

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Janeiro/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.331.882,48	-0,86%	0,74%	-116,38%
BB IPCA	1.691.917,81	0,02%	0,74%	3,34%
BB IMA-B 5+	1.537.331,67	-1,70%	0,74%	-229,82%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.501.965,29	-0,55%	0,74%	-74,85%
CAIXA IMA-B 5+	3.271.714,86	-1,70%	0,74%	-229,89%
SICREDI IRF-M LP	1.506.527,58	-0,91%	0,74%	-123,67%
BB TECNOLOGIA	382.352,21	5,39%	0,74%	730,87%
BB ENERGIA	460.627,92	-5,09%	0,74%	-690,21%
BB SMALL CAPS	421.409,70	-4,70%	0,74%	-637,50%
BB RETORNO AÇÕES	437.234,76	-3,18%	0,74%	-430,25%
BB CONSUMO	458.824,26	-1,42%	0,74%	-192,88%
BB SETOR FINANCEIRO	229.788,89	-6,60%	0,74%	-893,85%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	321.061,92	-7,08%	0,74%	-959,44%
CAIXA IRF-M	2.581.663,88	-0,67%	0,74%	-90,71%
TOTAL / MÉDIA	18.134.303,23	-1,28%	0,74%	-174,08%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	12,86%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA	9,33%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	8,48%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	13,80%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	18,04%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	8,31%	20%	Art. 7º, III, a
BB TECNOLOGIA	2,11%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	2,54%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAPS	2,32%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO AÇÕES	2,41%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	2,53%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	1,27%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,77%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	14,24%	20%	Art. 7º, I, b

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-1,28%	0,74%	-174,08%
Fevereiro			
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-1,28%	0,74%	-174,08%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -1,28%, enquanto que a meta acumulada no período é de 0,74%, sendo assim o RPPS atingiu -174,08% 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	2.331.882,48	66.994,33	0,37%
BB IPCA	1.691.917,81	23.014,28	0,13%
BB IMA-B 5+	1.537.331,67	68.327,90	0,38%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.501.965,29	37.595,23	0,21%
CAIXA IMA-B 5+	3.271.714,86	146.414,01	0,81%
SICREDI IRF-M LP	1.506.527,58	25.497,25	0,14%
BB TECNOLOGIA	382.352,21	36.075,83	0,20%
BB ENERGIA	460.627,92	43.010,37	0,24%
BB SMALL CAPS	421.409,70	47.337,40	0,26%
BB RETORNO AÇÕES	437.234,76	47.170,33	0,26%
BB CONSUMO	458.824,26	51.340,49	0,28%
BB SETOR FINANCEIRO	229.788,89	31.242,92	0,17%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	321.061,92	53.679,83	0,30%
CAIXA IRF-M	2.581.663,88	37.684,77	0,21%
Carteira	18.134.303,23	583.524,15	3,22%

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