

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Agosto/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	5.355.912,72	-0,45%	0,61%	-74,22%
BB IRF-M	2.417.407,57	0,72%	0,61%	118,35%
BB IMA-B 5+	4.911.804,52	-1,29%	0,61%	-210,35%
BB RETORNO TOTAL	4.762.505,50	1,04%	0,61%	169,79%
BB AÇÕES BOLSA	2.527.568,10	-0,75%	0,61%	-121,76%
BB AÇÕES AGRO	768.089,96	-3,41%	0,61%	-557,02%
BB TECNOLOGIA	536.561,19	2,09%	0,61%	341,31%
BB ENERGIA	481.616,65	-5,77%	0,61%	-942,15%
BB SMALL CAPS	555.017,71	-7,15%	0,61%	-1169,01%
BB RETORNO AÇÕES	361.493,81	-4,61%	0,61%	-752,88%
BB CONSUMO	272.740,22	-10,44%	0,61%	-1706,36%
BB SETOR FINANCEIRO	734.087,41	-6,72%	0,61%	-1098,48%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	485.678,28	-7,77%	0,61%	-1269,86%
CAIXA IRF-M	228,81	0,02%	0,61%	2,55%
CAIXA IRF-M1 TP	15.738,90	0,77%	0,61%	125,71%
CAIXA IMA-B 5+	4.554.676,67	-1,26%	0,61%	-206,06%
SICREDI IRF-M LP	1.796.343,30	0,76%	0,61%	123,60%
BI - MASSA FALIDA	209.268,66	0,22%	0,61%	35,30%
TOTAL / MÉDIA	30.746.739,98	-0,96%	0,61%	-157,01%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	17,42%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M	7,86%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	15,98%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	15,49%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	8,22%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,50%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,75%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,57%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,81%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,18%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,89%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,39%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,58%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	0,05%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	14,81%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,84%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,68%	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			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	12,09%	6,42%	188,49%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 12,09%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,42%, sendo assim o RPPS atingiu 188,49% 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	5.355.912,72	96.269,91	0,31%
BB IRF-M	2.417.407,57	24.636,06	0,08%
BB IMA-B 5+	4.911.804,52	134.192,02	0,44%
BB RETORNO TOTAL	4.762.505,50	32.617,90	0,11%
BB AÇÕES BOLSA	2.527.568,10	133.784,49	0,44%
BB AÇÕES AGRO	768.089,96	54.937,40	0,18%
BB TECNOLOGIA	536.561,19	44.108,80	0,14%
BB ENERGIA	481.616,65	32.828,37	0,11%
BB SMALL CAPS	555.017,71	59.274,25	0,19%
BB RETORNO AÇÕES	361.493,81	29.896,38	0,10%
BB CONSUMO	272.740,22	28.477,90	0,09%
BB SETOR FINANCEIRO	734.087,41	68.657,61	0,22%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	485.678,28	56.847,26	0,18%
CAIXA IRF-M	228,81	2,33	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	15.738,90	21,86	0,00%
CAIXA IMA-B 5+	4.554.676,67	120.995,32	0,39%
SICREDI IRF-M LP	1.796.343,30	19.187,26	0,06%
BI - MASSA FALIDA	209.268,66	0,00	0,00%
Carteira	30.746.739,98	672.550,96	2,19%

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	-