

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Junho/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	6.991.393,44	0,26%	0,67%	38,40%
BB Perfil	3.894.210,44	0,26%	0,67%	38,88%
Bradesco IRF-M1 TP	8.112.290,04	0,26%	0,67%	38,85%
Caixa IRF-M1	10.626.501,28	0,25%	0,67%	37,49%
Caixa Ref. DI LP	5.396.851,23	0,24%	0,67%	36,31%
Caixa IDKA 2A	9.413.367,56	1,18%	0,67%	175,82%
Santander Ativo FIC F	2.989.421,07	0,34%	0,67%	50,41%
Sicredi IRF-M	2.109.955,98	0,96%	0,67%	143,31%
Itaú Alocação Dinâm	1.048.903,76	0,44%	0,67%	65,20%
NTN-B - 2024	1.538.687,87	0,47%	0,67%	70,01%
NTN-B - 2024	1.801.308,55	0,47%	0,67%	70,01%
TOTAL / MÉDIA	53.922.891,22	0,46%	0,67%	69,19%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	12,97%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	7,22%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	15,04%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	19,71%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	10,01%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	17,46%	20%	Art. 7º, I, b
Santander Ativo FIC F	5,54%	20%	Art. 7º, IV, a
Sicredi IRF-M	3,91%	20%	Art. 7º, III, a
Itaú Alocação Dinâm	1,95%	20%	Art. 7º, IV, a
NTN-B - 2024	2,85%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,34%	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			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,51%	2,57%	97,53%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,51%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,57%, sendo assim o RPPS atingiu 97,53% 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	6.991.393,44	25.889,69	0,05%
BB Perfil	3.894.210,44	4.334,18	0,01%
Bradesco IRF-M1 TP	8.112.290,04	29.800,50	0,06%
Caixa IRF-M1	10.626.501,28	39.009,19	0,07%
Caixa Ref. DI LP	5.396.851,23	11.449,14	0,02%
Caixa IDKA 2A	9.413.367,56	272.760,55	0,51%
Santander Ativo FIC FI	2.989.421,07	1.040.596,89	1,93%
Sicredi IRF-M	2.109.955,98	16.436,03	0,03%
Itaú Alocação Dinâmica	1.048.903,76	12.544,21	0,02%
NTN-B - 2024	1.538.687,87	100.441,52	0,19%
NTN-B - 2024	1.801.308,55	117.584,72	0,22%
Carteira	53.922.891,22	1.488.932,06	2,76%

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	0,06
BB Perfil	0,08
Bradesco IRF-M1 TP	0,07
Caixa IRF-M1	0,07
Caixa Ref. DI LP	0,06
Caixa IDKA 2A	0,07
Santander Ativo FIC FI	0,05
Sicredi IRF-M	0,08
Itaú Alocação Dinâmica	0,04
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-