

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Maio/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.207.116,26	0,69%	1,27%	53,86%
BB IPCA IV	693.423,24	0,75%	1,27%	58,94%
BB IDKA 2A	10.305.296,39	0,67%	1,27%	52,74%
BB FLUXO	165.038,20	0,12%	1,27%	9,29%
BB PERFIL	2.942.988,00	0,26%	1,27%	20,54%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.688.464,59	0,48%	1,27%	37,80%
BB IRF-M1 TP	4.876.306,59	0,18%	1,27%	13,98%
BB FLUXO	124.581,73	0,07%	1,27%	5,35%
BB XI TP	406.320,76	0,75%	1,27%	58,71%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	571.563,23	0,28%	1,27%	21,83%
CAIXA RIO BRAVO	458.000,00	-2,95%	1,27%	-231,70%
CAIXA DIVIDENDOS	725.562,16	5,95%	1,27%	467,42%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.233.471,52	0,24%	1,27%	18,76%
CAIXA IRF-M1 TP	810.577,62	0,17%	1,27%	13,38%
CAIXA IMA-B	2.049.295,90	1,04%	1,27%	81,96%
CAIXA MATRIZ	1.927.907,22	0,27%	1,27%	21,60%
CAIXA TP	2.452.251,83	0,29%	1,27%	22,54%
CAIXA IMA-GERAL	2.015.735,85	0,47%	1,27%	36,65%
CAIXA IMA-B	6.035.008,22	1,06%	1,27%	83,51%
CAIXA IMA-B 5	8.956.737,75	0,67%	1,27%	52,62%
DAYCOVAL IMA-B 5	185.131,09	0,65%	1,27%	50,89%
PREMIUM FIDC	219.608,31	-3,39%	1,27%	-266,15%
TOTAL / MÉDIA	56.050.386,46	0,59%	1,27%	46,25%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,94%	20%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,24%	20%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	18,39%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,29%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	5,25%	20%	Art. 7º, IV, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	8,36%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,70%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,22%	20%	Art. 7º, IV, a
BB XI TP	0,72%	20%	Art. 7º, I, b
BRADESCO FEDERAL EXTRA	1,02%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA RIO BRAVO	0,82%	5%	Art. 8º, IV, b
CAIXA DIVIDENDOS	1,29%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	5,77%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	1,45%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,66%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	3,44%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA TP	4,38%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IMA-GERAL	3,60%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	10,77%	20%	Art. 7º, I, b
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%
Maio	0,59%	1,27%	46,25%
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,19%	5,50%	3,50%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,19%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,5%, sendo assim o RPPS atingiu 3,5% 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	2.207.116,26	28.738,16	0,05%
BB IPCA IV	693.423,24	6.025,13	0,01%
BB IDKA 2A	10.305.296,39	129.706,91	0,23%
BB FLUXO	165.038,20	32,59	0,00%
BB PERFIL	2.942.988,00	1.073,66	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.688.464,59	63.914,77	0,11%
BB IRF-M1 TP	4.876.306,59	7.979,43	0,01%
BB FLUXO	124.581,73	24,60	0,00%
BB XI TP	406.320,76	3.531,34	0,01%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	571.563,23	155,25	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	458.000,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	725.562,16	65.180,15	0,12%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.233.471,52	34.710,16	0,06%
CAIXA IRF-M1 TP	810.577,62	1.316,81	0,00%
CAIXA IMA-B	2.049.295,90	53.597,32	0,10%
CAIXA MATRIZ	1.927.907,22	913,31	0,00%
CAIXA TP	2.452.251,83	888,52	0,00%
CAIXA IMA-GERAL	2.015.735,85	24.589,29	0,04%
CAIXA IMA-B	6.035.008,22	157.839,72	0,28%
CAIXA IMA-B 5	8.956.737,75	116.806,67	0,21%
DAYCOVAL IMA-B 5	185.131,09	2.424,10	0,00%
PREMIUM FIDC	219.608,31	0,00	0,00%
Carteira	56.050.386,46	638.042,56	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	0,01
BB IPCA IV	0,02
BB IDKA 2A	0,01
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,01
BB ALOCAÇÃO ATIVA	0,01
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB XI TP	0,02
BRADESCO FEDERAL EXTRA	0,01
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B	0,01
CAIXA MATRIZ	0,00
CAIXA TP	0,01
CAIXA IMA-GERAL	0,01
CAIXA IMA-B	0,01
CAIXA IMA-B 5	0,01
DAYCOVAL IMA-B 5	0,01
PREMIUM FIDC	-