

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Dezembro/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	5.552.910,69	2,74%	0,94%	291,03%
BB IRF-M	2.525.488,16	1,46%	0,94%	154,69%
BB IMA-B 5+	5.122.981,50	3,93%	0,94%	416,83%
BB RETORNO TOTAL	4.944.633,49	0,95%	0,94%	100,53%
BB AÇÕES BOLSA	2.575.563,70	4,83%	0,94%	511,63%
BB AÇÕES AGRO	841.755,16	4,11%	0,94%	436,05%
BB TECNOLOGIA	599.541,29	3,68%	0,94%	390,55%
BB ENERGIA	549.461,47	6,29%	0,94%	666,35%
BB SMALL CAPS	605.938,44	7,31%	0,94%	775,44%
BB RETORNO AÇÕES	413.116,15	5,60%	0,94%	593,83%
BB CONSUMO	293.330,08	6,06%	0,94%	642,38%
BB SETOR FINANCEIRO	889.318,47	7,33%	0,94%	777,46%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	548.452,67	8,45%	0,94%	895,68%
BB IRF-M1 TP	30.986,04	0,30%	0,94%	31,43%
CAIXA IRF-M	239,06	1,46%	0,94%	154,79%
CAIXA IRF-M1 TP	545.047,68	0,31%	0,94%	32,73%
CAIXA IMA-B 5+	4.734.984,07	3,93%	0,94%	416,86%
SICREDI IRF-M LP	1.876.919,47	1,46%	0,94%	155,22%
BI - MASSA FALIDA	210.033,74	0,07%	0,94%	7,32%
TOTAL / MÉDIA	32.860.701,33	3,11%	0,94%	329,51%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	16,90%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M	7,69%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	15,59%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	15,05%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	7,84%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,56%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,82%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,67%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,84%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,26%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,89%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,71%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,67%	20%	Art. 8º, I
BB IRF-M1 TP	0,09%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	1,66%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	14,41%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,71%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,64%	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%
Maio	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	-1,03%	0,62%	-165,95%
Novembro	4,12%	0,66%	622,60%
Dezembro	3,11%	0,94%	329,51%
Acumulado	17,78%	9,50%	187,12%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 17,78%, enquanto que a meta acumulada no período é de 9,5%, sendo assim o RPPS atingiu 187,12% 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	5.552.910,69	126.201,96	0,38%
BB IRF-M	2.525.488,16	31.122,53	0,09%
BB IMA-B 5+	5.122.981,50	181.626,99	0,55%
BB RETORNO TOTAL	4.944.633,49	8.157,56	0,02%
BB AÇÕES BOLSA	2.575.563,70	147.499,47	0,45%
BB AÇÕES AGRO	841.755,16	66.517,91	0,20%
BB TECNOLOGIA	599.541,29	42.485,98	0,13%
BB ENERGIA	549.461,47	42.535,79	0,13%
BB SMALL CAPS	605.938,44	66.272,69	0,20%
BB RETORNO AÇÕES	413.116,15	30.688,02	0,09%
BB CONSUMO	293.330,08	32.352,94	0,10%
BB SETOR FINANCEIRO	889.318,47	78.596,59	0,24%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	548.452,67	73.740,30	0,22%
BB IRF-M1 TP	30.986,04	24,79	0,00%
CAIXA IRF-M	239,06	2,95	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	545.047,68	435,30	0,00%
CAIXA IMA-B 5+	4.734.984,07	165.827,55	0,50%
SICREDI IRF-M LP	1.876.919,47	25.188,17	0,08%
BI - MASSA FALIDA	210.033,74	0,00	0,00%
Carteira	32.860.701,33	906.780,62	2,76%

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	0,19
BB IRF-M	0,13
BB IMA-B 5+	0,19
BB RETORNO TOTAL	0,13
BB AÇÕES BOLSA	-
BB AÇÕES AGRO	-
BB TECNOLOGIA	-
BB ENERGIA	-
BB SMALL CAPS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB CONSUMO	-
BB SETOR FINANCEIRO	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	-
BB IRF-M1 TP	-
CAIXA IRF-M	0,13
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B 5+	0,19
SICREDI IRF-M LP	0,12
BI - MASSA FALIDA	-