

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Dezembro/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	9.049.585,67	0,39%	1,56%	25,28%
BB Perfil	3.854.178,15	0,35%	1,56%	22,44%
Caixa IRF-M1	9.583.113,92	0,40%	1,56%	25,72%
Caixa Ref. DI LP	4.194.654,78	0,35%	1,56%	22,52%
Bradesco IRF-M1	7.823.205,39	0,40%	1,56%	25,32%
NTN-B - 2024	1.529.948,59	1,37%	1,56%	87,78%
NTN-B - 2024	1.791.077,67	1,37%	1,56%	87,78%
Santander Ativo F	942.700,23	0,40%	1,56%	25,82%
Caixa IDKA 2A	8.652.788,34	1,10%	1,56%	70,39%
Itaú Alocação Din	1.025.650,24	0,34%	1,56%	22,01%
Sicredi IRF-M	2.012.270,79	0,63%	1,56%	40,41%
TOTAL / MÉDIA	50.459.173,77	0,58%	1,56%	37,16%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	17,93%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	7,64%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	18,99%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	8,31%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1	15,50%	20%	Art. 7º, I, b
NTN-B - 2024	3,03%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,55%	100%	Art. 7º, I, a
Santander Ativo F	1,87%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	17,15%	20%	Art. 7º, I, b
Itaú Alocação Din	2,03%	20%	Art. 7º, IV, a
Sicredi IRF-M	3,99%	20%	Art. 7º, III, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,58%	0,73%	79,38%
Fevereiro	0,47%	0,84%	56,01%
Março	0,42%	1,16%	36,59%
Abril	0,65%	0,98%	66,83%
Mai	0,73%	0,54%	136,12%
Junho	0,67%	0,42%	160,81%
Julho	0,70%	0,60%	117,52%
Agosto	0,43%	0,52%	82,69%
Setembro	0,74%	0,37%	201,60%
Outubro	0,71%	0,51%	140,21%
Novembro	0,25%	0,92%	26,77%
Dezembro	0,58%	1,56%	37,16%
Acumulado	7,17%	9,52%	75,26%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 7,17%, enquanto que a meta acumulada no período é de 9,52%, sendo assim o RPPS atingiu 75,26% 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	9.049.585,67	10.842,15	0,02%
BB Perfil	3.854.178,15	703,44	0,00%
Caixa IRF-M1	9.583.113,92	4.309,19	0,01%
Caixa Ref. DI LP	4.194.654,78	316.461,21	0,63%
Bradesco IRF-M1 TP	7.823.205,39	1.179,91	0,00%
NTN-B - 2024	1.529.948,59	0,00	0,00%
NTN-B - 2024	1.791.077,67	0,00	0,00%
Santander Ativo FIC FI	942.700,23	21.785,78	0,04%
Caixa IDKA 2A	8.652.788,34	201.606,12	0,40%
Itaú Alocação Dinâmica	1.025.650,24	23.642,35	0,05%
Sicredi IRF-M	2.012.270,79	10.713,95	0,02%
Carteira	50.459.173,77	468.327,29	0,93%

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	-
Caixa IRF-M1	0,02
Caixa Ref. DI LP	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,02
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
Santander Ativo FIC FI	0,02
Caixa IDKA 2A	0,06
Itaú Alocação Dinâmica	-
Sicredi IRF-M	0,01