

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Julho/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M	244.607,45	-0,50%	1,41%	-35,48%
BB IMA-B TP	139.252,67	-0,38%	1,41%	-27,28%
BB FLUXO	41.516,23	0,24%	1,41%	16,75%
BB PERFIL	186.385,15	0,39%	1,41%	27,97%
BB IRF-M	6.777.347,69	-0,50%	1,41%	-35,48%
BB IRF-M1 TP	6.485.744,72	0,16%	1,41%	11,69%
BB IMA-B 5+	189.195,69	-0,78%	1,41%	-55,22%
BB QUANTITATIVO	3.103.837,53	-2,78%	1,41%	-197,85%
BB JUROS E MOEDAS	2.015.332,72	0,33%	1,41%	23,18%
BB RETORNO AÇÕES	3.321.691,09	-4,46%	1,41%	-316,98%
BB IRF-M1 TP	432.089,75	0,16%	1,41%	11,69%
BB FLUXO	32.633,16	0,32%	1,41%	22,59%
BB PERFIL	401.365,97	0,39%	1,41%	27,67%
BB AÇÕES GLOBAIS	1.214.624,54	4,67%	1,41%	332,49%
BB IRF-M 1+	181.174,64	-0,84%	1,41%	-59,87%
BB RETORNO TOTAL	8.048.004,90	-0,11%	1,41%	-7,91%
BB AÇÕES BOLSA	1.258.120,07	2,30%	1,41%	163,92%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.558.727,10	0,19%	1,41%	13,63%
CAIXA IMA-B	7.323.461,24	-0,40%	1,41%	-28,36%
CAIXA IRF-M1 TP	8.495.646,47	0,17%	1,41%	11,84%
CAIXA TP	707.748,69	0,38%	1,41%	27,00%
CAIXA IRF-M1 TP	7.671.243,27	0,17%	1,41%	11,84%
CAIXA IRF-M	2.434.988,44	-0,47%	1,41%	-33,35%
CAIXA REF DI	243.391,17	0,45%	1,41%	32,13%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.724.772,43	-0,06%	1,41%	-4,62%
CAIXA IRF-M 1+	189.819,86	-0,87%	1,41%	-61,78%
CAIXA IRF-M 1+	1.094.628,87	-0,87%	1,41%	-61,78%
CAIXA IMA-B 5	4.789.257,70	0,01%	1,41%	0,99%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.717.709,83	-0,78%	1,41%	-55,17%
TOTAL / MÉDIA	78.023.319,04	-0,29%	1,41%	-20,52%

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	0,05%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	0,24%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	8,69%	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	3,98%	20%	Art. 8º, II, a
BB JUROS E MOEDAS	2,58%	10%	Art. 8º, III
BB RETORNO AÇÕES	4,26%	20%	Art. 8º, II, a
BB IRF-M1 TP	0,55%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,04%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	0,51%	20%	Art. 7º, IV, a
BB AÇÕES GLOBAIS	1,56%	10%	Art. 9º-A, I
BB IRF-M 1+	0,23%	20%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	10,31%	20%	Art. 7º, IV, a
BB AÇÕES BOLSA	1,61%	20%	Art. 8º, II, a
BRADESCO IRF-M 1 TP	4,56%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	9,39%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	10,89%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA TP	0,91%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IRF-M1 TP	9,83%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M	3,12%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA REF DI	0,31%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IDKA IPCA 2A	6,06%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M 1+	0,24%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M 1+	1,40%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5	6,14%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3,48%	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%
Mai	0,61%	1,28%	47,93%
Junho	0,08%	0,97%	8,57%
Julho	-0,29%	1,41%	-20,52%
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,10%	8,04%	-1,19%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,1%, enquanto que a meta acumulada no período é de 8,04%, sendo assim o RPPS atingiu -1,19% 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	244.607,45	3.092,10	0,00%
BB IMA-B TP	139.252,67	3.217,01	0,00%
BB FLUXO	41.516,23	9,38	0,00%
BB PERFIL	186.385,15	63,97	0,00%
BB IRF-M	6.777.347,69	85.672,90	0,11%
BB IRF-M1 TP	6.485.744,72	11.943,20	0,02%
BB IMA-B 5+	189.195,69	6.437,18	0,01%
BB QUANTITATIVO	3.103.837,53	219.394,36	0,28%
BB JUROS E MOEDAS	2.015.332,72	1.880,62	0,00%
BB RETORNO AÇÕES	3.321.691,09	238.700,48	0,31%
BB IRF-M1 TP	432.089,75	795,67	0,00%
BB FLUXO	32.633,16	7,37	0,00%
BB PERFIL	401.365,97	137,74	0,00%
BB AÇÕES GLOBAIS	1.214.624,54	90.884,14	0,12%
BB IRF-M 1+	181.174,64	3.426,99	0,00%
BB RETORNO TOTAL	8.048.004,90	104.684,35	0,13%
BB AÇÕES BOLSA	1.258.120,07	65.443,28	0,08%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.558.727,10	6.566,71	0,01%
CAIXA IMA-B	7.323.461,24	168.464,59	0,22%
CAIXA IRF-M1 TP	8.495.646,47	15.339,71	0,02%
CAIXA TP	707.748,69	289,96	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	7.671.243,27	13.851,17	0,02%
CAIXA IRF-M	2.434.988,44	30.706,21	0,04%
CAIXA REF DI	243.391,17	153,85	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.724.772,43	59.396,96	0,08%
CAIXA IRF-M 1+	189.819,86	3.602,41	0,00%
CAIXA IRF-M 1+	1.094.628,87	20.773,92	0,03%
CAIXA IMA-B 5	4.789.257,70	58.368,38	0,07%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.717.709,83	31.981,71	0,04%
Carteira	78.023.319,04	897.000,91	1,15%

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	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,05
BB IRF-M	-
BB IRF-M1 TP	-
BB IMA-B 5+	-
BB QUANTITATIVO	-
BB JUROS E MOEDAS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,05
BB AÇÕES GLOBAIS	-
BB IRF-M 1+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BB AÇÕES BOLSA	-
BRADESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA TP	0,02
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IRF-M	-
CAIXA REF DI	0,03
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
CAIXA IRF-M 1+	-
CAIXA IRF-M 1+	-
CAIXA IMA-B 5	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-