

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Outubro/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.473.121,18	1,89%	1,00%	188,42%
BB IDKA 2A	11.549.225,81	1,85%	1,00%	184,86%
BB FLUXO	331.748,95	0,75%	1,00%	75,18%
BB PERFIL	167.273,34	1,04%	1,00%	103,60%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	5.072.999,77	1,01%	1,00%	101,09%
BB IRF-M1 TP	3.945.808,56	0,98%	1,00%	98,08%
BB FLUXO	304.530,50	0,93%	1,00%	93,04%
BB XI TP	449.419,35	1,00%	1,00%	100,08%
BB IRF-M1 TP	965.190,86	0,34%	1,00%	33,99%
BB FLUXO	8.882.975,21	0,95%	1,00%	94,74%
BB PERFIL	5.063.882,21	1,04%	1,00%	103,60%
BB FLUXO	20.690,37	0,25%	1,00%	24,75%
BRABESCO FEDERAL EXTRA	648.668,47	1,01%	1,00%	100,46%
CAIXA RIO BRAVO	346.500,00	-0,11%	1,00%	-11,41%
CAIXA DIVIDENDOS	706.347,29	6,04%	1,00%	602,60%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.069.407,88	0,99%	1,00%	98,30%
CAIXA IMA-B	1.659.356,22	1,01%	1,00%	100,75%
CAIXA MATRIZ	1.495.264,13	1,02%	1,00%	102,02%
CAIXA TP	2.794.279,65	1,01%	1,00%	101,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.859.223,44	1,10%	1,00%	109,40%
CAIXA IMA-B 5	3.593.691,74	1,26%	1,00%	125,18%
DAYCOVAL IMA-B 5	205.886,48	1,77%	1,00%	176,93%
PREMIUM FIDC	86.467,25	-0,42%	1,00%	-42,00%
TOTAL / MÉDIA	58.691.958,66	1,29%	1,00%	128,49%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	4,21%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	19,68%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,57%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,29%	20%	Art. 7º, III, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	8,64%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	6,72%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,52%	20%	Art. 7º, III, a
BB XI TP	0,77%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	1,64%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	15,13%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	8,63%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	0,04%	20%	Art. 7º, III, a
BRABESCO FEDERAL EXTRA	1,11%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,59%	5%	Art. 11º
CAIXA DIVIDENDOS	1,20%	20%	Art. 8º, I
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	5,23%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	2,83%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	2,55%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	4,76%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA NOVO IMA-B LP	8,28%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	6,12%	100%	Art. 7º, I, b
DAYCOVAL IMA-B 5	0,35%	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	0,91%	0,12%	762,66%
Outubro	1,29%	1,00%	128,49%
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	8,50%	9,08%	93,61%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 8,5%, enquanto que a meta acumulada no período é de 9,08%, sendo assim o RPPS atingiu 93,61% 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	2.473.121,18	29.324,91	0,05%
BB IDKA 2A	11.549.225,81	152.555,13	0,26%
BB FLUXO	331.748,95	34,49	0,00%
BB PERFIL	167.273,34	25,59	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	5.072.999,77	50.634,62	0,09%
BB IRF-M1 TP	3.945.808,56	6.225,06	0,01%
BB FLUXO	304.530,50	31,66	0,00%
BB XI TP	449.419,35	2.681,20	0,00%
BB IRF-M1 TP	965.190,86	1.522,72	0,00%
BB FLUXO	8.882.975,21	923,63	0,00%
BB PERFIL	5.063.882,21	774,74	0,00%
BB FLUXO	20.690,37	2,15	0,00%
BRABESCO FEDERAL EXTRA	648.668,47	79,43	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	346.500,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	706.347,29	64.286,89	0,11%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.069.407,88	27.931,98	0,05%
CAIXA IMA-B	1.659.356,22	40.718,78	0,07%
CAIXA MATRIZ	1.495.264,13	361,38	0,00%
CAIXA TP	2.794.279,65	606,90	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.859.223,44	121.313,74	0,21%
CAIXA IMA-B 5	3.593.691,74	42.160,89	0,07%
DAYCOVAL IMA-B 5	205.886,48	2.410,53	0,00%
PREMIUM FIDC	86.467,25	0,00	0,00%
Carteira	58.691.958,66	472.912,11	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	0,02
BB IDKA 2A	0,02
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,06
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB XI TP	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,06
BB FLUXO	-
BRABESCO FEDERAL EXTRA	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-
CAIXA IMA-B	0,00
CAIXA MATRIZ	-
CAIXA TP	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	0,02
DAYCOVAL IMA-B 5	0,02
PREMIUM FIDC	-