

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Junho/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.203.014,54	-0,19%	0,97%	-19,14%
BB IPCA IV	695.858,98	0,35%	0,97%	36,18%
BB IDKA 2A	###	-0,09%	0,97%	-9,63%
BB FLUXO	25.122,16	0,05%	0,97%	5,24%
BB PERFIL	2.952.667,42	0,33%	0,97%	33,88%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.693.692,05	0,11%	0,97%	11,49%
BB IRF-M1 TP	4.885.086,29	0,18%	0,97%	18,55%
BB FLUXO	946.170,60	0,09%	0,97%	9,64%
BB XI TP	407.735,71	0,35%	0,97%	35,87%
BRASESCO FEDERAL EXTRA	573.323,91	0,31%	0,97%	31,73%
CAIXA RIO BRAVO	418.850,00	-7,96%	0,97%	-819,82%
CAIXA DIVIDENDOS	712.814,17	-1,76%	0,97%	-180,99%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.233.374,01	0,00%	0,97%	-0,31%
CAIXA IRF-M1 TP	812.106,65	0,19%	0,97%	19,43%
CAIXA IMA-B	2.057.521,05	0,40%	0,97%	41,35%
CAIXA MATRIZ	1.933.924,18	0,31%	0,97%	32,15%
CAIXA TP	2.459.862,79	0,31%	0,97%	31,97%
CAIXA IMA-GERAL	2.021.678,12	0,29%	0,97%	30,37%
CAIXA NOVO IMA-B LP	6.060.992,07	0,43%	0,97%	44,35%
CAIXA IMA-B 5	8.943.328,69	-0,15%	0,97%	-15,42%
DAYCOVAL IMA-B 5	184.674,76	-0,25%	0,97%	-25,39%
PREMIUM FIDC	219.254,96	-0,16%	0,97%	-16,57%
TOTAL / MÉDIA	#####	0,01%	0,97%	1,51%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,88%	20%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,23%	20%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	18,15%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,04%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	5,20%	20%	Art. 7º, IV, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	8,27%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,61%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	1,67%	20%	Art. 7º, IV, a
BB XI TP	0,72%	20%	Art. 7º, I, b
BRASESCO FEDERAL EXTRA	1,01%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA RIO BRAVO	0,74%	5%	Art. 8º, IV, b
CAIXA DIVIDENDOS	1,26%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	5,70%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	1,43%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,63%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	3,41%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA TP	4,34%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IMA-GERAL	3,56%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA NOVO IMA-B LP	10,68%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	15,76%	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%
Maio	0,59%	1,27%	46,25%
Junho	0,01%	0,97%	1,51%
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,21%	6,53%	3,17%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,21%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,53%, sendo assim o RPPS atingiu 3,17% 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	2.203.014,54	30.872,49	0,05%
BB IPCA IV	695.858,98	6.319,73	0,01%
BB IDKA 2A	10.295.660,06	137.008,28	0,24%
BB FLUXO	25.122,16	6,25	0,00%
BB PERFIL	2.952.667,42	1.153,58	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.693.692,05	61.559,04	0,11%
BB IRF-M1 TP	4.885.086,29	8.104,62	0,01%
BB FLUXO	946.170,60	235,43	0,00%
BB XI TP	407.735,71	3.703,71	0,01%
BRASESCO FEDERAL EXTRA	573.323,91	190,21	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	418.850,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	712.814,17	56.778,18	0,10%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.233.374,01	35.717,74	0,06%
CAIXA IRF-M1 TP	812.106,65	1.329,97	0,00%
CAIXA IMA-B	2.057.521,05	52.122,25	0,09%
CAIXA MATRIZ	1.933.924,18	1.037,28	0,00%
CAIXA TP	2.459.862,79	999,65	0,00%
CAIXA IMA-GERAL	2.021.678,12	23.798,31	0,04%
CAIXA NOVO IMA-B LP	6.060.992,07	153.106,89	0,27%
CAIXA IMA-B 5	8.943.328,69	124.985,62	0,22%
DAYCOVAL IMA-B 5	184.674,76	2.616,51	0,00%
PREMIUM FIDC	219.254,96	0,00	0,00%
Carteira	56.736.713,17	645.724,92	1,14%

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	0,02
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB XI TP	0,00
BRASESCO FEDERAL EXTRA	0,00
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B	0,00
CAIXA MATRIZ	0,00
CAIXA TP	0,00
CAIXA IMA-GERAL	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	0,00
CAIXA IMA-B 5	-
DAYCOVAL IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-