

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Novembro/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	5.404.556,04	2,60%	0,66%	392,10%
BB IRF-M1 TP	2.489.170,66	2,46%	0,66%	371,97%
BB IMA-B 5+	4.929.188,05	3,38%	0,66%	510,02%
BB RETORNO TOTAL	4.898.186,25	1,09%	0,66%	165,12%
BB AÇÕES BOLSA	2.571.470,17	8,63%	0,66%	1303,73%
BB AÇÕES AGRO	808.502,27	9,80%	0,66%	1479,97%
BB TECNOLOGIA	578.240,45	10,53%	0,66%	1590,22%
BB ENERGIA	516.969,58	10,06%	0,66%	1519,92%
BB SMALL CAPS	564.640,44	12,36%	0,66%	1866,07%
BB RETORNO AÇÕES	391.204,64	10,99%	0,66%	1659,25%
BB CONSUMO	276.572,58	16,01%	0,66%	2418,49%
BB SETOR FINANCEIRO	828.559,35	15,96%	0,66%	2410,38%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	505.727,86	14,74%	0,66%	2225,77%
CAIXA IRF-M	235,62	2,47%	0,66%	373,06%
CAIXA IRF-M1 TP	1.810.973,70	0,60%	0,66%	91,08%
CAIXA IMA-B 5+	4.555.854,41	3,37%	0,66%	508,87%
SICREDI IRF-M LP	1.849.836,62	2,61%	0,66%	394,66%
BI - MASSA FALIDA	209.888,91	0,08%	0,66%	11,70%
TOTAL / MÉDIA	33.189.777,60	4,12%	0,66%	622,60%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	16,28%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M1 TP	7,50%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	14,85%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	14,76%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	7,75%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,44%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,74%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,56%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,70%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,18%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,83%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,50%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,52%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	5,46%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	13,73%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,57%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,63%	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%	1115,18%
Julho	1,23%	0,50%	245,07%
Agosto	-0,96%	0,61%	-157,01%
Setembro	-1,11%	0,64%	-172,50%
Outubro	-1,03%	0,62%	-165,95%
Novembro	4,12%	0,66%	622,60%
Dezembro			
Acumulado	14,23%	8,48%	167,83%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 14,23%, enquanto que a meta acumulada no período é de 8,48%, sendo assim o RPPS atingiu 167,83% 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	5.404.556,04	119.672,67	0,36%
BB IRF-M1 TP	2.489.170,66	3.004,47	0,01%
BB IMA-B 5+	4.929.188,05	169.123,54	0,51%
BB RETORNO TOTAL	4.898.186,25	10.098,77	0,03%
BB AÇÕES BOLSA	2.571.470,17	145.070,95	0,44%
BB AÇÕES AGRO	808.502,27	62.780,56	0,19%
BB TECNOLOGIA	578.240,45	43.447,81	0,13%
BB ENERGIA	516.969,58	39.956,56	0,12%
BB SMALL CAPS	564.640,44	61.091,21	0,18%
BB RETORNO AÇÕES	391.204,64	29.353,15	0,09%
BB CONSUMO	276.572,58	29.626,44	0,09%
BB SETOR FINANCEIRO	828.559,35	75.461,51	0,23%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	505.727,86	67.060,20	0,20%
CAIXA IRF-M	235,62	2,93	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	1.810.973,70	2.192,46	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	4.555.854,41	154.281,46	0,46%
SICREDI IRF-M LP	1.849.836,62	25.129,29	0,08%
BI - MASSA FALIDA	209.888,91	0,00	0,00%
Carteira	33.189.777,60	821.546,58	2,48%

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	0,02
BB IRF-M1 TP	0,01
BB IMA-B 5+	0,01
BB RETORNO TOTAL	0,02
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	0,03
CAIXA IRF-M1 TP	0,02
CAIXA IMA-B 5+	0,01
SICREDI IRF-M LP	0,03
BI - MASSA FALIDA	-