

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Maio/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	3.406.117,44	0,93%	0,88%	104,86%
BB IPCA	1.738.107,77	0,52%	0,88%	59,37%
BB IMA-B 5+	3.286.144,04	1,11%	0,88%	125,73%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.354.928,48	0,79%	0,88%	90,02%
BB AÇÕES BOLSA	2.170.562,99	0,70%	0,88%	79,28%
BB AÇÕES AGRO	493.429,76	3,11%	0,88%	351,96%
BB TECNOLOGIA	268.530,84	-5,33%	0,88%	-603,95%
BB ENERGIA	464.087,10	-0,45%	0,88%	-50,83%
BB SMALL CAPS	342.862,28	-2,29%	0,88%	-259,64%
BB RETORNO AÇÕES	387.382,17	2,92%	0,88%	331,11%
BB CONSUMO	295.594,81	-3,13%	0,88%	-354,13%
BB SETOR FINANCEIRO	343.891,86	6,10%	0,88%	691,21%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	226.862,83	-4,44%	0,88%	-502,70%
CAIXA IRF-M	1.326.123,61	0,59%	0,88%	66,73%
CAIXA IRF-M1 TP	1.866.292,65	0,77%	0,88%	87,17%
CAIXA IMA-B 5+	3.339.501,96	1,14%	0,88%	128,76%
SICREDI IRF-M LP	1.513.975,42	0,64%	0,88%	72,12%
TOTAL / MÉDIA	24.824.396,01	0,76%	0,88%	86,44%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,72%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	7,00%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	13,24%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	13,51%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	8,74%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	1,99%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,08%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,87%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,38%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,56%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	1,19%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	1,39%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	0,91%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	5,34%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	7,52%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	13,45%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	6,10%	20%	Art. 7º, III, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,52%	0,95%	-54,43%
Fevereiro	-0,24%	1,42%	-16,50%
Março	3,10%	2,04%	152,23%
Abril	-1,40%	1,47%	-95,12%
Maio	0,76%	0,88%	86,44%
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	1,66%	6,95%	23,86%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,66%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,95%, sendo assim o RPPS atingiu 23,86% 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	3.406.117,44	75.046,12	0,30%
BB IPCA	1.738.107,77	17.029,26	0,07%
BB IMA-B 5+	3.286.144,04	115.216,21	0,46%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.354.928,48	35.187,56	0,14%
BB AÇÕES BOLSA	2.170.562,99	249.307,97	1,00%
BB AÇÕES AGRO	493.429,76	34.345,09	0,14%
BB TECNOLOGIA	268.530,84	35.948,20	0,14%
BB ENERGIA	464.087,10	36.365,30	0,15%
BB SMALL CAPS	342.862,28	42.444,01	0,17%
BB RETORNO AÇÕES	387.382,17	32.638,82	0,13%
BB CONSUMO	295.594,81	36.096,99	0,15%
BB SETOR FINANCEIRO	343.891,86	35.982,26	0,14%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	226.862,83	35.191,63	0,14%
CAIXA IRF-M	1.326.123,61	20.171,97	0,08%
CAIXA IRF-M1 TP	1.866.292,65	5.335,01	0,02%
CAIXA IMA-B 5+	3.339.501,96	117.464,35	0,47%
SICREDI IRF-M LP	1.513.975,42	24.574,84	0,10%
Carteira	24.824.396,01	719.399,09	2,90%

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	0,00
BB IPCA	-
BB IMA-B 5+	0,00
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+	0,00
SICREDI IRF-M LP	-