

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Abril/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	3.374.884,22	0,84%	1,47%	56,98%
BB IPCA	1.778.862,72	2,23%	1,47%	151,10%
BB IMA-B 5+	3.250.081,94	0,09%	1,47%	6,43%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.028.485,43	0,52%	1,47%	35,13%
BB AÇÕES BOLSA	2.155.480,99	-8,65%	1,47%	-586,16%
BB AÇÕES AGRO	478.564,63	-3,74%	1,47%	-253,73%
BB TECNOLOGIA	274.095,19	-11,37%	1,47%	-771,04%
BB ENERGIA	466.178,19	-2,42%	1,47%	-163,89%
BB SMALL CAPS	350.902,71	-8,19%	1,47%	-555,48%
BB RETORNO AÇÕES	376.383,76	-7,81%	1,47%	-529,28%
BB CONSUMO	305.130,98	-14,21%	1,47%	-963,57%
BB SETOR FINANCEIRO	324.119,98	-11,91%	1,47%	-807,38%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	237.394,83	-6,65%	1,47%	-450,89%
CAIXA IRF-M	1.318.360,15	-0,17%	1,47%	-11,68%
CAIXA IRF-M1 TP	1.901.663,58	0,67%	1,47%	45,51%
CAIXA IMA-B 5+	3.301.979,85	0,05%	1,47%	3,10%
SICREDI IRF-M LP	1.504.400,61	-0,12%	1,47%	-7,85%
BI - MASSA FALIDA	203.520,93	0,06%	1,47%	3,76%
TOTAL / MÉDIA	24.630.490,69	-1,39%	1,47%	-94,32%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,70%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	7,22%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	13,20%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	12,30%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	8,75%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	1,94%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,11%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,89%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,42%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,53%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	1,24%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	1,32%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	0,96%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	5,35%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	7,72%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	13,41%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	6,11%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,83%	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%
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,89%	6,02%	14,82%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,89%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,02%, sendo assim o RPPS atingiu 14,82% 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	3.374.884,22	73.034,32	0,30%
BB IPCA	1.778.862,72	16.858,72	0,07%
BB IMA-B 5+	3.250.081,94	112.564,48	0,46%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.028.485,43	31.190,17	0,13%
BB AÇÕES BOLSA	2.155.480,99	216.867,13	0,88%
BB AÇÕES AGRO	478.564,63	31.975,40	0,13%
BB TECNOLOGIA	274.095,19	35.129,36	0,14%
BB ENERGIA	466.178,19	35.382,52	0,14%
BB SMALL CAPS	350.902,71	44.508,74	0,18%
BB RETORNO AÇÕES	376.383,76	30.913,09	0,13%
BB CONSUMO	305.130,98	36.651,58	0,15%
BB SETOR FINANCEIRO	324.119,98	33.418,60	0,14%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	237.394,83	40.446,83	0,16%
CAIXA IRF-M	1.318.360,15	20.176,53	0,08%
CAIXA IRF-M1 TP	1.901.663,58	5.590,78	0,02%
CAIXA IMA-B 5+	3.301.979,85	114.290,68	0,46%
SICREDI IRF-M LP	1.504.400,61	25.263,61	0,10%
BI - MASSA FALIDA	203.520,93	0,00	0,00%
Carteira	24.630.490,69	681.527,57	2,77%

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	0,02
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	-