

### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Abril/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	4.401.790,35	2,01%	0,99%	202,54%
BB IRF-M	1.626.299,22	1,08%	0,99%	108,25%
BB IPCA	1.843.178,48	0,95%	0,99%	95,71%
BB IMA-B 5+	3.924.967,12	3,00%	0,99%	301,92%
BB RETORNO TOTAL	3.748.298,95	1,27%	0,99%	127,89%
BB AÇÕES BOLSA	2.313.114,35	1,18%	0,99%	118,80%
BB AÇÕES AGRO	559.659,55	-0,47%	0,99%	-47,39%
BB TECNOLOGIA	436.845,66	-1,82%	0,99%	-183,40%
BB ENERGIA	457.466,75	6,01%	0,99%	604,81%
BB SMALL CAPS	460.609,98	1,87%	0,99%	188,22%
BB RETORNO AÇÕES	330.987,71	0,68%	0,99%	68,29%
BB CONSUMO	216.616,60	0,30%	0,99%	30,38%
BB SETOR FINANCEIRO	655.374,44	7,67%	0,99%	771,99%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	393.317,20	6,53%	0,99%	657,66%
CAIXA IRF-M	1.295.459,25	1,08%	0,99%	108,66%
CAIXA IRF-M1 TP	86.331,62	0,41%	0,99%	41,02%
CAIXA IMA-B 5+	3.558.197,13	2,97%	0,99%	299,41%
SICREDI IRF-M LP	1.697.694,41	1,36%	0,99%	136,72%
BI - MASSA FALIDA	207.667,74	0,08%	0,99%	8,26%
TOTAL / MÉDIA	28.213.876,51	1,91%	0,99%	192,77%

### 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	15,60%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M	5,76%	100%	Art. 7º, I, b
BB IPCA	6,53%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	13,91%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	13,29%	20%	Art. 7º, III, a
BB AÇÕES BOLSA	8,20%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	1,98%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,55%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,62%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,63%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,17%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,77%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,32%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,39%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	4,59%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	0,31%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	12,61%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	6,02%	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	2,04%	1,09%	186,81%
Abril	1,91%	0,99%	192,77%
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	4,84%	4,29%	112,70%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 4,84%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,29%, sendo assim o RPPS atingiu 112,7% 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	4.401.790,35	98.604,69	0,35%
BB IRF-M	1.626.299,22	24.716,27	0,09%
BB IPCA	1.843.178,48	8.023,47	0,03%
BB IMA-B 5+	3.924.967,12	137.997,93	0,49%
BB RETORNO TOTAL	3.748.298,95	42.201,66	0,15%
BB AÇÕES BOLSA	2.313.114,35	167.409,88	0,59%
BB AÇÕES AGRO	559.659,55	41.957,10	0,15%
BB TECNOLOGIA	436.845,66	34.498,05	0,12%
BB ENERGIA	457.466,75	38.327,90	0,14%
BB SMALL CAPS	460.609,98	55.734,24	0,20%
BB RETORNO AÇÕES	330.987,71	30.548,83	0,11%
BB CONSUMO	216.616,60	29.029,09	0,10%
BB SETOR FINANCEIRO	655.374,44	81.917,27	0,29%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	393.317,20	58.714,26	0,21%
CAIXA IRF-M	1.295.459,25	19.558,86	0,07%
CAIXA IRF-M1 TP	86.331,62	188,63	0,00%
CAIXA IMA-B 5+	3.558.197,13	125.416,85	0,44%
SICREDI IRF-M LP	1.697.694,41	24.572,34	0,09%
BI - MASSA FALIDA	207.667,74	0,00	0,00%
Carteira	28.213.876,51	728.786,87	2,58%

##### 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	0,01
BB IRF-M	0,01
BB IPCA	0,00
BB IMA-B 5+	0,02
BB RETORNO TOTAL	0,01
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	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B 5+	0,02
SICREDI IRF-M LP	0,01
BI - MASSA FALIDA	-