

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Junho/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M	179.168,82	0,77%	0,74%	104,64%
BB IMA-B TP	112.816,64	2,02%	0,74%	273,76%
BB Fluxo	13.879,25	0,14%	0,74%	18,35%
BB Perfil	176.639,63	0,26%	0,74%	35,25%
BB IRF-M	6.496.763,33	0,77%	0,74%	104,64%
BB IRF-M1	7.659.609,60	0,26%	0,74%	34,80%
BB IMA-B 5+	2.490.142,15	2,80%	0,74%	379,56%
BB IRF-M1	9.413.418,70	0,26%	0,74%	34,80%
BB Fluxo	403.418,37	0,01%	0,74%	1,62%
BB Perfil	515.421,73	0,24%	0,74%	32,22%
BB IRF-M1	2.882.601,48	1,03%	0,74%	139,64%
Bradesco IRF-M1 TP	3.494.671,42	0,26%	0,74%	35,20%
Caixa IMA-B	6.859.793,57	2,03%	0,74%	274,52%
Caixa IRF-M1	8.329.728,65	0,26%	0,74%	35,14%
Caixa Brasil TP	2.975.697,29	0,22%	0,74%	29,25%
Caixa IRF-M1	7.521.425,82	0,26%	0,74%	35,14%
Caixa IRF-M	2.448.691,20	0,77%	0,74%	104,04%
Caixa Ref. DI LP	4.209.523,12	0,24%	0,74%	32,91%
Caixa IDKA 2A	2.595.657,66	1,18%	0,74%	159,31%
Caixa IRF-M1+	1.545.748,01	1,02%	0,74%	137,84%
Caixa IRF-M1+	1.118.796,51	1,02%	0,74%	137,84%
TOTAL / MÉDIA	71.443.612,95	0,67%	0,74%	90,73%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M	0,25%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B TP	0,16%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,02%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	0,25%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	9,09%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	10,72%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	3,49%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	13,18%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,56%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	0,72%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M1	4,03%	20%	Art. 7º, I, b
Bradesco IRF-M1 TP	4,89%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	9,60%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	11,66%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,17%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	10,53%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M	3,43%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	5,89%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	3,63%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	2,16%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	1,57%	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	0,78%	0,09%	826,10%
Junho	0,67%	0,74%	90,73%
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	1,70%	2,99%	56,68%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,7%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,99%, sendo assim o RPPS atingiu 56,68% 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	179.168,82	7.662,34	0,01%
BB IMA-B TP	112.816,64	10.118,95	0,01%
BB Fluxo	13.879,25	2,51	0,00%
BB Perfil	176.639,63	196,60	0,00%
BB IRF-M	6.496.763,33	277.840,96	0,39%
BB IRF-M1	7.659.609,60	28.364,15	0,04%
BB IMA-B 5+	2.490.142,15	344.198,42	0,48%
BB IRF-M1	9.413.418,70	34.858,64	0,05%
BB Fluxo	403.418,37	72,87	0,00%
BB Perfil	515.421,73	573,65	0,00%
BB IRF-M1	2.882.601,48	10.674,50	0,01%
Bradesco IRF-M1 TP	3.494.671,42	12.837,67	0,02%
Caixa IMA-B	6.859.793,57	618.525,90	0,87%
Caixa IRF-M1	8.329.728,65	30.577,89	0,04%
Caixa Brasil TP	2.975.697,29	3.682,24	0,01%
Caixa IRF-M1	7.521.425,82	27.610,66	0,04%
Caixa IRF-M	2.448.691,20	104.300,36	0,15%
Caixa Ref. DI LP	4.209.523,12	8.930,29	0,01%
Caixa IDKA 2A	2.595.657,66	75.211,45	0,11%
Caixa IRF-M1+	1.545.748,01	98.190,51	0,14%
Caixa IRF-M1+	1.118.796,51	71.069,28	0,10%
Carteira	71.443.612,95	1.688.598,79	2,36%

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	0,03
BB IMA-B TP	0,04
BB Fluxo	-
BB Perfil	0,08
BB IRF-M	0,03
BB IRF-M1	0,06
BB IMA-B 5+	0,03
BB IRF-M1	0,06
BB Fluxo	-
BB Perfil	0,08
BB IRF-M1	0,06
Bradesco IRF-M1 TP	0,07
Caixa IMA-B	0,03
Caixa IRF-M1	0,07
Caixa Brasil TP	0,01
Caixa IRF-M1	0,07
Caixa IRF-M	0,03
Caixa Ref. DI LP	0,06
Caixa IDKA 2A	0,07
Caixa IRF-M1+	0,03
Caixa IRF-M1+	0,03