

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Agosto/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	9.019.739,61	0,51%	0,52%	99,11%
BB Perfil	4.286.052,01	0,49%	0,52%	94,67%
Caixa IRF-M1	9.051.974,55	0,51%	0,52%	98,70%
Caixa Ref. DI LP	5.915.015,12	0,49%	0,52%	94,62%
Bradesco IRF-M1	7.579.466,64	0,52%	0,52%	101,34%
NTN-B - 2024	1.483.055,52	-2,28%	0,52%	-439,86%
NTN-B - 2024	1.736.180,97	-2,28%	0,52%	-439,86%
Santander Ativo F	904.908,20	-0,37%	0,52%	-72,23%
Caixa IDKA 2A	8.331.247,10	0,10%	0,52%	19,32%
Itaú Alocação Din	1.005.681,74	0,32%	0,52%	61,19%
TOTAL / MÉDIA	49.313.321,46	0,24%	0,52%	45,45%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	18,29%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	8,69%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	18,36%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	11,99%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1	15,37%	20%	Art. 7º, I, b
NTN-B - 2024	3,01%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,52%	100%	Art. 7º, I, a
Santander Ativo F	1,84%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	16,89%	20%	Art. 7º, I, b
Itaú Alocação Din	2,04%	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	0,24%	0,52%	45,45%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	4,56%	5,93%	76,91%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 4,56%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,93%, sendo assim o RPPS atingiu 76,91% 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	9.019.739,61	12.461,92	0,03%
BB Perfil	4.286.052,01	346,68	0,00%
Caixa IRF-M1	9.051.974,55	12.009,01	0,02%
Caixa Ref. DI LP	5.915.015,12	499,53	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	7.579.466,64	10.215,47	0,02%
NTN-B - 2024	1.483.055,52	208.463,76	0,42%
NTN-B - 2024	1.736.180,97	244.044,01	0,49%
Santander Ativo FIC FI	904.908,20	11.988,85	0,02%
Caixa IDKA 2A	8.331.247,10	59.626,66	0,12%
Itaú Alocação Dinâmica	1.005.681,74	9.364,23	0,02%
Carteira	49.313.321,46	470.448,37	0,95%

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