

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Março/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	6.917.966,11	0,60%	0,48%	124,76%
BB Perfil	4.372.161,69	-0,04%	0,48%	-8,93%
Bradesco IRF-M1 TP	8.026.222,08	0,57%	0,48%	119,88%
Caixa IRF-M1	9.715.341,33	0,59%	0,48%	123,05%
Caixa Ref. DI LP	5.365.976,67	0,14%	0,48%	29,78%
Caixa IDKA 2A	9.091.342,43	-1,45%	0,48%	-304,31%
Santander Ativo FIC F	2.951.926,47	0,09%	0,48%	19,28%
Sicredi IRF-M	2.038.893,89	-0,49%	0,48%	-101,58%
Itaú Alocação Dinâmic	1.037.251,86	0,53%	0,48%	110,68%
NTN-B - 2024	1.524.814,26	0,76%	0,48%	159,24%
NTN-B - 2024	1.785.067,03	0,76%	0,48%	159,24%
TOTAL / MÉDIA	52.826.963,82	0,07%	0,48%	15,43%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	13,10%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	8,28%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	15,19%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	18,39%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	10,16%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	17,21%	20%	Art. 7º, I, b
Santander Ativo FIC F	5,59%	20%	Art. 7º, IV, a
Sicredi IRF-M	3,86%	20%	Art. 7º, III, a
Itaú Alocação Dinâmic	1,96%	20%	Art. 7º, IV, a
NTN-B - 2024	2,89%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,38%	100%	Art. 7º, I, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,49%	0,62%	79,36%
Fevereiro	0,41%	0,66%	61,65%
Março	0,07%	0,48%	15,43%
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,97%	1,76%	55,14%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,97%, enquanto que a meta acumulada no período é de 1,76%, sendo assim o RPPS atingiu 55,14% 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-M1	6.917.966,11	20.367,28	0,04%
BB Perfil	4.372.161,69	4.370,00	0,01%
Bradesco IRF-M1 TP	8.026.222,08	23.285,78	0,04%
Caixa IRF-M1	9.715.341,33	28.289,02	0,05%
Caixa Ref. DI LP	5.365.976,67	3.417,87	0,01%
Caixa IDKA 2A	9.091.342,43	236.017,95	0,45%
Santander Ativo FIC FI	2.951.926,47	11.897,68	0,02%
Sicredi IRF-M	2.038.893,89	84.944,61	0,16%
Itaú Alocação Dinâmica	1.037.251,86	1.749,25	0,00%
NTN-B - 2024	1.524.814,26	93.005,22	0,18%
NTN-B - 2024	1.785.067,03	108.879,19	0,21%
Carteira	52.826.963,82	580.716,74	1,10%

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-M1	0,02
BB Perfil	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,02
Caixa IRF-M1	0,02
Caixa Ref. DI LP	-
Caixa IDKA 2A	-
Santander Ativo FIC FI	-
Sicredi IRF-M	-
Itaú Alocação Dinâmica	0,03
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-