

## 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Fevereiro/2024				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	5.756.011,51	0,52%	1,22%	42,44%
BB IRF-M	1.751.021,89	0,25%	1,22%	20,56%
BB IMA-B 5+	5.272.023,58	0,49%	1,22%	40,02%
BB RETORNO TOTAL	5.126.349,11	0,77%	1,22%	63,32%
BB AÇÕES BOLSA	2.756.367,50	5,26%	1,22%	430,56%
BB AÇÕES AGRO	803.047,64	0,60%	1,22%	48,86%
BB TECNOLOGIA	676.105,10	8,64%	1,22%	707,64%
BB ENERGIA	526.089,83	0,28%	1,22%	23,02%
BB SMALL CAPS	569.622,63	1,16%	1,22%	94,70%
BB RETORNO AÇÕES	393.662,62	0,50%	1,22%	40,65%
BB CONSUMO	269.235,42	-0,01%	1,22%	-0,53%
BB SETOR FINANCEIRO	846.346,03	0,23%	1,22%	19,03%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	507.157,95	1,13%	1,22%	92,24%
BB IRF-M1 TP	62.678,66	0,69%	1,22%	56,21%
CAIXA IRF-M	241,71	0,44%	1,22%	35,72%
CAIXA IRF-M1 TP	854.204,17	0,61%	1,22%	50,01%
CAIXA IMA-B 5+	4.238.236,43	0,48%	1,22%	39,05%
CAIXA DISPONIBILIDADES	1.570.739,07	0,19%	1,22%	15,54%
SICREDI IRF-M LP	1.899.341,21	0,46%	1,22%	37,97%
BI - MASSA FALIDA	210.234,12	0,01%	1,22%	0,65%
TOTAL / MÉDIA	34.088.716,18	1,05%	1,22%	86,22%

## 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	16,89%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M	5,14%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	15,47%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	15,04%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	8,09%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,36%	#N/D	#N/D
BB TECNOLOGIA	1,98%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,54%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,67%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,15%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,79%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,48%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,49%	20%	Art. 8º, I
BB IRF-M1 TP	0,18%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	2,51%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	12,43%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA DISPONIBILIDADES	4,61%	20%	Art. 7º, III, a
SICREDI IRF-M LP	5,57%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,62%	0%	Não enquadrado

## 3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,82%	0,92%	-88,70%
Fevereiro	1,05%	1,22%	86,22%
Março			
Abril			
Maió			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,23%	2,15%	10,60%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,23%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,15%, sendo assim o RPPS atingiu 10,6% 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	5.756.011,51	102.739,52	0,30%
BB IRF-M	1.751.021,89	18.554,83	0,05%
BB IMA-B 5+	5.272.023,58	148.624,00	0,44%
BB RETORNO TOTAL	5.126.349,11	7.461,36	0,02%
BB AÇÕES BOLSA	2.756.367,50	150.978,56	0,44%
BB AÇÕES AGRO	803.047,64	67.662,23	0,20%
BB TECNOLOGIA	676.105,10	49.673,95	0,15%
BB ENERGIA	526.089,83	38.971,89	0,11%
BB SMALL CAPS	569.622,63	60.666,53	0,18%
BB RETORNO AÇÕES	393.662,62	26.839,20	0,08%
BB CONSUMO	269.235,42	29.714,08	0,09%
BB SETOR FINANCEIRO	846.346,03	72.144,43	0,21%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	507.157,95	64.063,56	0,19%
BB IRF-M1 TP	62.678,66	58,14	0,00%
CAIXA IRF-M	241,71	2,57	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	854.204,17	759,58	0,00%
CAIXA IMA-B 5+	4.238.236,43	118.684,20	0,35%
CAIXA DISPONIBILIDADES	1.570.739,07	218,35	0,00%
SICREDI IRF-M LP	1.899.341,21	21.379,34	0,06%
BI - MASSA FALIDA	210.234,12	0,00	0,00%
Carteira	34.088.716,18	744.110,05	2,18%

#### 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	#N/D
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	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B 5+	-
CAIXA DISPONIBILIDADES	-
SICREDI IRF-M LP	-
BI - MASSA FALIDA	-