

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Fevereiro/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	3.295.046,24	0,48%	1,42%	33,37%
BB IPCA	1.699.101,02	1,38%	1,42%	97,08%
BB IMA-B 5+	2.653.542,35	-0,11%	1,42%	-7,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.972.965,43	0,55%	1,42%	38,40%
BB AÇÕES BOLSA	2.253.040,58	-2,28%	1,42%	-160,17%
BB AÇÕES AGRO	461.625,29	0,06%	1,42%	4,37%
BB TECNOLOGIA	298.084,45	-6,33%	1,42%	-444,61%
BB ENERGIA	440.445,86	-0,46%	1,42%	-32,39%
BB SMALL CAPS	349.299,62	-5,54%	1,42%	-388,80%
BB RETORNO AÇÕES	386.933,05	-2,55%	1,42%	-178,92%
BB CONSUMO	337.260,98	-2,62%	1,42%	-183,57%
BB SETOR FINANCEIRO	324.271,88	-1,33%	1,42%	-93,22%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	240.822,54	-6,91%	1,42%	-485,14%
CAIXA IRF-M	1.309.465,74	0,59%	1,42%	41,52%
CAIXA IRF-M1 TP	1.344.456,48	0,43%	1,42%	30,19%
CAIXA IMA-B 5+	3.187.931,77	0,02%	1,42%	1,48%
SICREDI IRF-M LP	1.490.664,20	0,75%	1,42%	52,70%
BI - MASSA FALIDA	203.210,72	0,00%	1,42%	0,00%
TOTAL / MÉDIA	23.248.168,20	-0,23%	1,42%	-16,36%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	14,17%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	7,31%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	11,41%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	12,79%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	9,69%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	1,99%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,28%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,89%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,50%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,66%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	1,45%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	1,39%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,04%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	5,63%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	5,78%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	13,71%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	6,41%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,87%	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			
Abril			
Mai			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,74%	2,39%	-31,06%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,74%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,39%, sendo assim o RPPS atingiu -31,06% 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	3.295.046,24	91.926,06	0,40%
BB IPCA	1.699.101,02	19.950,91	0,09%
BB IMA-B 5+	2.653.542,35	117.927,24	0,51%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.972.965,43	40.661,34	0,17%
BB AÇÕES BOLSA	2.253.040,58	181.270,49	0,78%
BB AÇÕES AGRO	461.625,29	0,00	0,00%
BB TECNOLOGIA	298.084,45	32.360,60	0,14%
BB ENERGIA	440.445,86	37.880,58	0,16%
BB SMALL CAPS	349.299,62	49.746,92	0,21%
BB RETORNO AÇÕES	386.933,05	36.472,29	0,16%
BB CONSUMO	337.260,98	43.083,54	0,19%
BB SETOR FINANCEIRO	324.271,88	39.004,27	0,17%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	240.822,54	45.860,57	0,20%
CAIXA IRF-M	1.309.465,74	26.435,27	0,11%
CAIXA IRF-M1 TP	1.344.456,48	6.177,20	0,03%
CAIXA IMA-B 5+	3.187.931,77	139.321,22	0,60%
SICREDI IRF-M LP	1.490.664,20	31.910,88	0,14%
BI - MASSA FALIDA	203.210,72	0,00	0,00%
Carteira	23.248.168,20	652.612,22	2,81%

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	0,01
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	-