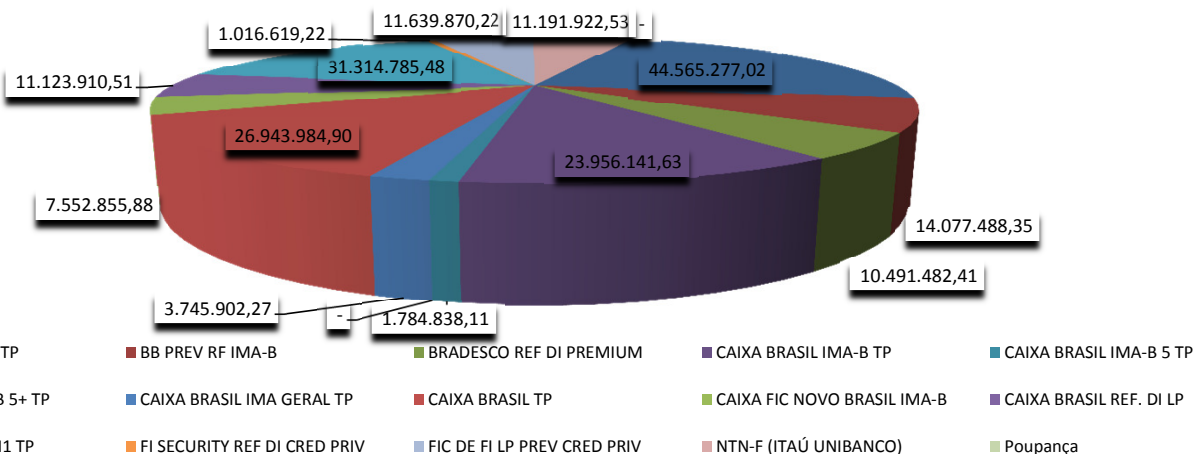


## 1. Rentabilidade Média

FUNDO	SALDO FINAL	RENTABILIDADE / MÊS	META /MÊS	% META
BB PREV RF IRF-M1 TP	44.565.277,02	1,21	0,92	131,52%
BB PREV RF IMA-B	14.077.488,35	5,16	0,92	560,87%
BRADESCO REF DI PREMIUM	10.491.482,41	1,15	0,92	125,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TP	23.956.141,63	5,31	0,92	577,17%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP	1.784.838,11	0,73	0,92	79,35%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP	-	0,00	0,92	0,00%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TP	3.745.902,27	3,34	0,92	363,04%
CAIXA BRASIL TP	26.943.984,90	1,17	0,92	127,17%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B	7.552.855,88	5,23	0,92	568,48%
CAIXA BRASIL REF. DI LP	11.123.910,51	1,18	0,92	128,26%
CAIXA BRASIL IRF-M1 TP	31.314.785,48	1,23	0,92	133,70%
FI SECURITY REF DI CRED PRIV	1.016.619,22	-20,38	0,92	#####
FIC DE FI LP PREV CRED PRIV	11.639.870,22	0,10	0,92	10,87%
NTN-F (ITAÚ UNIBANCO)	11.191.922,53	1,46	0,92	158,70%
Poupança	-	0,00	0,92	0,00%
<b>TOTAL / MÉDIA</b>	<b>199.405.078,53</b>	<b>2,00</b>	<b>0,92</b>	<b>217,55%</b>

A rentabilidade média da carteira é de 2,00%, enquanto que a meta atuarial foi de 0,92%, sendo assim, o RPPS atingiu 217,55% 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	44.565.277,02	0,05
BB PREV RF IMA-B	14.077.488,35	1,07
BRADESCO REF DI PREMIUM	10.491.482,41	0,00
CAIXA BRASIL IMA-B TP	23.956.141,63	1,06
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP	1.784.838,11	0,41
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP	-	
CAIXA BRASIL IMA GERAL TP	3.745.902,27	0,53
CAIXA BRASIL TP	26.943.984,90	0,03
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B	7.552.855,88	0,97
CAIXA BRASIL REF. DI LP	11.123.910,51	0,01
CAIXA BRASIL IRF-M1 TP	31.314.785,48	0,05
FI SECURITY REF DI CRED PRIV	1.016.619,22	0,14
FIC DE FI LP PREV CRED PRIV	11.639.870,22	0,62
NTN-F (ITAÚ UNIBANCO)	11.191.922,53	N/D
Poupança	-	

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	1,76	1,19	67,34%
Fevereiro	1,39	1,27	91,65%
Março	0,92	2,00	217,55%
Abril			0,00%
Maio			0,00%
Junho			0,00%
Julho			0,00%
Agosto			0,00%
Setembro			0,00%
Outubro			0,00%
Novembro			0,00%
Dezembro			0,00%
Acumulado	4,12	4,53	109,74%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 4,53%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,12%, sendo assim o RPPS atingiu 109,74% 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	VOLATILIDADE
BB PREV RF IRF-M1 TP	2,40	0,50
BB PREV RF IMA-B	0,40	9,00
BRADESCO REF DI PREMIUM	-0,50	0,00
CAIXA BRASIL IMA-B TP	0,30	9,10
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP	1,90	3,30
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP		
CAIXA BRASIL IMA GERAL TP	0,10	4,60
CAIXA BRASIL TP	-0,90	0,20
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B	0,40	8,20
CAIXA BRASIL REF. DI LP	-0,40	0,10
CAIXA BRASIL IRF-M1 TP	2,40	0,50
FI SECURITY REF DI CRED PRIV	-4,90	7,10
FIC DE FI LP PREV CRED PRIV	-0,20	8,70
NTN-F (ITAÚ UNIBANCO)	N/D	N/D
Poupança		

Os fundos BB PREV IRF-M1 TP e CAIXA BRASIL IRF-M1 TP tiveram o melhor Índice Sharpe positivo, portanto foram os fundos que tiveram melhor desempenho analisando a relação risco/retorno.