

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Outubro/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	117.849,18	3,35%	0,59%	571,09%
BB Fluxo	7.441,07	0,28%	0,59%	47,37%
BB Perfil	173.044,55	0,44%	0,59%	74,56%
BB IRF-M	5.454.350,96	1,68%	0,59%	286,61%
BB IRF-M1	7.418.575,62	0,60%	0,59%	101,95%
BB IMA-B 5+	2.772.162,30	4,66%	0,59%	794,12%
BB IRF-M1	8.501.190,25	0,60%	0,59%	101,95%
BB Fluxo	60.919,41	0,80%	0,59%	135,83%
BB Perfil	879.550,59	0,44%	0,59%	74,56%
Bradesco IRF-M1	3.387.484,16	0,60%	0,59%	102,45%
Caixa IMA-B	7.252.650,80	3,33%	0,59%	566,27%
Caixa IRF-M1	8.057.779,74	0,61%	0,59%	103,33%
Caixa Brasil TP	2.897.961,82	0,50%	0,59%	84,49%
Caixa IRF-M1	7.286.788,84	0,61%	0,59%	103,33%
Caixa IRF-M	2.335.308,76	1,69%	0,59%	288,47%
Caixa Ref. DI LP	4.125.406,56	0,45%	0,59%	76,54%
Caixa IDKA 2A	2.132.911,85	1,28%	0,59%	217,38%
Caixa IRF-M1+	1.462.136,21	2,02%	0,59%	343,22%
Caixa IRF-M1+	1.058.279,15	2,22%	0,59%	378,26%
BB PREV RF IRF-M	2.356.784,56	2,22%	0,59%	377,98%
BB IRF-M	111.667,07	1,68%	0,59%	285,62%
TOTAL / MÉDIA	67.850.243,45	1,30%	0,59%	220,55%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B TP	0,17%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,01%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	0,26%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	8,04%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	10,93%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	4,09%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	12,53%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,09%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	1,30%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1	4,99%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	10,69%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	11,88%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,27%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	10,74%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M	3,44%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	6,08%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	3,14%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	2,15%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	1,56%	20%	Art. 7º, I, b
BB PREV RF IRF-M	3,47%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M	0,16%	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	1,30%	0,59%	220,55%
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	8,72%	7,70%	113,20%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 8,72%, enquanto que a meta acumulada no período é de 7,7%, sendo assim o RPPS atingiu 113,2% 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	117.849,18	2.408,03	0,00%
BB Fluxo	7.441,07	0,86	0,00%
BB Perfil	173.044,55	26,65	0,00%
BB IRF-M	5.454.350,96	49.381,16	0,07%
BB IRF-M1	7.418.575,62	11.190,79	0,02%
BB IMA-B 5+	2.772.162,30	80.162,27	0,12%
BB IRF-M1	8.501.190,25	12.823,89	0,02%
BB Fluxo	60.919,41	7,04	0,00%
BB Perfil	879.550,59	135,44	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	3.387.484,16	4.959,05	0,01%
Caixa IMA-B	7.252.650,80	148.561,99	0,22%
Caixa IRF-M1	8.057.779,74	11.726,96	0,02%
Caixa Brasil TP	2.897.961,82	922,07	0,00%
Caixa IRF-M1	7.286.788,84	10.604,89	0,02%
Caixa IRF-M	2.335.308,76	21.375,28	0,03%
Caixa Ref. DI LP	4.125.406,56	574,85	0,00%
Caixa IDKA 2A	2.132.911,85	16.615,01	0,02%
Caixa IRF-M1+	1.462.136,21	19.140,63	0,03%
Caixa IRF-M1+	1.058.279,15	13.853,79	0,02%
BB PREV RF IRF-M1+	2.356.784,56	267,95	0,00%
BB IRF-M	111.667,07	1.010,98	0,00%
Carteira	67.850.243,45	381.202,20	0,56%

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	0,07
BB Fluxo	-
BB Perfil	-
BB IRF-M	0,06
BB IRF-M1	0,04
BB IMA-B 5+	0,07
BB IRF-M1	0,04
BB Fluxo	-
BB Perfil	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,04
Caixa IMA-B	0,07
Caixa IRF-M1	0,04
Caixa Brasil TP	0,02
Caixa IRF-M1	0,04
Caixa IRF-M	0,06
Caixa Ref. DI LP	-
Caixa IDKA 2A	0,05
Caixa IRF-M1+	0,07
Caixa IRF-M1+	0,07
BB PREV RF IRF-M1+	0,07
BB IRF-M	0,06