

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Julho/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.243.785,46	-0,39%	1,45%	-26,58%
BB IPCA	1.671.437,85	-0,01%	1,45%	-0,79%
BB IMA-B 5+	1.852.171,57	-0,78%	1,45%	-53,49%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.492.488,23	-0,25%	1,45%	-17,20%
BB AÇÕES BOLSA	402.830,43	0,71%	1,45%	48,75%
BB TECNOLOGIA	414.586,23	1,95%	1,45%	134,41%
BB ENERGIA	447.779,08	-3,24%	1,45%	-222,97%
BB SMALL CAPS	455.605,26	-6,64%	1,45%	-457,40%
BB RETORNO AÇÕES	487.528,75	-4,45%	1,45%	-306,65%
BB CONSUMO	451.484,00	-5,62%	1,45%	-387,43%
BB SETOR FINANCEIRO	292.839,28	-4,01%	1,45%	-276,31%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	299.474,23	-6,10%	1,45%	-419,99%
CAIXA IRF-M	2.842.350,94	-0,39%	1,45%	-27,02%
CAIXA IRF-M1 TP	1.428.079,30	0,17%	1,45%	11,47%
CAIXA IMA-B 5+	3.365.191,10	-0,76%	1,45%	-52,70%
SICREDI IRF-M LP	1.477.186,48	-0,54%	1,45%	-37,16%
TOTAL / MÉDIA	20.624.818,19	-0,92%	1,45%	-63,05%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	10,88%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA	8,10%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	8,98%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	12,08%	20%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	1,95%	20%	Art. 8º, II, a
BB TECNOLOGIA	2,01%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	2,17%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAPS	2,21%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO AÇÕES	2,36%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	2,19%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	1,42%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,45%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	13,78%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	6,92%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	16,32%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	7,16%	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%
Maio	1,30%	1,32%	98,30%
Junho	0,16%	1,02%	15,98%
Julho	-0,92%	1,45%	-63,05%
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-1,67%	8,38%	-19,95%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -1,67%, enquanto que a meta acumulada no período é de 8,38%, sendo assim o RPPS atingiu -19,95% da meta atuarial.

4. GERENCIAMENTO DE RISCO

4.1 RISCO DE CRÉDITO

Caso o RPPS detenha fundos com Crédito Privado, a análise de 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	2.243.785,46	51.796,30	0,25%
BB IPCA	1.671.437,85	20.226,22	0,10%
BB IMA-B 5+	1.852.171,57	63.353,02	0,31%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.492.488,23	29.284,27	0,14%
BB AÇÕES BOLSA	402.830,43	20.953,92	0,10%
BB TECNOLOGIA	414.586,23	27.094,25	0,13%
BB ENERGIA	447.779,08	33.929,67	0,16%
BB SMALL CAPS	455.605,26	42.425,90	0,21%
BB RETORNO AÇÕES	487.528,75	35.034,37	0,17%
BB CONSUMO	451.484,00	38.871,73	0,19%
BB SETOR FINANCEIRO	292.839,28	26.500,18	0,13%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	299.474,23	40.165,23	0,19%
CAIXA IRF-M	2.842.350,94	35.843,21	0,17%
CAIXA IRF-M1 TP	1.428.079,30	2.578,54	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	3.365.191,10	115.633,35	0,56%
SICREDI IRF-M LP	1.477.186,48	19.207,05	0,09%
Carteira	20.624.818,19	457.426,70	2,22%

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	-
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	-