

## 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Julho/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	8.848.255,00	0,69%	0,60%	114,72%
BB Perfil	4.533.825,55	0,51%	0,60%	85,00%
Caixa IRF-M1	8.641.739,10	0,70%	0,60%	117,00%
Caixa Ref. DI LP	5.886.173,66	0,55%	0,60%	92,01%
Bradesco IRF-M1	7.539.895,96	0,69%	0,60%	115,67%
NTN-B - 2024	1.517.625,15	0,66%	0,60%	111,06%
NTN-B - 2024	1.776.650,88	0,66%	0,60%	111,06%
Santander Ativo F	908.305,89	0,99%	0,60%	165,55%
Caixa IDKA 2A	8.322.921,66	0,92%	0,60%	153,37%
BB Público Suprer	0,00	0,20%	0,60%	33,29%
Itaú Alocação Din	1.002.505,16	0,25%	0,60%	41,88%
TOTAL / MÉDIA	48.977.898,01	0,70%	0,60%	117,52%

## 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	18,07%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	9,26%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	17,64%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	12,02%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1	15,39%	20%	Art. 7º, I, b
NTN-B - 2024	3,10%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,63%	100%	Art. 7º, I, a
Santander Ativo F	1,85%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	16,99%	20%	Art. 7º, I, b
BB Público Suprer	0,00%	20%	Art. 7º, IV, a
Itaú Alocação Din	2,05%	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%
Mai	0,73%	0,54%	136,12%
Junho	0,67%	0,42%	160,81%
Julho	0,70%	0,60%	117,52%
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	4,31%	5,38%	80,15%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 4,31%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,38%, sendo assim o RPPS atingiu 80,15% 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	8.848.255,00	10.757,14	0,02%
BB Perfil	4.533.825,55	245,35	0,00%
Caixa IRF-M1	8.641.739,10	9.784,66	0,02%
Caixa Ref. DI LP	5.886.173,66	415,16	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	7.539.895,96	8.657,11	0,02%
NTN-B - 2024	1.517.625,15	211.710,18	0,43%
NTN-B - 2024	1.776.650,88	247.844,51	0,51%
Santander Ativo FIC FI	908.305,89	11.850,72	0,02%
Caixa IDKA 2A	8.322.921,66	61.421,66	0,13%
BB Público Supremo	-	0,00	-
Itaú Alocação Dinâmica	1.002.505,16	12.119,83	0,02%
Carteira	48.977.898,01	478.370,02	0,98%

#### 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	0,06
BB Perfil	-
Caixa IRF-M1	0,06
Caixa Ref. DI LP	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,06
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
Santander Ativo FIC FI	0,03
Caixa IDKA 2A	0,04
BB Público Supremo	-
Itaú Alocação Dinâmica	0,05