

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Agosto/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	110.868,04	-0,42%	0,60%	-69,54%
BB Fluxo	23.792,92	0,40%	0,60%	66,78%
BB Perfil	149.825,18	0,49%	0,60%	82,51%
BB IRF-M	5.289.138,05	0,24%	0,60%	39,83%
BB IRF-M1	7.329.031,66	0,52%	0,60%	86,55%
BB IMA-B 5+	2.553.957,46	-0,91%	0,60%	-152,64%
BB IRF-M1	8.398.578,87	0,51%	0,60%	86,02%
BB Fluxo	10.038,09	1,90%	0,60%	318,00%
BB Perfil	872.585,05	0,49%	0,60%	82,51%
Bradesco IRF-M1	3.346.438,34	0,52%	0,60%	87,87%
Caixa IRF-M1	6.824.660,06	-0,42%	0,60%	-70,82%
Caixa IRF-M1	7.959.293,00	0,52%	0,60%	87,89%
Caixa Brasil TP	2.869.683,20	0,49%	0,60%	82,06%
Caixa IRF-M1	7.197.725,59	0,52%	0,60%	87,89%
Caixa IRF-M	2.264.178,88	0,20%	0,60%	32,93%
Caixa Ref. DI LP	4.088.706,86	0,49%	0,60%	82,03%
Caixa IDKA 2A	2.076.449,46	0,10%	0,60%	16,75%
Caixa IRF-M1+	1.260.337,72	0,05%	0,60%	7,67%
Caixa IRF-M1+	1.016.428,85	0,05%	0,60%	7,67%
BB PREV RF IRF-M	2.047.072,03	0,01%	0,60%	2,27%
BB IRF-M	96.981,09	0,24%	0,60%	39,83%
TOTAL / MÉDIA	65.785.770,40	0,28%	0,60%	47,14%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B TP	0,17%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,04%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	0,23%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	8,04%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	11,14%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	3,88%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	12,77%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,02%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	1,33%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1	5,09%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	10,37%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	12,10%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,36%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	10,94%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M	3,44%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	6,22%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	3,16%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	1,92%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	1,55%	20%	Art. 7º, I, b
BB PREV RF IRF-M	3,11%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M	0,15%	20%	Art. 7º, I, b

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,82%	0,81%	101,88%
Fevereiro	0,44%	0,92%	48,19%
Março	0,45%	1,24%	36,49%
Abril	0,61%	1,06%	57,53%
Mai	1,22%	0,62%	196,99%
Junho	1,27%	0,50%	255,64%
Julho	0,86%	0,68%	126,49%
Agosto	0,28%	0,60%	47,14%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	6,11%	6,60%	92,56%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 6,11%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,6%, sendo assim o RPPS atingiu 92,56% 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 IMA-B TP	110.868,04	2.279,72	0,00%
BB Fluxo	23.792,92	1,63	0,00%
BB Perfil	149.825,18	12,12	0,00%
BB IRF-M	5.289.138,05	51.459,29	0,08%
BB IRF-M1	7.329.031,66	10.125,99	0,02%
BB IMA-B 5+	2.553.957,46	74.236,19	0,11%
BB IRF-M1	8.398.578,87	11.603,71	0,02%
BB Fluxo	10.038,09	0,69	0,00%
BB Perfil	872.585,05	70,58	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	3.346.438,34	4.510,27	0,01%
Caixa IRF-M1	6.824.660,06	9.054,09	0,01%
Caixa IRF-M1	7.959.293,00	10.559,38	0,02%
Caixa Brasil TP	2.869.683,20	878,15	0,00%
Caixa IRF-M1	7.197.725,59	9.549,03	0,01%
Caixa IRF-M	2.264.178,88	22.328,01	0,03%
Caixa Ref. DI LP	4.088.706,86	345,30	0,00%
Caixa IDKA 2A	2.076.449,46	14.861,13	0,02%
Caixa IRF-M1+	1.260.337,72	17.098,21	0,03%
Caixa IRF-M1+	1.016.428,85	13.789,25	0,02%
BB PREV RF IRF-M1+	2.047.072,03	27.845,94	0,04%
BB IRF-M	96.981,09	943,55	0,00%
Carteira	65.785.770,40	262.493,04	0,40%

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 IMA-B TP	-
BB Fluxo	-
BB Perfil	-
BB IRF-M	-
BB IRF-M1	-
BB IMA-B 5+	-
BB IRF-M1	-
BB Fluxo	-
BB Perfil	-
Bradesco IRF-M1 TP	-
Caixa IRF-M1	-
Caixa IRF-M1	-
Caixa Brasil TP	-
Caixa IRF-M1	-
Caixa IRF-M	-
Caixa Ref. DI LP	-
Caixa IDKA 2A	-
Caixa IRF-M1+	-
Caixa IRF-M1+	-
BB PREV RF IRF-M1+	-
BB IRF-M	-