

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Agosto/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.280.198,83	-1,79%	0,73%	-246,39%
BB IPCA TP	1.690.181,28	0,66%	0,73%	90,72%
BB IMA-B 5+	1.455.297,27	-3,69%	0,73%	-506,67%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.456.939,55	-0,89%	0,73%	-122,09%
CAIXA IMA-B 5+	3.281.343,15	-2,74%	0,73%	-376,61%
SICREDI IRF-M	1.499.352,70	-0,91%	0,73%	-125,28%
BB TECNOLOGIA	348.559,50	9,43%	0,73%	1295,91%
BB ENERGIA	423.595,20	-6,08%	0,73%	-834,64%
BB SMALL CAP	381.470,36	-1,45%	0,73%	-199,57%
BB RETORNO TOTAL	396.550,18	-3,34%	0,73%	-458,22%
BB CONSUMO	438.698,11	-1,73%	0,73%	-238,29%
BB SETOR FINANCEIRO	162.293,61	-7,73%	0,73%	-1061,48%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	317.739,02	-8,11%	0,73%	-1113,69%
CAIXA IRF-M	1.300.869,42	-0,77%	0,73%	-105,80%
CAIXA IRF-M1 TP	282.362,32	0,02%	0,73%	2,44%
TOTAL / MÉDIA	16.715.450,50	-1,72%	0,73%	-235,96%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,64%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA TP	10,11%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	8,71%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	14,70%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	19,63%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M	8,97%	20%	Art. 7º, III, a
BB TECNOLOGIA	2,09%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	2,53%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAP	2,28%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO TOTAL	2,37%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	2,62%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	0,97%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,90%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	7,78%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	1,69%	20%	Art. 7º, I, b

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,33%	0,70%	-46,59%
Fevereiro	-0,84%	0,74%	-113,27%
Março	-8,32%	0,56%	-1493,85%
Abril	2,13%	0,18%	1215,91%
Mai	1,74%	0,10%	1655,39%
Junho	2,63%	0,75%	351,83%
Julho	4,29%	0,85%	506,05%
Agosto	-1,72%	0,73%	-235,96%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,96%	4,70%	-20,37%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,96%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,7%, sendo assim o RPPS atingiu -20,37% 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	2.280.198,83	108.241,28	0,65%
BB IPCA TP	1.690.181,28	37.320,54	0,22%
BB IMA-B 5+	1.455.297,27	109.861,81	0,66%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.456.939,55	59.950,72	0,36%
CAIXA IMA-B 5+	3.281.343,15	248.339,57	1,49%
SICREDI IRF-M	1.499.352,70	6.267,50	0,04%
BB TECNOLOGIA	348.559,50	38.715,32	0,23%
BB ENERGIA	423.595,20	56.028,22	0,34%
BB SMALL CAP	381.470,36	58.548,61	0,35%
BB RETORNO TOTAL	396.550,18	44.865,00	0,27%
BB CONSUMO	438.698,11	56.569,06	0,34%
BB SETOR FINANCEIRO	162.293,61	30.084,70	0,18%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	317.739,02	77.246,01	0,46%
CAIXA IRF-M	1.300.869,42	32.353,90	0,19%
CAIXA IRF-M1 TP	282.362,32	707,90	0,00%
Carteira	16.715.450,50	847.626,47	5,07%

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 TP	0,03
BB IMA-B 5+	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
CAIXA IMA-B 5+	-
SICREDI IRF-M	-
BB TECNOLOGIA	0,09
BB ENERGIA	-
BB SMALL CAP	0,02
BB RETORNO TOTAL	0,01
BB CONSUMO	0,01
BB SETOR FINANCEIRO	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	-
CAIXA IRF-M	-
CAIXA IRF-M1 TP	-