

# Rentabilidade Média

## RENTA FIXA

| Fundo                                                                                       | Saldo Atual      | Retorno % | Meta    | Atingimento |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|-----------|---------|-------------|
| BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI                                                               | R\$ 44.761,87    | 0,6354%   | 0,3777% | 168,2341%   |
| BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI                                                               | R\$ 688.314,03   | 0,6354%   | 0,3777% | 168,2329%   |
| BB PREV RF IMA GERAL EX-C TIT. PUB FI                                                       | R\$ 325.626,09   | 0,7807%   | 0,3777% | 206,7009%   |
| BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI                                            | R\$ 820.026,19   | 0,5189%   | 0,3777% | 137,3940%   |
| BB PREV RF IMA-B FI                                                                         | R\$ 65.210,87    | 0,4304%   | 0,3777% | 113,9591%   |
| BB PREV RF IMA-B FI                                                                         | R\$ 133.705,98   | 0,4304%   | 0,3777% | 113,9580%   |
| BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI                                                                | R\$ 185.729,01   | 0,4626%   | 0,3777% | 122,4758%   |
| BB PREV RF IMA-B5+ TIT. PUB FI                                                              | R\$ 116.403,07   | 0,7517%   | 0,3777% | 199,0334%   |
| BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI                                                                | R\$ 0,00         | 0,0000%   | 0,3777% | 0,0000%     |
| BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI                                                                | R\$ 0,00         | 0,0000%   | 0,3777% | 0,0000%     |
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI                                                           | R\$ 90.919,67    | 0,7430%   | 0,3777% | 196,7108%   |
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI                                                           | R\$ 879.655,27   | 0,7430%   | 0,3777% | 196,7095%   |
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI                                                           | R\$ 1.125.860,28 | 0,7430%   | 0,3777% | 196,7094%   |
| BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI                             | R\$ 12.043,26    | 0,8918%   | 0,3777% | 236,1078%   |
| BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI                             | R\$ 112.270,10   | 0,8631%   | 0,3777% | 228,5141%   |
| BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI                             | R\$ 425.236,06   | 0,6566%   | 0,3777% | 173,8391%   |
| BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FI EM COTAS DE FI                                              | R\$ 0,00         | 0,0000%   | 0,3777% | 0,0000%     |
| BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FI EM COTAS DE FI                                              | R\$ 0,00         | 0,0000%   | 0,3777% | 0,0000%     |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TIT. PUB RF LONGO PRAZO                                               | R\$ 270.307,46   | 0,4995%   | 0,3777% | 132,2414%   |
| FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                                              | R\$ 1.176.543,15 | 0,8829%   | 0,3777% | 233,7494%   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LONGO PRAZO FUNDO DE INV EM COTAS DE FUNDOS DE DE INV | R\$ 281.903,59   | 0,7822%   | 0,3777% | 207,1084%   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI - FI                                                  | R\$ 771.189,23   | 0,8876%   | 0,3777% | 234,9974%   |
| SICREDI - FI EM COTAS DE FI RF IMA-B5 LP                                                    | R\$ 50.994,04    | 0,5661%   | 0,3777% | 149,8849%   |
| SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1                                                       | R\$ 153.009,64   | 0,7728%   | 0,3777% | 204,5980%   |
| SICREDI - FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI                                                     | R\$ 94.276,49    | 0,3318%   | 0,3777% | 87,8518%    |

## RENTA VARIÁVEL

| Fundo                                     | Saldo Atual   | Retorno % | Meta    | Atingimento |
|-------------------------------------------|---------------|-----------|---------|-------------|
| BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI EM AÇÕES      | R\$ 71.638,57 | 1,7410%   | 0,3777% | 460,9460%   |
| BB AÇÕES SIDERURGIA FI EM COTAS DE FI     | R\$ 45.303,60 | 3,0562%   | 0,3777% | 809,1555%   |
| BB AÇÕES VALOR FI EM COTAS DE FI EM AÇÕES | R\$ 65.458,01 | 5,0652%   | 0,3777% | 1.341,0532% |

