

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Setembro/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1 TP	7.397.633,09	0,04%	0,41%	10,49%
BB RETORNO TOTAL	3.833.941,20	-0,88%	0,41%	-215,58%
BRADESCO IRF-M1	8.139.830,69	0,03%	0,41%	6,43%
CAIXA IRF-M1 TP	9.424.838,23	0,13%	0,41%	32,73%
CAIXA REF DI	5.417.960,67	0,00%	0,41%	-0,65%
CAIXA IDKA 2A	9.780.979,37	0,04%	0,41%	9,01%
SANTANDER ATIVO	2.988.060,47	-0,23%	0,41%	-55,26%
SICREDI IRF-M	3.085.572,32	-1,06%	0,41%	-260,38%
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.050.958,16	-0,23%	0,41%	-56,27%
NTN-B - 2024	1.531.191,34	0,86%	0,41%	210,42%
NTN-B - 2024	1.792.532,53	0,86%	0,41%	210,42%
TOTAL / MÉDIA	54.443.498,07	-0,05%	0,41%	-12,02%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1 TP	13,59%	20%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	7,04%	20%	Art. 7º, IV, a
BRADESCO IRF-M1	14,95%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	17,31%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA REF DI	9,95%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IDKA 2A	17,97%	20%	Art. 7º, I, b
SANTANDER ATIVO	5,49%	20%	Art. 7º, IV, a
SICREDI IRF-M	5,67%	20%	Art. 7º, III, a
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,93%	20%	Art. 7º, IV, a
NTN-B - 2024	2,81%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,29%	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	0,46%	0,67%	69,19%
Julho	0,44%	0,77%	56,86%
Agosto	0,12%	0,65%	18,70%
Setembro	-0,05%	0,41%	-12,02%
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	3,03%	4,45%	68,03%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 3,03%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,45%, sendo assim o RPPS atingiu 68,03% 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	7.397.633,09	10.257,55	0,02%
BB RETORNO TOTAL	3.833.941,20	68.068,34	0,13%
BRADESCO IRF-M1	8.139.830,69	11.293,49	0,02%
CAIXA IRF-M1 TP	9.424.838,23	12.439,18	0,02%
CAIXA REF DI	5.417.960,67	3.754,82	0,01%
CAIXA IDKA 2A	9.780.979,37	99.204,78	0,18%
SANTANDER ATIVO	2.988.060,47	#####	0,81%
SICREDI IRF-M	3.085.572,32	7.618,12	0,01%
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.050.958,16	4.848,76	0,01%
NTN-B - 2024	1.531.191,34	32.641,07	0,06%
NTN-B - 2024	1.792.532,53	38.212,19	0,07%
Carteira	54.443.498,07	#####	1,15%

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 RETORNO TOTAL	-
BRADESCO IRF-M1	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA REF DI	-
CAIXA IDKA 2A	-
SANTANDER ATIVO	-
SICREDI IRF-M	-
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	-
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-