

## 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Maio/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1 TP	8.209.634,55	0,92%	0,88%	104,81%
BB IMA-B 5+	1.030.367,43	1,11%	0,88%	126,18%
BB RETORNO TOTAL	5.386.135,05	0,93%	0,88%	105,71%
BRADESCO PREMIUM	1.090.760,74	1,10%	0,88%	124,61%
BRADESCO IMA-B TP	0,00	-0,02%	0,88%	-2,73%
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.859.320,60	0,94%	0,88%	106,42%
CAIXA IRF-M1 TP	9.742.976,68	0,93%	0,88%	105,54%
CAIXA REF DI	9.576.639,88	1,08%	0,88%	122,42%
CAIXA IDKA IPCA 2A	#####	0,83%	0,88%	94,15%
SANTANDER ATIVO	3.219.100,08	0,82%	0,88%	93,18%
SICREDI LIQUIDEZ	3.100.901,57	1,05%	0,88%	119,67%
SICREDI IRF-M 1	342.432,89	0,97%	0,88%	110,13%
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.151.915,88	0,99%	0,88%	112,39%
NTN-B - 2024	1.843.125,23	1,43%	0,88%	162,82%
NTN-B - 2024	2.157.706,79	1,43%	0,88%	162,82%
CAIXA AÇÕES MULT.	309.180,05	1,55%	0,88%	176,75%
CAIXA BDR NÍVEL I	47.265,11	-4,44%	0,88%	-504,59%
TOTAL / MÉDIA	#####	0,97%	0,88%	109,95%

## 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1 TP	12,04%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	1,51%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	7,90%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO PREMIUM	1,60%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO IMA-B TP	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
BRADESCO IRF-M 1 TP	12,99%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	14,29%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA REF DI	14,04%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IDKA IPCA 2A	17,77%	100%	Art. 7º, I, b
SANTANDER ATIVO	4,72%	20%	Art. 7º, III, a
SICREDI LIQUIDEZ	4,55%	20%	Art. 7º, III, a
SICREDI IRF-M 1	0,50%	20%	Art. 7º, III, a
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,69%	20%	Art. 7º, III, a
NTN-B - 2024	2,70%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,16%	100%	Art. 7º, I, a
CAIXA AÇÕES MULT.	0,45%	20%	Art. 8º, I
CAIXA BDR NÍVEL I	0,07%	10%	Art. 9º-A, III

## 3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,53%	0,95%	55,36%
Fevereiro	0,80%	1,42%	56,26%
Março	1,30%	2,03%	63,68%
Abril	0,84%	1,47%	57,10%
Maio	0,97%	0,88%	109,95%
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	4,51%	6,94%	64,95%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 4,51%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,94%, sendo assim o RPPS atingiu 64,95% 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	8.209.634,55	23.575,30	0,03%
BB IMA-B 5+	1.030.367,43	36.125,94	0,05%
BB RETORNO TOTAL	5.386.135,05	42.272,07	0,06%
BRADESCO PREMIUM	1.090.760,74	415,70	0,00%
BRADESCO IMA-B TP	0,00	0,00	0,00%
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.859.320,60	25.318,33	0,04%
CAIXA IRF-M1 TP	9.742.976,68	27.851,42	0,04%
CAIXA REF DI	9.576.639,88	4.262,76	0,01%
CAIXA IDKA IPCA 2A	12.119.823,14	149.121,47	0,22%
SANTANDER ATIVO	3.219.100,08	12.945,92	0,02%
SICREDI LIQUIDEZ	3.100.901,57	1.063,34	0,00%
SICREDI IRF-M 1	342.432,89	809,20	0,00%
Carteira	68.187.285,67	297.164,47	0,44%

#### 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 IMA-B 5+	0,00
BB RETORNO TOTAL	-
BRADESCO PREMIUM	0,05
BRADESCO IMA-B TP	0,00
BRADESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA REF DI	0,02
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
SANTANDER ATIVO	-
SICREDI LIQUIDEZ	0,02
SICREDI IRF-M 1	-
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	-
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
CAIXA AÇÕES MULT.	-
CAIXA BDR NÍVEL I	-