

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Julho/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	111.330,45	1,27%	0,68%	187,95%
BB Fluxo	13.050,77	0,39%	0,68%	58,21%
BB Perfil	149.090,41	0,55%	0,68%	81,04%
BB IRF-M	5.276.585,07	1,07%	0,68%	158,34%
BB IRF-M1	7.291.340,23	0,70%	0,68%	103,17%
BB IMA-B 5+	2.347.457,00	1,49%	0,68%	220,11%
BB IRF-M1	8.295.649,74	0,70%	0,68%	103,17%
BB Fluxo	39.285,15	1,93%	0,68%	284,59%
BB Perfil	868.305,74	0,55%	0,68%	81,04%
Bradesco IRF-M1	3.328.967,35	0,69%	0,68%	102,10%
Caixa IMA-B	6.853.651,31	1,27%	0,68%	187,95%
Caixa IRF-M1	7.917.727,63	0,70%	0,68%	103,27%
Caixa Brasil TP	2.855.686,02	0,56%	0,68%	82,28%
Caixa IRF-M1	7.160.137,32	0,70%	0,68%	103,27%
Caixa IRF-M	2.259.733,85	1,09%	0,68%	160,54%
Caixa Ref. DI LP	4.068.770,42	0,55%	0,68%	81,22%
Caixa IDKA 2A	2.074.374,46	0,92%	0,68%	135,38%
Caixa IRF-M1+	1.259.760,54	1,09%	0,68%	161,52%
Caixa IRF-M1+	1.015.963,37	1,28%	0,68%	188,92%
BB PREV RF IRF-M	2.046.795,08	1,29%	0,68%	190,21%
BB IRF-M	96.750,92	1,01%	0,68%	148,84%
TOTAL / MÉDIA	65.330.412,83	0,86%	0,68%	126,49%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B TP	0,17%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,02%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	0,23%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	8,08%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	11,16%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	3,59%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	12,70%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,06%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	1,33%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1	5,10%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	10,49%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	12,12%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,37%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	10,96%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M	3,46%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	6,23%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	3,18%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	1,93%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	1,56%	20%	Art. 7º, I, b
BB PREV RF IRF-M	3,13%	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			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	5,81%	5,96%	97,39%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 5,81%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,96%, sendo assim o RPPS atingiu 97,39% 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 IMA-B TP	111.330,45	2.732,14	0,00%
BB Fluxo	13.050,77	0,43	0,00%
BB Perfil	149.090,41	8,07	0,00%
BB IRF-M	5.276.585,07	57.179,23	0,09%
BB IRF-M1	7.291.340,23	8.864,34	0,01%
BB IMA-B 5+	2.347.457,00	84.774,27	0,13%
BB IRF-M1	8.295.649,74	10.085,32	0,02%
BB Fluxo	39.285,15	1,30	0,00%
BB Perfil	868.305,74	46,99	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	3.328.967,35	3.822,23	0,01%
Caixa IMA-B	6.853.651,31	167.484,72	0,26%
Caixa IRF-M1	7.917.727,63	8.964,89	0,01%
Caixa Brasil TP	2.855.686,02	916,68	0,00%
Caixa IRF-M1	7.160.137,32	8.107,10	0,01%
Caixa IRF-M	2.259.733,85	25.213,47	0,04%
Caixa Ref. DI LP	4.068.770,42	286,98	0,00%
Caixa IDKA 2A	2.074.374,46	15.308,51	0,02%
Caixa IRF-M1+	1.259.760,54	18.973,43	0,03%
Caixa IRF-M1+	1.015.963,37	15.301,57	0,02%
BB PREV RF IRF-M1+	2.046.795,08	30.398,58	0,05%
BB IRF-M	96.750,92	1.048,43	0,00%
Carteira	65.330.412,83	435.715,86	0,67%

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	0,04
BB Fluxo	-
BB Perfil	-
BB IRF-M	0,05
BB IRF-M1	0,06
BB IMA-B 5+	0,04
BB IRF-M1	0,06
BB Fluxo	-
BB Perfil	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,06
Caixa IMA-B	0,04
Caixa IRF-M1	0,06
Caixa Brasil TP	-
Caixa IRF-M1	0,06
Caixa IRF-M	0,05
Caixa Ref. DI LP	-
Caixa IDKA 2A	0,04
Caixa IRF-M1+	0,05
Caixa IRF-M1+	0,05
BB PREV RF IRF-M1+	-
BB IRF-M	0,05