

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Julho/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	5.380.350,95	0,78%	0,50%	156,31%
BB IRF-M	2.400.025,31	0,76%	0,50%	151,66%
BB IMA-B 5+	4.975.857,19	0,73%	0,50%	144,75%
BB RETORNO TOTAL	4.713.529,35	0,76%	0,50%	151,39%
BB AÇÕES BOLSA	2.546.542,97	3,28%	0,50%	654,81%
BB AÇÕES AGRO	795.195,60	3,98%	0,50%	792,95%
BB TECNOLOGIA	525.583,42	2,44%	0,50%	485,60%
BB ENERGIA	511.083,35	-0,79%	0,50%	-157,54%
BB SMALL CAPS	597.781,64	3,62%	0,50%	721,27%
BB RETORNO AÇÕES	378.953,30	4,53%	0,50%	903,50%
BB CONSUMO	304.540,80	2,16%	0,50%	431,26%
BB SETOR FINANCEIRO	786.990,50	1,29%	0,50%	256,99%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	526.600,30	5,04%	0,50%	1005,74%
CAIXA IRF-M	180.200,68	0,88%	0,50%	175,95%
CAIXA IRF-M1 TP	983.558,31	0,92%	0,50%	183,51%
CAIXA IMA-B 5+	4.714.122,66	0,74%	0,50%	147,08%
SICREDI IRF-M LP	1.782.858,68	0,95%	0,50%	188,86%
BI - MASSA FALIDA	208.817,62	0,16%	0,50%	31,52%
TOTAL / MÉDIA	32.312.592,63	1,23%	0,50%	245,07%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	16,65%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M	7,43%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	15,40%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	14,59%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	7,88%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,46%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,63%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,58%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,85%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,17%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,94%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,44%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,63%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	0,56%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	3,04%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	14,59%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,52%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,65%	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			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	13,18%	5,77%	228,49%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 13,18%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,77%, sendo assim o RPPS atingiu 228,49% 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	5.380.350,95	91.974,43	0,28%
BB IRF-M	2.400.025,31	25.391,90	0,08%
BB IMA-B 5+	4.975.857,19	128.469,36	0,40%
BB RETORNO TOTAL	4.713.529,35	36.882,95	0,11%
BB AÇÕES BOLSA	2.546.542,97	142.475,93	0,44%
BB AÇÕES AGRO	795.195,60	59.993,59	0,19%
BB TECNOLOGIA	525.583,42	42.368,67	0,13%
BB ENERGIA	511.083,35	37.243,56	0,12%
BB SMALL CAPS	597.781,64	67.518,34	0,21%
BB RETORNO AÇÕES	378.953,30	32.513,12	0,10%
BB CONSUMO	304.540,80	35.344,59	0,11%
BB SETOR FINANCEIRO	786.990,50	77.418,64	0,24%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	526.600,30	67.018,35	0,21%
CAIXA IRF-M	180.200,68	1.911,89	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	983.558,31	1.557,61	0,00%
CAIXA IMA-B 5+	4.714.122,66	118.741,69	0,37%
SICREDI IRF-M LP	1.782.858,68	18.893,98	0,06%
BI - MASSA FALIDA	208.817,62	0,00	0,00%
Carteira	32.312.592,63	675.452,99	2,09%

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	-