

## 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Julho/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.417.412,96	0,00%	-0,27%	-
BB IPCA IV	742.499,61	0,83%	-0,27%	-
BB IDKA 2A	11.284.275,79	-0,22%	-0,27%	-
BB FLUXO	499.719,08	0,56%	-0,27%	-
BB PERFIL	161.848,55	1,04%	-0,27%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.901.591,65	0,41%	-0,27%	-
BB IRF-M1 TP	4.115.130,80	1,04%	-0,27%	-
BB FLUXO	315.191,36	0,75%	-0,27%	-
BB XI TP	435.172,74	0,82%	-0,27%	-
BB FLUXO	11.623.470,87	0,89%	-0,27%	-
BB FLUXO	451.737,20	0,11%	-0,27%	-
BRADESCO FEDERAL EXTRA	628.267,07	1,01%	-0,27%	-
CAIXA RIO BRAVO	315.000,00	0,57%	-0,27%	-
CAIXA DIVIDENDOS	643.802,91	3,36%	-0,27%	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.958.600,66	0,79%	-0,27%	-
CAIXA IRF-M1 TP	0,00	0,10%	-0,27%	-
CAIXA IMA-B	2.110.254,41	-0,92%	-0,27%	-
CAIXA MATRIZ	1.446.448,42	1,03%	-0,27%	-
CAIXA TP	2.704.590,99	1,02%	-0,27%	-
CAIXA IMA-GERAL	0,00	-0,08%	-0,27%	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.679.443,30	-0,89%	-0,27%	-
CAIXA IMA-B 5	7.088.651,44	-0,03%	-0,27%	-
DAYCOVAL IMA-B 5	201.162,44	-0,01%	-0,27%	-
PREMIUM FIDC	87.839,95	-0,38%	-0,27%	-
TOTAL / MÉDIA	59.812.112,20	0,31%	-0,27%	-

Em virtude da deflação do IPCA no mês de julho ser maior que o Juros Real da Meta atualizada, não será apresetado a coluna % da meta, devido a distorção da logica.

## 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	4,04%	100%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,24%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	18,87%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,84%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,27%	20%	Art. 7º, III, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	8,19%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	6,88%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,53%	20%	Art. 7º, III, a
BB XI TP	0,73%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	19,43%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	0,76%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO FEDERAL EXTRA	1,05%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,53%	5%	Art. 11º
CAIXA DIVIDENDOS	1,08%	20%	Art. 8º, I
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	4,95%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,53%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	2,42%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	4,52%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-GERAL	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA NOVO IMA-B LP	7,82%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	11,85%	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%
Mai	0,66%	0,88%	74,42%
Junho	0,33%	1,08%	30,77%
Julho	0,31%	-0,27%	-
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	5,28%	7,82%	67,50%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 5,28%, enquanto que a meta acumulada no período é de 7,82%, sendo assim o RPPS atingiu 67,5% da meta atuarial.

Em virtude da deflação do IPCA no mês de julho ser maior que o Juros Real da Meta atualizada, não será apresetado a coluna % da meta, devido a distorção da logica.

## 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	2.417.412,96	29.632,57	0,05%
BB IPCA IV	742.499,61	7.002,92	0,01%
BB IDKA 2A	11.284.275,79	152.213,24	0,25%
BB FLUXO	499.719,08	122,28	0,00%
BB PERFIL	161.848,55	52,40	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.901.591,65	52.605,70	0,09%
BB IRF-M1 TP	4.115.130,80	9.462,55	0,02%
BB FLUXO	315.191,36	77,13	0,00%
BB XI TP	435.172,74	4.103,49	0,01%
BB FLUXO	11.623.470,87	2.844,28	0,00%
BB FLUXO	451.737,20	110,54	0,00%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	628.267,07	221,91	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	315.000,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	643.802,91	51.071,17	0,09%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.958.600,66	30.754,67	0,05%
CAIXA IRF-M1 TP	0,00	0,00	0,00%
CAIXA IMA-B	2.110.254,41	50.151,94	0,08%
CAIXA MATRIZ	1.446.448,42	546,85	0,00%
CAIXA TP	2.704.590,99	1.248,51	0,00%
CAIXA IMA-GERAL	0,00	0,00	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.679.443,30	112.730,78	0,19%
CAIXA IMA-B 5	7.088.651,44	85.983,68	0,14%
DAYCOVAL IMA-B 5	201.162,44	2.473,54	0,00%
PREMIUM FIDC	87.839,95	0,00	0,00%
Carteira	59.812.112,20	515.771,49	0,86%

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