

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Agosto/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	8.392.844,35	0,40%	0,32%	124,70%
BB Perfil	3.699.578,88	0,55%	0,32%	174,61%
BB IRF-M1	3.978.873,69	0,40%	0,32%	124,70%
BB Perfil	697.216,52	0,55%	0,32%	174,61%
Caixa IRF-M1	15.848.924,21	0,40%	0,32%	127,72%
Caixa Ref. DI LP	5.089.630,75	0,56%	0,32%	175,48%
Bradesco IRF-M1 TP	2.129.500,42	0,37%	0,32%	116,01%
NTN-B - 2024	1.436.084,75	0,66%	0,32%	206,77%
NTN-B - 2024	1.681.193,31	3,12%	0,32%	983,58%
Santander Ativo FIC FI	806.638,86	0,53%	0,32%	167,48%
TOTAL / MÉDIA	43.760.485,74	0,55%	0,32%	173,63%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	19,18%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	8,45%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M1	9,09%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	1,59%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	36,22%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	11,63%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	4,87%	100%	Art. 7º, I, b
NTN-B - 2024	3,28%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,84%	100%	Art. 7º, I, a
Santander Ativo FIC FI	1,84%	20%	Art. 7º, IV, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,63%	0,70%	89,63%
Fevereiro	0,53%	0,73%	72,05%
Março	0,62%	0,50%	124,16%
Abril	0,50%	0,63%	79,74%
Maio	0,25%	0,81%	30,41%
Junho	0,55%	1,67%	32,70%
Julho	0,69%	0,74%	93,46%
Agosto	0,55%	0,32%	173,63%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	4,39%	6,25%	70,17%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 4,39%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,25%, sendo assim o RPPS atingiu 70,17% 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	8.392.844,35	31.090,80	0,07%
BB Perfil	3.699.578,88	667,40	0,00%
BB IRF-M1	3.978.873,69	14.739,50	0,03%
BB Perfil	697.216,52	125,78	0,00%
Caixa IRF-M1	15.848.924,21	58.367,74	0,13%
Caixa Ref. DI LP	5.089.630,75	434,68	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	2.129.500,42	7.945,41	0,02%
NTN-B - 2024	1.436.084,75	48.939,26	0,11%
NTN-B - 2024	1.681.193,31	57.292,13	0,13%
Santander Ativo FIC FI	806.638,86	8.544,83	0,02%
Carteira	43.760.485,74	197.820,67	0,45%

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	-
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	-