



Rentabilidade Média

RENDA FIXA

Fundo	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.151.435,21	1,0139%	1,0030%	101,0867%
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 215.583,80	0,2185%	1,0030%	21,7846%
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 316.558,70	0,6942%	1,0030%	69,2124%
BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI	R\$ 3.098.470,35	1,1933%	1,0030%	118,9731%
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 159.989,98	0,9838%	1,0030%	98,0857%
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 1.441.417,79	0,9838%	1,0030%	98,0857%
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.077.259,50	1,0391%	1,0030%	103,5992%
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FI EM COTAS DE FI	R\$ 111.110,52	0,4883%	1,0030%	48,6839%
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$ 75.904,38	0,5355%	1,0030%	53,3898%
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LONGO PRAZO	R\$ 5.318.268,66	1,8300%	1,0030%	182,4526%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PUB RF LONGO PRAZO	R\$ 3.161.499,35	0,6420%	1,0030%	64,0080%
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TIT. PUB RF LONGO PRAZO	R\$ 5.370.320,93	1,0657%	1,0030%	106,2512%
FI CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RF LONGO PRAZO	R\$ 1.402.912,03	0,9366%	1,0030%	93,3799%
FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 1.363.957,14	1,0321%	1,0030%	102,9013%
FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	R\$ 0,00	0,0000%	1,0030%	0,0000%

ESTRUTURADO

Fundo	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	R\$ 743.378,34	8,7724%	1,0030%	874,6162%

EXTERIOR

Fundo	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FI EM COTAS DE FI EM AÇÕES - BDR NÍVEL I	R\$ 1.061.110,25	4,3280%	1,0030%	431,5055%

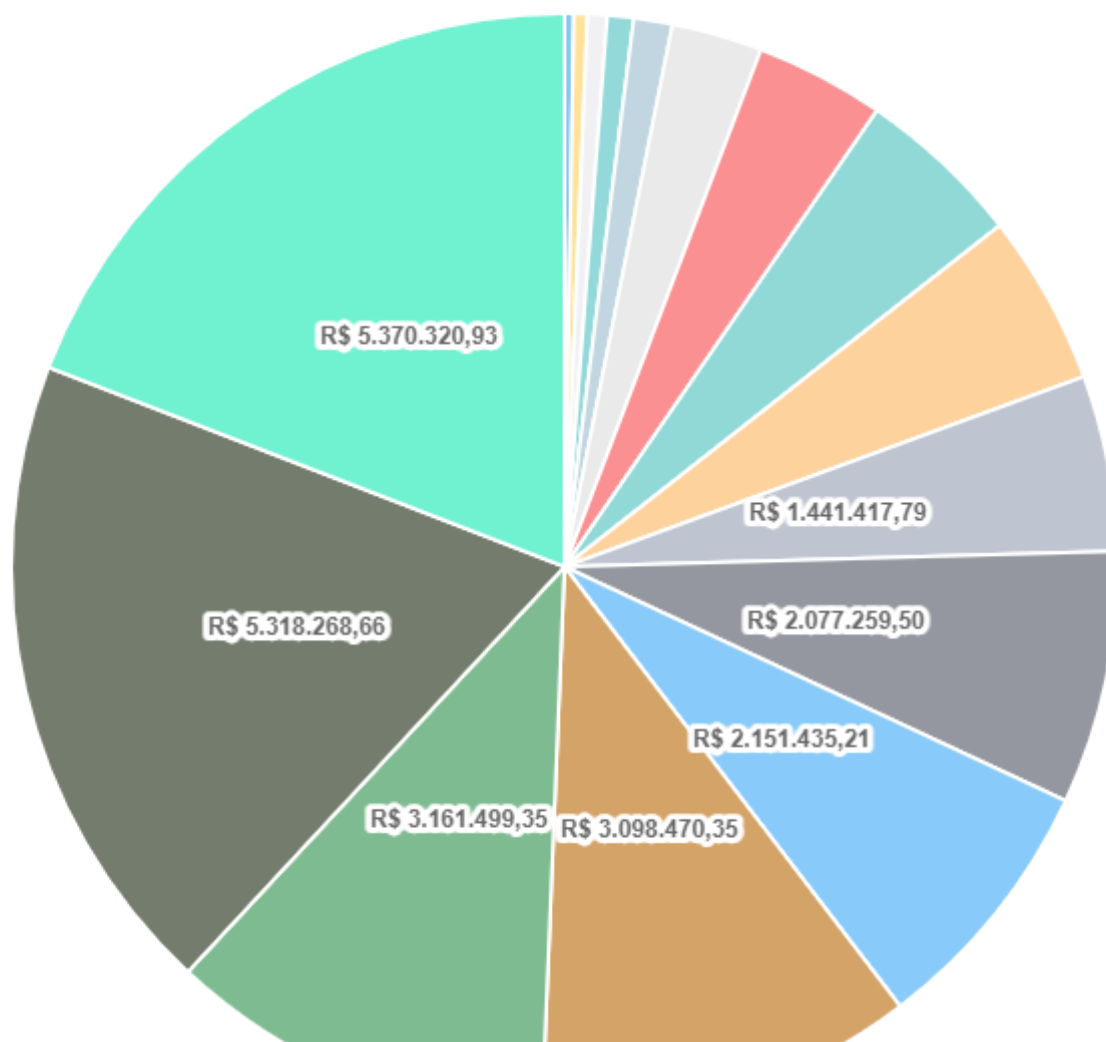
Total	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
	R\$ 28.069.176,93	1,3450%	1,0030%	134,1005%

