

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Março/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.120.983,00	-7,12%	0,56%	-1277,39%
BB IPCA TP	1.629.251,07	-1,89%	0,56%	-338,95%
BB IRF-M1	511.391,81	0,59%	0,56%	106,20%
BB IMA-B 5+	1.307.840,32	-10,89%	0,56%	-1954,16%
BB Alocacao Ativa	3.328.748,78	-2,10%	0,56%	-377,18%
Caixa IRF-M1+	1.710.323,85	0,02%	0,56%	2,77%
Caixa IMA-B 5+	3.422.589,10	-10,91%	0,56%	-1958,12%
Sicredi IRF-M	1.442.996,09	-0,49%	0,56%	-87,10%
BB Ações Tecnologia	236.101,00	-24,46%	0,56%	-4390,15%
BB Ações Energia	349.269,21	-25,38%	0,56%	-4556,05%
BB Ações Small Caps	268.660,81	-37,39%	0,56%	-6712,34%
BB Ações Retorno Total	306.998,39	-29,53%	0,56%	-5299,86%
BB Ações Consumo	298.193,04	-30,87%	0,56%	-5541,68%
BB Ações Set Financeiro	75.424,63	-30,51%	0,56%	-5475,95%
BB Ações Construção Civil	251.498,82	-41,21%	0,56%	-7397,92%
Caixa Simples LP	0,00	0,04%	0,56%	7,32%
Caixa IRF-M	287.825,60	2,79%	0,56%	501,68%
TOTAL / MÉDIA	17.548.095,52	-8,32%	0,56%	-1493,85%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	12,09%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA TP	9,28%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	2,91%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	7,45%	20%	Art. 7º, I, b
BB Alocacao Ativa	18,97%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	9,75%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B 5+	19,50%	20%	Art. 7º, I, b
Sicredi IRF-M	8,22%	20%	Art. 7º, III, a
BB Ações Tecnologia	1,35%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Energia	1,99%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Small Caps	1,53%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Retorno Total	1,75%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Consumo	1,70%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Set Financeiro	0,43%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Construção Civil	1,43%	20%	Art. 8º, II, a
Caixa Simples LP	0,00%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M	1,64%	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			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-9,38%	2,01%	-467,80%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -9,38%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,01%, sendo assim o RPPS atingiu -467,8% 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	2.120.983,00	168.262,19	0,96%
BB IPCA TP	1.629.251,07	62.757,60	0,36%
BB IRF-M1	511.391,81	1.505,60	0,01%
BB IMA-B 5+	1.307.840,32	158.052,58	0,90%
BB Alocacao Ativa	3.328.748,78	126.954,89	0,72%
Caixa IRF-M1+	1.710.323,85	92.335,84	0,53%
Caixa IMA-B 5+	3.422.589,10	416.520,29	2,37%
Sicredi IRF-M	1.442.996,09	60.118,26	0,34%
BB Ações Tecnologia	236.101,00	54.866,00	0,31%
BB Ações Energia	349.269,21	80.105,11	0,46%
BB Ações Small Caps	268.660,81	81.921,36	0,47%
BB Ações Retorno Total	306.998,39	82.265,09	0,47%
BB Ações Consumo	298.193,04	89.370,06	0,51%
BB Ações Set Financeiro	75.424,63	20.570,34	0,12%
BB Ações Construção Civil	251.498,82	91.406,33	0,52%
Caixa Simples LP	0,00	0,00	0,00%
Caixa IRF-M	287.825,60	10.362,14	0,06%
Carteira	17.548.095,52	1.464.150,76	8,34%

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 IRF-M1	0,02
BB IMA-B 5+	-
BB Alocacao Ativa	-
Caixa IRF-M1+	-
Caixa IMA-B 5+	-
Sicredi IRF-M	-
BB Ações Tecnologia	0,01
BB Ações Energia	0,01
BB Ações Small Caps	-
BB Ações Retorno Total	-
BB Ações Consumo	-
BB Ações Set Financeiro	-
BB Ações Construção Civil	-
Caixa Simples LP	-
Caixa IRF-M	-