

### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Agosto/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1 TP	7.394.471,81	0,09%	0,65%	13,61%
BB PERFIL	0,00	0,01%	0,65%	1,43%
BB RETORNO TOTAL	3.867.913,17	-0,92%	0,65%	-141,64%
BRADESCO IRF-M1	8.137.698,04	0,10%	0,65%	14,73%
CAIXA IRF-M1 TP	9.412.288,89	0,10%	0,65%	14,73%
CAIXA REF DI	5.418.103,58	0,14%	0,65%	22,36%
CAIXA IDKA 2A	9.777.388,65	0,77%	0,65%	119,50%
SANTANDER ATIVO	2.994.802,27	-0,35%	0,65%	-54,40%
SICREDI IRF-M	3.118.655,09	-0,62%	0,65%	-95,18%
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.053.373,01	-0,12%	0,65%	-19,23%
NTN-B - 2024	1.518.176,15	0,76%	0,65%	116,46%
NTN-B - 2024	1.777.295,93	0,76%	0,65%	116,46%
TOTAL / MÉDIA	54.470.166,59	0,12%	0,65%	18,70%

### 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1 TP	13,58%	20%	Art. 7º, I, b
BB PERFIL	0,00%	20%	Art. 7º, IV, a
BB RETORNO TOTAL	7,10%	20%	Art. 7º, IV, a
BRADESCO IRF-M1	14,94%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	17,28%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA REF DI	9,95%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IDKA 2A	17,95%	20%	Art. 7º, I, b
SANTANDER ATIVO	5,50%	20%	Art. 7º, IV, a
SICREDI IRF-M	5,73%	20%	Art. 7º, III, a
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,93%	20%	Art. 7º, IV, a
NTN-B - 2024	2,79%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,26%	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%	2562,21%
Junho	0,46%	0,67%	69,19%
Julho	0,44%	0,77%	56,86%
Agosto	0,12%	0,65%	18,70%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	3,08%	4,03%	76,44%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 3,08%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,03%, sendo assim o RPPS atingiu 76,44% 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 TP	7.394.471,81	18.647,15	0,03%
BB PERFIL	0,00	0,00	0,00%
BB RETORNO TOTAL	3.867.913,17	104.219,90	0,19%
BRADESCO IRF-M1	8.137.698,04	20.610,37	0,04%
CAIXA IRF-M1 TP	9.412.288,89	23.597,09	0,04%
CAIXA REF DI	5.418.103,58	10.383,27	0,02%
CAIXA IDKA 2A	9.777.388,65	140.006,44	0,26%
SANTANDER ATIVO	2.994.802,27	498.251,95	0,91%
SICREDI IRF-M	3.118.655,09	13.036,41	0,02%
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.053.373,01	12.640,57	0,02%
NTN-B - 2024	1.518.176,15	0,00	0,00%
NTN-B - 2024	1.777.295,93	0,00	0,00%
Carteira	#####	714.580,30	1,31%

##### 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 TP	-
BB PERFIL	0,03
BB RETORNO TOTAL	-
BRADESCO IRF-M1	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA REF DI	-
CAIXA IDKA 2A	0,04
SANTANDER ATIVO	-
SICREDI IRF-M	-
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	-
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-