

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Novembro/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	3.015.855,09	3,46%	1,44%	240,07%
BB IPCA	1.665.223,71	2,07%	1,44%	143,81%
BB IMA-B 5+	2.042.915,06	4,44%	1,44%	307,91%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.483.139,25	1,73%	1,44%	120,30%
BB AÇÕES BOLSA	1.775.231,30	-1,07%	1,44%	-74,19%
BB TECNOLOGIA	344.769,96	-3,45%	1,44%	-239,49%
BB ENERGIA	430.919,75	1,74%	1,44%	120,45%
BB SMALL CAPS	342.290,61	-2,56%	1,44%	-177,76%
BB RETORNO AÇÕES	386.848,09	-3,26%	1,44%	-225,97%
BB CONSUMO	338.665,54	-7,58%	1,44%	-526,20%
BB SETOR FINANCEIRO	259.545,89	-2,21%	1,44%	-153,02%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	220.966,06	2,66%	1,44%	184,23%
CAIXA IRF-M	1.444.353,65	1,05%	1,44%	73,05%
CAIXA IRF-M1 TP	2.447.964,93	0,78%	1,44%	54,12%
CAIXA IMA-B 5+	3.250.803,55	4,35%	1,44%	302,04%
SICREDI IRF-M LP	1.451.326,56	1,95%	1,44%	135,12%
TOTAL / MÉDIA	21.900.819,00	1,81%	1,44%	125,30%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,77%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA	7,60%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	9,33%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	11,34%	20%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	8,11%	20%	Art. 8º, II, a
BB TECNOLOGIA	1,57%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	1,97%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAPS	1,56%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO AÇÕES	1,77%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	1,55%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	1,19%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,01%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	6,59%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	11,18%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	14,84%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	6,63%	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%
Maior	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	-2,68%	1,74%	-153,80%
Novembro	1,81%	1,44%	125,30%
Dezembro			
Acumulado	-5,00%	15,26%	-32,76%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -5%, enquanto que a meta acumulada no período é de 15,26%, sendo assim o RPPS atingiu -32,76% 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	3.015.855,09	142.014,84	0,65%
BB IPCA	1.665.223,71	36.217,36	0,17%
BB IMA-B 5+	2.042.915,06	141.248,67	0,64%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.483.139,25	54.853,34	0,25%
BB AÇÕES BOLSA	1.775.231,30	105.095,83	0,48%
BB TECNOLOGIA	344.769,96	33.604,53	0,15%
BB ENERGIA	430.919,75	40.425,01	0,18%
BB SMALL CAPS	342.290,61	48.428,49	0,22%
BB RETORNO AÇÕES	386.848,09	43.091,26	0,20%
BB CONSUMO	338.665,54	45.924,86	0,21%
BB SETOR FINANCEIRO	259.545,89	37.133,90	0,17%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	220.966,06	37.731,60	0,17%
CAIXA IRF-M	1.444.353,65	37.316,31	0,17%
CAIXA IRF-M1 TP	2.447.964,93	19.411,37	0,09%
CAIXA IMA-B 5+	3.250.803,55	220.439,34	1,01%
SICREDI IRF-M LP	1.451.326,56	39.399,47	0,18%
Carteira	21.900.819,00	777.081,55	3,55%

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	0,03
BB IMA-B 5+	0,01
BB ALOCAÇÃO ATIVA	0,01
BB AÇÕES BOLSA	-
BB TECNOLOGIA	-
BB ENERGIA	-
BB SMALL CAPS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB CONSUMO	-
BB SETOR FINANCEIRO	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	-
CAIXA IRF-M	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	0,01
CAIXA IMA-B 5+	0,01
SICREDI IRF-M LP	0,01