

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Agosto/ 2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.417.560,78	0,01%	0,05%	12,45%
BB IPCA IV	0,00	0,59%	0,05%	1206,14%
BB IDKA 2A	11.279.247,51	-0,04%	0,05%	-90,71%
BB FLUXO	1.455.781,63	0,79%	0,05%	1600,49%
BB PERFIL	163.763,72	1,18%	0,05%	2408,96%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.960.670,61	1,21%	0,05%	2453,73%
BB IRF-M1 TP	4.164.688,09	1,20%	0,05%	2451,63%
BB FLUXO	323.898,36	1,05%	0,05%	2225,68%
BB XI TP	440.343,50	1,19%	0,05%	2418,93%
BB FLUXO	8.712.728,19	1,10%	0,05%	2230,39%
BB PERFIL	4.002.075,40	0,05%	0,05%	105,63%
BB FLUXO	529.357,58	0,15%	0,05%	306,26%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	635.531,57	1,16%	0,05%	2353,92%
CAIXA RIO BRAVO	344.550,00	10,25%	0,05%	20874,83%
CAIXA DIVIDENDOS	666.687,33	3,55%	0,05%	7236,32%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.002.169,36	1,47%	0,05%	2997,91%
CAIXA IMA-B	2.135.497,19	1,20%	0,05%	2435,19%
CAIXA MATRIZ	1.463.800,88	1,20%	0,05%	2442,24%
CAIXA TP	2.736.349,47	1,17%	0,05%	2390,50%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.734.449,46	1,18%	0,05%	2393,03%
CAIXA IMA-B 5	5.402.494,12	0,05%	0,05%	110,37%
DAYCOVAL IMA-B 5	201.372,54	0,10%	0,05%	212,62%
PREMIUM FIDC	87.231,81	-0,69%	0,05%	-1409,42%
TOTAL / MÉDIA	59.860.249,10	0,83%	0,05%	1698,88%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	4,04%	100%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	18,84%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	2,43%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,27%	20%	Art. 7º, III, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	8,29%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	6,96%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,54%	20%	Art. 7º, III, a
BB XI TP	0,74%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	14,56%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	6,69%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	0,88%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO FEDERAL EXTRA	1,06%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,58%	5%	Art. 11º
CAIXA DIVIDENDOS	1,11%	20%	Art. 8º, I
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	5,02%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,57%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	2,45%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	4,57%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA NOVO IMA-B LP	7,91%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	9,03%	100%	Art. 7º, I, b
DAYCOVAL IMA-B 5	0,34%	100%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,15%	5%	7º, V, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,27%	0,95%	28,23%
Fevereiro	0,79%	1,42%	55,24%
Março	1,89%	2,04%	92,64%
Abril	0,93%	1,47%	62,79%
Maio	0,66%	0,88%	74,42%
Junho	0,33%	1,08%	30,77%
Julho	0,31%	-0,27%	-
Agosto	0,83%	0,05%	1698,88%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	6,16%	7,87%	78,20%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 6,16%, enquanto que a meta acumulada no período é de 7,87%, sendo assim o RPPS atingiu 78,2% 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 IMA-B 5	2.417.560,78	28.339,46	0,05%
BB IPCA IV	0,00	0,00	0,00%
BB IDKA 2A	11.279.247,51	147.079,32	0,25%
BB FLUXO	1.455.781,63	312,12	0,00%
BB PERFIL	163.763,72	44,14	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.960.670,61	50.062,49	0,08%
BB IRF-M1 TP	4.164.688,09	7.821,01	0,01%
BB FLUXO	323.898,36	69,44	0,00%
BB XI TP	440.343,50	3.683,77	0,01%
BB FLUXO	8.712.728,19	1.868,00	0,00%
BB PERFIL	4.002.075,40	1.078,61	0,00%
BB FLUXO	529.357,58	113,49	0,00%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	635.531,57	216,33	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	344.550,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	666.687,33	49.034,98	0,08%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.002.169,36	32.133,05	0,05%
CAIXA IMA-B	2.135.497,19	51.921,17	0,09%
CAIXA MATRIZ	1.463.800,88	504,46	0,00%
CAIXA TP	2.736.349,47	1.161,83	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.734.449,46	117.025,62	0,20%
CAIXA IMA-B 5	5.402.494,12	62.526,27	0,10%
DAYCOVAL IMA-B 5	201.372,54	2.359,01	0,00%
PREMIUM FIDC	87.231,81	0,00	0,00%
Carteira	59.860.249,10	483.243,18	0,81%

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 IMA-B 5	0,01
BB IPCA IV	-
BB IDKA 2A	0,01
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,00
BB ALOCAÇÃO ATIVA	0,00
BB IRF-M1 TP	0,00
BB FLUXO	-
BB XI TP	0,01
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,00
BB FLUXO	-
BRADESCO FEDERAL EXTRA	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,01
CAIXA IMA-B	0,00
CAIXA MATRIZ	-
CAIXA TP	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	0,00
CAIXA IMA-B 5	0,01
DAYCOVAL IMA-B 5	0,01
PREMIUM FIDC	-