

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Setembro/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	9.075.603,31	0,62%	0,37%	168,65%
BB Perfil	4.405.385,19	0,44%	0,37%	120,02%
Caixa IRF-M1	9.108.708,57	0,63%	0,37%	170,66%
Caixa Ref. DI LP	5.941.401,74	0,45%	0,37%	121,47%
Bradesco IRF-M1	7.721.942,45	0,62%	0,37%	168,85%
NTN-B - 2024	1.491.317,50	0,56%	0,37%	151,69%
NTN-B - 2024	1.745.853,09	0,56%	0,37%	151,69%
Santander Ativo F	921.073,99	1,79%	0,37%	486,44%
Caixa IDKA 2A	8.449.920,65	1,42%	0,37%	387,87%
Itaú Alocação Din	1.013.553,54	0,78%	0,37%	213,13%
TOTAL / MÉDIA	49.874.760,03	0,74%	0,37%	201,60%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	18,20%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	8,83%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	18,26%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	11,91%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1	15,48%	20%	Art. 7º, I, b
NTN-B - 2024	2,99%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,50%	100%	Art. 7º, I, a
Santander Ativo F	1,85%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	16,94%	20%	Art. 7º, I, b
Itaú Alocação Din	2,03%	20%	Art. 7º, IV, 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%
Maio	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			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	5,53%	6,31%	87,64%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 5,53%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,31%, sendo assim o RPPS atingiu 87,64% 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	9.075.603,31	12.952,25	0,03%
BB Perfil	4.405.385,19	430,55	0,00%
Caixa IRF-M1	9.108.708,57	12.519,19	0,03%
Caixa Ref. DI LP	5.941.401,74	670,43	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	7.721.942,45	10.637,29	0,02%
NTN-B - 2024	1.491.317,50	38.267,67	0,08%
NTN-B - 2024	1.745.853,09	44.799,13	0,09%
Santander Ativo FIC FI	921.073,99	12.868,80	0,03%
Caixa IDKA 2A	8.449.920,65	64.756,00	0,13%
Itaú Alocação Dinâmica	1.013.553,54	9.287,63	0,02%
Carteira	49.874.760,03	176.609,61	0,35%

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	0,08
BB Perfil	-
Caixa IRF-M1	0,09
Caixa Ref. DI LP	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,09
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
Santander Ativo FIC FI	0,07
Caixa IDKA 2A	0,07
Itaú Alocação Dinâmica	0,07