



Informações referente a Maio 2015.

1. Rentabilidade Média

FUNDO	SALDO FINAL	RENTABILIDADE / MÊS	META /MÊS	% META
AQUILLA FIMOBILIÁRIO	2.591.488,20	-0,24	1,23	-19,38%
ÁTICO FICOTAS FIP - ÁTICO FLORESTAL	2.121.119,69	-0,12	1,23	-9,76%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	6.820.619,20	-0,09	1,23	-7,32%
ÁTICO RF FI IMA-B 5	2.733.948,63	1,70	1,23	138,55%
BB AÇÕES CONSUMO FIC FI	2.201.306,50	-2,66	1,23	-216,26%
BB PREV RF IMA-B 5 LP	5.684.384,39	1,65	1,23	134,15%
BB PREV RF IMA-B FI	4.138.359,79	2,58	1,23	209,76%
BB PREV RF IMA-B TP	8.027.538,12	2,61	1,23	212,20%
BB PREV RF IRF-M TP	1.310.374,18	1,59	1,23	129,27%
BB PREV RF PERFIL	7.986.740,30	1,03	1,23	83,74%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RF	2.494.180,53	1,25	1,23	101,63%
BRADESCO FIC FI RF IMA-B 5	2.176.930,34	1,68	1,23	136,59%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL FIA	1.005.683,42	-2,73	1,23	-221,57%
DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA AÇÕES	1.702.881,92	-6,26	1,23	-508,94%
FIDC TREND BANK BCO FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	68.175,78	1,99	1,23	161,55%
FIDC TREND BANK BCO FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	72.080,62	1,99	1,23	161,55%
FIDC TREND BANK BCO FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	36.252,15	1,99	1,23	161,55%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FI EM PARTICIPAÇÕES	612.865,12	-0,26	1,23	-21,14%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP	14.001.832,93	1,87	1,23	152,03%
CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIM CRÉD PRIV	3.696.150,50	1,14	1,23	92,68%
CAIXA BRASIL IPCA XIII RF CRÉDITO PRIVADO	6.721.796,00	1,12	1,23	91,06%
CAIXA BRASIL REF DI LP	7.015.491,46	0,98	1,23	79,67%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	34.615.722,86	2,43	1,23	197,56%
CAIXA VALOR AÇÕES DIVIDENDOS RPPS	2.123.721,24	-0,11	1,23	-8,94%
FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FII	340.830,00	-2,85	1,23	-231,87%
FIMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	1.950.000,00	-0,41	1,23	-33,33%
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	1.848.746,79	0,98	1,23	79,56%
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	1.069.170,47	1,66	1,23	134,96%

4. Gerenciamento de Risco

4.1. Risco de Mercado

4.1.1 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

FUNDOS	Valor Investido	% VaR 12 MESES
AQUILLA FIMOBILIÁRIO	2.591.488,20	N/D
ÁTICO FICOTAS FIP - ÁTICO FLORESTAL	2.121.119,69	N/D
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	6.820.619,20	N/D
ÁTICO RF FI IMA-B 5	2.733.948,63	N/D
BB AÇÕES CONSUMO FIC FI	2.201.306,50	N/D
BB PREV RF IMA-B 5 LP	5.684.384,39	N/D
BB PREV RF IMA-B FI	4.138.359,79	9,20
BB PREV RF IMA-B TP	8.027.538,12	9,10
BB PREV RF IRF-M TP	1.310.374,18	3,10
BB PREV RF IRF-M1 TP	9.325.707,63	0,40
BB PREV RF PERFIL	7.986.740,30	0,10
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RF	2.494.180,53	1,70
BRADESCO FIC FI RF IMA-B 5	2.176.930,34	13,20
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL FIA	1.005.683,42	N/D
BTG PACTUAL MULTIGESTORES IBOVESPA AÇÕES	2.965.333,70	N/D
DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA AÇÕES	1.702.881,92	N/D
FIDC TREND BANK BCO FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	68.175,78	N/D
FIDC TREND BANK BCO FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	72.080,62	N/D
FIDC TREND BANK BCO FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	36.252,15	N/D
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FI EM PARTICIPAÇÕES	612.865,12	N/D
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP	14.001.832,93	2,20
CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIM CRÉD PRIV	3.696.150,50	0,60
CAIXA BRASIL IPCA XIII RF CRÉDITO PRIVADO	6.721.796,00	0,50
CAIXA BRASIL REF DI LP	7.015.491,46	0,10
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	34.615.722,86	8,40
CAIXA VALOR AÇÕES DIVIDENDOS RPPS	2.123.721,24	N/D
FIDC PREMIUM	2.696.791,25	N/D

GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	3.457.111,10	-3,38	1,23	-274,85%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI EM AÇÕES	3.629.282,14	-4,06	1,23	-330,37%
INFINITY LOTUS FI RF	2.353.212,68	1,02	1,23	82,93%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESA ATIVO	3.914.173,52	-4,77	1,23	-387,80%
JMALUCELLI SMALL CAPS FI EM AÇÕES	-	2,19	1,23	177,88%
LEME BRASPREV FI RF LP PREV CRÉDITO PRIVADO	5.198.367,46	1,96	1,23	159,50%
LEME FIC FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	7.698.442,75	9,17	1,23	745,53%
LEME IMA-B FI EM RF PREV	5.318.455,20	3,43	1,23	278,86%
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FIDC	8.840.772,83	1,08	1,23	87,80%
LMX IMA-B FI RF	909.280,17	1,81	1,23	146,94%
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	876.145,19	1,13	1,23	92,21%
QUELUZ VALOR FI EM AÇÕES	8.418.386,71	-2,85	1,23	-231,71%
QUEST AÇÕES FIC FI DE AÇÕES	3.697.725,91	-6,46	1,23	-525,20%
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	1.617.913,49	-3,59	1,23	-291,87%
QUEST YIELD FIC FI RF LP	2.402.539,52	1,15	1,23	93,50%
SCHRODER FI EM AÇÕES IBRX-50	2.546.244,25	-6,15	1,23	-500,00%
TITULOS (NTN-B)	34.281.551,01	1,71	1,23	139,02%
TITULOS (NTN-C)	25.262.775,33	1,42	1,23	115,45%
TITULOS (TDA)	1.586.892,89	-1,43	1,23	-116,26%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	5.703.488,19	0,34	1,23	27,64%
VIAJA BRASIL FIP (Fundo aguardando decisão judicial)	12.397,43	0,01	1,23	0,81%
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI EM AÇÕES	2.209.505,71	-5,54	1,23	-450,41%
TOTAL / MÉDIA	272.105.635,73	0,92	1,23	75,02%

A rentabilidade média da carteira é de 0,92%, enquanto que a meta atuarial foi de 1,23%, sendo assim, o RPPS atingiu 75,02% da meta Atuarial

FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FII	340.830,00	N/D
FIIMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	1.950.000,00	N/D
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	1.848.746,79	N/D
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	1.069.170,47	N/D
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	3.457.111,10	N/D
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	2.014.748,54	N/D
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI EM AÇÕES	3.629.282,14	N/D
INFINITY LOTUS FI RF	2.353.212,68	N/D
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESA ATIVO	3.914.173,52	N/D
JMALUCELLI SMALL CAPS FI EM AÇÕES	-	N/D
LEME BRASPREV FI RF LP PREV CRÉDITO PRIVADO	5.198.367,46	N/D
LEME FIC FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	7.698.442,75	N/D
LEME IMA-B FI EM RF PREV	5.318.455,20	N/D
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FIDC	8.840.772,83	N/D
LMX IMA-B FI RF	909.280,17	N/D
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	876.145,19	N/D
QUELUZ VALOR FI EM AÇÕES	8.418.386,71	N/D
QUEST AÇÕES FIC FI DE AÇÕES	3.697.725,91	N/D
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	1.617.913,49	N/D
QUEST YIELD FIC FI RF LP	2.402.539,52	N/D
SCHRODER FI EM AÇÕES IBRX-50	2.546.244,25	N/D
TITULOS (NTN-B)	34.281.551,01	N/D
TITULOS (NTN-C)	25.262.775,33	N/D
TITULOS (TDA)	1.586.892,89	N/D
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	5.703.488,19	N/D
VIAJA BRASIL FIP (Fundo aguardando decisão judicial)	12.397,43	N/D
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI EM AÇÕES	2.209.505,71	N/D

Os fundos BB PERFIL E CAIXA BRASIL DI tiveram o menor VaR% dentre os fundos da carteira, sendo assim, são os fundos que apresentaram menor risco,

Setembro			0,00%
Outubro			0,00%
Novembro			0,00%
Dezembro			0,00%
Acumulado	7,84	4,96	63,32%

FIDC TREND BANK BCO FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	N/D
FIDC TREND BANK BCO FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	N/D
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FI EM PARTICIPAÇÕES	N/D
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP	0,30
CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIM CRÉD PRIV	5,60
CAIXA BRASIL IPCA XIII RF CRÉDITO PRIVADO	6,10
CAIXA BRASIL REF DI LP	0,10
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	0,30
CAIXA VALOR AÇÕES DIVIDENDOS RPPS	N/D
FIDC PREMIUM	N/D
FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FII	N/D
FIIMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	N/D
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	N/D
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	N/D
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	N/D
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	N/D
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI EM AÇÕES	N/D
INFINITY LOTUS FI RF	N/D
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO	N/D
JMALUCELLI SMALL CAPS FI EM AÇÕES	N/D
LEME BRASPREV FI RF LP PREV CRÉDITO PRIVADO	N/D
LEME FIC FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	N/D
LEME IMA-B FI EM RF PREV	N/D
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FIDC	N/D
LMX IMA-B FI RF	N/D
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	N/D
QUELUZ VALOR FI EM AÇÕES	N/D
QUEST AÇÕES FIC FI DE AÇÕES	N/D
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	N/D
QUEST YIELD FIC FI RF LP	N/D
SCHRODER FI EM AÇÕES IBRX-50	N/D
TITULOS (NTN-B)	N/D
TITULOS (NTN-C)	N/D
TITULOS (TDA)	N/D
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	N/D
VIAJA BRASIL FIP (Fundo aguardando decisão judicial)	N/D
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI EM AÇÕES	N/D

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 4,96%, enquanto que a meta acumulada no período é de 7,84%, sendo assim o RPPS atingiu 63,32% da meta atuarial

O fundo CAIXA BRASIL IPCA XIII CRED PRIV obteve o melhor Índice Sharpe positivo, portanto foi o fundo que teve melhor desempenho analisando a relação risco/retorno.