

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Outubro/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M	235.631,50	-2,68%	1,70%	-157,79%
BB IMA-B TP	133.918,04	-2,58%	1,70%	-152,15%
BB FLUXO	19.141,23	0,55%	1,70%	32,40%
BB PERFIL	188.997,63	0,49%	1,70%	28,81%
BB IRF-M	6.528.650,75	-2,68%	1,70%	-157,79%
BB IRF-M1 TP	6.497.394,28	-0,52%	1,70%	-30,57%
BB IMA-B 5+	174.448,95	-3,93%	1,70%	-231,48%
BB QUANTITATIVO	2.772.278,30	-5,02%	1,70%	-295,94%
BB JUROS E MOEDAS	2.041.063,40	0,38%	1,70%	22,52%
BB RETORNO AÇÕES	2.724.458,41	-8,50%	1,70%	-500,69%
BB IRF-M1 TP	432.865,86	-0,52%	1,70%	-30,57%
BB FLUXO	633.499,79	0,32%	1,70%	18,95%
BB PERFIL	406.991,74	0,49%	1,70%	28,81%
BB AÇÕES GLOBAIS	1.391.803,51	10,56%	1,70%	622,41%
BB IRF-M 1+	171.274,38	-3,54%	1,70%	-208,47%
BB RETORNO TOTAL	7.948.105,84	-0,90%	1,70%	-52,81%
BB AÇÕES BOLSA	1.325.943,89	7,19%	1,70%	423,71%
BRASESCO IRF-M 1 TP	3.565.597,35	-0,55%	1,70%	-32,13%
CAIXA IMA-B	7.043.727,53	-2,56%	1,70%	-150,94%
CAIXA IRF-M1 TP	8.511.257,71	-0,54%	1,70%	-31,56%
CAIXA TP	717.373,02	0,52%	1,70%	30,66%
CAIXA IRF-M1 TP	7.685.339,59	-0,54%	1,70%	-31,56%
CAIXA IRF-M	2.346.977,61	-2,64%	1,70%	-155,60%
CAIXA REF DI	247.117,91	0,50%	1,70%	29,63%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.069.167,71	-1,29%	1,70%	-76,14%
CAIXA IRF-M 1+	179.656,68	-3,49%	1,70%	-205,83%
CAIXA IRF-M 1+	1.036.021,14	-3,49%	1,70%	-205,83%
CAIXA IMA-B 5	5.029.757,08	-1,24%	1,70%	-73,30%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.670.048,45	-0,66%	1,70%	-38,96%
TOTAL / MÉDIA	77.728.509,28	-1,29%	1,70%	-76,18%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M	0,30%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B TP	0,17%	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	8,40%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,36%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	0,22%	20%	Art. 7º, I, b
BB QUANTITATIVO	3,57%	20%	Art. 8º, II, a
BB JUROS E MOEDAS	2,63%	10%	Art. 8º, III
BB RETORNO AÇÕES	3,51%	20%	Art. 8º, II, a
BB IRF-M1 TP	0,56%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,82%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	0,52%	20%	Art. 7º, IV, a
BB AÇÕES GLOBAIS	1,79%	10%	Art. 9º-A, I
BB IRF-M 1+	0,22%	20%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	10,23%	20%	Art. 7º, IV, a
BB AÇÕES BOLSA	1,71%	20%	Art. 8º, II, a
BRASESCO IRF-M 1 TP	4,59%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	9,06%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	10,95%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA TP	0,92%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IRF-M1 TP	9,89%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M	3,02%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA REF DI	0,32%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IDKA IPCA 2A	6,52%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M 1+	0,23%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M 1+	1,33%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5	6,47%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3,44%	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%
Maior	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	-1,29%	1,70%	-76,18%
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-1,95%	13,11%	-14,88%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -1,95%, enquanto que a meta acumulada no período é de 13,11%, sendo assim o RPPS atingiu -14,88% 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	235.631,50	4.267,80	0,01%
BB IMA-B TP	133.918,04	3.709,21	0,00%
BB FLUXO	19.141,23	5,22	0,00%
BB PERFIL	188.997,63	70,51	0,00%
BB IRF-M	6.528.650,75	118.247,99	0,15%
BB IRF-M1 TP	6.497.394,28	25.543,42	0,03%
BB IMA-B 5+	174.448,95	7.457,14	0,01%
BB QUANTITATIVO	2.772.278,30	246.280,00	0,32%
BB JUROS E MOEDAS	2.041.063,40	2.719,64	0,00%
BB RETORNO AÇÕES	2.724.458,41	268.810,70	0,35%
BB IRF-M1 TP	432.865,86	1.701,74	0,00%
BB FLUXO	633.499,79	172,81	0,00%
BB PERFIL	406.991,74	151,85	0,00%
BB AÇÕES GLOBAIS	1.391.803,51	94.116,11	0,12%
BB IRF-M 1+	171.274,38	4.306,88	0,01%
BB RETORNO TOTAL	7.948.105,84	96.791,31	0,12%
BB AÇÕES BOLSA	1.325.943,89	71.186,70	0,09%
BRASESCO IRF-M 1 TP	3.565.597,35	14.001,08	0,02%
CAIXA IMA-B	7.043.727,53	193.603,91	0,25%
CAIXA IRF-M1 TP	8.511.257,71	33.265,28	0,04%
CAIXA TP	717.373,02	263,47	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	7.685.339,59	30.037,28	0,04%
CAIXA IRF-M	2.346.977,61	42.491,75	0,05%
CAIXA REF DI	247.117,91	202,22	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.069.167,71	68.976,32	0,09%
CAIXA IRF-M 1+	179.656,68	4.494,81	0,01%
CAIXA IRF-M 1+	1.036.021,14	25.920,12	0,03%
CAIXA IMA-B 5	5.029.757,08	70.475,68	0,09%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.670.048,45	35.225,71	0,05%
Carteira	77.728.509,28	1.030.940,18	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	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,00
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	0,00
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	-