

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Janeiro/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.979.453,89	-0,76%	0,95%	-79,47%
BB IPCA	1.675.921,15	0,09%	0,95%	9,23%
BB IMA-B 5+	2.206.533,85	-1,33%	0,95%	-139,44%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.506.789,55	0,04%	0,95%	3,99%
BB AÇÕES BOLSA	2.105.655,71	-5,41%	0,95%	-567,58%
BB AÇÕES AGRO	261.338,14	4,54%	0,95%	475,98%
BB TECNOLOGIA	318.244,04	-7,58%	0,95%	-795,15%
BB ENERGIA	442.488,03	2,60%	0,95%	272,56%
BB SMALL CAPS	369.783,27	4,33%	0,95%	454,56%
BB RETORNO AÇÕES	397.054,61	1,12%	0,95%	117,34%
BB CONSUMO	346.318,60	2,30%	0,95%	241,41%
BB SETOR FINANCEIRO	319.963,69	16,75%	0,95%	1757,44%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	258.704,39	10,16%	0,95%	1066,03%
CAIXA IRF-M	1.301.765,62	-0,07%	0,95%	-7,54%
CAIXA IRF-M1 TP	2.483.771,70	0,61%	0,95%	63,92%
CAIXA IMA-B 5+	3.187.257,80	-1,62%	0,95%	-169,86%
SICREDI IRF-M LP	1.479.555,14	-0,20%	0,95%	-21,40%
BI - MASSA FALIDA	203.210,72	0,06%	0,95%	6,35%
TOTAL / MÉDIA	#####	-0,51%	0,95%	-53,89%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,04%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	7,34%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	9,66%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	10,97%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	9,22%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	1,14%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,39%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,94%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,62%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,74%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	1,52%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	1,40%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,13%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	5,70%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	10,87%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	13,95%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	6,48%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,89%	0%	Não enquadrado

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,51%	0,95%	-53,89%
Fevereiro			
Março			
Abril			
Mai			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,51%	0,95%	-53,89%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,51%, enquanto que a meta acumulada no período é de 0,95%, sendo assim o RPPS atingiu -53,89% 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	2.979.453,89	87.776,48	0,38%
BB IPCA	1.675.921,15	59.070,61	0,26%
BB IMA-B 5+	2.206.533,85	151.216,87	0,66%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.506.789,55	34.097,41	0,15%
BB AÇÕES BOLSA	2.105.655,71	0,00	0,00%
BB AÇÕES AGRO	261.338,14	21.975,31	0,10%
BB TECNOLOGIA	318.244,04	55.559,54	0,24%
BB ENERGIA	442.488,03	41.043,35	0,18%
BB SMALL CAPS	369.783,27	65.903,77	0,29%
BB RETORNO AÇÕES	397.054,61	50.738,48	0,22%
BB CONSUMO	346.318,60	86.229,98	0,38%
BB SETOR FINANCEIRO	319.963,69	45.991,49	0,20%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	258.704,39	65.365,11	0,29%
CAIXA IRF-M	1.301.765,62	29.933,36	0,13%
CAIXA IRF-M1 TP	2.483.771,70	61.876,23	0,27%
CAIXA IMA-B 5+	3.187.257,80	221.227,67	0,97%
SICREDI IRF-M LP	1.479.555,14	37.065,32	0,16%
BI - MASSA FALIDA	203.210,72	0,00	0,00%
Carteira	22.843.809,90	780.309,04	3,42%

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 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	-