro/2015				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB Perfil	36.205.976,02	0,77%	1,35%	56,82%
BB IPCA IV	11.717.807,30	1,31%	1,35%	96,63%
BB IPCA III CP	1.251.360,39	0,81%	1,35%	59,69%
BB VII TP	14.531.275,23	0,74%	1,35%	54,59%
BB IRF-M1	127.465.189,63	1,05%	1,35%	77,20%
Caixa Brasil I 2022 TP	11.730.510,00	1,31%	1,35%	96,48%
Caixa 2016 I TP RF	7.433.678,00	0,95%	1,35%	70,47%
Caixa 2016 III TP	15.554.835,00	0,95%	1,35%	70,44%
Caixa 2016 V TP	10.466.295,50	0,95%	1,35%	70,45%
Caixa IRF-M1	126.304.087,77	1,05%	1,35%	77,92%
Santander Irf-M1	5.877.317,87	1,05%	1,35%	77,88%
Itália FIDC	592.978,92	-0,50%	1,35%	-36,98%
Master III FIDC	42.336,72	-1,42%	1,35%	-104,85%
Urca CP	3.250.731,74	1,47%	1,35%	108,90%
BTG Pactual IMA-B	0,00	1,11%	1,35%	82,31%
RB Capital Renda II FII	1.731.499,11	1,81%	1,35%	133,62%
BRB Publico LP	1.139.332,14	1,03%	1,35%	76,20%
TOTAL / MÉDIA	375.295.211,34	1,05%	1,35%	77,93%

A rentabilidade média da carteira foi de 1,05% enquanto que a meta atuarial foi de 1,35%.

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB Perfil	9,65%	20%	Art. 7º, IV
BB IPCA IV	3,12%	20%	Art. 7º, IV
BB IPCA III CP	0,33%	5%	Art. 7º, VII, "b"
BB VII TP	3,87%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB IRF-M1	33,96%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa Brasil I 2022 TP	3,13%	20%	Art. 7º, IV
Caixa 2016 I TP RF	1,98%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa 2016 III TP	4,14%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa 2016 V TP	2,79%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa IRF-M1	33,65%	100%	Art. 7º, I, "b"
Santander Irf-M1	1,57%	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	0,87%	0%	Ativo em Enquadramento
BTG Pactual IMA-B	0,00%	100%	Art. 7º, I, "b"
RB Capital Renda II FII	0,46%	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%
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	1,05%	1,35%	77,93%
Dezembro			
Acumulado	12,39%	14,64%	84,59%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 12,39%, enquanto que a meta acumulada no período é de 14,64%, sendo assim o RPPS atingiu 84,59% 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	36.205.976,02	10.636,09	0,00%
BB IPCA IV	11.717.807,30	12.790,69	0,00%
BB IPCA III CP	1.251.360,39	61.498,63	0,02%
BB VII TP	14.531.275,23	372.385,68	0,10%
BB IRF-M1	127.465.189,63	449.922,31	0,12%
Caixa Brasil I 2022 TP	11.730.510,00	297.892,90	0,08%
Caixa 2016 I TP RF	7.433.678,00	207.819,84	0,06%
Caixa 2016 III TP	15.554.835,00	440.040,94	0,12%
Caixa 2016 V TP	10.466.295,50	75.449,88	0,02%
Caixa IRF-M1	126.304.087,77	417.638,21	0,11%
Santander Irf-M1	5.877.317,87	20.329,24	0,01%
Itália FIDC	592.978,92	184.303,77	0,05%
Master III FIDC	42.336,72	3.458,41	0,00%
Urca CP	3.250.731,74	335.508,37	0,09%
BTG Pactual IMA-B	0,00	0,00	0,00%
RB Capital Renda II FII	1.731.499,11	0,00	0,00%
BRB Publico LP	1.139.332,14	81,79	0,00%
Carteira	375.295.211,34	1.687.167,15	0,45%

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	0,00
BB IPCA IV	0,19
BB IPCA III CP	-
BB VII TP	-
BB IRF-M1	-
Caixa Brasil I 2022 TP	0,19
Caixa 2016 I TP RF	-
Caixa 2016 III TP	-
Caixa 2016 V TP	-
Caixa IRF-M1	-
Santander Irf-M1	-
Itália FIDC	-
Master III FIDC	-
Urca CP	0,02
BTG Pactual IMA-B	-
RB Capital Renda II FII	-