



## Rentabilidade Média

### RENDA FIXA

| Fundo   | Saldo Atual    | Retorno % | Meta    | Atingimento |
|---|----------------|-----------|---------|-------------|
| BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI   | R\$ 41.521,12  | 0,7392%   | 0,6160% | 120,0032%   |
| BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI   | R\$ 638.480,30 | 0,7392%   | 0,6160% | 120,0053%   |
| BB PREV RF IMA GERAL EX-C TIT. PUB FI   | R\$ 299.862,57 | 0,5748%   | 0,6160% | 93,3106%    |
| BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI  | R\$ 742.076,22 | 0,5809%   | 0,6160% | 94,2988%    |
| BB PREV RF IMA-B FI   | R\$ 62.165,77  | -0,4542%  | 0,6160% | -73,7350%   |
| BB PREV RF IMA-B FI   | R\$ 127.462,41 | -0,4542%  | 0,6160% | -73,7368%   |
| BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI  | R\$ 176.825,23 | -0,4013%  | 0,6160% | -65,1417%   |
| BB PREV RF IMA-B5+ TIT. PUB FI  | R\$ 113.238,16 | -1,2873%  | 0,6160% | -208,9724%  |
| BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI  | R\$ 0,00       | 0,0000%   | 0,6160% | 0,0000%     |
| BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI  | R\$ 0,00       | 0,0000%   | 0,6160% | 0,0000%     |
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI   | R\$ 82.586,35  | 1,1158%   | 0,6160% | 181,1344%   |
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI   | R\$ 367.681,25 | 0,9283%   | 0,6160% | 150,6939%   |
| BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI                             | R\$ 90.714,38  | 1,1314%   | 0,6160% | 183,6622%   |
| BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI                             | R\$ 772.852,21 | 1,0296%   | 0,6160% | 167,1433%   |
| BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FI EM COTAS DE FI  | R\$ 0,00       | 0,0000%   | 0,6160% | 0,0000%     |
| BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FI EM COTAS DE FI  | R\$ 0,00       | 0,0000%   | 0,6160% | 0,0000%     |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TIT. PUB RF LONGO PRAZO   | R\$ 257.238,28 | -0,3708%  | 0,6160% | -60,1923%   |
| FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO  | R\$ 953.452,12 | 1,2372%   | 0,6160% | 200,8480%   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LONGO PRAZO FUNDO DE INV EM COTAS DE FUNDOS DE DE INV | R\$ 254.799,77 | 0,6545%   | 0,6160% | 106,2461%   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI - FI  | R\$ 689.455,20 | 1,3005%   | 0,6160% | 211,1147%   |

### RENDA VARIÁVEL

| Fundo                                     | Saldo Atual   | Retorno % | Meta    | Atingimento  |
|---|---------------|-----------|---------|--------------|
| BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI EM AÇÕES      | R\$ 55.851,16 | -0,7451%  | 0,6160% | -120,9632%   |
| BB AÇÕES SIDERURGIA FI EM COTAS DE FI     | R\$ 41.414,18 | -6,4641%  | 0,6160% | -1.049,3667% |
| BB AÇÕES VALOR FI EM COTAS DE FI EM AÇÕES | R\$ 57.239,38 | -5,8143%  | 0,6160% | -943,8802%   |

### ESTRUTURADO

| Fundo  | Saldo Atual    | Retorno % | Meta    | Atingimento |
|--|----------------|-----------|---------|-------------|
| FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO | R\$ 85.846,74  | -0,4068%  | 0,6160% | -66,0388%   |
| FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO   | R\$ 185.553,21 | -0,9168%  | 0,6160% | -148,8301%  |

