

# Rentabilidade Média

## RENTA FIXA

| Fundo                                                                                       | Saldo Atual      | Retorno % | Meta    | Atingimento |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|-----------|---------|-------------|
| BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI                                                               | R\$ 44.029,51    | 1,0496%   | 0,8596% | 122,1023%   |
| BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI                                                               | R\$ 677.052,37   | 1,0496%   | 0,8596% | 122,1028%   |
| BB PREV RF IMA GERAL EX-C TIT. PUB FI                                                       | R\$ 318.813,82   | 0,9175%   | 0,8596% | 106,7400%   |
| BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI                                            | R\$ 805.556,31   | 1,0266%   | 0,8596% | 119,4296%   |
| BB PREV RF IMA-B FI                                                                         | R\$ 64.258,38    | 1,2938%   | 0,8596% | 150,5163%   |
| BB PREV RF IMA-B FI                                                                         | R\$ 131.753,03   | 1,2938%   | 0,8596% | 150,5166%   |
| BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI                                                                | R\$ 182.919,06   | 1,3055%   | 0,8596% | 151,8727%   |
| BB PREV RF IMA-B5+ TIT. PUB FI                                                              | R\$ 114.569,79   | 1,5693%   | 0,8596% | 182,5643%   |
| BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI                                                                | R\$ 0,00         | 0,0000%   | 0,8596% | 0,0000%     |
| BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI                                                                | R\$ 0,00         | 0,0000%   | 0,8596% | 0,0000%     |
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI                                                           | R\$ 88.900,65    | 0,7445%   | 0,8596% | 86,6108%    |
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI                                                           | R\$ 860.121,10   | 0,7445%   | 0,8596% | 86,6103%    |
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI                                                           | R\$ 1.100.858,73 | 0,7445%   | 0,8596% | 86,6104%    |
| BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI                             | R\$ 0,00         | 0,0000%   | 0,8596% | 0,0000%     |
| BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI                             | R\$ 173.873,94   | 0,8016%   | 0,8596% | 93,2583%    |
| BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI                             | R\$ 461.412,81   | 0,5975%   | 0,8596% | 69,5111%    |
| BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FI EM COTAS DE FI                                              | R\$ 0,00         | 0,0000%   | 0,8596% | 0,0000%     |
| BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FI EM COTAS DE FI                                              | R\$ 0,00         | 0,0000%   | 0,8596% | 0,0000%     |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TIT. PUB RF LONGO PRAZO                                               | R\$ 266.150,77   | 1,3000%   | 0,8596% | 151,2346%   |
| FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                                              | R\$ 1.145.639,47 | 0,8411%   | 0,8596% | 97,8477%    |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LONGO PRAZO FUNDO DE INV EM COTAS DE FUNDOS DE DE INV | R\$ 274.748,20   | 0,8712%   | 0,8596% | 101,3541%   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI - FI                                                  | R\$ 751.034,41   | 0,8610%   | 0,8596% | 100,1647%   |
| SICREDI - FI EM COTAS DE FI RF IMA-B5 LP                                                    | R\$ 50.079,84    | 0,1597%   | 0,8596% | 18,5761%    |
| SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1                                                       | R\$ 149.606,98   | 0,4993%   | 0,8596% | 58,0799%    |

## RENTA VARIÁVEL

| Fundo                                     | Saldo Atual   | Retorno % | Meta    | Atingimento |
|-------------------------------------------|---------------|-----------|---------|-------------|
| BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI EM AÇÕES      | R\$ 66.768,24 | 5,0334%   | 0,8596% | 585,5532%   |
| BB AÇÕES SIDERURGIA FI EM COTAS DE FI     | R\$ 42.335,00 | -1,2867%  | 0,8596% | -149,6846%  |
| BB AÇÕES VALOR FI EM COTAS DE FI EM AÇÕES | R\$ 59.963,11 | -2,2984%  | 0,8596% | -267,3795%  |

## ESTRUTURADO



# 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%       |

|       | Efetivo % | Meta % | Atingimento % |
|-------|-----------|--------|---------------|
| Total | 2,52%     | 3,42%  | 73,61%        |

