

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Setembro/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.244.472,03	-1,57%	1,13%	-138,67%
BB IPCA TP	1.685.079,54	-0,30%	1,13%	-26,72%
BB IMA-B 5	1.416.781,71	-2,65%	1,13%	-234,24%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.438.449,86	-0,75%	1,13%	-66,60%
CAIXA IMA-B 5+	3.194.617,19	-2,64%	1,13%	-233,92%
SICREDI IRF-M	1.483.447,53	-1,06%	1,13%	-93,89%
BB NIVEL I	328.468,23	-5,76%	1,13%	-510,15%
BB ENERGIA	402.049,84	-5,09%	1,13%	-450,17%
BB SMALL CAP	361.745,88	-5,17%	1,13%	-457,63%
BB RETORNO TOTAL	375.133,66	-5,40%	1,13%	-477,99%
BB CONSUMO	420.788,06	-4,08%	1,13%	-361,33%
BB SETOR FINANCEIRO	164.184,75	-6,52%	1,13%	-577,18%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	292.085,59	-8,07%	1,13%	-714,57%
CAIXA IRF-M	1.292.898,92	-0,61%	1,13%	-54,23%
CAIXA IRF-M1 TP	1.033.145,17	0,08%	1,13%	6,71%
TOTAL / MÉDIA	17.133.347,96	-1,98%	1,13%	-174,92%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,10%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA TP	9,84%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5	8,27%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	14,23%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	18,65%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M	8,66%	20%	Art. 7º, III, a
BB NIVEL I	1,92%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	2,35%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAP	2,11%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO TOTAL	2,19%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	2,46%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	0,96%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,70%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	7,55%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	6,03%	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%
Maior	1,74%	0,10%	1655,39%
Junho	2,63%	0,75%	351,83%
Julho	4,29%	0,85%	506,05%
Agosto	-1,72%	0,73%	-235,96%
Setembro	-1,98%	1,13%	-174,92%
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-2,91%	5,88%	-49,54%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -2,91%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,88%, sendo assim o RPPS atingiu -49,54% 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	2.244.472,03	73.887,35	0,43%
BB IPCA TP	1.685.079,54	24.739,59	0,14%
BB IMA-B 5	1.416.781,71	16.654,55	0,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.438.449,86	38.397,63	0,22%
CAIXA IMA-B 5+	3.194.617,19	167.462,74	0,98%
SICREDI IRF-M	1.483.447,53	3.662,56	0,02%
BB NIVEL I	328.468,23	31.833,85	0,19%
BB ENERGIA	402.049,84	43.837,66	0,26%
BB SMALL CAP	361.745,88	48.539,15	0,28%
BB RETORNO TOTAL	375.133,66	39.233,51	0,23%
BB CONSUMO	420.788,06	48.756,97	0,28%
BB SETOR FINANCEIRO	164.184,75	26.216,89	0,15%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	292.085,59	59.569,19	0,35%
CAIXA IRF-M	1.292.898,92	19.196,57	0,11%
CAIXA IRF-M1 TP	1.033.145,17	1.363,58	0,01%
Carteira	17.133.347,96	543.927,31	3,17%

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	-
BB IPCA TP	-
BB IMA-B 5	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
CAIXA IMA-B 5+	-
SICREDI IRF-M	-
BB NIVEL I	0,01
BB ENERGIA	0,00
BB SMALL CAP	0,01
BB RETORNO TOTAL	-
BB CONSUMO	0,02
BB SETOR FINANCEIRO	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	-
CAIXA IRF-M	-
CAIXA IRF-M1 TP	-