

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Junho/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	3.591.867,27	-0,40%	1,08%	-36,48%
BB IPCA	1.743.800,41	0,33%	1,08%	30,23%
BB IMA-B 5+	3.349.136,66	-1,09%	1,08%	-100,88%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.365.982,27	0,33%	1,08%	30,41%
BB AÇÕES BOLSA	2.008.995,49	-7,44%	1,08%	-687,09%
BB AÇÕES AGRO	521.591,02	-12,11%	1,08%	-1117,43%
BB TECNOLOGIA	245.314,83	-8,65%	1,08%	-798,04%
BB ENERGIA	440.386,50	-5,11%	1,08%	-471,40%
BB SMALL CAPS	286.253,73	-16,51%	1,08%	-1524,03%
BB RETORNO AÇÕES	341.531,90	-11,84%	1,08%	-1092,53%
BB CONSUMO	252.816,41	-14,47%	1,08%	-1335,85%
BB SETOR FINANCEIRO	309.505,16	-12,43%	1,08%	-1147,56%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	199.458,10	-12,08%	1,08%	-1115,05%
CAIXA IRF-M	1.330.688,16	0,34%	1,08%	31,77%
CAIXA IRF-M1 TP	1.233.535,05	0,92%	1,08%	85,28%
CAIXA IMA-B 5+	3.302.772,77	-1,10%	1,08%	-101,52%
SICREDI IRF-M LP	1.518.816,53	0,32%	1,08%	29,52%
BI - MASSA FALIDA	204.161,91	0,15%	1,08%	13,70%
TOTAL / MÉDIA	24.246.614,17	-2,16%	1,08%	-199,60%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B TP	14,81%	100%	Art. 7º, I, b
BB IPCA	7,19%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	13,81%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	13,88%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	8,29%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,15%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,01%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,82%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,18%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,41%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	1,04%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	1,28%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	0,82%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	5,49%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	5,09%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	13,62%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	6,26%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,84%	0%	Não 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%
Maior	0,76%	0,88%	85,89%
Junho	-2,16%	1,08%	-199,60%
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,54%	8,11%	-6,68%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,54%, enquanto que a meta acumulada no período é de 8,11%, sendo assim o RPPS atingiu -6,68% 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 TP	3.591.867,27	77.760,16	0,32%
BB IPCA	1.743.800,41	19.393,44	0,08%
BB IMA-B 5+	3.349.136,66	117.821,11	0,49%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.365.982,27	36.727,22	0,15%
BB AÇÕES BOLSA	2.008.995,49	277.996,65	1,15%
BB AÇÕES AGRO	521.591,02	68.457,52	0,28%
BB TECNOLOGIA	245.314,83	38.349,02	0,16%
BB ENERGIA	440.386,50	39.018,19	0,16%
BB SMALL CAPS	286.253,73	52.604,91	0,22%
BB RETORNO AÇÕES	341.531,90	44.737,91	0,18%
BB CONSUMO	252.816,41	42.726,18	0,18%
BB SETOR FINANCEIRO	309.505,16	45.040,67	0,19%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	199.458,10	34.173,59	0,14%
CAIXA IRF-M	1.330.688,16	20.986,84	0,09%
CAIXA IRF-M1 TP	1.233.535,05	9.229,32	0,04%
CAIXA IMA-B 5+	3.302.772,77	116.740,00	0,48%
SICREDI IRF-M LP	1.518.816,53	24.927,70	0,10%
BI - MASSA FALIDA	204.161,91	0,00	0,00%
Carteira	24.246.614,17	805.893,16	3,32%

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 TP	-
BB IPCA	-
BB IMA-B 5+	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
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	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B 5+	-
SICREDI IRF-M LP	-
BI - MASSA FALIDA	-