

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Março/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.254.432,05	-0,49%	1,42%	-34,24%
BB IPCA	1.688.341,37	0,38%	1,42%	26,43%
BB IMA-B 5+	1.433.609,93	-1,20%	1,42%	-84,76%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.468.658,33	-0,42%	1,42%	-29,63%
BB TECNOLOGIA	379.288,10	-1,48%	1,42%	-104,05%
BB ENERGIA	469.523,52	8,84%	1,42%	621,95%
BB SMALL CAPS	427.636,85	3,79%	1,42%	266,66%
BB RETORNO AÇÕES	461.855,78	7,08%	1,42%	498,02%
BB CONSUMO	443.188,83	2,05%	1,42%	144,00%
BB SETOR FINANCEIRO	247.994,69	6,08%	1,42%	427,49%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	315.686,70	9,44%	1,42%	664,46%
CAIXA IRF-M	3.563.576,26	-0,82%	1,42%	-57,56%
CAIXA IMA-B 5+	3.304.099,66	-1,22%	1,42%	-85,72%
SICREDI IRF-M LP	1.469.221,92	-1,14%	1,42%	-80,16%
TOTAL / MÉDIA	18.927.113,99	0,04%	1,42%	3,15%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	11,91%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA	8,92%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	7,57%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	13,04%	20%	Art. 7º, I, b
BB TECNOLOGIA	2,00%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	2,48%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAPS	2,26%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO AÇÕES	2,44%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	2,34%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	1,31%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,67%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	18,83%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	17,46%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	7,76%	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			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-3,09%	3,55%	-87,14%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -3,09%, enquanto que a meta acumulada no período é de 3,55%, sendo assim o RPPS atingiu -87,14% 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	2.254.432,05	58.846,41	0,31%
BB IPCA	1.688.341,37	21.774,50	0,12%
BB IMA-B 5+	1.433.609,93	57.995,74	0,31%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.468.658,33	34.086,78	0,18%
BB TECNOLOGIA	379.288,10	33.490,72	0,18%
BB ENERGIA	469.523,52	47.025,53	0,25%
BB SMALL CAPS	427.636,85	50.130,99	0,26%
BB RETORNO AÇÕES	461.855,78	46.026,72	0,24%
BB CONSUMO	443.188,83	48.168,66	0,25%
BB SETOR FINANCEIRO	247.994,69	32.244,59	0,17%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	315.686,70	53.788,75	0,28%
CAIXA IRF-M	3.563.576,26	51.365,84	0,27%
CAIXA IMA-B 5+	3.304.099,66	134.474,24	0,71%
SICREDI IRF-M LP	1.469.221,92	24.429,69	0,13%
Carteira	18.927.113,99	545.081,49	2,88%

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	0,00
BB IMA-B 5+	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
BB TECNOLOGIA	-
BB ENERGIA	-
BB SMALL CAPS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB CONSUMO	-
BB SETOR FINANCEIRO	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	-
CAIXA IRF-M	-
CAIXA IMA-B 5+	-
SICREDI IRF-M LP	-