

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Agosto/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	2.145.773,79	-0,43%	0,60%	-71,35%
BB IPCA TP	1.600.204,41	-0,06%	0,60%	-9,77%
BB IRF-M1	2.813.392,15	0,38%	0,60%	63,85%
BB IMA-B 5+	1.303.377,19	-0,82%	0,60%	-136,89%
BB Alocacao Ativa	4.226.041,62	0,08%	0,60%	14,19%
BB IMA-B 5+	2.690.805,08	-0,79%	0,60%	-131,78%
Caixa IRF-M1+	3.788.581,51	0,07%	0,60%	11,47%
Caixa IMA-B 5+	1.771.706,76	-1,50%	0,60%	-251,92%
Sicredi IRF-M	1.378.996,55	0,11%	0,60%	18,96%
TOTAL / MÉDIA	21.718.879,06	-0,21%	0,60%	-34,43%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B TP	9,88%	20%	Art. 7º, I, b
BB IPCA TP	7,37%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	12,95%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	6,00%	20%	Art. 7º, I, b
BB Alocacao Ativa	19,46%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	12,39%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	17,44%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B 5+	8,16%	20%	Art. 7º, I, b
Sicredi IRF-M	6,35%	20%	Art. 7º, III, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	4,44%	0,81%	549,50%
Fevereiro	-0,49%	0,92%	-53,43%
Março	0,40%	1,24%	32,14%
Abril	0,96%	1,06%	90,77%
Maio	2,34%	0,62%	378,91%
Junho	2,71%	0,50%	546,41%
Julho	1,10%	0,68%	162,88%
Agosto	-0,21%	0,60%	-34,43%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	11,73%	6,60%	177,81%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 11,73%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,6%, sendo assim o RPPS atingiu 177,81% 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	2.145.773,79	44.122,39	0,20%
BB IPCA TP	1.600.204,41	21.352,74	0,10%
BB IRF-M1	2.813.392,15	3.887,06	0,02%
BB IMA-B 5+	1.303.377,19	37.885,42	0,17%
BB Alocacao Ativa	4.226.041,62	43.890,64	0,20%
BB IMA-B 5+	2.690.805,08	78.213,95	0,36%
Caixa IRF-M1+	3.788.581,51	51.397,32	0,24%
Caixa IMA-B 5+	1.771.706,76	51.170,51	0,24%
Sicredi IRF-M	1.378.996,55	14.306,03	0,07%
Carteira	21.718.879,06	330.206,27	1,52%

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 IPCA TP	-
BB IRF-M1	-
BB IMA-B 5+	-
BB Alocacao Ativa	-
BB IMA-B 5+	-
Caixa IRF-M1+	-
Caixa IMA-B 5+	-
Sicredi IRF-M	-