

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Agosto/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	3.595.289,15	1,05%	0,05%	2147,54%
BB IPCA	1.742.692,80	-0,14%	0,05%	-287,54%
BB IMA-B 5+	3.367.428,85	2,45%	0,05%	4981,35%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.420.351,11	1,21%	0,05%	2453,73%
BB AÇÕES BOLSA	2.122.222,32	-3,34%	0,05%	-6804,31%
BB AÇÕES AGRO	576.170,26	6,95%	0,05%	14155,21%
BB TECNOLOGIA	288.351,08	4,59%	0,05%	9346,14%
BB ENERGIA	458.406,65	1,13%	0,05%	2305,00%
BB SMALL CAPS	483.314,46	9,56%	0,05%	19455,82%
BB RETORNO AÇÕES	387.555,98	8,77%	0,05%	17851,84%
BB CONSUMO	293.330,52	6,44%	0,05%	13113,22%
BB SETOR FINANCEIRO	505.899,26	6,90%	0,05%	14045,79%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	329.127,05	4,07%	0,05%	8287,65%
CAIXA IRF-M	1.373.096,55	2,04%	0,05%	4157,99%
CAIXA IRF-M1 TP	2.531.604,56	1,06%	0,05%	2164,99%
CAIXA IMA-B 5+	3.320.665,47	2,49%	0,05%	5079,07%
SICREDI IRF-M LP	1.568.986,96	2,12%	0,05%	4314,17%
BI - MASSA FALIDA	204.987,52	0,24%	0,05%	490,41%
TOTAL / MÉDIA	26.569.480,55	1,69%	0,05%	3450,13%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,53%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	6,56%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	12,67%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	12,87%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	7,99%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,17%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,09%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,73%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,82%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,46%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	1,10%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	1,90%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,24%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	5,17%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	9,53%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	12,50%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,91%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,77%	0%	Nao 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%
Mai	0,76%	0,88%	85,89%
Junho	-2,16%	1,08%	-199,60%
Julho	0,92%	-0,27%	-337,82%
Agosto	1,69%	0,05%	3450,13%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,07%	7,87%	26,35%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,07%, enquanto que a meta acumulada no período é de 7,87%, sendo assim o RPPS atingiu 26,35% 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	3.595.289,15	87.403,20	0,33%
BB IPCA	1.742.692,80	17.435,85	0,07%
BB IMA-B 5+	3.367.428,85	131.380,73	0,49%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.420.351,11	34.517,77	0,13%
BB AÇÕES BOLSA	2.122.222,32	261.190,17	0,98%
BB AÇÕES AGRO	576.170,26	44.839,82	0,17%
BB TECNOLOGIA	288.351,08	38.574,56	0,15%
BB ENERGIA	458.406,65	33.776,78	0,13%
BB SMALL CAPS	483.314,46	59.760,22	0,22%
BB RETORNO AÇÕES	387.555,98	35.520,73	0,13%
BB CONSUMO	293.330,52	34.001,64	0,13%
BB SETOR FINANCEIRO	505.899,26	49.669,25	0,19%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	329.127,05	43.140,46	0,16%
CAIXA IRF-M	1.373.096,55	20.408,70	0,08%
CAIXA IRF-M1 TP	2.531.604,56	4.699,34	0,02%
CAIXA IMA-B 5+	3.320.665,47	130.356,55	0,49%
SICREDI IRF-M LP	1.568.986,96	23.623,40	0,09%
BI - MASSA FALIDA	204.987,52	0,00	0,00%
Carteira	26.569.480,55	776.281,87	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	0,00
BB IPCA	0,01
BB IMA-B 5+	0,00
BB ALOCAÇÃO ATIVA	0,00
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	0,00
CAIXA IMA-B 5+	0,00
SICREDI IRF-M LP	0,00
BI - MASSA FALIDA	-