

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Fevereiro/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.295.604,40	-1,56%	1,35%	-115,16%
BB IPCA	1.682.023,67	-0,58%	1,35%	-43,29%
BB IMA-B 5+	1.501.700,03	-2,32%	1,35%	-171,57%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.479.098,92	-0,91%	1,35%	-67,65%
BB TECNOLOGIA	384.981,15	0,69%	1,35%	50,90%
BB ENERGIA	431.390,01	-6,35%	1,35%	-469,85%
BB SMALL CAPS	412.021,07	-2,23%	1,35%	-164,92%
BB RETORNO AÇÕES	431.325,58	-1,35%	1,35%	-100,04%
BB CONSUMO	434.300,33	-5,34%	1,35%	-395,65%
BB SETOR FINANCEIRO	223.269,82	-6,88%	1,35%	-509,26%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	288.446,09	-10,16%	1,35%	-751,97%
CAIXA IRF-M	3.092.967,67	-1,06%	1,35%	-78,60%
CAIXA IMA-B 5+	3.194.850,16	-2,35%	1,35%	-173,91%
SICREDI IRF-M LP	1.486.153,39	-1,35%	1,35%	-100,11%
TOTAL / MÉDIA	18.338.132,29	-1,88%	1,35%	-138,88%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	12,52%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA	9,17%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	8,19%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	13,52%	20%	Art. 7º, I, b
BB TECNOLOGIA	2,10%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	2,35%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAPS	2,25%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO AÇÕES	2,35%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	2,37%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	1,22%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,57%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	16,87%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	17,42%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	8,10%	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			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-3,14%	2,10%	-149,45%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -3,14%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,1%, sendo assim o RPPS atingiu -149,45% 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	2.295.604,40	55.176,31	0,30%
BB IPCA	1.682.023,67	20.538,50	0,11%
BB IMA-B 5+	1.501.700,03	56.375,67	0,31%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.479.098,92	32.168,92	0,18%
BB TECNOLOGIA	384.981,15	35.365,30	0,19%
BB ENERGIA	431.390,01	41.196,41	0,22%
BB SMALL CAPS	412.021,07	45.839,29	0,25%
BB RETORNO AÇÕES	431.325,58	46.594,85	0,25%
BB CONSUMO	434.300,33	46.872,92	0,26%
BB SETOR FINANCEIRO	223.269,82	30.947,19	0,17%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	288.446,09	45.744,13	0,25%
CAIXA IRF-M	3.092.967,67	40.788,42	0,22%
CAIXA IMA-B 5+	3.194.850,16	121.009,73	0,66%
SICREDI IRF-M LP	1.486.153,39	23.148,70	0,13%
Carteira	18.338.132,29	510.264,32	2,78%

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 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	-