

## 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Junho/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	8.607.949,99	0,57%	0,42%	136,75%
BB Perfil	5.635.171,63	0,41%	0,42%	98,06%
Caixa IRF-M1	8.581.678,31	0,57%	0,42%	137,37%
Caixa Ref. DI LP	5.853.954,25	0,45%	0,42%	108,78%
Bradesco IRF-M1	7.488.085,56	0,56%	0,42%	134,32%
NTN-B - 2024	1.507.608,98	0,44%	0,42%	105,29%
NTN-B - 2024	1.764.925,18	0,44%	0,42%	105,29%
Santander Ativo F	899.398,93	2,25%	0,42%	540,10%
Caixa IDKA 2A	8.247.259,62	1,22%	0,42%	291,99%
BB Público Suprer	13.145,69	0,08%	0,42%	19,28%
BB Público Suprer	0,00	#DIV/0!	0,42%	#DIV/0!
TOTAL / MÉDIA	48.599.178,14	0,67%	0,42%	160,81%

## 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	17,71%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	11,60%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	17,66%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	12,05%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1	15,41%	20%	Art. 7º, I, b
NTN-B - 2024	3,10%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,63%	100%	Art. 7º, I, a
Santander Ativo F	1,85%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	16,97%	20%	Art. 7º, I, b
BB Público Suprer	0,03%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Público Suprer	0,00%	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%
Maior	0,73%	0,54%	136,12%
Junho	0,67%	0,42%	160,81%
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	3,58%	4,75%	75,39%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 3,58%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,75%, sendo assim o RPPS atingiu 75,39% 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

### 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	8.607.949,99	9.725,44	0,02%
BB Perfil	5.635.171,63	346,97	0,00%
Caixa IRF-M1	8.581.678,31	8.935,05	0,02%
Caixa Ref. DI LP	5.853.954,25	412,12	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	7.488.085,56	7.911,15	0,02%
NTN-B - 2024	1.507.608,98	212.045,31	0,44%
NTN-B - 2024	1.764.925,18	248.236,85	0,51%
Santander Ativo FIC FI	899.398,93	11.950,52	0,02%
Caixa IDKA 2A	8.247.259,62	61.238,46	0,13%
BB Público Supremo	13.145,69	0,47	0,00%
BB Público Supremo		0,00	
Carteira	48.599.178,14	474.764,25	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	0,04
BB Perfil	-
Caixa IRF-M1	0,05
Caixa Ref. DI LP	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,05
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
Santander Ativo FIC FI	0,09
Caixa IDKA 2A	0,05
BB Público Supremo	-
BB Público Supremo	-