

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Junho/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	8.303.694,36	0,50%	1,67%	29,88%
BB Perfil	3.660.153,24	0,50%	1,67%	29,96%
BB IRF-M1	3.936.609,53	0,50%	1,67%	29,88%
BB Fluxo	0,00	0,37%	1,67%	21,98%
BB Perfil	689.786,43	0,50%	1,67%	29,96%
Caixa IRF-M1	15.440.777,12	0,50%	1,67%	29,68%
Caixa Ref. DI LP	5.035.040,30	0,48%	1,67%	28,65%
Bradesco IRF-M1 TP	2.016.539,26	0,50%	1,67%	30,13%
Santander Ativo FIC FI	798.339,26	-0,21%	1,67%	-12,39%
NTN-B - 2024	1.449.237,75	1,35%	1,67%	80,68%
NTN-B - 2024	1.696.591,24	1,35%	1,67%	80,68%
TOTAL / MÉDIA	43.026.768,49	0,55%	1,67%	32,70%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	19,30%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	8,51%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M1	9,15%	100%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,00%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	1,60%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	35,89%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	11,70%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	4,69%	100%	Art. 7º, I, b
Santander Ativo FIC FI	1,86%	20%	Art. 7º, IV, a
NTN-B - 2024	3,37%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,94%	100%	Art. 7º, I, 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			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	3,10%	5,14%	60,39%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 3,1%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,14%, sendo assim o RPPS atingiu 60,39% 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	8.303.694,36	28.787,96	0,07%
BB Perfil	3.660.153,24	641,39	0,00%
BB IRF-M1	3.936.609,53	13.647,77	0,03%
BB Fluxo	0,00	0,00	0,00%
BB Perfil	689.786,43	120,88	0,00%
Caixa IRF-M1	15.440.777,12	53.164,21	0,12%
Caixa Ref. DI LP	5.035.040,30	485,12	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	2.016.539,26	7.033,98	0,02%
Santander Ativo FIC FI	798.339,26	9.274,68	0,02%
NTN-B - 2024	1.449.237,75	56.416,38	0,13%
NTN-B - 2024	1.696.591,24	66.045,43	0,15%
Carteira	43.026.768,49	189.234,55	0,44%

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