



1. Rentabilidade Média

FUNDO	SALDO FINAL	RENTABILIDADE / MÊS	META /MÊS	% META
AQUILLA FIIMOBILIÁRIO	2.608.024,39	-0,20	1,27	-15,74%
ÁTICO FICOTAS FIP - ÁTICO FLORESTAL	2.016.945,27	-0,13	1,27	-10,23%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	9.356.318,20	-0,15	1,27	-11,81%
ÁTICO RF FI IMA-B 5 / TOWER IMA-B 5	2.053.439,42	0,74	1,27	58,24%
BB AÇÕES CONSUMO FIC FI	2.045.130,46	-2,62	1,27	-206,20%
BB PREV RF IMA-B 5 LP	14.584.084,89	0,79	1,27	62,18%
BB PREV RF IMA-B FI	29.611.569,81	-0,14	1,27	-11,02%
BB PREV RF IMA-B TP	9.130.918,57	-0,12	1,27	-9,44%
BB PREV RF IRF-M TP	-	0,00	1,27	0,00%
BB PREV RF IRF-M1 TP	33.740.460,57	1,04	1,27	81,85%
BB PREV RF PERFIL	38.634.350,64	1,14	1,27	89,72%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RF	2.821.565,33	0,87	1,27	68,47%
BRADESCO FIC FI RF IMA-B 5	-	0,00	1,27	0,00%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL FIA	1.053.068,40	-2,89	1,27	-227,45%
BTG PACTUAL MULTIGESTORES IBOVESPA AÇÕES	-	0,00	1,27	0,00%
DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA AÇÕES	-	-7,39	1,27	-581,61%
FIDC TREND BANK BCO FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	49.605,97	-5,90	1,27	-464,35%
FIDC TREND BANK BCO FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	52.447,22	-5,90	1,27	-464,35%
FIDC TREND BANK BCO FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	26.377,77	-5,90	1,27	-464,35%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FI EM PARTICIPAÇÕES	319.161,61	-0,16	1,27	-12,59%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP	18.375.433,31	0,80	1,27	62,96%
CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIM CRÉD PRIV	4.284.522,35	1,12	1,27	88,15%
CAIXA BRASIL IPCA XIII RF CRÉDITO PRIVADO	7.736.444,00	1,10	1,27	86,57%
CAIXA BRASIL REF DI LP	-	0,00	1,27	0,00%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	-	0,00	1,27	0,00%
CAIXA VALOR AÇÕES DIVIDENDOS RPPS	2.126.090,24	-3,31	1,27	-260,51%
FIDC PREMIUM	2.569.555,77	-0,73	1,27	-57,45%
FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FII	276.396,90	-0,52	1,27	-40,93%
FIIMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	2.055.980,00	-0,20	1,27	-15,36%
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	2.070.350,39	0,46	1,27	36,20%

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 FIIMOBILIÁRIO	2.608.024,39	2,36
ÁTICO FICOTAS FIP - ÁTICO FLORESTAL	2.016.945,27	0,34
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	9.356.318,20	4,08
ÁTICO RF FI IMA-B 5 / TOWER IMA-B 5	2.053.439,42	0,32
BB AÇÕES CONSUMO FIC FI	2.045.130,46	2,09
BB PREV RF IMA-B 5 LP	14.584.084,89	0,30
BB PREV RF IMA-B FI	29.611.569,81	0,83
BB PREV RF IMA-B TP	9.130.918,57	0,84
BB PREV RF IRF-M TP	-	0,40
BB PREV RF IRF-M1 TP	33.740.460,57	0,04
BB PREV RF PERFIL	38.634.350,64	0,01
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RF	2.821.565,33	0,17
BRADESCO FIC FI RF IMA-B 5	-	0,31
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL FIA	1.053.068,40	1,61
BTG PACTUAL MULTIGESTORES IBOVESPA AÇÕES	-	0,00
DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA AÇÕES	-	2,46
FIDC TREND BANK BCO FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	49.605,97	27,56
FIDC TREND BANK BCO FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	52.447,22	27,56
FIDC TREND BANK BCO FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	26.377,77	27,56
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FI EM PARTICIPAÇÕES	319.161,61	4,89
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP	18.375.433,31	0,29
CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIM CRÉD PRIV	4.284.522,35	0,03
CAIXA BRASIL IPCA XIII RF CRÉDITO PRIVADO	7.736.444,00	0,02
CAIXA BRASIL REF DI LP	-	0,01
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	-	0,77
CAIXA VALOR AÇÕES DIVIDENDOS RPPS	2.126.090,24	1,80
FIDC PREMIUM	2.569.555,77	0,12
FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FII	276.396,90	1,08

FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	1.176.015,30	1,99	1,27	156,62%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	4.834.864,84	-6,33	1,27	-498,19%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	3.586.768,69	-6,11	1,27	-480,88%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI EM AÇÕES	3.173.826,89	-6,11	1,27	-480,88%
INFINITY LOTUS FI RF	-	0,00	1,27	0,00%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO	3.829.959,03	-5,01	1,27	-394,30%
TOWER BRIDGE II RF FI IMA-B 5	603.263,88	1,20	1,27	94,44%
LEME BRASPREV FI RF LP PREV CRÉDITO PRIVADO	3.902.806,62	0,52	1,27	40,93%
LEME FIC FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	5.601.540,68	1,10	1,27	86,57%
LEME IMA-B FI EM RF PREV	4.853.630,95	0,44	1,27	34,63%
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FIDC	5.033.077,86	1,44	1,27	113,42%
TMJ IMA-B FI RF	1.010.916,95	-1,30	1,27	-102,31%
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	1.018.430,04	1,27	1,27	99,95%
QUELUZ VALOR FI EM AÇÕES	6.098.273,34	-2,45	1,27	-192,82%
QUEST AÇÕES FIC FI DE AÇÕES	5.712.217,37	-7,95	1,27	-625,69%
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	1.701.502,29	-1,20	1,27	-94,44%
QUEST YIELD FIC FI RF LP	2.717.890,51	0,74	1,27	58,04%
SCHRODER FI EM AÇÕES IBRX-50	-	0,00	1,27	0,00%
TITULOS (NTN-B)	37.016.584,31	-0,88	1,27	-69,26%
TITULOS (NTN-C)	28.493.828,15	1,10	1,27	86,57%
TITULOS (TDA)	1.364.173,93	-2,25	1,27	-177,08%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	6.026.992,20	0,51	1,27	40,14%
VIAJA BRASIL FIP (Fundo aguardando decisão judicial)	12.397,43	0,01	1,27	0,79%
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI EM AÇÕES	-	0,00	1,27	0,00%
TOTAL / MÉDIA	315.367.202,74	-0,11	1,27	-8,64%

A rentabilidade média da carteira é de -0,11%, enquanto que a meta atuarial foi de 1,27%, sendo assim, o RPPS atingiu -8,64% da meta Atuarial

FII BIG FACTUAL CORPORATE OFFICE FII	278.338,30	1,00
FIIMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	2.055.980,00	1,23
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	2.070.350,39	0,26
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	1.176.015,30	0,83
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	4.834.864,84	2,08
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	3.586.768,69	2,17
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI EM AÇÕES	3.173.826,89	1,99
INFINITY LOTUS FI RF	-	0,71
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO	3.829.959,03	2,01
TOWER BRIDGE II RF FI IMA-B 5	603.263,88	0,32
LEME BRASPREV FI RF LP PREV CRÉDITO PRIVADO	3.902.806,62	1,44
LEME FIC FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	5.601.540,68	1,85
LEME IMA-B FI EM RF PREV	4.853.630,95	1,11
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FIDC	5.033.077,86	0,26
TMJ IMA-B FI RF	1.010.916,95	0,86
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	1.018.430,04	0,00
QUELUZ VALOR FI EM AÇÕES	6.098.273,34	1,48
QUEST AÇÕES FIC FI DE AÇÕES	5.712.217,37	2,08
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	1.701.502,29	1,59
QUEST YIELD FIC FI RF LP	2.717.890,51	1,63
SCHRODER FI EM AÇÕES IBRX-50	-	
TITULOS (NTN-B)	37.016.584,31	N/D
TITULOS (NTN-C)	28.493.828,15	N/D
TITULOS (TDA)	1.364.173,93	N/D
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	6.026.992,20	1,09
VIAJA BRASIL FIP (Fundo aguardando decisão judicial)	12.397,43	N/D
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI EM AÇÕES	-	2,10

O fundo BB PERFIL Obteve o menor VaR% dentre os fundos da carteira, sendo assim, é o fundo que apresenta menor risco,

FIDC TREND BANK BCO FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	10,85	29,13
FIDC TREND BANK BCO FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	10,85	29,13
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FI EM PARTICIPAÇÕES	-0,99	64,03
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP	1,97	3,06
CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIM CRÉD PRIV	10,97	0,34
CAIXA BRASIL IPCA XIII RF CRÉDITO PRIVADO	11,68	0,23
CAIXA BRASIL REF DI LP	-0,10	0,07
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RF LP	2,14	8,92
CAIXA VALOR AÇÕES DIVIDENDOS RPPS	-0,08	17,29
FIDC PREMIUM	1,70	1,20
FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FII	-1,70	10,80
FIIMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	-0,28	11,96
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	0,10	2,50
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	2,50	9,60
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-1,13	20,15
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI EM AÇÕES	-1,17	20,99
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI EM AÇÕES	-1,07	19,27
INFINITY LOTUS FI RF	0,23	6,85
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO	-0,65	19,28
TOWER BRIDGE II RF FI IMA-B 5	1,90	3,50
LEME BRASPREV FI RF LP PREV CRÉDITO PRIVADO	-1,47	14,92
LEME FIC FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-1,97	18,48
LEME IMA-B FI EM RF PREV	-0,95	10,26
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FIDC	0,20	2,60
TMJ IMA-B FI RF	-0,47	6,72
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	-585,60	0,01
QUELUZ VALOR FI EM AÇÕES	-0,84	14,16
QUEST AÇÕES FIC FI DE AÇÕES	-0,94	19,92
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	-0,44	15,21
QUEST YIELD FIC FI RF LP	-1,15	15,75
SCHRODER FI EM AÇÕES IBRX-50		
TITULOS (NTN-B)	N/D	N/D
TITULOS (NTN-C)	N/D	N/D
TITULOS (TDA)	N/D	N/D
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII	-1,68	10,80
VIAJA BRASIL FIP (Fundo aguardando decisão judicial)	N/D	N/D
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI EM AÇÕES	-0,73	20,78

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 5,95%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,61%, sendo assim o RPPS atingiu 90,09% da meta atuarial

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