

## 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Abril/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M	114.567,62	1,07%	0,17%	649,71%
BB IMA-B TP	108.947,66	-0,75%	0,17%	-454,69%
BB Fluxo	48.080,64	0,34%	0,17%	208,94%
BB Perfil	175.732,06	0,26%	0,17%	156,49%
BB IRF-M	5.959.180,97	1,07%	0,17%	649,71%
BB IRF-M1	7.610.413,80	0,48%	0,17%	293,68%
BB IMA-B 5+	2.398.389,70	-1,78%	0,17%	-1080,48%
BB IRF-M1	9.352.958,73	0,41%	0,17%	249,88%
BB Fluxo	461.871,22	0,17%	0,17%	100,82%
BB Perfil	732.801,12	0,26%	0,17%	156,49%
BB PREV RF IRF-M1+	2.803.204,49	1,27%	0,17%	768,21%
Bradesco IRF-M1 TP	3.471.941,30	0,41%	0,17%	251,47%
Caixa IMA-B	6.624.222,31	-1,76%	0,17%	-1066,11%
Caixa IRF-M1	8.275.668,03	0,58%	0,17%	353,95%
Caixa Brasil TP	2.961.748,02	0,45%	0,17%	269,77%
Caixa IRF-M1	7.472.611,15	0,43%	0,17%	262,57%
Caixa IRF-M	2.396.596,63	1,13%	0,17%	683,86%
Caixa Ref. DI LP	4.185.586,66	0,00%	0,17%	2,11%
Caixa IDKA 2A	2.156.941,05	0,43%	0,17%	258,06%
Caixa IRF-M1+	1.501.791,87	1,44%	0,17%	873,50%
Caixa IRF-M1+	1.086.981,50	1,44%	0,17%	873,50%
TOTAL / MÉDIA	69.900.236,53	0,28%	0,17%	169,97%

## 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M	0,16%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B TP	0,16%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,07%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	0,25%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	8,53%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	10,89%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	3,43%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	13,38%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,66%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	1,05%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PREV RF IRF-M1+	4,01%	20%	Art. 7º, I, b
Bradesco IRF-M1 TP	4,97%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	9,48%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	11,84%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,24%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	10,69%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M	3,43%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	5,99%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	3,09%	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

## 3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,48%	0,69%	69,12%
Fevereiro	0,42%	0,73%	58,26%
Março	-0,94%	0,55%	-171,17%
Abril	0,28%	0,17%	169,97%
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,24%	2,14%	11,06%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,24%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,14%, sendo assim o RPPS atingiu 11,06% 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	114.567,62	4.817,46	0,01%
BB IMA-B TP	108.947,66	9.623,66	0,01%
BB Fluxo	48.080,64	5,33	0,00%
BB Perfil	175.732,06	196,38	0,00%
BB IRF-M	5.959.180,97	250.577,86	0,36%
BB IRF-M1	7.610.413,80	27.513,84	0,04%
BB IMA-B 5+	2.398.389,70	325.488,69	0,47%
BB IRF-M1	9.352.958,73	33.813,65	0,05%
BB Fluxo	461.871,22	51,17	0,00%
BB Perfil	732.801,12	818,90	0,00%
BB PREV RF IRF-M1+	2.803.204,49	175.990,29	0,25%
Bradesco IRF-M1 TP	3.471.941,30	12.445,68	0,02%
Caixa IMA-B	6.624.222,31	588.340,46	0,84%
Caixa IRF-M1	8.275.668,03	29.629,79	0,04%
Caixa Brasil TP	2.961.748,02	3.562,03	0,01%
Caixa IRF-M1	7.472.611,15	26.754,56	0,04%
Caixa IRF-M	2.396.596,63	100.358,67	0,14%
Caixa Ref. DI LP	4.185.586,66	8.787,29	0,01%
Caixa IDKA 2A	2.156.941,05	61.421,70	0,09%
Caixa IRF-M1+	1.501.791,87	93.799,56	0,13%
Caixa IRF-M1+	1.086.981,50	67.891,16	0,10%
Carteira	69.900.236,53	1.752.343,60	2,51%

#### 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	0,00
BB IMA-B TP	0,04
BB Fluxo	-
BB Perfil	-
BB IRF-M	0,00
BB IRF-M1	-
BB IMA-B 5+	0,03
BB IRF-M1	-
BB Fluxo	-
BB Perfil	-
BB PREV RF IRF-M1+	-
Bradesco IRF-M1 TP	-
Caixa IMA-B	0,04
Caixa IRF-M1	-
Caixa Brasil TP	-
Caixa IRF-M1	-
Caixa IRF-M	0,00
Caixa Ref. DI LP	-
Caixa IDKA 2A	0,05
Caixa IRF-M1+	0,00
Caixa IRF-M1+	0,00