

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Setembro/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	114.025,13	2,85%	0,45%	637,68%
BB Fluxo	12.919,66	0,16%	0,45%	35,88%
BB Perfil	172.290,22	0,45%	0,45%	99,65%
BB IRF-M	5.364.067,68	1,42%	0,45%	317,24%
BB IRF-M1	7.374.423,97	0,62%	0,45%	138,69%
BB IMA-B 5+	2.648.645,07	3,71%	0,45%	830,23%
BB IRF-M1	8.450.595,42	0,62%	0,45%	138,69%
BB Fluxo	109.930,40	0,86%	0,45%	191,72%
BB Perfil	875.716,46	0,45%	0,45%	100,89%
Bradesco IRF-M1	3.367.225,78	0,62%	0,45%	139,10%
Caixa IMA-B	7.019.236,86	2,85%	0,45%	638,45%
Caixa IRF-M1	8.009.178,49	0,63%	0,45%	140,35%
Caixa Brasil TP	2.883.653,81	0,49%	0,45%	109,02%
Caixa IRF-M1	7.242.837,88	0,63%	0,45%	140,35%
Caixa IRF-M	2.296.407,68	1,42%	0,45%	318,75%
Caixa Ref. DI LP	4.106.946,39	0,45%	0,45%	99,90%
Caixa IDKA 2A	2.106.027,22	1,42%	0,45%	318,98%
Caixa IRF-M1+	1.283.715,35	1,85%	0,45%	415,37%
Caixa IRF-M1+	1.035.282,29	1,85%	0,45%	415,37%
BB PREV RF IRF-M	2.305.608,54	1,67%	0,45%	374,63%
BB IRF-M	98.354,99	1,42%	0,45%	317,24%
TOTAL / MÉDIA	66.877.089,29	1,15%	0,45%	258,01%

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	0,26%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	8,02%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	11,03%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	3,96%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	12,64%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,16%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	1,31%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1	5,03%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	10,50%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	11,98%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,31%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	10,83%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M	3,43%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	6,14%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	3,15%	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	3,45%	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	1,15%	0,45%	258,01%
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	7,33%	7,07%	103,61%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 7,33%, enquanto que a meta acumulada no período é de 7,07%, sendo assim o RPPS atingiu 103,61% 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	114.025,13	2.446,71	0,00%
BB Fluxo	12.919,66	1,26	0,00%
BB Perfil	172.290,22	16,84	0,00%
BB IRF-M	5.364.067,68	52.624,57	0,08%
BB IRF-M1	7.374.423,97	10.524,41	0,02%
BB IMA-B 5+	2.648.645,07	80.013,73	0,12%
BB IRF-M1	8.450.595,42	12.060,27	0,02%
BB Fluxo	109.930,40	10,73	0,00%
BB Perfil	875.716,46	85,59	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	3.367.225,78	4.638,49	0,01%
Caixa IMA-B	7.019.236,86	150.469,32	0,22%
Caixa IRF-M1	8.009.178,49	11.007,98	0,02%
Caixa Brasil TP	2.883.653,81	892,69	0,00%
Caixa IRF-M1	7.242.837,88	9.954,70	0,01%
Caixa IRF-M	2.296.407,68	22.759,97	0,03%
Caixa Ref. DI LP	4.106.946,39	463,43	0,00%
Caixa IDKA 2A	2.106.027,22	16.139,55	0,02%
Caixa IRF-M1+	1.283.715,35	17.783,21	0,03%
Caixa IRF-M1+	1.035.282,29	14.341,69	0,02%
BB PREV RF IRF-M1+	2.305.608,54	32.045,13	0,05%
BB IRF-M	98.354,99	964,92	0,00%
Carteira	66.877.089,29	417.065,91	0,62%

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	0,08
BB Fluxo	-
BB Perfil	-
BB IRF-M	0,08
BB IRF-M1	0,08
BB IMA-B 5+	0,07
BB IRF-M1	0,08
BB Fluxo	-
BB Perfil	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,09
Caixa IMA-B	0,08
Caixa IRF-M1	0,09
Caixa Brasil TP	0,04
Caixa IRF-M1	0,09
Caixa IRF-M	0,08
Caixa Ref. DI LP	-
Caixa IDKA 2A	0,07
Caixa IRF-M1+	0,07
Caixa IRF-M1+	0,07
BB PREV RF IRF-M1+	0,07
BB IRF-M	0,08