

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Maio/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.293.104,74	1,05%	1,32%	79,86%
BB IPCA	1.675.812,63	0,88%	1,32%	66,46%
BB IMA-B 5+	1.419.170,04	1,35%	1,32%	102,47%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.495.943,54	0,48%	1,32%	36,40%
BB TECNOLOGIA	398.720,87	-0,51%	1,32%	-38,91%
BB ENERGIA	483.637,52	4,84%	1,32%	366,10%
BB SMALL CAPS	480.505,47	7,20%	1,32%	545,50%
BB RETORNO AÇÕES	511.553,50	2,60%	1,32%	196,49%
BB CONSUMO	475.947,80	6,38%	1,32%	482,89%
BB SETOR FINANCEIRO	287.897,18	6,59%	1,32%	499,32%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	330.643,20	7,02%	1,32%	531,28%
CAIXA IRF-M	2.898.456,42	0,09%	1,32%	7,07%
CAIXA IRF-M1 TP	1.553.524,44	0,15%	1,32%	11,43%
CAIXA IMA-B 5+	3.365.145,25	1,39%	1,32%	105,33%
SICREDI IRF-M LP	1.482.396,61	0,21%	1,32%	15,55%
TOTAL / MÉDIA	20.152.459,21	1,30%	1,32%	98,30%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	11,38%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA	8,32%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	7,04%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	12,39%	20%	Art. 7º, I, b
BB TECNOLOGIA	1,98%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	2,40%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAPS	2,38%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO AÇÕES	2,54%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	2,36%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	1,43%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,64%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	14,38%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	7,71%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	16,70%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	7,36%	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	1,30%	1,32%	98,30%
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,93%	5,76%	-16,09%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,93%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,76%, sendo assim o RPPS atingiu -16,09% 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	2.293.104,74	60.128,98	0,30%
BB IPCA	1.675.812,63	23.167,10	0,11%
BB IMA-B 5+	1.419.170,04	56.222,43	0,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.495.943,54	34.025,57	0,17%
BB TECNOLOGIA	398.720,87	35.669,15	0,18%
BB ENERGIA	483.637,52	48.780,20	0,24%
BB SMALL CAPS	480.505,47	54.544,78	0,27%
BB RETORNO AÇÕES	511.553,50	51.205,40	0,25%
BB CONSUMO	475.947,80	52.510,81	0,26%
BB SETOR FINANCEIRO	287.897,18	34.973,45	0,17%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	330.643,20	52.915,93	0,26%
CAIXA IRF-M	2.898.456,42	43.280,87	0,21%
CAIXA IRF-M1 TP	1.553.524,44	2.523,75	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	3.365.145,25	133.752,20	0,66%
SICREDI IRF-M LP	1.482.396,61	23.739,30	0,12%
Carteira	20.152.459,21	545.695,65	2,71%

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	0,01
BB IPCA	0,01
BB IMA-B 5+	0,01
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	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B 5+	0,01
SICREDI IRF-M LP	0,00