

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Agosto/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.205.794,77	0,10%	1,31%	7,89%
BB IPCA IV	685.035,99	0,45%	1,31%	34,09%
BB IDKA 2A	10.322.642,55	0,18%	1,31%	13,60%
BB FLUXO	43.822,31	0,24%	1,31%	18,16%
BB PERFIL	2.977.530,38	0,45%	1,31%	34,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.660.957,66	-0,45%	1,31%	-34,21%
BB IRF-M1 TP	4.909.480,07	0,33%	1,31%	25,49%
BB FLUXO	1.232.066,66	0,14%	1,31%	10,46%
BB XI TP	401.546,25	0,45%	1,31%	33,95%
BRASESCO FEDERAL EXTRA	577.897,21	0,42%	1,31%	32,00%
CAIXA RIO BRAVO	367.500,00	-0,40%	1,31%	-30,79%
CAIXA DIVIDENDOS	681.106,37	-1,32%	1,31%	-100,67%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.767.333,36	-1,28%	1,31%	-97,29%
CAIXA IRF-M1 TP	414.232,46	0,34%	1,31%	26,20%
CAIXA IMA-B	2.026.015,64	-1,14%	1,31%	-86,65%
CAIXA MATRIZ	1.951.892,17	0,48%	1,31%	36,37%
CAIXA TP	2.479.139,34	0,40%	1,31%	30,67%
CAIXA IMA-GERAL	2.011.368,59	-0,38%	1,31%	-28,75%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.969.866,08	-1,12%	1,31%	-85,54%
CAIXA IMA-B 5	8.956.543,34	0,13%	1,31%	10,20%
DAYCOVAL IMA-B 5	184.646,66	0,06%	1,31%	4,79%
PREMIUM FIDC	218.153,67	-0,30%	1,31%	-22,86%
TOTAL / MÉDIA	56.044.571,53	-0,14%	1,31%	-10,77%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,94%	20%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,22%	20%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	18,42%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,08%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	5,31%	20%	Art. 7º, IV, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	8,32%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,76%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	2,20%	20%	Art. 7º, IV, a
BB XI TP	0,72%	20%	Art. 7º, I, b
BRASESCO FEDERAL EXTRA	1,03%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA RIO BRAVO	0,66%	5%	Art. 8º, IV, b
CAIXA DIVIDENDOS	1,22%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	4,94%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	0,74%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,62%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	3,48%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA TP	4,42%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IMA-GERAL	3,59%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA NOVO IMA-B LP	10,65%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	15,98%	20%	Art. 7º, I, b
DAYCOVAL IMA-B 5	0,33%	20%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,39%	5%	Art. 7º, VII, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,35%	0,69%	-50,12%
Fevereiro	-0,75%	1,30%	-57,79%
Março	0,13%	1,37%	9,78%
Abril	0,57%	0,75%	76,63%
Maior	0,59%	1,27%	46,25%
Junho	0,01%	0,97%	1,51%
Julho	-0,15%	1,40%	-10,34%
Agosto	-0,14%	1,31%	-10,77%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,08%	9,44%	-0,84%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,08%, enquanto que a meta acumulada no período é de 9,44%, sendo assim o RPPS atingiu - 0,84% 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 IMA-B 5	2.205.794,77	27.394,15	0,05%
BB IPCA IV	685.035,99	4.671,31	0,01%
BB IDKA 2A	10.322.642,55	116.026,16	0,21%
BB FLUXO	43.822,31	9,45	0,00%
BB PERFIL	2.977.530,38	1.027,55	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.660.957,66	56.449,97	0,10%
BB IRF-M1 TP	4.909.480,07	8.253,21	0,01%
BB FLUXO	1.232.066,66	265,62	0,00%
BB XI TP	401.546,25	2.738,57	0,00%
BRASESCO FEDERAL EXTRA	577.897,21	197,88	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	367.500,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	681.106,37	46.373,50	0,08%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.767.333,36	39.226,95	0,07%
CAIXA IRF-M1 TP	414.232,46	691,78	0,00%
CAIXA IMA-B	2.026.015,64	51.743,72	0,09%
CAIXA MATRIZ	1.951.892,17	1.328,65	0,00%
CAIXA TP	2.479.139,34	931,66	0,00%
CAIXA IMA-GERAL	2.011.368,59	22.516,06	0,04%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.969.866,08	152.502,70	0,27%
CAIXA IMA-B 5	8.956.543,34	110.333,53	0,20%
DAYCOVAL IMA-B 5	184.646,66	2.342,75	0,00%
PREMIUM FIDC	218.153,67	0,00	0,00%
Carteira	56.044.571,53	588.797,02	1,05%

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 IMA-B 5	-
BB IPCA IV	0,00
BB IDKA 2A	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,01
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB XI TP	0,00
BRASESCO FEDERAL EXTRA	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA MATRIZ	0,01
CAIXA TP	-
CAIXA IMA-GERAL	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	-
DAYCOVAL IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-