

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Abril/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.146.868,44	1,22%	0,18%	696,42%
BB IPCA TP	1.642.615,26	0,82%	0,18%	468,07%
BB IRF-M1	513.500,33	0,41%	0,18%	235,27%
BB IMA-B 5+	1.356.616,01	1,91%	0,18%	1092,08%
BB Alocacao Ativa	3.359.126,86	0,91%	0,18%	520,75%
Caixa IRF-M1+	0,00	0,10%	0,18%	54,69%
Caixa IMA-B 5+	3.489.167,42	1,95%	0,18%	1110,02%
Sicredi IRF-M	1.458.874,29	1,10%	0,18%	627,90%
BB Ações Tecnologia	275.207,96	16,56%	0,18%	9451,65%
BB Ações Energia	371.850,57	6,47%	0,18%	3689,28%
BB Ações Small Caps	295.307,54	9,92%	0,18%	5659,67%
BB Ações Retorno Total	334.102,40	8,83%	0,18%	5037,89%
BB Ações Consumo	350.998,03	17,71%	0,18%	10104,83%
BB Ações Set Financeiro	90.988,14	2,50%	0,18%	1425,91%
BB Ações Construção Civil	270.400,58	7,52%	0,18%	4288,62%
Caixa IRF-M	291.073,36	1,13%	0,18%	643,88%
TOTAL / MÉDIA	16.246.697,19	2,13%	0,18%	1215,91%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,21%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA TP	10,11%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	3,16%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	8,35%	20%	Art. 7º, I, b
BB Alocacao Ativa	20,68%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	0,00%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B 5+	21,48%	20%	Art. 7º, I, b
Sicredi IRF-M	8,98%	20%	Art. 7º, III, a
BB Ações Tecnologia	1,69%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Energia	2,29%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Small Caps	1,82%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Retorno Total	2,06%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Consumo	2,16%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Set Financeiro	0,56%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Construção Civil	1,66%	20%	Art. 8º, II, a
Caixa IRF-M	1,79%	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			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-7,45%	2,18%	-341,14%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -7,45%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,18%, sendo assim o RPPS atingiu -341,14% 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	2.146.868,44	189.658,89	1,17%
BB IPCA TP	1.642.615,26	69.939,06	0,43%
BB IRF-M1	513.500,33	1.856,45	0,01%
BB IMA-B 5+	1.356.616,01	184.108,18	1,13%
BB Alocacao Ativa	3.359.126,86	145.737,93	0,90%
Caixa IRF-M1+	0,00	0,00	0,00%
Caixa IMA-B 5+	3.489.167,42	476.363,65	2,93%
Sicredi IRF-M	1.458.874,29	70.038,75	0,43%
BB Ações Tecnologia	275.207,96	68.199,31	0,42%
BB Ações Energia	371.850,57	90.692,79	0,56%
BB Ações Small Caps	295.307,54	94.696,72	0,58%
BB Ações Retorno Total	334.102,40	92.661,84	0,57%
BB Ações Consumo	350.998,03	111.706,57	0,69%
BB Ações Set Financeiro	90.988,14	27.111,89	0,17%
BB Ações Construção Civil	270.400,58	106.244,27	0,65%
Caixa IRF-M	291.073,36	12.188,84	0,08%
Carteira	16.246.697,19	1.588.806,17	9,78%

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	-
BB IMA-B 5+	0,03
BB Alocacao Ativa	0,03
Caixa IRF-M1+	0,00
Caixa IMA-B 5+	0,03
Sicredi IRF-M	0,00
BB Ações Tecnologia	0,00
BB Ações Energia	0,03
BB Ações Small Caps	0,01
BB Ações Retorno Total	0,02
BB Ações Consumo	0,08
BB Ações Set Financeiro	0,01
BB Ações Construção Civil	0,00
Caixa IRF-M	0,00