### EXTERIOR

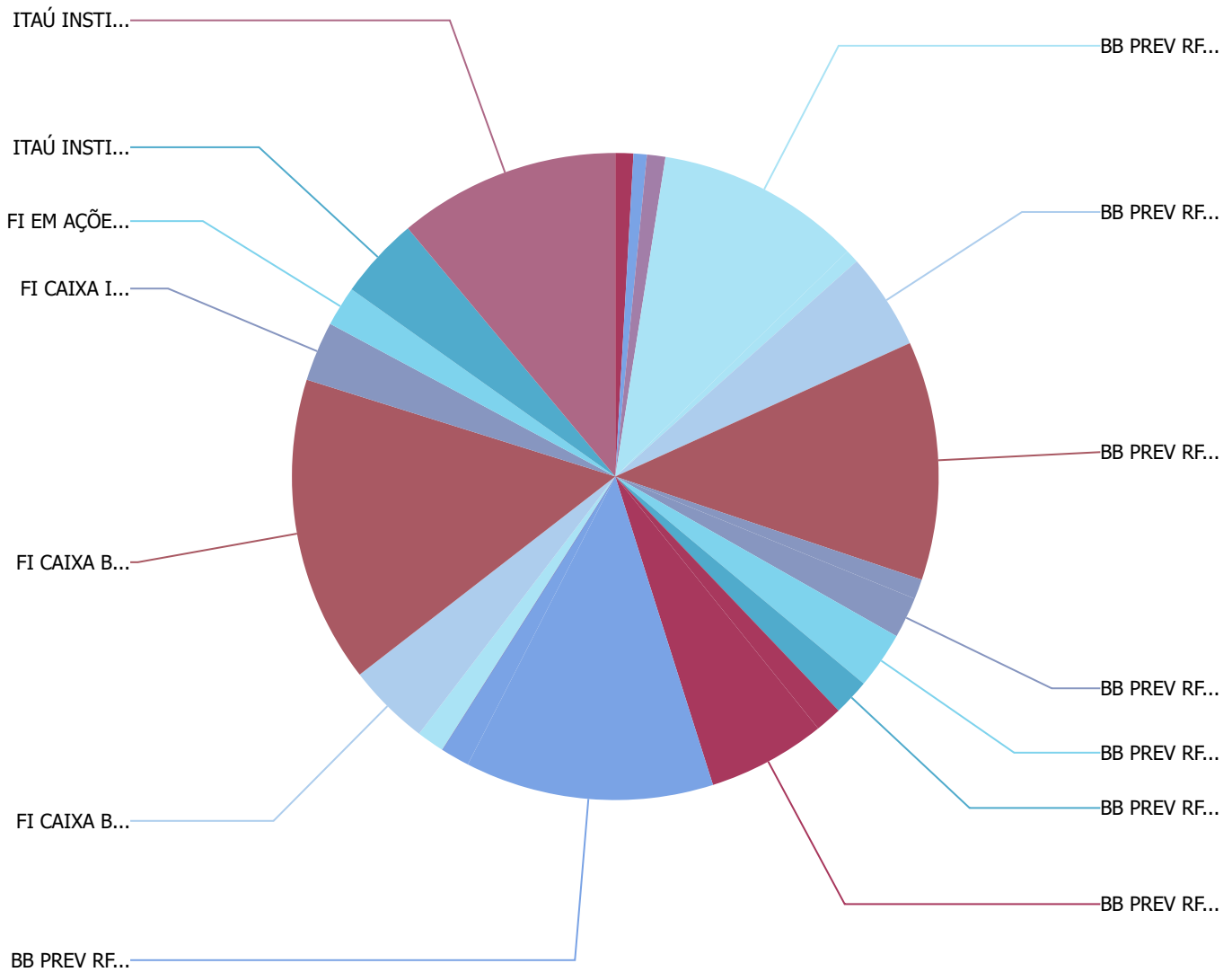
| Fundo                                       | Saldo Atual    | Retorno % | Meta    | Atingimento |
|---|----------------|-----------|---------|-------------|
| FI EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | R\$ 124.379,01 | 2,9037%   | 0,6160% | 471,3809%   |

| Total | Saldo Atual      | Retorno % | Meta    | Atingimento |
|-------|------------------|-----------|---------|-------------|
|       | R\$ 6.220.695,02 | 0,6082%   | 0,6160% | 98,7372%    |

**Total: R\$ R\$ 6.220.695,02**

A rentabilidade média da carteira é de 0,6082%, enquanto que a meta atuarial foi de 0,6160%, sendo assim, atingindo 98,7372% da meta Atuarial

