

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Junho/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M	245.833,50	0,17%	0,97%	17,75%
BB IMA-B TP	139.788,81	0,38%	0,97%	38,57%
BB FLUXO	30.418,20	0,21%	0,97%	21,45%
BB PERFIL	185.655,22	0,33%	0,97%	33,77%
BB IRF-M	6.811.317,98	0,17%	0,97%	17,75%
BB IRF-M1 TP	6.475.103,39	0,18%	0,97%	18,49%
BB IMA-B 5+	189.668,24	0,77%	0,97%	78,82%
BB QUANTITATIVO	3.192.641,78	-0,80%	0,97%	-81,95%
BB JUROS E MOEDAS	2.008.787,67	0,27%	0,97%	27,71%
BB RETORNO AÇÕES	3.276.618,60	-0,26%	0,97%	-26,40%
BB IRF-M1 TP	431.380,81	0,18%	0,97%	18,49%
BB FLUXO	318.940,25	0,20%	0,97%	20,32%
BB PERFIL	412.959,27	0,33%	0,97%	33,77%
BB AÇÕES GLOBAIS	960.384,91	-2,33%	0,97%	-238,98%
BB IRF-M 1+	182.712,48	0,15%	0,97%	15,85%
BB RETORNO TOTAL	8.056.962,01	0,05%	0,97%	4,81%
BB AÇÕES BOLSA	1.029.780,55	2,70%	0,97%	276,85%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.551.922,07	0,20%	0,97%	20,75%
CAIXA IMA-B	7.352.772,41	0,40%	0,97%	41,21%
CAIXA IRF-M1 TP	8.481.527,76	0,19%	0,97%	19,37%
CAIXA TP	705.072,21	0,31%	0,97%	31,87%
CAIXA IRF-M1 TP	7.658.494,58	0,19%	0,97%	19,37%
CAIXA IRF-M	2.446.459,70	0,18%	0,97%	18,72%
CAIXA REF DI	242.296,61	0,31%	0,97%	31,40%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.727.842,58	-0,28%	0,97%	-28,47%
CAIXA IRF-M 1+	191.482,96	0,17%	0,97%	17,25%
CAIXA IRF-M 1+	1.104.219,43	0,17%	0,97%	17,25%
CAIXA IMA-B 5	4.788.592,06	-0,15%	0,97%	-15,37%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.738.953,72	0,00%	0,97%	-0,31%
TOTAL / MÉDIA	77.938.589,76	0,08%	0,97%	8,57%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M	0,32%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B TP	0,18%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,04%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	0,24%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	8,74%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,31%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	0,24%	20%	Art. 7º, I, b
BB QUANTITATIVO	4,10%	20%	Art. 8º, II, a
BB JUROS E MOEDAS	2,58%	10%	Art. 8º, III
BB RETORNO AÇÕES	4,20%	20%	Art. 8º, II, a
BB IRF-M1 TP	0,55%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,41%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	0,53%	20%	Art. 7º, IV, a
BB AÇÕES GLOBAIS	1,23%	10%	Art. 9º-A, I
BB IRF-M 1+	0,23%	20%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	10,34%	20%	Art. 7º, IV, a
BB AÇÕES BOLSA	1,32%	20%	Art. 8º, II, a
BRADESCO IRF-M 1 TP	4,56%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	9,43%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	10,88%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA TP	0,90%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IRF-M1 TP	9,83%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M	3,14%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA REF DI	0,31%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IDKA IPCA 2A	6,07%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M 1+	0,25%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M 1+	1,42%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5	6,14%	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%
Maió	0,61%	1,28%	47,93%
Junho	0,08%	0,97%	8,57%
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,19%	6,55%	2,95%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,19%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,55%, sendo assim o RPPS atingiu 2,95% 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 IRF-M	245.833,50	3.502,51	0,00%
BB IMA-B TP	139.788,81	3.547,09	0,00%
BB FLUXO	30.418,20	7,57	0,00%
BB PERFIL	185.655,22	72,53	0,00%
BB IRF-M	6.811.317,98	97.044,30	0,12%
BB IRF-M1 TP	6.475.103,39	10.742,54	0,01%
BB IMA-B 5+	189.668,24	7.057,49	0,01%
BB QUANTITATIVO	3.192.641,78	275.759,22	0,35%
BB JUROS E MOEDAS	2.008.787,67	2.142,05	0,00%
BB RETORNO AÇÕES	3.276.618,60	266.431,74	0,34%
BB IRF-M1 TP	431.380,81	715,68	0,00%
BB FLUXO	318.940,25	79,36	0,00%
BB PERFIL	412.959,27	161,34	0,00%
BB AÇÕES GLOBAIS	960.384,91	76.145,03	0,10%
BB IRF-M 1+	182.712,48	4.093,10	0,01%
BB RETORNO TOTAL	8.056.962,01	120.487,74	0,15%
BB AÇÕES BOLSA	1.029.780,55	62.350,40	0,08%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.551.922,07	5.866,84	0,01%
CAIXA IMA-B	7.352.772,41	186.264,46	0,24%
CAIXA IRF-M1 TP	8.481.527,76	13.889,99	0,02%
CAIXA TP	705.072,21	286,53	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	7.658.494,58	12.542,13	0,02%
CAIXA IRF-M	2.446.459,70	34.908,34	0,04%
CAIXA REF DI	242.296,61	151,88	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.727.842,58	67.709,20	0,09%
CAIXA IRF-M 1+	191.482,96	4.264,68	0,01%
CAIXA IRF-M 1+	1.104.219,43	24.593,01	0,03%
CAIXA IMA-B 5	4.788.592,06	66.921,97	0,09%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.738.953,72	30.256,08	0,04%
Carteira	77.938.589,76	1.035.618,35	1,33%

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	-
BB IMA-B TP	0,00
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,02
BB IRF-M	-
BB IRF-M1 TP	-
BB IMA-B 5+	0,00
BB QUANTITATIVO	-
BB JUROS E MOEDAS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,02
BB AÇÕES GLOBAIS	-
BB IRF-M 1+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BB AÇÕES BOLSA	-
BRADESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IMA-B	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA TP	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IRF-M	-
CAIXA REF DI	-
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
CAIXA IRF-M 1+	-
CAIXA IRF-M 1+	-
CAIXA IMA-B 5	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-