

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Julho/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.321.841,19	4,39%	0,85%	516,89%
BB IPCA TP	1.679.093,31	1,12%	0,85%	131,96%
BB IMA-B 5+	1.511.026,73	7,28%	0,85%	857,75%
BB Alocacao Ativa	3.487.938,61	1,77%	0,85%	208,34%
Caixa IMA-B 5+	3.887.927,58	7,29%	0,85%	859,37%
Sicredi IRF-M	1.513.151,22	1,33%	0,85%	156,76%
BB Ações Tecnologia	318.513,46	8,81%	0,85%	1037,84%
BB Ações Energia	450.995,70	7,73%	0,85%	910,80%
BB Ações Small Caps	387.093,69	10,14%	0,85%	1194,49%
BB Ações Retorno Total	410.233,40	7,83%	0,85%	922,93%
BB Ações Consumo	446.441,84	7,39%	0,85%	871,09%
BB Ações Set Financeiro	162.538,42	8,56%	0,85%	1008,95%
BB Ações Construção Civil	345.770,00	7,07%	0,85%	832,96%
Caixa IRF-M	1.310.965,74	1,02%	0,85%	120,45%
Caixa IRF-M1	32.312,25	0,01%	0,85%	1,74%
Caixa Prático	0,00	0,00%	0,85%	0,05%
TOTAL / MÉDIA	18.265.843,14	4,29%	0,85%	506,05%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	12,71%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA TP	9,19%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	8,27%	20%	Art. 7º, I, b
BB Alocacao Ativa	19,10%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B 5+	21,29%	20%	Art. 7º, I, b
Sicredi IRF-M	8,28%	20%	Art. 7º, III, a
BB Ações Tecnologia	1,74%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Energia	2,47%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Small Caps	2,12%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Retorno Total	2,25%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Consumo	2,44%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Set Financeiro	0,89%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Construção Civil	1,89%	20%	Art. 8º, II, a
Caixa IRF-M	7,18%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	0,18%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Prático	0,00%	20%	Art. 7º, IV, a

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%
Mai	1,74%	0,10%	1655,39%
Junho	2,63%	0,75%	351,83%
Julho	4,29%	0,85%	506,05%
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,77%	3,94%	19,62%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,77%, enquanto que a meta acumulada no período é de 3,94%, sendo assim o RPPS atingiu 19,62% 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	2.321.841,19	204.580,77	1,12%
BB IPCA TP	1.679.093,31	71.539,09	0,39%
BB IMA-B 5+	1.511.026,73	205.882,47	1,13%
BB Alocacao Ativa	3.487.938,61	151.099,11	0,83%
Caixa IMA-B 5+	3.887.927,58	531.712,67	2,91%
Sicredi IRF-M	1.513.151,22	11.668,54	0,06%
BB Ações Tecnologia	318.513,46	72.092,51	0,39%
BB Ações Energia	450.995,70	107.450,83	0,59%
BB Ações Small Caps	387.093,69	119.007,46	0,65%
BB Ações Retorno Total	410.233,40	100.782,76	0,55%
BB Ações Consumo	446.441,84	135.669,34	0,74%
BB Ações Set Financeiro	162.538,42	50.598,81	0,28%
BB Ações Construção Civil	345.770,00	140.254,91	0,77%
Caixa IRF-M	1.310.965,74	55.345,16	0,30%
Caixa IRF-M1	32.312,25	118,81	0,00%
Caixa Prático	0,00	0,00	0,00%
Carteira	18.265.843,14	1.800.537,89	9,86%

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	0,10
BB IPCA TP	0,05
BB IMA-B 5+	0,10
BB Alocacao Ativa	0,08
Caixa IMA-B 5+	0,10
Sicredi IRF-M	0,03
BB Ações Tecnologia	0,02
BB Ações Energia	0,00
BB Ações Small Caps	0,02
BB Ações Retorno Total	-
BB Ações Consumo	0,00
BB Ações Set Financeiro	-
BB Ações Construção Civil	-
Caixa IRF-M	0,05
Caixa IRF-M1	0,02
Caixa Prático	-