



Rentabilidade Média

Fundo de Renda Fixa

Fundo	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 369.330,76	-0,5483%	1,3086%	-41,8997%
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TIT. PUB FI	R\$ 444.484,67	-0,8362%	1,3086%	-63,9004%
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 77.343,36	-1,5558%	1,3086%	-118,8904%
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 308.108,15	-1,5558%	1,3086%	-118,8904%
BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI	R\$ 501.584,00	-1,5329%	1,3086%	-117,1405%
BB PREV RF IMA-B5+ TIT. PUB FI	R\$ 386.284,20	-2,3178%	1,3086%	-177,1206%
BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 21.301,43	-0,4255%	1,3086%	-32,5157%
BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 377.528,81	-1,1906%	1,3086%	-90,9827%
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 8.981,82	0,0042%	1,3086%	0,3210%
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 176.863,52	0,0048%	1,3086%	0,3668%
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.096,32	0,0110%	1,3086%	0,8406%
FI CAIXA BRASIL IMA-B TIT. PUB RF LONGO PRAZO	R\$ 386.910,26	-1,5370%	1,3086%	-117,4538%

Fundo de Ações

Fundo	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
BB AÇÕES VALOR FI EM COTAS DE FI EM AÇÕES	R\$ 54.863,43	-5,0280%	1,3086%	-384,2274%

Fundo Multimercado

Fundo	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	R\$ 73.799,04	0,9423%	1,3086%	72,0083%

Total	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
	R\$ 3.188.479,77	-1,2604%	1,3086%	-96,3161%

Total: R\$ R\$ 3.188.479,77

A rentabilidade média da carteira é de -1,2604%, enquanto que a meta atuarial foi de 1,3086%, sendo assim, atingindo -96,3161% da meta Atuarial

Carteira Atual

Comparativo com a Meta Atuarial

Mês	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
JANEIRO	-0,8333%	0,6959%	-119,7490%
FEVEREIRO	-1,2604%	1,3086%	-96,3161%

	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
Total	-2,0832%	2,0136%	-103,4572%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -2,0832% enquanto que a meta acumulada no período é de 2,0136%, sendo assim o RPPS atingiu -103,4572% da meta atuarial

Gerenciamento de Risco

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

Nome	Saldo	VAR 12M
BB AÇÕES VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 54.863,43	1,198570%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 369.330,76	0,008940%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 444.484,67	0,013087%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 308.108,15	0,093980%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 77.343,36	0,093980%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 501.584,00	0,092654%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 386.284,20	0,228901%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 377.528,81	0,009573%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 21.301,43	0,009573%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 8.981,82	0,000301%

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 176.863,52	0,000301%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 1.096,32	0,000086%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	R\$ 73.799,04	0,494433%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 386.910,26	0,094130%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 0,00	0,008940%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 0,00	0,000086%

	Saldo	VAR 12M
Geral	R\$ 3.188.479,77	0,167036%

O fundo BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI obteve o menor VaR% dentre os fundos da carteira, sendo assim, é o fundo que apresenta menor risco.

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

Nome	Sharpe
BB AÇÕES VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	3,583453%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	17,646210%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	11,140982%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	5,664939%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	5,664939%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	6,080131%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	0,905491%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE	16,600828%

INVESTIMENTO	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	16,600828%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	33,188824%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	33,188824%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	25,336586%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	15,162290%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	5,887643%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	17,646210%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	25,336586%

	Sharpe
Geral	14,046569%

O fundo BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI teve o melhor Índice Sharpe positivo, portanto foi o fundo que teve melhor desempenho analisando a relação risco/retorno.