

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Outubro / 2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.198.964,81	-1,27%	1,69%	-75,26%
BB IPCA IV	690.492,52	-0,50%	1,69%	-29,29%
BANRISUL IDKA IPCA 2A	10.298.667,25	-1,25%	1,69%	-73,96%
BB FLUXO	3.334.964,26	0,52%	1,69%	30,62%
BB PERFIL	3.011.618,36	0,44%	1,69%	26,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.584.911,43	-1,63%	1,69%	-96,01%
BB IRF-M1 TP	4.901.903,45	-0,52%	1,69%	-30,62%
BB FLUXO	184.138,14	0,46%	1,69%	27,26%
BB XI TP	404.739,11	-0,50%	1,69%	-29,28%
BB FLUXO	3.015.977,11	0,11%	1,69%	6,46%
BRASESCO FEDERAL EXTRA	583.428,85	0,51%	1,69%	30,00%
CAIXA RIO BRAVO	354.900,00	-0,82%	1,69%	-48,36%
CAIXA DIVIDENDOS	609.508,55	-4,31%	1,69%	-254,18%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.758.792,71	-0,66%	1,69%	-39,04%
CAIXA IRF-M1 TP	413.571,79	-0,54%	1,69%	-31,62%
CAIXA IMA-B	1.971.041,23	-2,56%	1,69%	-151,23%
CAIXA MATRIZ	1.970.989,58	0,46%	1,69%	27,32%
CAIXA TP	2.502.777,96	0,52%	1,69%	30,72%
CAIXA IMA-GERAL	1.982.158,83	-1,44%	1,69%	-84,75%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.809.137,56	-2,55%	1,69%	-150,74%
CAIXA IMA-B 5	8.931.896,62	-1,24%	1,69%	-73,44%
DAYCOVAL IMA-B 5	183.808,73	-1,33%	1,69%	-78,50%
PREMIUM FIDC	217.386,97	-0,17%	1,69%	-10,05%
TOTAL / MÉDIA	60.915.775,82	-0,97%	1,69%	-57,22%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,61%	20%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,13%	20%	Art. 7º, I, b
BANRISUL IDKA IPCA 2A	16,91%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	5,47%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	4,94%	20%	Art. 7º, IV, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	7,53%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,05%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,30%	20%	Art. 7º, IV, a
BB XI TP	0,66%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	4,95%	20%	Art. 7º, IV, a
BRASESCO FEDERAL EXTRA	0,96%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA RIO BRAVO	0,58%	5%	Art. 8º, IV, b
CAIXA DIVIDENDOS	1,00%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	4,53%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	0,68%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,24%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	3,24%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA TP	4,11%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IMA-GERAL	3,25%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA NOVO IMA-B LP	9,54%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	14,66%	20%	Art. 7º, I, b
DAYCOVAL IMA-B 5	0,30%	20%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,36%	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	-0,15%	1,40%	-10,34%
Agosto	-0,14%	1,31%	-10,77%
Setembro	0,43%	1,60%	26,57%
Outubro	-0,97%	1,69%	-57,22%
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,63%	13,08%	-4,79%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,63%, enquanto que a meta acumulada no período é de 13,08%, sendo assim o RPPS atingiu -4,79% 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	2.198.964,81	31.175,30	0,05%
BB IPCA IV	690.492,52	4.799,85	0,01%
BANRISUL IDKA IPCA 2A	10.298.667,25	137.555,95	0,23%
BB FLUXO	3.334.964,26	909,72	0,00%
BB PERFIL	3.011.618,36	1.123,63	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.584.911,43	62.389,23	0,10%
BB IRF-M1 TP	4.901.903,45	19.271,02	0,03%
BB FLUXO	184.138,14	50,23	0,00%
BB XI TP	404.739,11	2.813,74	0,00%
BB FLUXO	3.015.977,11	822,70	0,00%
BRASESCO FEDERAL EXTRA	583.428,85	176,15	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	354.900,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	609.508,55	54.356,22	0,09%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.758.792,71	36.396,51	0,06%
CAIXA IRF-M1 TP	413.571,79	1.616,40	0,00%
CAIXA IMA-B	1.971.041,23	54.176,04	0,09%
CAIXA MATRIZ	1.970.989,58	1.878,85	0,00%
CAIXA TP	2.502.777,96	919,20	0,00%
CAIXA IMA-GERAL	1.982.158,83	26.162,99	0,04%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.809.137,56	160.513,40	0,26%
CAIXA IMA-B 5	8.931.896,62	125.151,46	0,21%
DAYCOVAL IMA-B 5	183.808,73	2.669,29	0,00%
PREMIUM FIDC	217.386,97	0,00	0,00%
Carteira	60.915.775,82	650.614,72	1,07%

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	-
BANRISUL IDKA IPCA 2A	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,00
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB XI TP	-
BB FLUXO	-
BRASESCO FEDERAL EXTRA	0,02
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA MATRIZ	-
CAIXA TP	0,02
CAIXA IMA-GERAL	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	-
DAYCOVAL IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-