

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Maio/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	6.973.491,97	0,39%	0,03%	1502,93%
BB Perfil	3.924.011,37	0,26%	0,03%	986,32%
Bradesco IRF-M1 TP	8.091.279,02	0,39%	0,03%	1523,27%
Caixa IRF-M1	9.944.915,55	0,39%	0,03%	1510,59%
Caixa Ref. DI LP	5.383.781,96	0,33%	0,03%	1269,43%
Caixa IDKA 2A	9.304.019,62	1,91%	0,03%	7366,99%
Santander Ativo FIC F	2.979.380,69	0,48%	0,03%	1868,47%
Sicredi IRF-M	2.089.934,37	1,39%	0,03%	5365,36%
Itaú Alocação Dinâm	1.044.352,11	0,54%	0,03%	2089,65%
NTN-B - 2024	1.531.520,90	0,05%	0,03%	205,08%
NTN-B - 2024	1.792.918,34	0,05%	0,03%	205,08%
TOTAL / MÉDIA	53.059.605,90	0,66%	0,03%	2562,21%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	13,14%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	7,40%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	15,25%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	18,74%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	10,15%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	17,54%	20%	Art. 7º, I, b
Santander Ativo FIC F	5,62%	20%	Art. 7º, IV, a
Sicredi IRF-M	3,94%	20%	Art. 7º, III, a
Itaú Alocação Dinâm	1,97%	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	0,39%	0,10%	401,41%
Maio	0,66%	0,03%	#####
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,03%	1,89%	107,71%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,03%, enquanto que a meta acumulada no período é de 1,89%, sendo assim o RPPS atingiu 107,71% 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	6.973.491,97	25.872,10	0,05%
BB Perfil	3.924.011,37	4.391,33	0,01%
Bradesco IRF-M1 TP	8.091.279,02	29.783,45	0,06%
Caixa IRF-M1	9.944.915,55	36.568,82	0,07%
Caixa Ref. DI LP	5.383.781,96	11.462,39	0,02%
Caixa IDKA 2A	9.304.019,62	268.022,61	0,51%
Santander Ativo FIC FI	2.979.380,69	17.488,68	0,03%
Sicredi IRF-M	2.089.934,37	101.479,64	0,19%
Itaú Alocação Dinâmica	1.044.352,11	12.361,19	0,02%
NTN-B - 2024	1.531.520,90	99.510,24	0,19%
NTN-B - 2024	1.792.918,34	116.494,49	0,22%
Carteira	53.059.605,90	669.541,92	1,26%

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	0,05
BB Perfil	0,04
Bradesco IRF-M1 TP	0,05
Caixa IRF-M1	0,05
Caixa Ref. DI LP	0,07
Caixa IDKA 2A	0,09
Santander Ativo FIC FI	0,03
Sicredi IRF-M	0,03
Itaú Alocação Dinâmica	0,02
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-