

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Setembro/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M	242.115,15	-0,38%	1,61%	-23,39%
BB IMA-B TP	137.467,75	-0,15%	1,61%	-9,56%
BB FLUXO	32.497,15	0,32%	1,61%	19,97%
BB PERFIL	188.078,12	0,46%	1,61%	28,58%
BB IRF-M	6.708.293,57	-0,38%	1,61%	-23,39%
BB IRF-M1 TP	6.531.274,77	0,37%	1,61%	22,80%
BB IMA-B 5+	181.582,61	-1,30%	1,61%	-81,02%
BB QUANTITATIVO	2.918.876,47	-3,98%	1,61%	-247,83%
BB JUROS E MOEDAS	2.033.291,76	0,46%	1,61%	28,70%
BB RETORNO AÇÕES	2.977.466,67	-7,71%	1,61%	-480,07%
BB IRF-M1 TP	435.123,03	0,37%	1,61%	22,80%
BB FLUXO	328.266,18	0,49%	1,61%	30,39%
BB PERFIL	405.011,65	0,46%	1,61%	28,58%
BB AÇÕES GLOBAIS	1.258.830,94	0,62%	1,61%	38,62%
BB IRF-M 1+	177.556,39	-0,82%	1,61%	-50,92%
BB RETORNO TOTAL	8.019.985,95	0,11%	1,61%	6,67%
BB AÇÕES BOLSA	1.236.992,96	-4,78%	1,61%	-297,65%
BRASESCO IRF-M 1 TP	3.585.148,64	0,39%	1,61%	24,36%
CAIXA IMA-B	7.228.905,97	-0,16%	1,61%	-9,70%
CAIXA IRF-M1 TP	8.557.095,29	0,38%	1,61%	23,54%
CAIXA TP	713.659,45	0,43%	1,61%	26,82%
CAIXA IRF-M1 TP	7.726.729,16	0,38%	1,61%	23,54%
CAIXA IRF-M	2.410.636,43	-0,37%	1,61%	-22,97%
CAIXA REF DI	245.881,53	0,53%	1,61%	32,97%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.135.531,64	1,01%	1,61%	63,14%
CAIXA IRF-M 1+	186.159,67	-0,78%	1,61%	-48,51%
CAIXA IRF-M 1+	1.073.521,77	-0,78%	1,61%	-48,51%
CAIXA IMA-B 5	5.093.117,55	0,94%	1,61%	58,53%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.687.821,13	0,35%	1,61%	22,09%
TOTAL / MÉDIA	78.456.919,35	-0,32%	1,61%	-19,62%

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	0,04%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	0,24%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	8,55%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,32%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	0,23%	20%	Art. 7º, I, b
BB QUANTITATIVO	3,72%	20%	Art. 8º, II, a
BB JUROS E MOEDAS	2,59%	10%	Art. 8º, III
BB RETORNO AÇÕES	3,80%	20%	Art. 8º, II, a
BB IRF-M1 TP	0,55%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,42%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	0,52%	20%	Art. 7º, IV, a
BB AÇÕES GLOBAIS	1,60%	10%	Art. 9º-A, I
BB IRF-M 1+	0,23%	20%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	10,22%	20%	Art. 7º, IV, a
BB AÇÕES BOLSA	1,58%	20%	Art. 8º, II, a
BRASESCO IRF-M 1 TP	4,57%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	9,21%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	10,91%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA TP	0,91%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IRF-M1 TP	9,85%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M	3,07%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA REF DI	0,31%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IDKA IPCA 2A	6,55%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M 1+	0,24%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M 1+	1,37%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5	6,49%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3,43%	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	-0,26%	1,32%	-19,53%
Setembro	-0,32%	1,61%	-19,62%
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,67%	11,22%	-5,94%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,67%, enquanto que a meta acumulada no período é de 11,22%, sendo assim o RPPS atingiu -5,94% 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	242.115,15	3.119,73	0,00%
BB IMA-B TP	137.467,75	3.454,25	0,00%
BB FLUXO	32.497,15	6,84	0,00%
BB PERFIL	188.078,12	52,86	0,00%
BB IRF-M	6.708.293,57	86.438,41	0,11%
BB IRF-M1 TP	6.531.274,77	13.295,27	0,02%
BB IMA-B 5+	181.582,61	7.204,01	0,01%
BB QUANTITATIVO	2.918.876,47	239.947,61	0,31%
BB JUROS E MOEDAS	2.033.291,76	1.764,02	0,00%
BB RETORNO AÇÕES	2.977.466,67	263.130,26	0,34%
BB IRF-M1 TP	435.123,03	885,75	0,00%
BB FLUXO	328.266,18	69,08	0,00%
BB PERFIL	405.011,65	113,83	0,00%
BB AÇÕES GLOBAIS	1.258.830,94	80.198,41	0,10%
BB IRF-M 1+	177.556,39	3.377,54	0,00%
BB RETORNO TOTAL	8.019.985,95	92.626,33	0,12%
BB AÇÕES BOLSA	1.236.992,96	66.341,61	0,08%
BRASESCO IRF-M 1 TP	3.585.148,64	7.282,33	0,01%
CAIXA IMA-B	7.228.905,97	180.245,15	0,23%
CAIXA IRF-M1 TP	8.557.095,29	17.263,50	0,02%
CAIXA TP	713.659,45	199,30	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	7.726.729,16	15.588,28	0,02%
CAIXA IRF-M	2.410.636,43	31.036,63	0,04%
CAIXA REF DI	245.881,53	194,46	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.135.531,64	56.358,37	0,07%
CAIXA IRF-M 1+	186.159,67	3.538,21	0,00%
CAIXA IRF-M 1+	1.073.521,77	20.403,72	0,03%
CAIXA IMA-B 5	5.093.117,55	58.185,24	0,07%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.687.821,13	35.971,67	0,05%
Carteira	78.456.919,35	922.485,70	1,18%

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	0,01
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	0,01
BB AÇÕES GLOBAIS	-
BB IRF-M 1+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BB AÇÕES BOLSA	-
BRASESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA TP	-
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	-