

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Agosto/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IPCA TP	1.421.537,46	-0,40%	0,40%	-100,81%
BB IRF-M1	5.473.091,22	0,40%	0,40%	99,75%
BB IMA-B 5+	5.722.760,19	-0,56%	0,40%	-141,75%
BB IMA-B5	35.746,44	-0,35%	0,40%	-88,21%
BB IRF-M1	1.385.413,58	0,40%	0,40%	99,75%
BB IMA-B 5+	603.681,46	-0,56%	0,40%	-141,65%
BB IMA-B 5+	681.123,55	-0,51%	0,40%	-128,18%
Caixa IRF-M1	3.304.339,12	0,32%	0,40%	81,70%
Caixa IMA-B 5+	2.581.218,44	-0,78%	0,40%	-195,93%
Sicredi IRF-M	1.181.074,47	-1,00%	0,40%	-251,89%
TOTAL / MÉDIA	22.389.985,93	-0,16%	0,40%	-39,96%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IPCA TP	6,35%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	24,44%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	25,56%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B5	0,16%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	6,19%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	2,70%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	3,04%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	14,76%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B 5+	11,53%	100%	Art. 7º, I, b
Sicredi IRF-M	5,28%	20%	Art. 7º, III, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	1,70%	0,87%	195,68%
Fevereiro	0,55%	0,82%	67,22%
Março	0,62%	0,58%	107,92%
Abril	0,04%	0,71%	5,55%
Maio	-1,88%	0,89%	-211,95%
Junho	-0,11%	1,75%	-6,29%
Julho	1,72%	0,82%	210,10%
Agosto	-0,16%	0,40%	-39,96%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,46%	7,03%	34,97%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,46%, enquanto que a meta acumulada no período é de 7,03%, sendo assim o RPPS atingiu 34,97% 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 IPCA TP	1.421.537,46	42.962,07	0,19%
BB IRF-M1	5.473.091,22	20.274,74	0,09%
BB IMA-B 5+	5.722.760,19	231.783,64	1,04%
BB IMA-B5	35.746,44	665,60	0,00%
BB IRF-M1	1.385.413,58	5.132,18	0,02%
BB IMA-B 5+	603.681,46	24.450,35	0,11%
BB IMA-B 5+	681.123,55	27.586,91	0,12%
Caixa IRF-M1	3.304.339,12	12.169,08	0,05%
Caixa IMA-B 5+	2.581.218,44	104.125,35	0,47%
Sicredi IRF-M	1.181.074,47	23.622,69	0,11%
Carteira	22.389.985,93	448.200,60	2,00%

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 IPCA TP	-
BB IRF-M1	-
BB IMA-B 5+	-
BB IMA-B5	-
BB IRF-M1	-
BB IMA-B 5+	-
BB IMA-B 5+	-
Caixa IRF-M1	-
Caixa IMA-B 5+	-
Sicredi IRF-M	-