



Rentabilidade Média

REDA VARIÁVEL

Fundo	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI EM AÇÕES	R\$ 83.469,27	2,6689%	0,0000%	0,0000%
BB AÇÕES SIDERURGIA FI EM COTAS DE FI	R\$ 0,00	0,0000%	0,0000%	0,0000%
BB AÇÕES VALOR FI EM COTAS DE FI EM AÇÕES	R\$ 0,00	0,0000%	0,0000%	0,0000%

REDA FIXA

Fundo	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 179.583,51	0,7772%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 35.601,06	0,5878%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 428.654,83	0,5878%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TIT. PUB FI	R\$ 140.511,90	0,5578%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FIF RESP LIM	R\$ 377.568,40	0,2802%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 0,00	0,0000%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 0,00	0,0000%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI	R\$ 192.389,09	-0,7823%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IMA-B5+ TIT. PUB FI	R\$ 0,00	0,0000%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 0,00	0,0000%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 0,00	0,0000%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 300.257,51	1,1732%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 1.537.364,28	1,1943%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 1.611.969,58	1,1834%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 301,72	1,2959%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 719.757,74	1,2928%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.443.298,80	1,2928%	0,0000%	0,0000%
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FI EM COTAS DE FI	R\$ 0,00	0,0000%	0,0000%	0,0000%
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FI EM COTAS DE FI	R\$ 0,00	0,0000%	0,0000%	0,0000%
FI CAIXA BRASIL IMA-B TIT. PUB RF LONGO PRAZO	R\$ 174.215,72	-0,8114%	0,0000%	0,0000%
FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 1.688.969,99	1,2842%	0,0000%	0,0000%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LONGO PRAZO FUNDO DE INV EM COTAS DE FUNDOS DE DE INV	R\$ 314.312,69	1,2131%	0,0000%	0,0000%
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI FIF RESP LIMITADA	R\$ 1.438.198,95	1,2814%	0,0000%	0,0000%
SICREDI - FI COTAS DE FI RF IMA-B5 LP	R\$ 54.854,29	0,2643%	0,0000%	0,0000%

SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1	R\$ 561.152,92	1,2240%	0,0000%	0,0000%
SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI	R\$ 613.187,12	1,1562%	0,0000%	0,0000%

ESTRUTURADO

Fundo	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	R\$ 96.629,18	1,0084%	0,0000%	0,0000%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	R\$ 287.781,89	3,0713%	0,0000%	0,0000%

EXTERIOR

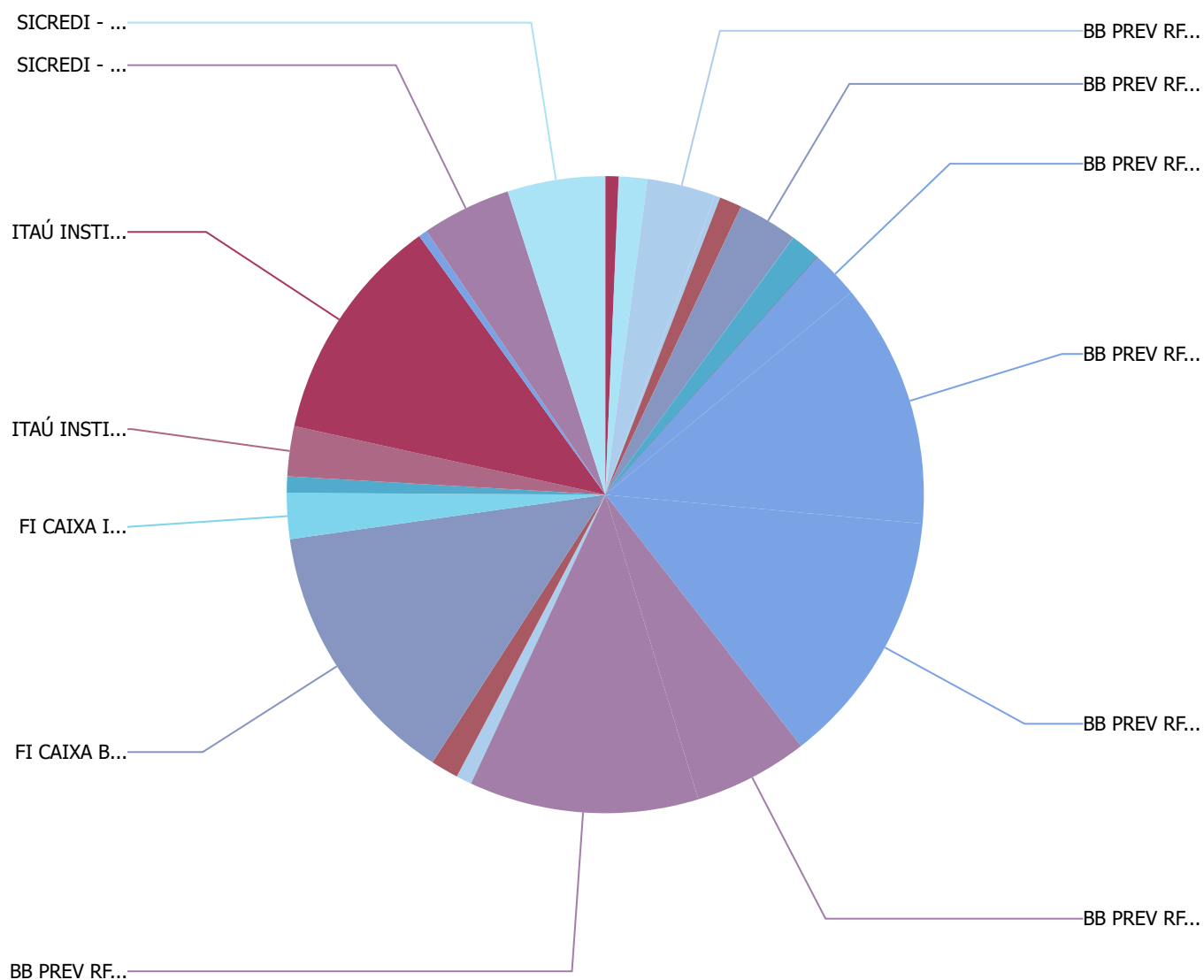
Fundo	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
FI EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$ 102.900,24	6,0287%	0,0000%	0,0000%

