

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Fevereiro/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M	113.478,16	0,63%	0,73%	86,96%
BB IMA-B TP	118.011,97	0,44%	0,73%	60,03%
BB Fluxo	28.098,42	0,18%	0,73%	24,94%
BB Perfil	175.337,45	0,27%	0,73%	37,53%
BB IRF-M	5.902.513,12	0,59%	0,73%	81,63%
BB IRF-M1	7.528.721,10	0,35%	0,73%	48,50%
BB IMA-B 5+	2.740.242,31	0,30%	0,73%	41,09%
BB IRF-M1	9.259.220,09	0,35%	0,73%	48,50%
BB Fluxo	210.886,53	0,36%	0,73%	50,02%
BB Perfil	731.155,59	0,27%	0,73%	37,53%
BB PREV RF IRF-M1+	2.779.969,21	0,78%	0,73%	106,54%
Bradesco IRF-M1 TP	3.437.755,46	0,35%	0,73%	48,66%
Caixa IMA-B	7.258.332,35	0,44%	0,73%	60,32%
Caixa IRF-M1	8.179.537,15	0,36%	0,73%	49,92%
Caixa Brasil TP	2.938.208,04	0,29%	0,73%	40,16%
Caixa IRF-M1	7.396.896,18	0,36%	0,73%	49,92%
Caixa IRF-M	2.372.541,52	0,63%	0,73%	86,91%
Caixa Ref. DI LP	4.179.496,20	0,27%	0,73%	37,64%
Caixa IDKA 2A	2.179.478,38	0,60%	0,73%	82,65%
Caixa IRF-M1+	1.487.086,13	0,78%	0,73%	106,91%
Caixa IRF-M1+	1.076.337,64	0,78%	0,73%	106,91%
TOTAL / MÉDIA	70.093.303,00	0,42%	0,73%	58,26%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M	0,16%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B TP	0,17%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,04%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	0,25%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	8,42%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	10,74%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	3,91%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	13,21%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,30%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	1,04%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PREV RF IRF-M1+	3,97%	20%	Art. 7º, I, b
Bradesco IRF-M1 TP	4,90%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	10,36%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	11,67%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,19%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	10,55%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M	3,38%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	5,96%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	3,11%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	2,12%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	1,54%	20%	Art. 7º, I, b

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,48%	0,69%	69,12%
Fevereiro	0,42%	0,73%	58,26%
Março			
Abril			
Mai			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,90%	1,42%	63,45%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,9%, enquanto que a meta acumulada no período é de 1,42%, sendo assim o RPPS atingiu 63,45% 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 IRF-M	113.478,16	997,90	0,00%
BB IMA-B TP	118.011,97	2.673,05	0,00%
BB Fluxo	28.098,42	3,65	0,00%
BB Perfil	175.337,45	28,71	0,00%
BB IRF-M	5.902.513,12	51.905,41	0,07%
BB IRF-M1	7.528.721,10	7.465,48	0,01%
BB IMA-B 5+	2.740.242,31	93.896,95	0,13%
BB IRF-M1	9.259.220,09	9.181,44	0,01%
BB Fluxo	210.886,53	27,41	0,00%
BB Perfil	731.155,59	119,71	0,00%
BB PREV RF IRF-M1+	2.779.969,21	35.658,91	0,05%
Bradesco IRF-M1 TP	3.437.755,46	3.405,43	0,00%
Caixa IMA-B	7.258.332,35	165.331,74	0,24%
Caixa IRF-M1	8.179.537,15	8.006,43	0,01%
Caixa Brasil TP	2.938.208,04	1.274,02	0,00%
Caixa IRF-M1	7.396.896,18	7.240,35	0,01%
Caixa IRF-M	2.372.541,52	20.895,15	0,03%
Caixa Ref. DI LP	4.179.496,20	1.068,62	0,00%
Caixa IDKA 2A	2.179.478,38	14.621,40	0,02%
Caixa IRF-M1+	1.487.086,13	19.066,19	0,03%
Caixa IRF-M1+	1.076.337,64	13.799,91	0,02%
Carteira	70.093.303,00	423.532,88	0,60%

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 IRF-M	0,02
BB IMA-B TP	-
BB Fluxo	-
BB Perfil	-
BB IRF-M	0,02
BB IRF-M1	0,05
BB IMA-B 5+	-
BB IRF-M1	0,05
BB Fluxo	-
BB Perfil	-
BB PREV RF IRF-M1+	0,02
Bradesco IRF-M1 TP	0,05
Caixa IMA-B	-
Caixa IRF-M1	0,06
Caixa Brasil TP	-
Caixa IRF-M1	0,06
Caixa IRF-M	0,02
Caixa Ref. DI LP	-
Caixa IDKA 2A	0,03
Caixa IRF-M1+	0,02
Caixa IRF-M1+	0,02