

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Outubro/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	4.197.263,75	1,20%	1,00%	119,69%
BB IPCA	1.783.263,82	2,24%	1,00%	223,58%
BB IMA-B 5+	3.773.218,35	0,70%	1,00%	70,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.497.801,35	1,01%	1,00%	101,09%
BB AÇÕES BOLSA	2.102.057,00	7,70%	1,00%	767,67%
BB AÇÕES AGRO	602.445,84	8,23%	1,00%	820,54%
BB TECNOLOGIA	371.314,00	3,18%	1,00%	316,78%
BB ENERGIA	467.394,13	6,60%	1,00%	657,63%
BB SMALL CAPS	558.177,45	6,75%	1,00%	672,56%
BB RETORNO AÇÕES	399.695,60	6,17%	1,00%	615,04%
BB CONSUMO	306.933,80	5,91%	1,00%	589,62%
BB SETOR FINANCEIRO	608.917,10	6,60%	1,00%	657,75%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	429.142,64	1,99%	1,00%	198,45%
CAIXA IRF-M	276.511,91	0,94%	1,00%	93,38%
CAIXA IRF-M1 TP	1.799.772,31	0,65%	1,00%	64,83%
CAIXA IMA-B 5+	3.421.335,98	0,64%	1,00%	64,01%
SICREDI IRF-M LP	1.605.830,95	0,88%	1,00%	88,06%
BI - MASSA FALIDA	205.664,33	0,15%	1,00%	14,89%
TOTAL / MÉDIA	26.406.740,31	2,13%	1,00%	211,98%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	15,89%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	6,75%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	14,29%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	13,25%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	7,96%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,28%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,41%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,77%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	2,11%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,51%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	1,16%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,31%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,63%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	1,05%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	6,82%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	12,96%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	6,08%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,78%	0%	Não enquadrado

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,51%	0,95%	-53,89%
Fevereiro	-0,23%	1,42%	-16,36%
Março	3,08%	2,04%	150,97%
Abril	-1,39%	1,47%	-94,32%
Mai	0,76%	0,88%	85,89%
Junho	-2,16%	1,08%	-199,60%
Julho	0,92%	-0,27%	-337,82%
Agosto	1,69%	0,05%	3450,13%
Setembro	0,51%	0,12%	423,38%
Outubro	2,13%	1,00%	211,98%
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	4,77%	9,08%	52,54%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 4,77%, enquanto que a meta acumulada no período é de 9,08%, sendo assim o RPPS atingiu 52,54% 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	4.197.263,75	102.717,11	0,39%
BB IPCA	1.783.263,82	13.727,71	0,05%
BB IMA-B 5+	3.773.218,35	145.619,40	0,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.497.801,35	34.912,25	0,13%
BB AÇÕES BOLSA	2.102.057,00	240.540,41	0,91%
BB AÇÕES AGRO	602.445,84	48.359,80	0,18%
BB TECNOLOGIA	371.314,00	43.625,06	0,17%
BB ENERGIA	467.394,13	41.183,79	0,16%
BB SMALL CAPS	558.177,45	73.387,15	0,28%
BB RETORNO AÇÕES	399.695,60	42.535,40	0,16%
BB CONSUMO	306.933,80	39.663,71	0,15%
BB SETOR FINANCEIRO	608.917,10	71.619,71	0,27%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	429.142,64	62.446,70	0,24%
CAIXA IRF-M	276.511,91	4.064,39	0,02%
CAIXA IRF-M1 TP	1.799.772,31	2.805,02	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	3.421.335,98	132.423,14	0,50%
SICREDI IRF-M LP	1.605.830,95	23.940,23	0,09%
BI - MASSA FALIDA	205.664,33	0,00	0,00%
Carteira	26.406.740,31	819.897,51	3,10%

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	0,04
BB IMA-B 5+	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
BB AÇÕES BOLSA	-
BB AÇÕES AGRO	-
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	-
BI - MASSA FALIDA	-