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,5243% enquanto que a meta acumulada no período é de 3,4293%, sendo assim o RPPS atingiu 73,61% 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\$ 63.568,57  | 0,147094% |
| BB AÇÕES SIDERURGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO          | R\$ 42.886,82  | 0,460809% |
| BB AÇÕES VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES      | R\$ 61.373,72  | 0,268958% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO            | R\$ 670.019,87 | 0,003539% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO            | R\$ 43.572,18  | 0,003539% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA GERAL EX-C TÍTULOS PUBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO    | R\$ 315.915,18 | 0,004585% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | R\$ 797.370,37 | 0,003485% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO                              | R\$ 63.437,60  | 0,023085% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO                              | R\$ 130.070,13 | 0,023085% |

|                                                                                                               |                  |           |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|-----------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B<br>TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE<br>INVESTIMENTO                               | R\$ 180.561,83   | 0,022684% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-<br>B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE<br>INVESTIMENTO                            | R\$ 112.799,60   | 0,057875% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-<br>M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                               | R\$ 88.243,67    | 0,000279% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-<br>M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                               | R\$ 1.092.723,37 | 0,000279% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-<br>M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                               | R\$ 853.764,80   | 0,000279% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA<br>REFERENCIADO DI LONGO PRAZO<br>PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM<br>COTAS DE FI | R\$ 562.961,01   | 0,000123% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA<br>REFERENCIADO DI LONGO PRAZO<br>PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM<br>COTAS DE FI | R\$ 199.316,92   | 0,000123% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL<br>IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA<br>LONGO PRAZO                        | R\$ 262.735,18   | 0,022335% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA<br>INDEXA BOLSA AMERICANA<br>MULTIMERCADO LONGO PRAZO                             | R\$ 214.130,77   | 0,171691% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES<br>CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I                                             | R\$ 149.635,97   | 0,087608% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA<br>REFERENCIADO DI - FUNDO DE<br>INVESTIMENTO                                   | R\$ 744.623,09   | 0,000158% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M<br>TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE<br>INVESTIMENTO                               | R\$ 0,00         | 0,007714% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M<br>TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE<br>INVESTIMENTO                               | R\$ 0,00         | 0,007714% |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO<br>AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO<br>EM COTAS DE FUNDOS DE<br>INVESTIMENTO        | R\$ 0,00         | 0,000096% |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO<br>AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO<br>EM COTAS DE FUNDOS DE<br>INVESTIMENTO        | R\$ 0,00         | 0,000096% |
| FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO<br>DE INVEST CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA<br>LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO      | R\$ 90.688,25    | 0,016495% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL<br>RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO<br>PRAZO                               | R\$ 1.136.083,88 | 0,000155% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO<br>RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE<br>INV EM COTAS DE FUNDOS DE DE INV     | R\$ 272.375,16   | 0,001083% |
| SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO<br>INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1                                           | R\$ 75.136,67    | 0,000303% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA<br>REFERENCIADO DI LONGO PRAZO<br>PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM<br>COTAS DE FI | R\$ 0,00         | 0,000123% |

|                                                                                         |          |           |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------|
| SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B5 LP | R\$ 0,00 | 0,003989% |
| SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI                      | R\$ 0,00 | 0,000130% |

|       |                  |           |
|-------|------------------|-----------|
|       | Saldo            | VAR 12M   |
| Geral | R\$ 8.223.994,61 | 0,043210% |

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                               | 19,475973% |
| BB AÇÕES SIDERURGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO          | 7,905118%  |
| BB AÇÕES VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES      | 19,195535% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO            | 23,708341% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO            | 23,708341% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO    | 27,282261% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | 24,352582% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO                              | 25,899250% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO                              | 25,899250% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO             | 25,707321% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO           | 21,004759% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                           | 26,464324% |

|                                                                                                      |            |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                          | 26,464324% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                          | 26,464324% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | 26,643330% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | 26,643330% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                     | 25,637741% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO                          | 19,889901% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I                                       | 23,154701% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI - FUNDO DE INVESTIMENTO                                | 26,327597% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                            | 26,697047% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                            | 26,697047% |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO        | 26,971417% |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO        | 26,971417% |
| FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO LONGO PRAZO   | 23,348679% |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO                            | 26,473003% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INV EM COTAS DE FUNDOS DE DE INV  | 28,620769% |
| SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1                                     | 26,444074% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | 26,643330% |
| SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B5 LP              | 24,327799% |
| SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI                                   | 26,694021% |

|       |            |
|-------|------------|
|       | Sharpe     |
| Geral | 24,571513% |

O fundo ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LONGO PRAZO FUNDO DE INV EM COTAS DE FUNDOS DE DE INV teve o melhor Índice Sharpe positivo, portanto foi o fundo que teve melhor desempenho analisando a relação risco/retorno.