Total	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
	R\$ 12.382.930,68	1,1863%	0,0000%	∞%

Total: R\$ R\$ 12.382.930,68

A rentabilidade média da carteira é de 1,1863%, enquanto que a meta atuarial foi de 0,0000%, sendo assim, atingindo ∞% da meta Atuarial

Carteira Atual



Comparativo com a Meta Atuarial

Mês	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
JANEIRO	1,1072%	0,5640%	196,3186%
FEVEREIRO	0,7465%	1,7187%	43,4349%
MARÇO	0,6038%	0,9657%	62,5227%
ABRIL	1,0455%	0,8351%	125,1896%
MAIO	1,2911%	0,6644%	194,3200%
JUNHO	1,1567%	0,6444%	179,5030%
JULHO	1,1863%	0,6644%	178,5532%

	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
Total	7,35%	6,21%	118,44%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 7,3572% enquanto que a meta acumulada no período é de 6,2112%, sendo assim o RPPS atingiu 118,44% 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\$ 83.469,27	0,111910%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 179.583,51	0,000170%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 428.654,83	0,003174%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 35.601,06	0,003174%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 140.511,90	0,003492%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 377.568,40	0,003260%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 192.389,09	0,017182%

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 300.257,51	0,000475%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 1.537.364,28	0,000475%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 1.611.969,58	0,000475%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 719.757,74	0,000208%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 301,72	0,000208%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 1.443.298,80	0,000208%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 174.215,72	0,017490%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 1.688.969,99	0,000192%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	R\$ 287.781,89	0,117992%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$ 102.900,24	0,257785%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INV EM COTAS DE FUNDOS DE DE INV	R\$ 314.312,69	0,000248%
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI - FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 1.438.198,95	0,000182%
BB AÇÕES SIDERURGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 0,00	0,121351%
BB AÇÕES VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 0,00	0,133161%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 0,00	0,016822%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 0,00	0,016822%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 0,00	0,040467%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 0,00	0,014795%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 0,00	0,014795%
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 0,00	0,000126%
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 0,00	0,000126%

EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO		
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	R\$ 96.629,18	0,008153%
SICREDI - FI COTAS DE FI RF IMA-B5 LP	R\$ 54.854,29	0,002997%
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	R\$ 561.152,92	0,000620%
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI	R\$ 613.187,12	0,000175%

	Saldo	VAR 12M
Geral	R\$ 12.382.930,68	0,028397%

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	27,459946%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	26,169455%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	24,364784%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	24,364784%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	23,550175%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	23,187831%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	12,399513%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	25,477843%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	25,477843%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	25,477843%

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	26,111414%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	26,111414%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	26,111414%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	12,285568%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	26,056706%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	28,230106%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	19,019206%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INV EM COTAS DE FUNDOS DE DE INV	26,445766%
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI - FUNDO DE INVESTIMENTO	26,104533%
BB AÇÕES SIDERURGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-8,208940%
BB AÇÕES VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-4,816886%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	12,335770%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	12,335770%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA- B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	3,987609%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	20,707454%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	20,707454%
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	26,449565%
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	26,449565%
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO	22,455362%
SICREDI - FI COTAS DE FI RF IMA-B5 LP	23,395841%

SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	25,577977%
SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI	26,134905%

	Sharpe
Geral	20,684925%

O fundo FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO teve o melhor Índice Sharpe positivo, portanto foi o fundo que teve melhor desempenho analisando a relação risco/retorno.