

### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Janeiro/2024				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	5.726.327,16	-0,46%	0,92%	-50,21%
BB IRF-M	2.843.879,09	0,65%	0,92%	70,72%
BB IMA-B 5+	5.246.374,36	-1,44%	0,92%	-156,38%
BB RETORNO TOTAL	5.087.002,59	0,84%	0,92%	91,26%
BB AÇÕES BOLSA	2.618.645,10	1,67%	0,92%	181,75%
BB AÇÕES AGRO	798.283,25	-5,16%	0,92%	-561,15%
BB TECNOLOGIA	622.314,08	3,80%	0,92%	412,72%
BB ENERGIA	524.614,89	-4,52%	0,92%	-491,35%
BB SMALL CAPS	563.108,91	-7,07%	0,92%	-768,02%
BB RETORNO AÇÕES	391.717,84	-5,18%	0,92%	-562,82%
BB CONSUMO	269.252,77	-8,21%	0,92%	-891,89%
BB SETOR FINANCEIRO	844.383,41	-5,05%	0,92%	-549,02%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	501.507,27	-8,56%	0,92%	-930,06%
BB IRF-M1 TP	46.804,04	0,80%	0,92%	86,76%
CAIXA IRF-M	240,66	0,67%	0,92%	72,72%
CAIXA IRF-M1 TP	550.017,87	0,91%	0,92%	99,08%
CAIXA IMA-B 5+	4.665.980,39	-1,46%	0,92%	-158,35%
SICREDI IRF-M LP	1.890.573,73	0,73%	0,92%	79,05%
BI - MASSA FALIDA	210.217,52	0,09%	0,92%	9,51%
TOTAL / MÉDIA	33.401.244,93	-0,82%	0,92%	-88,70%

### 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	17,14%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M	8,51%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	15,71%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	15,23%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	7,84%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,39%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,86%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,57%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,69%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,17%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,81%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,53%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,50%	20%	Art. 8º, I
BB IRF-M1 TP	0,14%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	1,65%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	13,97%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,66%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,63%	0%	Não enquadrado

### 3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,82%	0,92%	-88,70%
Fevereiro			
Março			
Abril			
Mai			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,82%	0,92%	-88,70%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,82%, enquanto que a meta acumulada no período é de 0,92%, sendo assim o RPPS atingiu -88,7% 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	5.726.327,16	125.577,44	0,38%
BB IRF-M	2.843.879,09	33.478,18	0,10%
BB IMA-B 5+	5.246.374,36	180.731,40	0,54%
BB RETORNO TOTAL	5.087.002,59	8.326,82	0,02%
BB AÇÕES BOLSA	2.618.645,10	148.449,41	0,44%
BB AÇÕES AGRO	798.283,25	65.739,55	0,20%
BB TECNOLOGIA	622.314,08	44.239,48	0,13%
BB ENERGIA	524.614,89	40.674,57	0,12%
BB SMALL CAPS	563.108,91	62.109,33	0,19%
BB RETORNO AÇÕES	391.717,84	28.012,26	0,08%
BB CONSUMO	269.252,77	30.089,08	0,09%
BB SETOR FINANCEIRO	844.383,41	71.468,56	0,21%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	501.507,27	66.398,97	0,20%
BB IRF-M1 TP	46.804,04	42,18	0,00%
CAIXA IRF-M	240,66	2,84	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	550.017,87	472,98	0,00%
CAIXA IMA-B 5+	4.665.980,39	158.794,10	0,48%
SICREDI IRF-M LP	1.890.573,73	23.871,53	0,07%
BI - MASSA FALIDA	210.217,52	0,00	0,00%
Carteira	33.401.244,93	875.471,34	2,62%

##### 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+	-
SICREDI IRF-M LP	-
BI - MASSA FALIDA	-