

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Abril/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1 TP	8.134.665,96	0,70%	1,47%	47,54%
BB IMA-B 5+	1.019.060,20	0,04%	1,47%	2,96%
BB RETORNO TOTAL	5.336.530,48	0,62%	1,47%	41,80%
BRADESCO PREMIUM	1.078.938,40	0,86%	1,47%	58,73%
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.660.521,12	0,68%	1,47%	46,16%
BRADESCO IMA-B TP	116.695,64	0,84%	1,47%	56,91%
CAIXA IRF-M1 TP	9.653.385,01	0,72%	1,47%	49,16%
CAIXA REF DI	9.474.647,19	0,80%	1,47%	54,37%
CAIXA IDKA IPCA 2A	11.513.415,91	1,36%	1,47%	92,57%
SANTANDER ATIVO	3.192.937,64	0,77%	1,47%	52,26%
SICREDI LIQUIDEZ	3.068.610,65	0,75%	1,47%	50,74%
SICREDI IRF-M 1	339.148,62	0,66%	1,47%	44,89%
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.140.642,99	0,78%	1,47%	52,74%
NTN-B - 2024	1.817.109,70	1,87%	1,47%	126,79%
NTN-B - 2024	2.127.250,97	1,87%	1,47%	126,79%
CAIXA AÇÕES MULT.	304.448,17	-7,78%	1,47%	-528,48%
CAIXA BDR NÍVEL I	49.459,63	-6,82%	1,47%	-463,38%
TOTAL / MÉDIA	67.027.468,28	0,84%	1,47%	57,10%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1 TP	12,14%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	1,52%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	7,96%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO PREMIUM	1,61%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO IRF-M 1 TP	12,92%	100%	Art. 7º, I, b
BRADESCO IMA-B TP	0,17%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	14,40%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA REF DI	14,14%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IDKA IPCA 2A	17,18%	100%	Art. 7º, I, b
SANTANDER ATIVO	4,76%	20%	Art. 7º, III, a
SICREDI LIQUIDEZ	4,58%	20%	Art. 7º, III, a
SICREDI IRF-M 1	0,51%	20%	Art. 7º, III, a
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,70%	20%	Art. 7º, III, a
NTN-B - 2024	2,71%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,17%	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			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	3,50%	6,00%	58,37%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 3,5%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6%, sendo assim o RPPS atingiu 58,37% 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	8.134.665,96	24.127,22	0,04%
BB IMA-B 5+	1.019.060,20	35.294,49	0,05%
BB RETORNO TOTAL	5.336.530,48	41.119,81	0,06%
BRADESCO PREMIUM	1.078.938,40	389,60	0,00%
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.660.521,12	25.496,75	0,04%
BRADESCO IMA-B TP	116.695,64	2.505,65	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	9.653.385,01	28.380,40	0,04%
CAIXA REF DI	9.474.647,19	4.435,42	0,01%
CAIXA IDKA IPCA 2A	11.513.415,91	137.953,19	0,21%
SANTANDER ATIVO	3.192.937,64	14.818,94	0,02%
SICREDI LIQUIDEZ	3.068.610,65	930,77	0,00%
SICREDI IRF-M 1	339.148,62	806,62	0,00%
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.140.642,99	3.345,68	0,00%
NTN-B - 2024	1.817.109,70	0,00	0,00%
NTN-B - 2024	2.127.250,97	0,00	0,00%
CAIXA AÇÕES MULT.	304.448,17	27.884,13	0,04%
CAIXA BDR NÍVEL I	49.459,63	5.481,32	0,01%
Carteira	67.027.468,28	292.337,63	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+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BRADESCO PREMIUM	0,05
BRADESCO IRF-M 1 TP	-
BRADESCO IMA-B TP	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA REF DI	-
CAIXA IDKA IPCA 2A	0,01
SANTANDER ATIVO	-
SICREDI LIQUIDEZ	-
SICREDI IRF-M 1	-
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	-
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
CAIXA AÇÕES MULT.	-
CAIXA BDR NÍVEL I	-