

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Maio/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M	245.409,29	0,16%	1,28%	12,46%
BB IMA-B TP	139.265,65	1,05%	1,28%	82,71%
BB FLUXO	19.441,44	0,18%	1,28%	14,42%
BB PERFIL	185.046,61	0,28%	1,28%	22,28%
BB IRF-M	6.799.564,49	0,16%	1,28%	12,46%
BB IRF-M1 TP	6.463.466,05	0,18%	1,28%	13,95%
BB IMA-B 5+	188.223,29	0,06%	1,28%	4,90%
BB QUANTITATIVO	3.218.327,98	4,96%	1,28%	388,58%
BB JUROS E MOEDAS	2.003.380,30	0,16%	1,28%	12,46%
BB RETORNO AÇÕES	3.285.065,76	2,31%	1,28%	181,45%
BB IRF-M1 TP	430.605,51	0,05%	1,28%	3,91%
BB FLUXO	494.311,45	0,09%	1,28%	7,14%
BB PERFIL	411.605,51	0,28%	1,28%	22,04%
BB AÇÕES GLOBAIS	983.271,39	-1,44%	1,28%	-112,73%
BB IRF-M 1+	182.430,87	-0,56%	1,28%	-44,11%
BB RETORNO TOTAL	8.053.190,91	0,61%	1,28%	47,65%
BB AÇÕES BOLSA	1.002.742,66	0,26%	1,28%	20,32%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.544.757,83	0,20%	1,28%	15,37%
CAIXA IMA-B	7.323.378,95	1,04%	1,28%	81,76%
CAIXA IRF-M1 TP	8.465.558,74	0,17%	1,28%	13,35%
CAIXA TP	702.890,68	0,29%	1,28%	22,48%
CAIXA IRF-M1 TP	7.644.075,18	0,17%	1,28%	13,35%
CAIXA IRF-M	2.442.008,34	0,17%	1,28%	13,29%
CAIXA REF DI	241.557,93	0,24%	1,28%	19,09%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.740.989,28	0,84%	1,28%	66,16%
CAIXA IRF-M 1+	191.161,84	-0,63%	1,28%	-49,73%
CAIXA IRF-M 1+	1.102.367,65	0,15%	1,28%	11,51%
CAIXA IMA-B 5	4.795.771,77	0,67%	1,28%	52,49%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.739.036,33	0,24%	1,28%	18,72%
TOTAL / MÉDIA	78.038.903,68	0,61%	1,28%	47,93%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M	0,31%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B TP	0,18%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,02%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	0,24%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	8,71%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,28%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	0,24%	20%	Art. 7º, I, b
BB QUANTITATIVO	4,12%	20%	Art. 8º, II, a
BB JUROS E MOEDAS	2,57%	10%	Art. 8º, III
BB RETORNO AÇÕES	4,21%	20%	Art. 8º, II, a
BB IRF-M1 TP	0,55%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,63%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	0,53%	20%	Art. 7º, IV, a
BB AÇÕES GLOBAIS	1,26%	10%	Art. 9º-A, I
BB IRF-M 1+	0,23%	20%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	10,32%	20%	Art. 7º, IV, a
BB AÇÕES BOLSA	1,28%	20%	Art. 8º, II, a
BRADESCO IRF-M 1 TP	4,54%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	9,38%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	10,85%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA TP	0,90%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IRF-M1 TP	9,80%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M	3,13%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA REF DI	0,31%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IDKA IPCA 2A	6,08%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M 1+	0,24%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M 1+	1,41%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5	6,15%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3,51%	20%	Art. 7º, I, b

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,50%	0,69%	-72,38%
Fevereiro	-0,75%	1,31%	-57,18%
Março	0,04%	1,38%	2,86%
Abril	0,72%	0,75%	95,01%
Maio	0,61%	1,28%	47,93%
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,11%	5,52%	1,99%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,11%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,52%, sendo assim o RPPS atingiu 1,99% 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 Kansal

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 IRF-M	245.409,29	3.654,54	0,00%
BB IMA-B TP	139.265,65	3.647,06	0,00%
BB FLUXO	19.441,44	3,84	0,00%
BB PERFIL	185.046,61	67,51	0,00%
BB IRF-M	6.799.564,49	101.256,42	0,13%
BB IRF-M1 TP	6.463.466,05	10.576,61	0,16%
BB IMA-B 5+	188.223,29	7.456,73	0,01%
BB QUANTITATIVO	3.218.327,98	319.102,21	0,41%
BB JUROS E MOEDAS	2.003.380,30	2.184,13	0,00%
BB RETORNO AÇÕES	3.285.065,76	328.827,99	0,42%
BB IRF-M1 TP	430.605,51	704,63	0,00%
BB FLUXO	494.311,45	97,62	0,00%
BB PERFIL	411.605,51	150,16	0,00%
BB AÇÕES GLOBAIS	983.271,39	93.223,12	0,12%
BB IRF-M 1+	182.430,87	4.358,26	0,01%
BB RETORNO TOTAL	8.053.190,91	123.364,59	0,16%
BB AÇÕES BOLSA	1.002.742,66	69.683,77	0,09%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.544.757,83	5.802,85	0,01%
CAIXA IMA-B	7.323.378,95	191.535,79	0,25%
CAIXA IRF-M1 TP	8.465.558,74	13.752,59	0,02%
CAIXA TP	702.890,68	254,68	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	7.644.075,18	12.418,06	0,02%
CAIXA IRF-M	2.442.008,34	36.465,01	0,05%
CAIXA REF DI	241.557,93	140,79	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.740.989,28	63.374,48	0,08%
CAIXA IRF-M 1+	191.161,84	4.344,04	0,01%
CAIXA IRF-M 1+	1.102.367,65	26.204,01	0,03%
CAIXA IMA-B 5	4.795.771,77	62.542,65	0,08%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.739.036,33	29.402,57	0,04%
Carteira	78.038.903,68	1.098.617,86	1,41%

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 IRF-M	0,00
BB IMA-B TP	0,01
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,01
BB IRF-M	0,00
BB IRF-M1 TP	-
BB IMA-B 5+	0,01
BB QUANTITATIVO	-
BB JUROS E MOEDAS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,01
BB AÇÕES GLOBAIS	-
BB IRF-M 1+	0,00
BB RETORNO TOTAL	0,01
BB AÇÕES BOLSA	-
BRADESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IMA-B	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA TP	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IRF-M	0,00
CAIXA REF DI	-
CAIXA IDKA IPCA 2A	0,01
CAIXA IRF-M 1+	0,00
CAIXA IRF-M 1+	0,00
CAIXA IMA-B 5	0,01
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,00