Total: R\$ R\$ 28.069.176,93

A rentabilidade média da carteira é de 1,3450%, enquanto que a meta atuarial foi de 1,0030%, sendo assim, atingindo 134,1005% da meta Atuarial

Carteira Atual

- FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF
- FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF
- BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FI EM COTAS DE FI
- BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI
- BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI
- BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI
- FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO
- BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FI EM COTAS DE FI EM AÇÕES - BDR NÍVEL I
- FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO
- FI CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RF LONGO PRAZO
- BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI
- BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI
- BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FI EM COTAS DE FI
- BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI
- FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PUB RF LONGO PRAZO
- FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LONGO PRAZO
- FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TIT. PUB RF LONGO PRAZO





Comparativo com a Meta Atuarial

Mês	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
JANEIRO	-0,8312%	0,9528%	-87,2379%
FEVEREIRO	0,2667%	1,4247%	18,7205%
MARÇO	1,7088%	2,0373%	83,8774%
ABRIL	0,0704%	1,4750%	4,7697%
MAIO	0,6680%	0,8825%	75,6991%
JUNHO	-0,0193%	1,0834%	-1,7838%
JULHO	0,5377%	-0,2722%	297,5337%
AGOSTO	0,7600%	0,0491%	1.547,8834%
SETEMBRO	0,5994%	0,1194%	501,9965%
OUTUBRO	1,3450%	1,0030%	134,1005%

	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
Total	5,2007%	9,0832%	57,2561%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 5,2007% enquanto que a meta acumulada no período é de 9,0832%, sendo assim o RPPS atingiu 57,2561% 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 ESG GLOBAIS IS FUNDO DE		

INVESTIMENTO EM COTAS DE FI EM AÇÕES - BDR NÍVEL I	R\$ 1.061.110,25	0,251630%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 215.583,80	0,000284%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 316.558,70	0,000284%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 2.151.435,21	0,002188%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 3.098.470,35	0,016246%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 1.441.417,79	0,000269%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 159.989,98	0,000269%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 2.077.259,50	0,000258%
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 111.110,52	0,000213%
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	R\$ 75.904,38	0,000250%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 5.370.320,93	0,002653%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 1.402.912,03	0,004928%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	R\$ 0,00	0,000845%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 5.318.268,66	0,008575%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 3.161.499,35	0,037357%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 1.363.957,14	0,000272%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	R\$ 743.378,34	0,401948%

	Saldo	VAR 12M
Geral	R\$ 28.069.176,93	0,042851%

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 ESG GLOBAIS IS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI EM AÇÕES - BDR NÍVEL I	-24,102734%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	25,181639%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	25,181639%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	29,880822%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	32,268328%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	25,938694%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	25,938694%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	25,274775%
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	25,286170%
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	25,202153%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA	29,246143%

FIXA LONGO PRAZO	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	30,677191%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	26,797941%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	28,986377%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	32,916668%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	25,180341%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	-11,904163%

	Sharpe
Geral	22,232393%

O fundo FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PUB RF LONGO PRAZO teve o melhor Índice Sharpe positivo, portanto foi o fundo que teve melhor desempenho analisando a relação risco/retorno.

