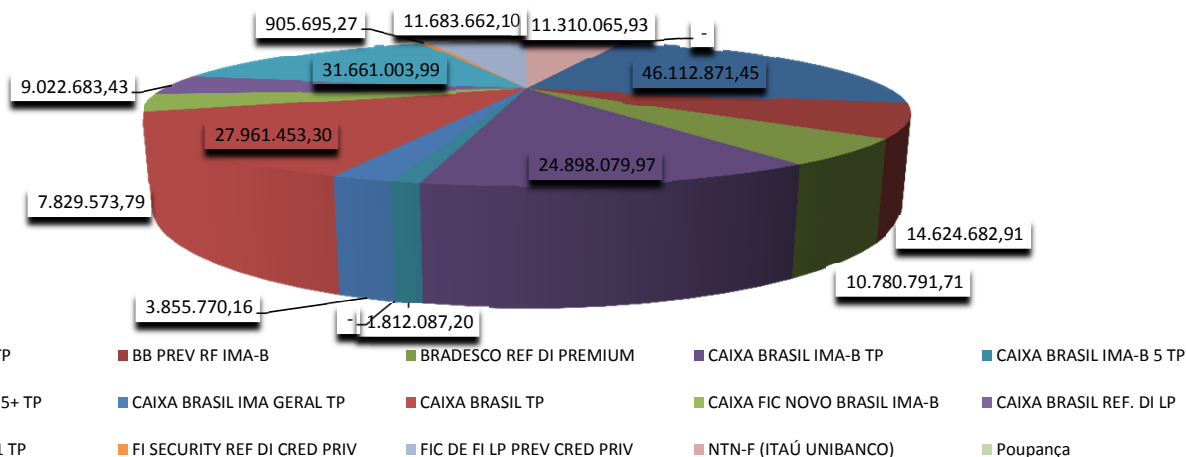


## 1. Rentabilidade Média

FUNDO	SALDO FINAL	RENTABILIDADE / MÊS	META /MÊS	% META
BB PREV RF IRF-M1 TP	46.112.871,45	1,11	1,10	100,91%
BB PREV RF IMA-B	14.624.682,91	3,89	1,10	353,64%
BRADESCO REF DI PREMIUM	10.780.791,71	1,04	1,10	94,55%
CAIXA BRASIL IMA-B TP	24.898.079,97	3,93	1,10	357,27%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP	1.812.087,20	1,53	1,10	139,09%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP	-	0,00	1,10	0,00%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TP	3.855.770,16	2,93	1,10	266,36%
CAIXA BRASIL TP	27.961.453,30	1,09	1,10	99,09%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B	7.829.573,79	3,66	1,10	332,73%
CAIXA BRASIL REF. DI LP	9.022.683,43	1,07	1,10	97,27%
CAIXA BRASIL IRF-M1 TP	31.661.003,99	1,11	1,10	100,91%
FI SECURITY REF DI CRED PRIV	905.695,27	-10,91	1,10	-991,82%
FIC DE FI LP PREV CRED PRIV	11.683.662,10	0,38	1,10	34,55%
NTN-F (ITAÚ UNIBANCO)	11.310.065,93	1,06	1,10	96,36%
Poupança	-	0,00	1,10	0,00%
<b>TOTAL / MÉDIA</b>	<b>202.458.421,21</b>	<b>1,69</b>	<b>1,10</b>	<b>153,43%</b>

A rentabilidade média da carteira é de 1,69%, enquanto que a meta atuarial foi de 1,10%, sendo assim, o RPPS atingiu 153,43% 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	46.112.871,45	0,05
BB PREV RF IMA-B	14.624.682,91	1,07
BRADESCO REF DI PREMIUM	10.780.791,71	0,00
CAIXA BRASIL IMA-B TP	24.898.079,97	1,06
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP	1.812.087,20	0,41
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP	-	
CAIXA BRASIL IMA GERAL TP	3.855.770,16	0,53
CAIXA BRASIL TP	27.961.453,30	0,03
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B	7.829.573,79	0,97
CAIXA BRASIL REF. DI LP	9.022.683,43	0,01
CAIXA BRASIL IRF-M1 TP	31.661.003,99	0,05
FI SECURITY REF DI CRED PRIV	905.695,27	0,14
FIC DE FI LP PREV CRED PRIV	11.683.662,10	0,62
NTN-F (ITAÚ UNIBANCO)	11.310.065,93	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	1,10	1,69	153,43%
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	5,27	6,29	119,37%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 6,29%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,27%, sendo assim o RPPS atingiu 119,37% 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.