

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Maio/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	8.837.500,49	0,65%	0,54%	120,05%
BB Perfil	4.912.198,24	0,53%	0,54%	98,42%
Caixa IRF-M1	8.532.746,55	0,65%	0,54%	121,60%
Caixa Ref. DI LP	5.827.491,96	0,54%	0,54%	99,62%
Bradesco IRF-M1 TP	7.446.332,56	0,65%	0,54%	121,50%
NTN-B - 2024	1.501.011,40	0,89%	0,54%	164,57%
NTN-B - 2024	1.757.201,53	0,89%	0,54%	164,57%
Santander Ativo FIC FI	879.567,48	1,85%	0,54%	343,87%
Caixa IDKA 2A	8.147.943,21	1,06%	0,54%	197,75%
TOTAL / MÉDIA	47.841.993,42	0,73%	0,54%	136,12%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	18,47%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	10,27%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	17,84%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	12,18%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	15,56%	20%	Art. 7º, I, b
NTN-B - 2024	3,14%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,67%	100%	Art. 7º, I, a
Santander Ativo FIC FI	1,84%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	17,03%	20%	Art. 7º, I, b

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			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,89%	4,32%	67,00%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,89%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,32%, sendo assim o RPPS atingiu 67% 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	8.837.500,49	8.200,65	0,02%
BB Perfil	4.912.198,24	297,78	0,00%
Caixa IRF-M1	8.532.746,55	7.653,23	0,02%
Caixa Ref. DI LP	5.827.491,96	402,93	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	7.446.332,56	6.813,96	0,01%
NTN-B - 2024	1.501.011,40	210.703,00	0,44%
NTN-B - 2024	1.757.201,53	246.665,43	0,52%
Santander Ativo FIC FI	879.567,48	10.839,59	0,02%
Caixa IDKA 2A	8.147.943,21	52.995,75	0,11%
Carteira	47.841.993,42	467.121,06	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	0,07
Caixa IDKA 2A	0,05