

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Agosto/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.218.787,97	-1,11%	1,36%	-81,86%
BB IPCA	1.676.362,65	0,29%	1,36%	21,65%
BB IMA-B 5+	1.810.656,98	-2,24%	1,36%	-164,69%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.481.300,00	-0,45%	1,36%	-32,98%
BB AÇÕES BOLSA	671.355,42	2,84%	1,36%	208,50%
BB TECNOLOGIA	408.188,31	-1,54%	1,36%	-113,39%
BB ENERGIA	456.844,52	2,02%	1,36%	148,75%
BB SMALL CAPS	433.263,29	-4,90%	1,36%	-360,31%
BB RETORNO AÇÕES	473.532,29	-2,87%	1,36%	-210,94%
BB CONSUMO	433.002,34	-4,09%	1,36%	-300,78%
BB SETOR FINANCEIRO	295.408,93	-2,39%	1,36%	-175,25%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	273.969,20	-8,52%	1,36%	-625,77%
CAIXA IRF-M	2.778.526,90	-0,49%	1,36%	-35,74%
CAIXA IRF-M1 TP	1.432.988,99	0,34%	1,36%	25,26%
CAIXA IMA-B 5+	3.285.886,21	-2,36%	1,36%	-173,16%
SICREDI IRF-M LP	1.466.571,83	-0,72%	1,36%	-52,80%
TOTAL / MÉDIA	20.596.645,83	-1,14%	1,36%	-83,92%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	10,77%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA	8,14%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	8,79%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	12,05%	20%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	3,26%	20%	Art. 8º, II, a
BB TECNOLOGIA	1,98%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	2,22%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAPS	2,10%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO AÇÕES	2,30%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	2,10%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	1,43%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,33%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	13,49%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	6,96%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	15,95%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	7,12%	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%
Maior	1,30%	1,32%	98,30%
Junho	0,16%	1,02%	15,98%
Julho	-0,92%	1,45%	-63,05%
Agosto	-1,14%	1,36%	-83,92%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-2,80%	9,86%	-28,36%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -2,8%, enquanto que a meta acumulada no período é de 9,86%, sendo assim o RPPS atingiu -28,36% 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	2.218.787,97	56.982,36	0,28%
BB IPCA	1.676.362,65	18.876,22	0,09%
BB IMA-B 5+	1.810.656,98	70.928,48	0,34%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.481.300,00	30.051,62	0,15%
BB AÇÕES BOLSA	671.355,42	33.406,07	0,16%
BB TECNOLOGIA	408.188,31	25.343,63	0,12%
BB ENERGIA	456.844,52	33.297,87	0,16%
BB SMALL CAPS	433.263,29	39.304,23	0,19%
BB RETORNO AÇÕES	473.532,29	34.958,30	0,17%
BB CONSUMO	433.002,34	34.598,99	0,17%
BB SETOR FINANCEIRO	295.408,93	27.539,86	0,13%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	273.969,20	32.957,21	0,16%
CAIXA IRF-M	2.778.526,90	35.527,79	0,17%
CAIXA IRF-M1 TP	1.432.988,99	2.393,13	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	3.285.886,21	129.436,83	0,63%
SICREDI IRF-M LP	1.466.571,83	19.551,56	0,09%
Carteira	20.596.645,83	489.991,54	2,38%

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