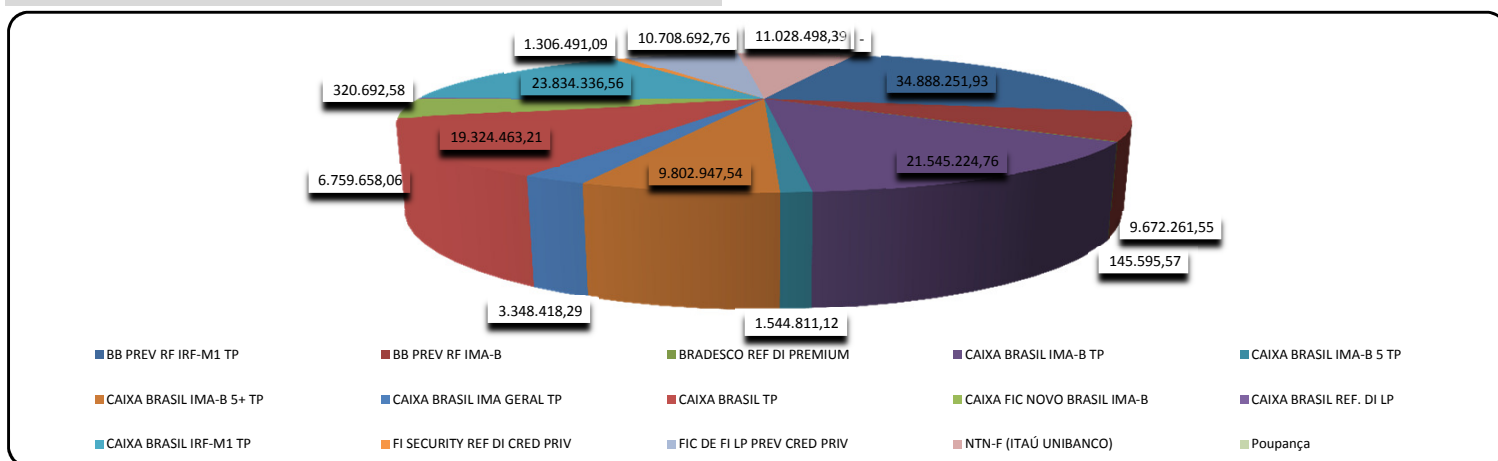


## 1. Rentabilidade Média

FUNDO	SALDO FINAL	RENTABILIDADE / MÊS	META /MÊS	% META
BB PREV RF IRF-M1 TP	34.888.251,93	0,86	1,20	71,67%
BB PREV RF IMA-B	9.672.261,55	2,49	1,20	207,50%
BRADESCO REF DI PREMIUM	145.595,57	0,96	1,20	80,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TP	21.545.224,76	2,42	1,20	201,67%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP	1.544.811,12	0,44	1,20	36,67%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP	9.802.947,54	3,56	1,20	296,67%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TP	3.348.418,29	1,52	1,20	126,67%
CAIXA BRASIL TP	19.324.463,21	0,91	1,20	75,83%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B	6.759.658,06	2,42	1,20	201,67%
CAIXA BRASIL REF. DI LP	320.692,58	0,97	1,20	80,83%
CAIXA BRASIL IRF-M1 TP	23.834.336,56	0,85	1,20	70,83%
FI SECURITY REF DI CRED PRIV	1.306.491,09	0,30	1,20	25,00%
FIC DE FI LP PREV CRED PRIV	10.708.692,76	0,78	1,20	65,00%
NTN-F (ITAÚ UNIBANCO)	11.028.498,39	0,86	1,20	71,67%
Poupança	-	0,00	1,20	0,00%
<b>TOTAL / MÉDIA</b>	<b>154.230.343,41</b>	<b>1,42</b>	<b>1,20</b>	<b>118,75%</b>

A rentabilidade média da carteira é de 1,42%, enquanto que a meta atuarial foi de 1,20%, sendo assim, o RPPS atingiu 118,75% da meta Atuarial

## 2. Carteira Atual



## 4. Gerenciamento de Risco

### 4.1. Risco de Mercado

#### 4.1.1 VaR - VALUE AT RISK

Value-at-Risk ou Valor sob Risco pode se definido como perda máxima num determinado Período sob condições normais de mercado com determinado grau de confiança

FUNDOS	Valor Investido	% VaR 12 MESES
BB PREV RF IRF-M1 TP	34.888.251,93	0,40
BB PREV RF IMA-B	9.672.261,55	9,10
BRADESCO REF DI PREMIUM	145.595,57	0,00
CAIXA BRASIL IMA-B TP	21.545.224,76	9,00
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP	1.544.811,12	2,30
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP	9.802.947,54	13,10
CAIXA BRASIL IMA GERAL TP	3.348.418,29	4,40
CAIXA BRASIL TP	19.324.463,21	0,20
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B	6.759.658,06	8,30
CAIXA BRASIL REF. DI LP	320.692,58	0,10
CAIXA BRASIL IRF-M1 TP	23.834.336,56	0,40
FI SECURITY REF DI CRED PRIV	1.306.491,09	7,00
FIC DE FI LP PREV CRED PRIV	10.708.692,76	6,80
NTN-F (ITAÚ UNIBANCO)	11.028.498,39	N/D
Poupança	-	N/D

O fundo Bradesco Ref Di Premium obteve o menor VaR% dentre os fundos da carteira, sendo assim, é o fundo que apresenta menor risco,

### 3. Comparativo com a Meta Atuarial

	Meta Atuarial	Rent. Média da Carteira	% Atingido da Meta
Janeiro	1,75	1,58	90,33%
Fevereiro	1,71		0%
Março	1,81		0%
Abril	1,20	1,43	118,75%
Maiο			0%
Junho			0%
Julho			0%
Agosto			0%
Setembro			0%
Outubro			0%
Novembro			0%
Dezembro			0%
Acumulado	6,56	3,78	57,58%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 3,78%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,56%, sendo assim o RPPS atingiu 57,58% da meta atuarial

### 4.1.2 INDICE SHARPE

O índice de Sharpe é uma medida que permite a classificação do fundo em termos de desempenho global, sendo considerados melhores os fundos com maior índice. Vale lembrar ainda que o índice varia se o resultado for calculado com base e rentabilidades semanais, mensais ou anuais

FUNDOS	INDICE SHARPE
BB PREV RF IRF-M1 TP	-2,00
BB PREV RF IMA-B	0,40
BRDESCO REF DI PREMIUM	9,80
CAIXA BRASIL IMA-B TP	0,30
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP	0,10
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP	0,40
CAIXA BRASIL IMA GERAL TP	0,10
CAIXA BRASIL TP	-1,90
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B	0,50
CAIXA BRASIL REF. DI LP	-0,40
CAIXA BRASIL IRF-M1 TP	-1,60
FI SECURITY REF DI CRED PRIV	-1,80
FIC DE FI LP PREV CRED PRIV	-1,60
NTN-F (ITAÚ UNIBANCO)	N/D
Poupança	N/D

O fundo Bradesco Ref Di Premium obteve o melhor Índice Sharpe positivo, portanto foi o fundo que teve melhor desempenho analisando a relação risco/retorno.