

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Junho/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	109.930,25	3,71%	0,50%	747,56%
BB Fluxo	20.514,69	0,29%	0,50%	57,44%
BB Perfil	148.276,11	0,39%	0,50%	77,99%
BB IRF-M	5.220.565,71	2,14%	0,50%	430,76%
BB IRF-M1	7.240.713,65	0,54%	0,50%	109,56%
BB IMA-B 5+	2.312.956,63	5,04%	0,50%	1014,55%
BB IRF-M1	8.238.049,86	0,55%	0,50%	110,17%
BB Fluxo	43.196,00	1,85%	0,50%	373,19%
BB Perfil	863.563,23	0,46%	0,50%	92,06%
Bradesco IRF-M1	3.306.092,36	0,56%	0,50%	112,87%
Caixa IMA-B	6.767.455,83	3,67%	0,50%	738,33%
Caixa IRF-M1	7.862.698,81	0,56%	0,50%	113,64%
Caixa Brasil TP	2.839.851,25	0,48%	0,50%	97,21%
Caixa IRF-M1	7.110.373,78	0,56%	0,50%	113,48%
Caixa IRF-M	2.235.413,54	2,15%	0,50%	432,09%
Caixa Ref. DI LP	4.046.499,02	0,45%	0,50%	91,40%
Caixa IDKA 2A	2.055.516,73	1,22%	0,50%	245,35%
Caixa IRF-M1+	1.003.120,60	0,31%	0,50%	62,81%
Caixa IRF-M1+	1.003.120,60	0,31%	0,50%	62,81%
BB PREV RF IRF-M	2.020.746,80	1,04%	0,50%	208,80%
BB IRF-M	79.155,24	0,83%	0,50%	168,01%
TOTAL / MÉDIA	64.527.810,69	1,27%	0,50%	255,64%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B TP	0,17%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,03%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	0,23%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	8,09%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	11,22%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	3,58%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	12,77%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,07%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	1,34%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1	5,12%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	10,49%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	12,18%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,40%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	11,02%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M	3,46%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	6,27%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	3,19%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	1,55%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	1,55%	20%	Art. 7º, I, b
BB PREV RF IRF-M	3,13%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M	0,12%	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%
Maior	1,22%	0,62%	196,99%
Junho	1,27%	0,50%	255,64%
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	4,91%	5,25%	93,49%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 4,91%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,25%, sendo assim o RPPS atingiu 93,49% 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	109.930,25	2.853,32	0,00%
BB Fluxo	20.514,69	0,56	0,00%
BB Perfil	148.276,11	9,13	0,00%
BB IRF-M	5.220.565,71	59.405,57	0,09%
BB IRF-M1	7.240.713,65	8.180,71	0,01%
BB IMA-B 5+	2.312.956,63	89.037,90	0,14%
BB IRF-M1	8.238.049,86	9.307,52	0,01%
BB Fluxo	43.196,00	1,18	0,00%
BB Perfil	863.563,23	53,17	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	3.306.092,36	3.492,88	0,01%
Caixa IMA-B	6.767.455,83	174.676,74	0,27%
Caixa IRF-M1	7.862.698,81	8.186,47	0,01%
Caixa Brasil TP	2.839.851,25	911,22	0,00%
Caixa IRF-M1	7.110.373,78	7.403,16	0,01%
Caixa IRF-M	2.235.413,54	26.163,10	0,04%
Caixa Ref. DI LP	4.046.499,02	284,87	0,00%
Caixa IDKA 2A	2.055.516,73	15.262,85	0,02%
Caixa IRF-M1+	1.003.120,60	15.761,66	0,02%
Caixa IRF-M1+	1.003.120,60	15.761,66	0,02%
BB PREV RF IRF-M1+	2.020.746,80	32.640,76	0,05%
BB IRF-M	79.155,24	900,72	0,00%
Carteira	64.527.810,69	449.150,03	0,70%

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	0,09
BB Fluxo	-
BB Perfil	-
BB IRF-M	0,09
BB IRF-M1	0,04
BB IMA-B 5+	0,09
BB IRF-M1	0,04
BB Fluxo	-
BB Perfil	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,05
Caixa IMA-B	0,09
Caixa IRF-M1	0,05
Caixa Brasil TP	0,02
Caixa IRF-M1	0,05
Caixa IRF-M	0,09
Caixa Ref. DI LP	-
Caixa IDKA 2A	0,05
Caixa IRF-M1+	0,09
Caixa IRF-M1+	0,09
BB PREV RF IRF-M1+	-