ESTRUTURADO

| Fundo                                                                                              | Saldo Atual    | Retorno % | Meta    | Atingimento |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-----------|---------|-------------|
| FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO | R\$ 92.598,19  | 1,3532%   | 0,3777% | 358,2858%   |
| FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO                                           | R\$ 242.865,48 | 2,4834%   | 0,3777% | 657,5118%   |

EXTERIOR

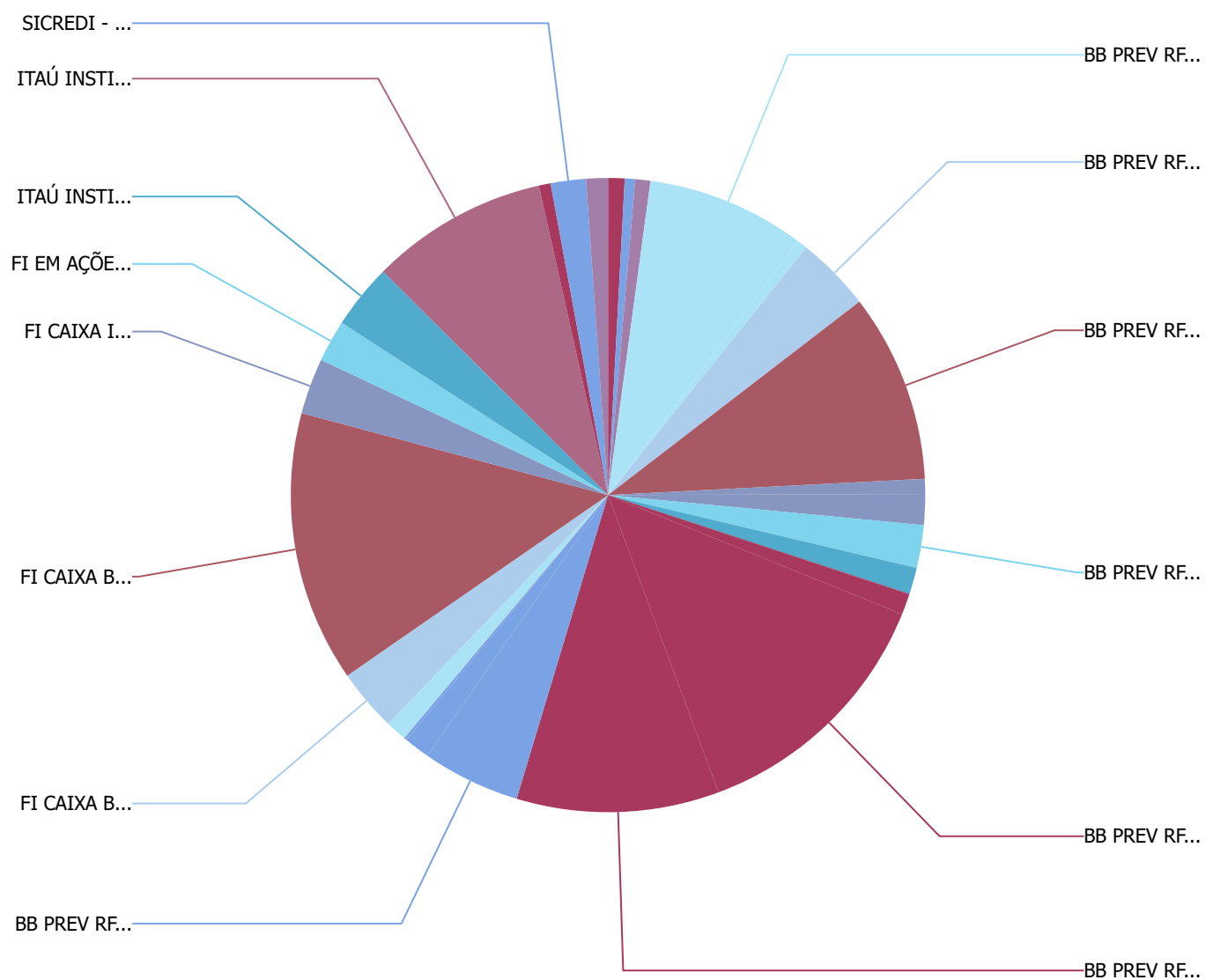
| Fundo                                       | Saldo Atual    | Retorno % | Meta    | Atingimento |
|---------------------------------------------|----------------|-----------|---------|-------------|
| FI EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | R\$ 182.060,97 | 0,5655%   | 0,3777% | 149,7153%   |

