

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Março/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	3.396.340,04	3,07%	2,04%	150,90%
BB IPCA	1.740.082,23	2,41%	2,04%	118,39%
BB IMA-B 5+	2.747.004,84	3,52%	2,04%	172,89%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.012.874,04	1,34%	2,04%	65,89%
BB AÇÕES BOLSA	2.359.471,01	4,72%	2,04%	231,87%
BB AÇÕES AGRO	497.170,90	7,70%	2,04%	377,97%
BB TECNOLOGIA	309.266,41	3,75%	2,04%	184,13%
BB ENERGIA	477.726,32	8,46%	2,04%	415,47%
BB SMALL CAPS	382.218,22	9,42%	2,04%	462,59%
BB RETORNO AÇÕES	408.254,99	5,51%	2,04%	270,49%
BB CONSUMO	355.681,23	5,46%	2,04%	268,09%
BB SETOR FINANCEIRO	358.381,26	7,36%	2,04%	361,06%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	254.307,47	5,60%	2,04%	274,86%
CAIXA IRF-M	1.320.635,64	0,85%	2,04%	41,87%
CAIXA IRF-M1 TP	1.858.982,54	0,79%	2,04%	38,66%
CAIXA IMA-B 5+	3.300.469,61	3,53%	2,04%	173,28%
SICREDI IRF-M LP	1.506.144,57	1,04%	2,04%	50,97%
BI - MASSA FALIDA	203.408,03	0,10%	2,04%	4,77%
TOTAL / MÉDIA	24.488.419,35	3,08%	2,04%	150,97%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,87%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	7,11%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	11,22%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	12,30%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	9,64%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,03%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,26%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,95%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,56%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,67%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	1,45%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	1,46%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,04%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	5,39%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	7,59%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	13,48%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	6,15%	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			
Maió			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,31%	4,47%	51,78%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,31%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,47%, sendo assim o RPPS atingiu 51,78% 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	3.396.340,04	73.452,84	0,30%
BB IPCA	1.740.082,23	17.002,63	0,07%
BB IMA-B 5+	2.747.004,84	94.285,52	0,39%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.012.874,04	30.797,64	0,13%
BB AÇÕES BOLSA	2.359.471,01	212.793,12	0,87%
BB AÇÕES AGRO	497.170,90	37.095,33	0,15%
BB TECNOLOGIA	309.266,41	37.824,45	0,15%
BB ENERGIA	477.726,32	38.983,84	0,16%
BB SMALL CAPS	382.218,22	52.192,97	0,21%
BB RETORNO AÇÕES	408.254,99	36.219,77	0,15%
BB CONSUMO	355.681,23	45.935,19	0,19%
BB SETOR FINANCEIRO	358.381,26	38.623,97	0,16%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	254.307,47	46.560,67	0,19%
CAIXA IRF-M	1.320.635,64	20.874,05	0,09%
CAIXA IRF-M1 TP	1.858.982,54	5.651,99	0,02%
CAIXA IMA-B 5+	3.300.469,61	112.458,66	0,46%
SICREDI IRF-M LP	1.506.144,57	26.608,96	0,11%
BI - MASSA FALIDA	203.408,03	0,00	0,00%
Carteira	24.488.419,35	673.415,01	2,75%

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	0,01
BB IPCA	0,02
BB IMA-B 5+	0,01
BB ALOCAÇÃO ATIVA	0,01
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	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B 5+	0,01
SICREDI IRF-M LP	0,00
BI - MASSA FALIDA	-