

### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Março/2024				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	5.758.505,90	0,04%	0,55%	7,90%
BB IRF-M	1.829.895,45	0,49%	0,55%	88,78%
BB IMA-B 5+	5.241.113,04	-0,59%	0,55%	-106,82%
BB RETORNO TOTAL	5.165.649,09	0,77%	0,55%	139,67%
BB AÇÕES BOLSA	2.847.128,01	3,29%	0,55%	599,90%
BB AÇÕES AGRO	824.347,15	2,65%	0,55%	483,22%
BB TECNOLOGIA	695.538,19	2,87%	0,55%	523,65%
BB ENERGIA	511.108,71	-2,85%	0,55%	-518,80%
BB SMALL CAPS	579.775,44	1,78%	0,55%	324,72%
BB RETORNO AÇÕES	384.008,82	-2,45%	0,55%	-446,78%
BB CONSUMO	272.773,09	1,31%	0,55%	239,39%
BB SETOR FINANCEIRO	845.264,44	-0,13%	0,55%	-23,28%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	512.641,46	1,08%	0,55%	196,98%
BB IRF-M1 TP	149.623,67	0,59%	0,55%	107,56%
CAIXA IRF-M	517.680,40	0,15%	0,55%	27,20%
CAIXA IRF-M1 TP	771.006,91	0,80%	0,55%	145,09%
CAIXA IMA-B 5+	4.214.538,99	-0,56%	0,55%	-101,87%
CAIXA DISPONIBILIDADES	1.283.360,12	0,51%	0,55%	93,30%
SICREDI IRF-M LP	1.878.709,27	0,47%	0,55%	85,08%
BI - MASSA FALIDA	210.303,71	0,03%	0,55%	6,03%
TOTAL / MÉDIA	34.492.971,86	0,43%	0,55%	77,68%

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	16,69%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M	5,31%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	15,19%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	14,98%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	8,25%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,39%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	2,02%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,48%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,68%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,11%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,79%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,45%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,49%	20%	Art. 8º, I
BB IRF-M1 TP	0,43%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M	1,50%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	2,24%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	12,22%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA DISPONIBILIDADES	3,72%	20%	Art. 7º, III, a
SICREDI IRF-M LP	5,45%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,61%	0%	Não enquadrado

### 3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,82%	0,92%	-88,70%
Fevereiro	1,05%	1,22%	86,22%
Março	0,43%	0,55%	77,68%
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,66%	2,71%	24,16%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,66%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,71%, sendo assim o RPPS atingiu 24,16% 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	5.758.505,90	80.963,86	0,23%
BB IRF-M	1.829.895,45	15.064,07	0,04%
BB IMA-B 5+	5.241.113,04	118.792,52	0,34%
BB RETORNO TOTAL	5.165.649,09	5.229,83	0,02%
BB AÇÕES BOLSA	2.847.128,01	140.422,45	0,41%
BB AÇÕES AGRO	824.347,15	64.743,47	0,19%
BB TECNOLOGIA	695.538,19	48.045,66	0,14%
BB ENERGIA	511.108,71	33.429,16	0,10%
BB SMALL CAPS	579.775,44	54.607,93	0,16%
BB RETORNO AÇÕES	384.008,82	25.129,78	0,07%
BB CONSUMO	272.773,09	26.985,95	0,08%
BB SETOR FINANCEIRO	845.264,44	67.376,74	0,20%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	512.641,46	55.918,06	0,16%
BB IRF-M1 TP	149.623,67	129,32	0,00%
CAIXA IRF-M	517.680,40	4.262,91	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	771.006,91	630,75	0,00%
CAIXA IMA-B 5+	4.214.538,99	94.485,91	0,27%
CAIXA DISPONIBILIDADES	1.283.360,12	159,13	0,00%
SICREDI IRF-M LP	1.878.709,27	15.900,38	0,05%
BI - MASSA FALIDA	210.303,71	0,00	0,00%
Carteira	34.492.971,86	642.328,53	1,86%

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