

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Julho/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	3.557.758,45	-0,95%	-0,27%	-
BB IPCA	1.745.157,72	0,08%	-0,27%	-
BB IMA-B 5+	3.286.999,31	-1,86%	-0,27%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.379.616,53	0,41%	-0,27%	-
BB AÇÕES BOLSA	2.195.607,41	9,29%	-0,27%	-
BB AÇÕES AGRO	538.712,45	3,28%	-0,27%	-
BB TECNOLOGIA	275.694,14	12,38%	-0,27%	-
BB ENERGIA	453.274,47	2,93%	-0,27%	-
BB SMALL CAPS	341.153,70	3,87%	-0,27%	-
BB RETORNO AÇÕES	356.310,94	4,33%	-0,27%	-
BB CONSUMO	275.579,43	9,00%	-0,27%	-
BB SETOR FINANCEIRO	320.173,80	3,45%	-0,27%	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	216.252,43	8,42%	-0,27%	-
CAIXA IRF-M	1.345.613,01	1,12%	-0,27%	-
CAIXA IRF-M1 TP	2.504.965,02	0,86%	-0,27%	-
CAIXA IMA-B 5+	3.239.834,77	-1,91%	-0,27%	-
SICREDI IRF-M LP	1.536.427,40	1,16%	-0,27%	-
BI - MASSA FALIDA	204.494,90	0,16%	-0,27%	-
TOTAL / MÉDIA	25.773.625,88	0,92%	-0,27%	-

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,80%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	6,77%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	12,75%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	13,11%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	8,52%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,09%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,07%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,76%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,32%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,38%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	1,07%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	1,24%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	0,84%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	5,22%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	9,72%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	12,57%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,96%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,79%	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%
Maió	0,76%	0,88%	85,89%
Junho	-2,16%	1,08%	-199,60%
Julho	0,92%	-0,27%	-
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,37%	7,82%	4,77%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,37%, enquanto que a meta acumulada no período é de 7,82%, sendo assim o RPPS atingiu 4,77% 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	3.557.758,45	84.388,43	0,33%
BB IPCA	1.745.157,72	19.235,03	0,07%
BB IMA-B 5+	3.286.999,31	122.679,49	0,48%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.379.616,53	36.271,30	0,14%
BB AÇÕES BOLSA	2.195.607,41	272.681,98	1,06%
BB AÇÕES AGRO	538.712,45	40.133,25	0,16%
BB TECNOLOGIA	275.694,14	38.572,72	0,15%
BB ENERGIA	453.274,47	35.890,48	0,14%
BB SMALL CAPS	341.153,70	41.833,72	0,16%
BB RETORNO AÇÕES	356.310,94	32.393,39	0,13%
BB CONSUMO	275.579,43	32.384,76	0,13%
BB SETOR FINANCEIRO	320.173,80	32.579,81	0,13%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	216.252,43	30.065,02	0,12%
CAIXA IRF-M	1.345.613,01	21.301,01	0,08%
CAIXA IRF-M1 TP	2.504.965,02	5.672,49	0,02%
CAIXA IMA-B 5+	3.239.834,77	122.053,12	0,47%
SICREDI IRF-M LP	1.536.427,40	24.941,50	0,10%
BI - MASSA FALIDA	204.494,90	0,00	0,00%
Carteira	25.773.625,88	753.418,38	2,92%

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	-
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	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B 5+	-
SICREDI IRF-M LP	0,00
BI - MASSA FALIDA	-