

### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Setembro/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	5.303.768,71	-0,97%	0,64%	-151,63%
BB IRF-M	2.420.783,45	0,14%	0,64%	21,75%
BB IMA-B 5+	4.815.750,13	-1,96%	0,64%	-304,58%
BB RETORNO TOTAL	4.804.336,09	0,88%	0,64%	136,80%
BB AÇÕES BOLSA	2.409.520,90	-4,67%	0,64%	-727,40%
BB AÇÕES AGRO	786.367,97	2,38%	0,64%	370,63%
BB TECNOLOGIA	533.041,39	-3,36%	0,64%	-522,95%
BB ENERGIA	482.310,36	0,14%	0,64%	22,43%
BB SMALL CAPS	549.558,00	-3,74%	0,64%	-582,55%
BB RETORNO AÇÕES	364.635,31	0,87%	0,64%	135,35%
BB CONSUMO	261.648,89	-4,07%	0,64%	-633,36%
BB SETOR FINANCEIRO	721.495,02	-1,72%	0,64%	-267,16%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	469.488,15	-3,33%	0,64%	-519,18%
CAIXA IRF-M	229,14	0,14%	0,64%	22,46%
CAIXA IRF-M1 TP	1.384.588,67	0,34%	0,64%	52,81%
CAIXA IMA-B 5+	4.450.164,74	-1,86%	0,64%	-288,99%
SICREDI IRF-M LP	1.798.852,61	0,14%	0,64%	21,76%
BI - MASSA FALIDA	209.505,14	0,11%	0,64%	17,60%
TOTAL / MÉDIA	31.766.044,67	-1,11%	0,64%	-172,50%

### 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	16,70%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M	7,62%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	15,16%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	15,12%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	7,59%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,48%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,68%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,52%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,73%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,15%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,82%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,27%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,48%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	4,36%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	14,01%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,66%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,66%	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	1,90%	0,99%	190,76%
Mai	3,20%	0,61%	523,45%
Junho	3,35%	0,30%	### ##
Julho	1,23%	0,50%	245,07%
Agosto	-0,96%	0,61%	-157,01%
Setembro	-1,11%	0,64%	-172,50%
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	10,85%	7,10%	152,86%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 10,85%, enquanto que a meta acumulada no período é de 7,1%, sendo assim o RPPS atingiu 152,86% 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	5.303.768,71	105.173,48	0,33%
BB IRF-M	2.420.783,45	24.540,97	0,08%
BB IMA-B 5+	4.815.750,13	146.075,10	0,46%
BB RETORNO TOTAL	4.804.336,09	27.243,10	0,09%
BB AÇÕES BOLSA	2.409.520,90	125.709,81	0,40%
BB AÇÕES AGRO	786.367,97	55.320,47	0,17%
BB TECNOLOGIA	533.041,39	44.956,09	0,14%
BB ENERGIA	482.310,36	33.560,36	0,11%
BB SMALL CAPS	549.558,00	53.534,16	0,17%
BB RETORNO AÇÕES	364.635,31	27.392,95	0,09%
BB CONSUMO	261.648,89	24.309,83	0,08%
BB SETOR FINANCEIRO	721.495,02	61.577,69	0,19%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	469.488,15	52.739,95	0,17%
CAIXA IRF-M	229,14	2,32	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	1.384.588,67	1.799,77	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	4.450.164,74	131.561,77	0,41%
SICREDI IRF-M LP	1.798.852,61	19.554,89	0,06%
BI - MASSA FALIDA	209.505,14	0,00	0,00%
Carteira	31.766.044,67	697.871,67	2,20%

##### 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	-
CAIXA IRF-M	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B 5+	-
SICREDI IRF-M LP	-
BI - MASSA FALIDA	-