

1. RENTABILIDADE MÉDIA

| Outubro/ 2023 | | | | |
|---------------------|---------------|---------------|-------|-----------|
| Nome do Fundo | Aplicação | Rentabilidade | Meta | % Meta |
| BB IMA-B | 5.267.790,93 | -0,68% | 0,62% | -109,06% |
| BB IRF-M | 2.429.336,56 | 0,35% | 0,62% | 56,80% |
| BB IMA-B 5+ | 4.768.164,97 | -0,99% | 0,62% | -158,86% |
| BB RETORNO TOTAL | 4.845.212,37 | 0,85% | 0,62% | 136,79% |
| BB AÇÕES BOLSA | 2.367.125,78 | -1,76% | 0,62% | -282,88% |
| BB AÇÕES AGRO | 736.343,85 | -6,36% | 0,62% | -1022,75% |
| BB TECNOLOGIA | 523.154,69 | -1,85% | 0,62% | -298,20% |
| BB ENERGIA | 454.251,58 | -5,82% | 0,62% | -935,31% |
| BB SMALL CAPS | 502.545,49 | -8,55% | 0,62% | -1375,36% |
| BB RETORNO AÇÕES | 352.479,04 | -3,33% | 0,62% | -535,99% |
| BB CONSUMO | 238.396,15 | -8,89% | 0,62% | -1428,80% |
| BB SETOR FINANCEIRO | 714.520,44 | -3,04% | 0,62% | -489,16% |
| BB CONSTRUÇÃO CIVIL | 440.768,30 | -6,12% | 0,62% | -983,50% |
| CAIXA IRF-M | 229,94 | 0,35% | 0,62% | 56,13% |
| CAIXA IRF-M1 TP | 1.700.117,59 | 0,33% | 0,62% | 52,46% |
| CAIXA IMA-B 5+ | 4.407.351,85 | -0,96% | 0,62% | -154,67% |
| SICREDI IRF-M LP | 1.816.667,16 | 0,99% | 0,62% | 159,22% |
| BI - MASSA FALIDA | 209.726,37 | 0,11% | 0,62% | 16,98% |
| TOTAL / MÉDIA | 31.774.183,06 | -0,99% | 0,62% | -158,97% |

2. ENQUADRAMENTO

| Nome do Fundo | % PL do RPPS | % Resolução | Enquadramento |
|---------------------|--------------|-------------|-----------------|
| BB IMA-B | 16,58% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB IRF-M | 7,65% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB IMA-B 5+ | 15,01% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB RETORNO TOTAL | 15,25% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB AÇÕES BOLSA | 7,45% | 20% | Art. 8º, I |
| BB AÇÕES AGRO | 2,32% | 20% | Art. 8º, I |
| BB TECNOLOGIA | 1,65% | 20% | Art. 8º, I |
| BB ENERGIA | 1,43% | 20% | Art. 8º, I |
| BB SMALL CAPS | 1,58% | 20% | Art. 8º, I |
| BB RETORNO AÇÕES | 1,11% | 20% | Art. 8º, I |
| BB CONSUMO | 0,75% | 20% | Art. 8º, I |
| BB SETOR FINANCEIRO | 2,25% | 20% | Art. 8º, I |
| BB CONSTRUÇÃO CIVIL | 1,39% | 20% | Art. 8º, I |
| CAIXA IRF-M | 0,00% | 100% | Art. 7º, I, b |
| CAIXA IRF-M1 TP | 5,35% | 100% | Art. 7º, I, b |
| CAIXA IMA-B 5+ | 13,87% | 100% | Art. 7º, I, b |
| SICREDI IRF-M LP | 5,72% | 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 | -0,99% | 0,62% | -158,97% |
| Novembro | | | |
| Dezembro | | | |
| Acumulado | 9,76% | 7,77% | 125,63% |

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 9,76%, enquanto que a meta acumulada no período é de 7,77%, sendo assim o RPPS atingiu 125,63% 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 | 5.267.790,93 | 117.455,46 | 0,37% |
| BB IRF-M | 2.429.336,56 | 29.302,35 | 0,09% |
| BB IMA-B 5+ | 4.768.164,97 | 162.904,59 | 0,51% |
| BB RETORNO TOTAL | 4.845.212,37 | 21.250,38 | 0,07% |
| BB AÇÕES BOLSA | 2.367.125,78 | 133.304,41 | 0,42% |
| BB AÇÕES AGRO | 736.343,85 | 53.997,00 | 0,17% |
| BB TECNOLOGIA | 523.154,69 | 40.124,54 | 0,13% |
| BB ENERGIA | 454.251,58 | 33.587,59 | 0,11% |
| BB SMALL CAPS | 502.545,49 | 51.943,93 | 0,16% |
| BB RETORNO AÇÕES | 352.479,04 | 26.266,78 | 0,08% |
| BB CONSUMO | 238.396,15 | 23.324,98 | 0,07% |
| BB SETOR FINANCEIRO | 714.520,44 | 61.769,60 | 0,19% |
| BB CONSTRUÇÃO CIVIL | 440.768,30 | 56.973,23 | 0,18% |
| CAIXA IRF-M | 229,94 | 2,78 | 0,00% |
| CAIXA IRF-M1 TP | 1.700.117,59 | 2.267,57 | 0,01% |
| CAIXA IMA-B 5+ | 4.407.351,85 | 148.263,58 | 0,47% |
| SICREDI IRF-M LP | 1.816.667,16 | 23.805,40 | 0,07% |
| BI - MASSA FALIDA | 209.726,37 | 0,00 | 0,00% |
| Carteira | 31.774.183,06 | 752.547,50 | 2,37% |

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 | - |