

### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Janeiro/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	4.153.640,32	-0,05%	0,92%	-4,97%
BB IPCA	1.788.091,10	1,50%	0,92%	162,57%
BB IMA-B 5+	3.635.364,37	-1,26%	0,92%	-136,75%
BB RETORNO TOTAL	3.597.959,99	0,65%	0,92%	70,16%
BB AÇÕES BOLSA	2.244.281,89	5,92%	0,92%	641,65%
BB AÇÕES AGRO	610.170,43	0,87%	0,92%	93,79%
BB TECNOLOGIA	414.355,63	7,62%	0,92%	825,03%
BB ENERGIA	441.627,99	-0,02%	0,92%	-2,69%
BB SMALL CAPS	516.853,40	2,80%	0,92%	303,69%
BB RETORNO AÇÕES	376.421,14	6,69%	0,92%	724,43%
BB CONSUMO	256.125,59	3,16%	0,92%	342,31%
BB SETOR FINANCEIRO	639.321,05	1,25%	0,92%	135,21%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	388.328,33	6,68%	0,92%	723,60%
CAIXA IRF-M	1.516.206,22	0,95%	0,92%	102,82%
CAIXA IRF-M1 TP	2.009.188,58	1,14%	0,92%	123,47%
CAIXA IMA-B 5+	3.296.090,00	-1,28%	0,92%	-138,35%
SICREDI IRF-M LP	1.630.393,72	0,89%	0,92%	96,03%
BI - MASSA FALIDA	206.830,57	0,21%	0,92%	22,54%
BB IRF-M	213.043,60	1,45%	0,92%	157,00%
TOTAL / MÉDIA	27.934.293,92	0,91%	0,92%	98,20%

### 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	14,87%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	6,40%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	13,01%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	12,88%	20%	Art. 7º, III, a
BB AÇÕES BOLSA	8,03%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,18%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,48%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,58%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,85%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,35%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,92%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,29%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,39%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	5,43%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	7,19%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	11,80%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,84%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,74%	0%	-
BB IRF-M	0,76%	100%	Art. 7º, I, b

### 3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,91%	0,92%	98,20%
Fevereiro			
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,91%	0,92%	98,20%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,91%, enquanto que a meta acumulada no período é de 0,92%, sendo assim o RPPS atingiu 98,2% 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	4.153.640,32	118.531,36	0,42%
BB IPCA	1.788.091,10	12.305,35	0,04%
BB IMA-B 5+	3.635.364,37	159.182,13	0,57%
BB RETORNO TOTAL	3.597.959,99	52.842,19	0,19%
BB AÇÕES BOLSA	2.244.281,89	237.082,66	0,85%
BB AÇÕES AGRO	610.170,43	52.857,98	0,19%
BB TECNOLOGIA	414.355,63	41.253,65	0,15%
BB ENERGIA	441.627,99	48.375,82	0,17%
BB SMALL CAPS	516.853,40	75.050,33	0,27%
BB RETORNO AÇÕES	376.421,14	46.714,10	0,17%
BB CONSUMO	256.125,59	39.023,43	0,14%
BB SETOR FINANCEIRO	639.321,05	94.212,78	0,34%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	388.328,33	69.788,99	0,25%
CAIXA IRF-M	1.516.206,22	30.286,77	0,11%
CAIXA IRF-M1 TP	2.009.188,58	3.064,75	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	3.296.090,00	144.249,31	0,52%
SICREDI IRF-M LP	1.630.393,72	32.360,06	0,12%
BI - MASSA FALIDA	206.830,57	0,00	0,00%
BB IRF-M	213.043,60	4.320,98	0,02%
Carteira	27.934.293,92	920.310,89	3,29%

##### 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 IPCA	0,02
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	-
CAIXA IRF-M	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	0,00
CAIXA IMA-B 5+	-
SICREDI IRF-M LP	0,00
BI - MASSA FALIDA	-
BB IRF-M	0,00