

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Abril/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.269.170,50	0,65%	0,80%	81,90%
BB IPCA	1.704.729,15	0,97%	0,80%	121,59%
BB IMA-B 5+	1.400.219,34	0,46%	0,80%	57,75%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.484.000,13	0,62%	0,80%	77,85%
BB TECNOLOGIA	400.780,66	5,67%	0,80%	709,86%
BB ENERGIA	461.330,21	-1,75%	0,80%	-218,60%
BB SMALL CAPS	448.212,25	4,81%	0,80%	602,74%
BB RETORNO AÇÕES	498.613,19	7,96%	0,80%	996,99%
BB CONSUMO	447.412,20	0,95%	0,80%	119,38%
BB SETOR FINANCEIRO	260.297,55	0,69%	0,80%	86,39%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	308.963,01	-2,13%	0,80%	-266,81%
CAIXA IRF-M	3.695.005,21	0,86%	0,80%	107,47%
CAIXA IRF-M1 TP	501.183,68	0,24%	0,80%	29,66%
CAIXA IMA-B 5+	3.318.970,48	0,45%	0,80%	56,38%
SICREDI IRF-M LP	1.479.358,14	0,69%	0,80%	86,43%
TOTAL / MÉDIA	19.678.245,70	0,93%	0,80%	116,04%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	11,53%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA	8,66%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	7,12%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	12,62%	20%	Art. 7º, I, b
BB TECNOLOGIA	2,04%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	2,34%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAPS	2,28%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO AÇÕES	2,53%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	2,27%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	1,32%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,57%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	18,78%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	2,55%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	16,87%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	7,52%	20%	Art. 7º, III, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-1,28%	0,74%	-174,08%
Fevereiro	-1,88%	1,35%	-138,88%
Março	0,04%	1,42%	3,15%
Abril	0,93%	0,80%	116,04%
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-2,20%	4,38%	-50,17%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -2,2%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,38%, sendo assim o RPPS atingiu -50,17% 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	2.269.170,50	57.094,93	0,29%
BB IPCA	1.704.729,15	22.857,92	0,12%
BB IMA-B 5+	1.400.219,34	53.668,82	0,27%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.484.000,13	33.107,17	0,17%
BB TECNOLOGIA	400.780,66	34.994,88	0,18%
BB ENERGIA	461.330,21	45.585,48	0,23%
BB SMALL CAPS	448.212,25	49.180,13	0,25%
BB RETORNO AÇÕES	498.613,19	48.652,49	0,25%
BB CONSUMO	447.412,20	48.535,43	0,25%
BB SETOR FINANCEIRO	260.297,55	31.396,22	0,16%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	308.963,01	47.443,64	0,24%
CAIXA IRF-M	3.695.005,21	53.583,79	0,27%
CAIXA IRF-M1 TP	501.183,68	770,83	0,00%
CAIXA IMA-B 5+	3.318.970,48	127.861,02	0,65%
SICREDI IRF-M LP	1.479.358,14	23.603,41	0,12%
Carteira	19.678.245,70	519.343,96	2,64%

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	0,00
BB IPCA	0,01
BB IMA-B 5+	0,00
BB ALOCAÇÃO ATIVA	0,01
BB TECNOLOGIA	-
BB ENERGIA	-
BB SMALL CAPS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB CONSUMO	-
BB SETOR FINANCEIRO	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	-
CAIXA IRF-M	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	0,01
CAIXA IMA-B 5+	0,00
SICREDI IRF-M LP	0,01