

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Junho/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.224.287,29	2,03%	0,75%	271,56%
BB IPCA TP	1.660.501,12	1,14%	0,75%	152,86%
BB IRF-M1	0,00	0,03%	0,75%	4,39%
BB IMA-B 5+	1.408.514,52	2,80%	0,75%	374,33%
BB Alocacao Ativa	3.427.350,97	0,95%	0,75%	126,83%
Caixa IRF-M1+	0,00	0,47%	0,75%	63,16%
Caixa IMA-B 5+	3.623.695,15	2,83%	0,75%	377,96%
Sicredi IRF-M	1.493.289,21	0,96%	0,75%	128,07%
BB Ações Tecnologia	292.734,75	7,64%	0,75%	1022,00%
BB Ações Energia	418.642,18	4,08%	0,75%	545,17%
BB Ações Small Caps	351.471,02	13,39%	0,75%	1790,07%
BB Ações Retorno Total	380.440,53	6,53%	0,75%	872,54%
BB Ações Consumo	415.715,36	9,92%	0,75%	1325,96%
BB Ações Set Financeiro	136.375,48	10,97%	0,75%	1466,37%
BB Ações Construção Civil	322.945,15	18,35%	0,75%	2452,89%
Caixa IRF-M	447.703,27	0,58%	0,75%	77,13%
Caixa IRF-M1	1.252.126,90	0,14%	0,75%	18,69%
TOTAL / MÉDIA	17.855.792,90	2,63%	0,75%	351,83%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	12,46%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA TP	9,30%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	0,00%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	7,89%	20%	Art. 7º, I, b
BB Alocacao Ativa	19,19%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	0,00%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B 5+	20,29%	20%	Art. 7º, I, b
Sicredi IRF-M	8,36%	20%	Art. 7º, III, a
BB Ações Tecnologia	1,64%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Energia	2,34%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Small Caps	1,97%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Retorno Total	2,13%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Consumo	2,33%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Set Financeiro	0,76%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Construção Civil	1,81%	20%	Art. 8º, II, a
Caixa IRF-M	2,51%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	7,01%	20%	Art. 7º, I, b

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,33%	0,70%	-46,59%
Fevereiro	-0,84%	0,74%	-113,27%
Março	-8,32%	0,56%	-1493,85%
Abril	2,13%	0,18%	1215,91%
Maio	2,00%		1655,00%
Junho	2,63%	0,75%	351,83%
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-3,13%	2,96%	-105,53%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -3,13%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,96%, sendo assim o RPPS atingiu -105,53% 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	2.224.287,29	199.576,26	1,12%
BB IPCA TP	1.660.501,12	71.929,90	0,40%
BB IRF-M1	0,00	0,00	0,00%
BB IMA-B 5+	1.408.514,52	194.691,08	1,09%
BB Alocacao Ativa	3.427.350,97	150.814,53	0,84%
Caixa IRF-M1+	0,00	0,00	0,00%
Caixa IMA-B 5+	3.623.695,15	503.488,17	2,82%
Sicredi IRF-M	1.493.289,21	11.632,35	0,07%
BB Ações Tecnologia	292.734,75	72.774,09	0,41%
BB Ações Energia	418.642,18	107.952,47	0,60%
BB Ações Small Caps	351.471,02	117.917,16	0,66%
BB Ações Retorno Total	380.440,53	106.223,99	0,59%
BB Ações Consumo	415.715,36	134.377,38	0,75%
BB Ações Set Financeiro	136.375,48	43.885,57	0,25%
BB Ações Construção Civil	322.945,15	136.413,05	0,76%
Caixa IRF-M	447.703,27	19.069,62	0,11%
Caixa IRF-M1	1.252.126,90	4.596,48	0,03%
Carteira	17.855.792,90	1.708.693,35	9,57%

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	0,04
BB IPCA TP	0,04
BB IRF-M1	0,06
BB IMA-B 5+	0,03
BB Alocacao Ativa	0,04
Caixa IRF-M1+	0,03
Caixa IMA-B 5+	0,03
Sicredi IRF-M	0,08
BB Ações Tecnologia	-
BB Ações Energia	-
BB Ações Small Caps	0,03
BB Ações Retorno Total	-
BB Ações Consumo	-
BB Ações Set Financeiro	0,02
BB Ações Construção Civil	0,03
Caixa IRF-M	0,03
Caixa IRF-M1	0,07