## Carteira Atual



# Comparativo com a Meta Atuarial

| Mês       | Efetivo % | Meta %  | Atingimento % |
|-----------|-----------|---------|---------------|
| JANEIRO   | 1,3556%   | 0,9171% | 147,8110%     |
| FEVEREIRO | 0,7042%   | 1,2283% | 57,3333%      |
| MARÇO     | 1,4762%   | 1,0978% | 134,4715%     |
| ABRIL     | 0,9719%   | 0,9974% | 97,4407%      |
| MAIO      | 1,3050%   | 0,6160% | 211,8517%     |
| JUNHO     | 1,5383%   | 0,3048% | 504,7015%     |
| JULHO     | 1,2038%   | 0,5056% | 238,0967%     |
| AGOSTO    | 0,6082%   | 0,6160% | 98,7372%      |

|       | Efetivo % | Meta %  | Atingimento % |
|-------|-----------|---------|---------------|
| Total | 9,5346%   | 6,4547% | 147,7166%     |

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 9,5346% enquanto que a meta acumulada no período é de 6,4547%, sendo assim o RPPS atingiu 147,7166% 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 BOLSA AMERICANA FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES                            | R\$ 55.851,16  | 0,199222% |
| BB AÇÕES SIDERURGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO       | R\$ 41.414,18  | 0,730480% |
| BB AÇÕES VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES   | R\$ 57.239,38  | 0,192236% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO         | R\$ 638.480,30 | 0,003983% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO         | R\$ 41.521,12  | 0,003983% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | R\$ 299.862,57 | 0,002722% |

|  |                |           |
|--|----------------|-----------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI                | R\$ 742.076,22 | 0,003208% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO   | R\$ 62.165,77  | 0,013604% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO   | R\$ 127.462,41 | 0,013604% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                            | R\$ 176.825,23 | 0,013315% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                          | R\$ 113.238,16 | 0,039937% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI  | R\$ 82.586,35  | 0,000113% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI  | R\$ 367.681,25 | 0,000113% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | R\$ 772.852,21 | 0,000093% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | R\$ 90.714,38  | 0,000093% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                            | R\$ 953.452,12 | 0,000133% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO                          | R\$ 185.553,21 | 0,248256% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INV EM COTAS DE FUNDOS DE DE INV  | R\$ 254.799,77 | 0,000780% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI - FUNDO DE INVESTIMENTO                                | R\$ 689.455,20 | 0,000147% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                            | R\$ 0,00       | 0,005838% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                            | R\$ 0,00       | 0,005838% |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO        | R\$ 0,00       | 0,000039% |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO        | R\$ 0,00       | 0,000039% |
| FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO   | R\$ 85.846,74  | 0,008971% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                     | R\$ 257.238,28 | 0,013407% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I                                       | R\$ 124.379,01 | 0,159265% |

|       |                  |           |
|-------|------------------|-----------|
|       | Saldo            | VAR 12M   |
| Geral | R\$ 6.220.695,02 | 0,063824% |

O fundo BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO 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 BOLSA AMERICANA FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES  | 17,522178% |
| BB AÇÕES SIDERURGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO                         | 13,716742% |
| BB AÇÕES VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES                     | -2,830015% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                           | 24,527836% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                           | 24,527836% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                   | 23,895303% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI                | 24,024708% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO   | 20,637058% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO   | 20,637058% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                            | 20,701977% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                          | 17,965434% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI  | 26,092397% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI  | 26,092397% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | 26,273444% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO   | 26,273444% |

|   |            |
|---|------------|
| PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI   |            |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                           | 26,401052% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO                         | 17,641077% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INV EM COTAS DE FUNDOS DE DE INV | 25,001125% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI - FUNDO DE INVESTIMENTO                               | 26,555855% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                           | 23,284145% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                           | 23,284145% |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO       | 26,447831% |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO       | 26,447831% |
| FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO  | 28,603989% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                    | 20,770728% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I                                      | 16,175760% |

|       |            |
|-------|------------|
|       | Sharpe     |
| Geral | 21,948898% |

O fundo FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO teve o melhor Índice Sharpe positivo, portanto foi o fundo que teve melhor desempenho analisando a relação risco/retorno.