| Total | Saldo Atual      | Retorno % | Meta    | Atingimento |
|-------|------------------|-----------|---------|-------------|
|       | R\$ 8.523.910,17 | 0,8177%   | 0,3777% | 216,4907%   |

Total: R\$ R\$ 8.523.910,17

A rentabilidade média da carteira é de 0,8177%, enquanto que a meta atuarial foi de 0,3777%, sendo assim, atingindo 216,4907% da meta Atuarial

Carteira Atual



# Comparativo com a Meta Atuarial

| Mês       | Efetivo % | Meta %  | Atingimento % |
|-----------|-----------|---------|---------------|
| JANEIRO   | 0,6690%   | 0,8195% | 81,6308%      |
| FEVEREIRO | 0,9334%   | 1,2300% | 75,8864%      |
| MARÇO     | 0,8257%   | 0,5584% | 147,8693%     |
| ABRIL     | 0,0749%   | 0,7793% | 9,6101%       |
| MAIO      | 1,0712%   | 0,8596% | 124,6168%     |
| JUNHO     | 0,7657%   | 0,6086% | 125,8052%     |
| JULHO     | 1,0315%   | 0,7793% | 132,3621%     |
| AGOSTO    | 0,8177%   | 0,3777% | 216,4907%     |

|       | Efetivo % | Meta % | Atingimento % |
|-------|-----------|--------|---------------|
| Total | 6,35%     | 6,17%  | 102,99%       |

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 6,3556% enquanto que a meta acumulada no período é de 6,1706%, sendo assim o RPPS atingiu 102,99% 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\$ 71.638,57  | 0,141535% |
| BB AÇÕES SIDERURGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO       | R\$ 45.303,60  | 0,362952% |
| BB AÇÕES VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES   | R\$ 65.458,01  | 0,204815% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO         | R\$ 688.314,03 | 0,003561% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO         | R\$ 44.761,87  | 0,003561% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | R\$ 325.626,09 | 0,003609% |

|                                                                                                               |                  |           |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|-----------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B<br>5 LONGO PRAZO FUNDO DE<br>INVESTIMENTO EM COTAS DE FI                   | R\$ 820.026,19   | 0,003528% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B<br>FUNDO DE INVESTIMENTO                                                   | R\$ 65.210,87    | 0,019911% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B<br>FUNDO DE INVESTIMENTO                                                   | R\$ 133.705,98   | 0,019911% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B<br>TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE<br>INVESTIMENTO                               | R\$ 185.729,01   | 0,019980% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-<br>B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE<br>INVESTIMENTO                            | R\$ 116.403,07   | 0,050655% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-<br>M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                               | R\$ 90.919,67    | 0,000150% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-<br>M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                               | R\$ 1.125.860,28 | 0,000150% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-<br>M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                               | R\$ 879.655,27   | 0,000150% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA<br>REFERENCIADO DI LONGO PRAZO<br>PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM<br>COTAS DE FI | R\$ 425.236,06   | 0,000043% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA<br>REFERENCIADO DI LONGO PRAZO<br>PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM<br>COTAS DE FI | R\$ 112.270,10   | 0,000043% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA<br>REFERENCIADO DI LONGO PRAZO<br>PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM<br>COTAS DE FI | R\$ 12.043,26    | 0,000043% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL<br>RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO<br>PRAZO                               | R\$ 1.176.543,15 | 0,000052% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA<br>INDEXA BOLSA AMERICANA<br>MULTIMERCADO LONGO PRAZO                             | R\$ 242.865,48   | 0,151505% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES<br>CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I                                             | R\$ 182.060,97   | 0,177177% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO<br>RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE<br>INV EM COTAS DE FUNDOS DE DE INV     | R\$ 281.903,59   | 0,000592% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA<br>REFERENCIADO DI - FUNDO DE<br>INVESTIMENTO                                   | R\$ 771.189,23   | 0,000054% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M<br>TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE<br>INVESTIMENTO                               | R\$ 0,00         | 0,005993% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M<br>TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE<br>INVESTIMENTO                               | R\$ 0,00         | 0,005993% |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO<br>AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO<br>EM COTAS DE FUNDOS DE<br>INVESTIMENTO        | R\$ 0,00         | 0,000037% |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO<br>AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO<br>EM COTAS DE FUNDOS DE<br>INVESTIMENTO        | R\$ 0,00         | 0,000037% |

