

## 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Outubro/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	9.085.712,22	0,61%	0,51%	119,57%
BB Perfil	4.424.673,20	0,44%	0,51%	86,22%
Caixa IRF-M1	9.293.181,22	0,60%	0,51%	118,07%
Caixa Ref. DI LP	4.167.103,40	0,37%	0,51%	73,45%
Bradesco IRF-M1	7.768.400,30	0,60%	0,51%	118,47%
NTN-B - 2024	1.498.488,70	0,48%	0,51%	94,69%
NTN-B - 2024	1.754.248,26	0,48%	0,51%	94,69%
Santander Ativo F	937.170,79	1,75%	0,51%	344,14%
Caixa IDKA 2A	8.557.788,67	1,28%	0,51%	251,38%
Itaú Alocação Din	1.018.584,76	0,50%	0,51%	97,75%
Sicredi IRF-M	2.014.206,10	0,71%	0,51%	139,87%
TOTAL / MÉDIA	50.519.557,62	0,71%	0,51%	140,21%

## 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	17,98%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	8,76%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	18,40%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	8,25%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1	15,38%	20%	Art. 7º, I, b
NTN-B - 2024	2,97%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,47%	100%	Art. 7º, I, a
Santander Ativo F	1,86%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	16,94%	20%	Art. 7º, I, b
Itaú Alocação Din	2,02%	20%	Art. 7º, IV, a
Sicredi IRF-M	3,99%	20%	Art. 7º, III, a

## 3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,58%	0,73%	79,38%
Fevereiro	0,47%	0,84%	56,01%
Março	0,42%	1,16%	36,59%
Abril	0,65%	0,98%	66,83%
Mai	0,73%	0,54%	136,12%
Junho	0,67%	0,42%	160,81%
Julho	0,70%	0,60%	117,52%
Agosto	0,43%	0,52%	82,69%
Setembro	0,74%	0,37%	201,60%
Outubro	0,71%	0,51%	140,21%
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	6,29%	6,85%	91,70%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 6,29%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,85%, sendo assim o RPPS atingiu 91,7% da meta atuarial.

## 4. GERENCIAMENTO DE RISCO

### 4.1 RISCO DE CRÉDITO

Caso o RPPS detenha fundos com Crédito Privado, a análise do crédito será feita a parte através da análise de avaliação de risco cedida por empresas com sede no país e fornecidas pelo RPPS para a Kansai

### 4.2 RISCO DE MERCADO

#### 4.2.1 VaR - VALUE AT RISK

O VaR representa o valor monetário das perdas no valor presente a que uma carteira está sujeita, a um determinado nível de confiança e dentro de um horizonte de tempo.

Fundo	Aplicação	VaR	VaR %
BB IRF-M1	9.085.712,22	13.705,63	0,03%
BB Perfil	4.424.673,20	681,33	0,00%
Caixa IRF-M1	9.293.181,22	13.524,91	0,03%
Caixa Ref. DI LP	4.167.103,40	580,66	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	7.768.400,30	11.372,42	0,02%
NTN-B - 2024	1.498.488,70	37.339,30	0,07%
NTN-B - 2024	1.754.248,26	43.712,31	0,09%
Santander Ativo FIC FI	937.170,79	208,68	0,00%
Caixa IDKA 2A	8.557.788,67	66.663,66	0,13%
Itaú Alocação Dinâmica	1.018.584,76	6.861,69	0,01%
Sicredi IRF-M	2.014.206,10	223,05	0,00%
Carteira	50.519.557,62	165.596,99	0,33%

#### 4.2.2 ÍNDICE SHARPE

O Índice Sharpe é um indicador de performance que ajusta o retorno ao risco, ou seja, ele avalia se um determinado fundo de investimento apresenta uma rentabilidade ponderada ao risco que o investidor está exposto.

Fundo	Sharpe
BB IRF-M1	0,04
BB Perfil	-
Caixa IRF-M1	0,04
Caixa Ref. DI LP	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,04
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
Santander Ativo FIC FI	0,07
Caixa IDKA 2A	0,05
Itaú Alocação Dinâmica	0,02
Sicredi IRF-M	0,07