

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Outubro/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.914.985,98	-2,72%	1,74%	-155,90%
BB IPCA	1.676.752,34	-1,10%	1,74%	-63,00%
BB IMA-B 5+	1.956.101,58	-3,98%	1,74%	-228,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.440.816,15	-1,63%	1,74%	-93,32%
BB AÇÕES BOLSA	1.294.420,09	6,90%	1,74%	395,77%
BB TECNOLOGIA	357.096,73	-5,84%	1,74%	-335,05%
BB ENERGIA	423.566,28	-5,11%	1,74%	-292,99%
BB SMALL CAPS	351.291,43	-12,78%	1,74%	-733,50%
BB RETORNO AÇÕES	399.872,16	-8,50%	1,74%	-487,56%
BB CONSUMO	366.459,95	-9,80%	1,74%	-562,16%
BB SETOR FINANCEIRO	260.487,48	-5,92%	1,74%	-339,70%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	215.250,19	-12,26%	1,74%	-703,49%
CAIXA IRF-M	1.478.782,37	-2,52%	1,74%	-144,44%
CAIXA IRF-M1 TP	2.429.016,95	-0,54%	1,74%	-30,74%
CAIXA IMA-B 5+	3.115.184,55	-3,98%	1,74%	-228,37%
SICREDI IRF-M LP	1.423.600,86	-2,60%	1,74%	-149,26%
TOTAL / MÉDIA	21.103.685,09	-2,68%	1,74%	-153,80%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,81%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA	7,95%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	9,27%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	11,57%	20%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	6,13%	20%	Art. 8º, II, a
BB TECNOLOGIA	1,69%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	2,01%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAPS	1,66%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO AÇÕES	1,89%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	1,74%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	1,23%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,02%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	7,01%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	11,51%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	14,76%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	6,75%	20%	Art. 7º, III, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-1,28%	0,74%	-174,08%
Fevereiro	-1,88%	1,35%	-138,88%
Março	0,04%	1,42%	3,15%
Abril	0,93%	0,80%	116,04%
Maior	1,30%	1,32%	98,30%
Junho	0,16%	1,02%	15,98%
Julho	-0,92%	1,45%	-63,05%
Agosto	-1,14%	1,36%	-83,92%
Setembro	-1,36%	1,65%	-82,03%
Outubro	-2,68%	1,74%	-153,80%
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-6,68%	13,62%	-49,07%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -6,68%, enquanto que a meta acumulada no período é de 13,62%, sendo assim o RPPS atingiu -49,07% 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	2.914.985,98	80.795,77	0,38%
BB IPCA	1.676.752,34	20.475,73	0,10%
BB IMA-B 5+	1.956.101,58	83.617,12	0,40%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.440.816,15	33.213,43	0,16%
BB AÇÕES BOLSA	1.294.420,09	69.494,27	0,33%
BB TECNOLOGIA	357.096,73	30.491,91	0,14%
BB ENERGIA	423.566,28	36.066,15	0,17%
BB SMALL CAPS	351.291,43	43.641,79	0,21%
BB RETORNO AÇÕES	399.872,16	39.453,68	0,19%
BB CONSUMO	366.459,95	38.725,83	0,18%
BB SETOR FINANCEIRO	260.487,48	32.835,86	0,16%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	215.250,19	32.892,65	0,16%
CAIXA IRF-M	1.478.782,37	26.773,18	0,13%
CAIXA IRF-M1 TP	2.429.016,95	9.493,54	0,04%
CAIXA IMA-B 5+	3.115.184,55	132.426,65	0,63%
SICREDI IRF-M LP	1.423.600,86	26.618,84	0,13%
Carteira	21.103.685,09	563.118,17	2,67%

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 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	-