

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Junho/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	5.038.499,11	2,39%	0,30%	793,37%
BB IRF-M	2.211.907,99	2,09%	0,30%	695,78%
BB IMA-B 5+	4.639.994,99	3,31%	0,30%	1099,44%
BB RETORNO TOTAL	4.298.009,13	1,80%	0,30%	599,83%
BB AÇÕES BOLSA	2.465.570,73	5,19%	0,30%	1724,87%
BB AÇÕES AGRO	714.781,04	5,85%	0,30%	1945,90%
BB TECNOLOGIA	513.087,51	4,34%	0,30%	1444,10%
BB ENERGIA	515.153,57	9,24%	0,30%	3071,64%
BB SMALL CAPS	576.912,42	9,13%	0,30%	3036,21%
BB RETORNO AÇÕES	362.525,89	7,40%	0,30%	2459,18%
BB CONSUMO	282.646,11	9,10%	0,30%	3025,12%
BB SETOR FINANCEIRO	776.976,29	9,96%	0,30%	3312,09%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	501.313,31	9,42%	0,30%	3131,82%
CAIXA IRF-M	178.624,38	0,36%	0,30%	118,71%
CAIXA IRF-M1 TP	624.588,51	1,24%	0,30%	411,17%
CAIXA IMA-B 5+	4.679.603,10	3,08%	0,30%	1022,47%
SICREDI IRF-M LP	1.766.130,19	2,11%	0,30%	700,68%
BI - MASSA FALIDA	208.488,00	0,18%	0,30%	59,81%
TOTAL / MÉDIA	30.354.812,27	3,35%	0,30%	1115,18%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	16,60%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M	7,29%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	15,29%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	14,16%	20%	Art. 7º, III, a
BB AÇÕES BOLSA	8,12%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,35%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,69%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,70%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,90%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,19%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,93%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,56%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,65%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	0,59%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	2,06%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	15,42%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,82%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,69%	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%
Maior	3,20%	0,61%	523,45%
Junho	3,35%	0,30%	###
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	11,81%	5,24%	225,28%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 11,81%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,24%, sendo assim o RPPS atingiu 225,28% 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	5.038.499,11	94.339,82	0,31%
BB IRF-M	2.211.907,99	25.741,09	0,08%
BB IMA-B 5+	4.639.994,99	134.283,95	0,44%
BB RETORNO TOTAL	4.298.009,13	39.118,54	0,13%
BB AÇÕES BOLSA	2.465.570,73	157.631,10	0,52%
BB AÇÕES AGRO	714.781,04	53.188,24	0,18%
BB TECNOLOGIA	513.087,51	42.667,70	0,14%
BB ENERGIA	515.153,57	41.295,42	0,14%
BB SMALL CAPS	576.912,42	66.873,45	0,22%
BB RETORNO AÇÕES	362.525,89	31.237,28	0,10%
BB CONSUMO	282.646,11	34.965,31	0,12%
BB SETOR FINANCEIRO	776.976,29	83.088,22	0,27%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	501.313,31	66.774,14	0,22%
CAIXA IRF-M	178.624,38	2.081,00	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	624.588,51	1.215,29	0,00%
CAIXA IMA-B 5+	4.679.603,10	133.814,30	0,44%
SICREDI IRF-M LP	1.766.130,19	20.048,55	0,07%
BI - MASSA FALIDA	208.488,00	0,00	0,00%
Carteira	30.354.812,27	727.862,73	2,40%

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