

### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Fevereiro/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	4.205.558,16	1,25%	1,22%	102,10%
BB IRF-M	1.575.553,50	0,80%	1,22%	65,37%
BB IPCA	1.804.449,78	0,91%	1,22%	74,73%
BB IMA-B 5+	3.677.255,56	1,15%	1,22%	94,12%
BB RETORNO TOTAL	3.633.102,69	0,98%	1,22%	79,78%
BB AÇÕES BOLSA	2.207.310,47	-1,65%	1,22%	-134,56%
BB AÇÕES AGRO	590.604,30	-3,21%	1,22%	-261,92%
BB TECNOLOGIA	406.551,13	-1,88%	1,22%	-153,85%
BB ENERGIA	411.206,55	-6,89%	1,22%	-562,66%
BB SMALL CAPS	461.832,98	-10,65%	1,22%	-869,51%
BB RETORNO AÇÕES	346.003,05	-8,08%	1,22%	-660,05%
BB CONSUMO	230.712,71	-9,92%	1,22%	-810,44%
BB SETOR FINANCEIRO	617.911,88	-5,50%	1,22%	-449,58%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	371.648,14	-4,30%	1,22%	-350,85%
CAIXA IRF-M	266.892,20	0,05%	1,22%	3,70%
CAIXA IRF-M1 TP	2.119.063,31	0,95%	1,22%	77,33%
CAIXA IMA-B 5+	3.333.500,59	1,13%	1,22%	92,71%
SICREDI IRF-M LP	1.644.405,89	0,86%	1,22%	70,20%
BI - MASSA FALIDA	207.002,23	0,08%	1,22%	6,78%
TOTAL / MÉDIA	28.110.565,12	-0,10%	1,22%	-8,22%

### 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	14,96%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M	5,60%	100%	Art. 7º, I, b
BB IPCA	6,42%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	13,08%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	12,92%	20%	Art. 7º, III, a
BB AÇÕES BOLSA	7,85%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,10%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,45%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,46%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,64%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,23%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,82%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,20%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,32%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	0,95%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	7,54%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	11,86%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,85%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,74%	0%	Não enquadrado

### 3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,91%	0,92%	98,20%
Fevereiro	-0,10%	1,22%	-8,22%
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,81%	2,16%	37,51%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,81%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,16%, sendo assim o RPPS atingiu 37,51% 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	4.205.558,16	121.701,23	0,43%
BB IRF-M	1.575.553,50	32.044,27	0,11%
BB IPCA	1.804.449,78	11.651,25	0,04%
BB IMA-B 5+	3.677.255,56	164.424,91	0,58%
BB RETORNO TOTAL	3.633.102,69	54.169,56	0,19%
BB AÇÕES BOLSA	2.207.310,47	210.162,32	0,75%
BB AÇÕES AGRO	590.604,30	49.157,76	0,17%
BB TECNOLOGIA	406.551,13	39.507,98	0,14%
BB ENERGIA	411.206,55	42.425,89	0,15%
BB SMALL CAPS	461.832,98	63.012,67	0,22%
BB RETORNO AÇÕES	346.003,05	40.372,32	0,14%
BB CONSUMO	230.712,71	33.677,44	0,12%
BB SETOR FINANCEIRO	617.911,88	87.959,72	0,31%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	371.648,14	63.514,53	0,23%
CAIXA IRF-M	266.892,20	5.347,11	0,02%
CAIXA IRF-M1 TP	2.119.063,31	4.135,06	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	3.333.500,59	149.260,38	0,53%
SICREDI IRF-M LP	1.644.405,89	32.476,33	0,12%
BI - MASSA FALIDA	207.002,23	0,00	0,00%
Carteira	28.110.565,12	888.162,48	3,16%

##### 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	0,00
BB IRF-M	0,00
BB IPCA	0,00
BB IMA-B 5+	0,00
BB RETORNO TOTAL	0,00
BB AÇÕES BOLSA	-
BB AÇÕES AGRO	-
BB TECNOLOGIA	-
BB ENERGIA	-
BB SMALL CAPS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB CONSUMO	-
BB SETOR FINANCEIRO	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	-
CAIXA IRF-M	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	0,00
CAIXA IMA-B 5+	0,00
SICREDI IRF-M LP	0,00
BI - MASSA FALIDA	-