

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Setembro/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.146.399,28	-0,11%	1,65%	-6,52%
BB IPCA	1.695.365,92	1,13%	1,65%	68,60%
BB IMA-B 5+	1.787.087,45	-1,30%	1,65%	-78,78%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.481.168,19	-0,01%	1,65%	-0,32%
BB AÇÕES BOLSA	910.896,87	-4,25%	1,65%	-257,37%
BB TECNOLOGIA	379.242,19	-7,09%	1,65%	-429,16%
BB ENERGIA	446.359,28	-2,30%	1,65%	-138,90%
BB SMALL CAPS	402.782,06	-7,04%	1,65%	-425,76%
BB RETORNO AÇÕES	437.006,50	-7,71%	1,65%	-466,80%
BB CONSUMO	406.263,82	-6,18%	1,65%	-373,71%
BB SETOR FINANCEIRO	276.879,96	-9,28%	1,65%	-561,50%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	245.329,18	-10,45%	1,65%	-632,64%
CAIXA IRF-M	1.722.133,21	-0,23%	1,65%	-13,93%
CAIXA IRF-M1 TP	2.442.098,47	0,37%	1,65%	22,66%
CAIXA IMA-B 5+	3.244.314,06	-1,27%	1,65%	-76,57%
SICREDI IRF-M LP	1.461.622,19	-0,34%	1,65%	-20,42%
TOTAL / MÉDIA	20.484.948,63	-1,36%	1,65%	-82,03%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	10,48%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA	8,28%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	8,72%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	12,11%	20%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	4,45%	20%	Art. 8º, II, a
BB TECNOLOGIA	1,85%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	2,18%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAPS	1,97%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO AÇÕES	2,13%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	1,98%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	1,35%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,20%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	8,41%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	11,92%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	15,84%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	7,14%	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	0,93%	0,80%	116,04%
Mai	1,30%	1,32%	98,30%
Junho	0,16%	1,02%	15,98%
Julho	-0,92%	1,45%	-63,05%
Agosto	-1,14%	1,36%	-83,92%
Setembro	-1,36%	1,65%	-82,03%
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-4,11%	11,67%	-35,23%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -4,11%, enquanto que a meta acumulada no período é de 11,67%, sendo assim o RPPS atingiu -35,23% 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	2.146.399,28	53.882,03	0,26%
BB IPCA	1.695.365,92	17.133,85	0,08%
BB IMA-B 5+	1.787.087,45	70.899,92	0,35%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.481.168,19	27.866,01	0,14%
BB AÇÕES BOLSA	910.896,87	48.852,64	0,24%
BB TECNOLOGIA	379.242,19	28.758,78	0,14%
BB ENERGIA	446.359,28	35.149,43	0,17%
BB SMALL CAPS	402.782,06	42.755,26	0,21%
BB RETORNO AÇÕES	437.006,50	38.619,96	0,19%
BB CONSUMO	406.263,82	38.399,09	0,19%
BB SETOR FINANCEIRO	276.879,96	30.107,72	0,15%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	245.329,18	32.338,39	0,16%
CAIXA IRF-M	1.722.133,21	22.172,24	0,11%
CAIXA IRF-M1 TP	2.442.098,47	4.926,81	0,02%
CAIXA IMA-B 5+	3.244.314,06	128.520,41	0,63%
SICREDI IRF-M LP	1.461.622,19	19.977,91	0,10%
Carteira	20.484.948,63	497.271,77	2,43%

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	0,02
BB IMA-B 5+	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
BB AÇÕES BOLSA	-
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	-