

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Outubro/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	8.521.297,89	0,93%	0,86%	108,80%
BB Perfil	3.737.497,83	0,53%	0,86%	61,77%
BB IRF-M1	4.039.770,86	0,93%	0,86%	108,80%
BB Perfil	704.362,66	0,53%	0,86%	61,77%
Caixa IRF-M1	16.091.302,78	0,94%	0,86%	108,83%
Caixa Ref. DI LP	5.139.455,40	0,53%	0,86%	61,92%
Bradesco IRF-M1 TP	2.161.903,70	0,90%	0,86%	104,84%
NTN-B - 2024	1.459.801,59	1,12%	0,86%	129,85%
NTN-B - 2024	1.708.958,10	1,12%	0,86%	129,85%
Santander Ativo FIC FI	814.260,82	0,51%	0,86%	58,81%
TOTAL / MÉDIA	44.378.611,63	0,85%	0,86%	99,03%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	19,20%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	8,42%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M1	9,10%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	1,59%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	36,26%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	11,58%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	4,87%	100%	Art. 7º, I, b
NTN-B - 2024	3,29%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,85%	100%	Art. 7º, I, a
Santander Ativo FIC FI	1,83%	20%	Art. 7º, IV, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro			
Fevereiro			
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro	0,85%	0,86%	99,03%
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,85%	0,86%	99,03%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,85%, enquanto que a meta acumulada no período é de 0,86%, sendo assim o RPPS atingiu 99,03% 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 Asset.

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	8.521.297,89	23.750,76	0,05%
BB Perfil	3.737.497,83	916,99	0,00%
BB IRF-M1	4.039.770,86	11.259,74	0,03%
BB Perfil	704.362,66	172,81	0,00%
Caixa IRF-M1	16.091.302,78	44.244,24	0,10%
Caixa Ref. DI LP	5.139.455,40	576,25	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	2.161.903,70	6.145,32	0,01%
NTN-B - 2024	1.459.801,59	49.860,05	0,11%
NTN-B - 2024	1.708.958,10	58.370,08	0,13%
Santander Ativo FIC FI	814.260,82	2.654,97	0,01%
Carteira	44.378.611,63	174.962,34	0,39%

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	-
BB IRF-M1	0,08
BB Perfil	-
Caixa IRF-M1	0,08
Caixa Ref. DI LP	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,08
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
Santander Ativo FIC FI	-