|                                                                                                    |                |           |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-----------|
| FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO | R\$ 92.598,19  | 0,015952% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                   | R\$ 270.307,46 | 0,019877% |
| SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B5 LP            | R\$ 50.994,04  | 0,004009% |
| SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1                                   | R\$ 153.009,64 | 0,000169% |
| SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI                                 | R\$ 94.276,49  | 0,000039% |

|       |                  |           |
|-------|------------------|-----------|
|       | Saldo            | VAR 12M   |
| Geral | R\$ 8.523.910,17 | 0,039228% |

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                               | 18,132560% |
| BB AÇÕES SIDERURGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO          | 13,388863% |
| BB AÇÕES VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES      | 21,519358% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO            | 24,336372% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO            | 24,336372% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO    | 26,213277% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | 23,962938% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO                              | 19,289760% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO                              | 19,289760% |

|                                                                                                               |            |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B<br>TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE<br>INVESTIMENTO                               | 19,542019% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-<br>B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE<br>INVESTIMENTO                            | 10,130534% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-<br>M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                               | 27,295113% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-<br>M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                               | 27,295113% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-<br>M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                               | 27,295113% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA<br>REFERENCIADO DI LONGO PRAZO<br>PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM<br>COTAS DE FI | 26,800763% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA<br>REFERENCIADO DI LONGO PRAZO<br>PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM<br>COTAS DE FI | 26,800763% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA<br>REFERENCIADO DI LONGO PRAZO<br>PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM<br>COTAS DE FI | 26,800763% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL<br>RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO<br>PRAZO                               | 26,820486% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA<br>INDEXA BOLSA AMERICANA<br>MULTIMERCADO LONGO PRAZO                             | 18,569244% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES<br>CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I                                             | 16,991292% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO<br>RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE<br>INV EM COTAS DE FUNDOS DE DE INV     | 25,280798% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA<br>REFERENCIADO DI - FUNDO DE<br>INVESTIMENTO                                   | 26,761614% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M<br>TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE<br>INVESTIMENTO                               | 26,129459% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M<br>TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE<br>INVESTIMENTO                               | 26,129459% |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO<br>AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO<br>EM COTAS DE FUNDOS DE<br>INVESTIMENTO        | 27,297070% |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO<br>AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO<br>EM COTAS DE FUNDOS DE<br>INVESTIMENTO        | 27,297070% |
| FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO<br>DE INVEST CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA<br>LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO      | 27,693514% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL<br>IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA<br>LONGO PRAZO                        | 19,687819% |
| SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM<br>COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO<br>RENDA FIXA IMA-B5 LP                 | 23,599020% |

|                                                                    |            |
|--------------------------------------------------------------------|------------|
| SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1   | 27,140898% |
| SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI | 26,809065% |

|       |            |
|-------|------------|
|       | Sharpe     |
| Geral | 23,504395% |

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.