

1. RENTABILIDADE MÉDIA

| Novembro/2023 | | | | |
|--------------------------|---------------|---------------|-------|----------|
| Nome do Fundo | Aplicação | Rentabilidade | Meta | % Meta |
| BB IMA-B 5 | 2.743.627,68 | 1,79% | 0,69% | 259,22% |
| BB IDKA 2A | 5.653.057,94 | 1,38% | 0,69% | 199,59% |
| BB FLUXO | 551.986,63 | 0,76% | 0,69% | 110,91% |
| BB PERFIL | 191.330,39 | 0,91% | 0,69% | 132,65% |
| BB RETORNO TOTAL | 5.821.505,28 | 1,09% | 0,69% | 158,60% |
| BB IRF-M1 TP | 1.646.629,82 | 0,97% | 0,69% | 140,37% |
| BB FLUXO | 450.857,35 | 0,83% | 0,69% | 120,19% |
| BB IMA-B 5 | 9.527.532,86 | 1,79% | 0,69% | 259,22% |
| BB IRF-M1 TP | 12.734.675,56 | 0,92% | 0,69% | 132,77% |
| BB FLUXO | 425.638,80 | 0,26% | 0,69% | 37,65% |
| BB PERFIL | 3.468.854,66 | 0,91% | 0,69% | 132,65% |
| BB RETORNO TOTAL | 4.367.117,23 | 1,09% | 0,69% | 158,60% |
| BB FLUXO | 112.584,09 | 0,21% | 0,69% | 29,86% |
| BB FLUXO | 990.696,81 | 0,78% | 0,69% | 113,56% |
| CAIXA RIO BRAVO | 391.050,00 | -1,41% | 0,69% | -205,11% |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | 1.139.779,75 | 1,43% | 0,69% | 208,15% |
| CAIXA IMA-B | 677.605,94 | 2,61% | 0,69% | 378,36% |
| CAIXA MATRIZ | 49.606,65 | 0,99% | 0,69% | 143,02% |
| CAIXA TP | 76.460,60 | 0,91% | 0,69% | 132,17% |
| CAIXA NOVO IMA-B LP | 5.421.216,36 | 2,67% | 0,69% | 387,08% |
| CAIXA IMA-B 5 | 290.230,36 | 1,79% | 0,69% | 259,25% |
| PREMIUM FIDC | 83.127,95 | -4,80% | 0,69% | -696,41% |
| TOTAL / MÉDIA | 56.815.172,71 | 1,37% | 0,69% | 199,41% |

2. ENQUADRAMENTO

| Nome do Fundo | % PL do RPPS | % Resolução | Enquadramento |
|--------------------------|--------------|-------------|-----------------|
| BB IMA-B 5 | 4,83% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB IDKA 2A | 9,95% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB FLUXO | 0,97% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB PERFIL | 0,34% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB RETORNO TOTAL | 10,25% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB IRF-M1 TP | 2,90% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB FLUXO | 0,79% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB IMA-B 5 | 16,77% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB IRF-M1 TP | 22,41% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB FLUXO | 0,75% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB PERFIL | 6,11% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB RETORNO TOTAL | 7,69% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB FLUXO | 0,20% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB FLUXO | 1,74% | 20% | Art. 7º, III, a |
| CAIXA RIO BRAVO | 0,69% | 5% | Art. 11º |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | 2,01% | 100% | Art. 7º, I, b |
| CAIXA IMA-B | 1,19% | 100% | Art. 7º, I, b |
| CAIXA MATRIZ | 0,09% | 20% | Art. 7º, III, a |
| CAIXA TP | 0,13% | 20% | Art. 7º, III, a |
| CAIXA NOVO IMA-B LP | 9,54% | 20% | Art. 7º, III, a |
| CAIXA IMA-B 5 | 0,51% | 100% | Art. 7º, I, b |
| PREMIUM FIDC | 0,15% | 5% | 7º, V, a |

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

| | Rentabilidade | Meta | % Meta |
|-----------|---------------|-------|---------|
| Janeiro | 1,00% | 0,94% | 106,12% |
| Fevereiro | 0,93% | 1,25% | 74,58% |
| Março | 1,37% | 1,12% | 122,30% |
| Abril | 1,03% | 1,02% | 101,30% |
| Maio | 1,17% | 0,64% | 182,42% |
| Junho | 1,39% | 0,33% | 422,49% |
| Julho | 0,92% | 0,53% | 173,10% |
| Agosto | 0,75% | 0,64% | 116,69% |
| Setembro | 0,35% | 0,41% | 85,78% |
| Outubro | 0,23% | 0,65% | 35,75% |
| Novembro | 1,37% | 0,69% | 199,41% |
| Dezembro | | | |
| Acumulado | 11,02% | 8,52% | 129,24% |

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 11,02%, enquanto que a meta acumulada no período é de 8,52%, sendo assim o RPPS atingiu 129,24% 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 | 2.743.627,68 | 27.812,09 | 0,05% |
| BB IDKA 2A | 5.653.057,94 | 53.161,95 | 0,09% |
| BB FLUXO | 551.986,63 | 93,28 | 0,00% |
| BB PERFIL | 191.330,39 | 34,96 | 0,00% |
| BB RETORNO TOTAL | 5.821.505,28 | 12.002,41 | 0,02% |
| BB IRF-M1 TP | 1.646.629,82 | 1.987,51 | 0,00% |
| BB FLUXO | 450.857,35 | 76,19 | 0,00% |
| BB IMA-B 5 | 9.527.532,86 | 96.580,37 | 0,17% |
| BB IRF-M1 TP | 12.734.675,56 | 15.370,97 | 0,03% |
| BB FLUXO | 425.638,80 | 71,93 | 0,00% |
| BB PERFIL | 3.468.854,66 | 633,75 | 0,00% |
| BB RETORNO TOTAL | 4.367.117,23 | 9.003,85 | 0,02% |
| BB FLUXO | 112.584,09 | 19,03 | 0,00% |
| BB FLUXO | 990.696,81 | 167,42 | 0,00% |
| CAIXA RIO BRAVO | 391.050,00 | 0,00 | 0,00% |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | 1.139.779,75 | 7.633,38 | 0,01% |
| CAIXA IMA-B | 677.605,94 | 14.883,21 | 0,03% |
| CAIXA MATRIZ | 49.606,65 | 20,05 | 0,00% |
| CAIXA TP | 76.460,60 | 22,14 | 0,00% |
| CAIXA NOVO IMA-B LP | 5.421.216,36 | 122.778,83 | 0,22% |
| CAIXA IMA-B 5 | 290.230,36 | 2.928,74 | 0,01% |
| PREMIUM FIDC | 83.127,95 | 0,00 | 0,00% |
| Carteira | 56.815.172,71 | 341.224,86 | 0,60% |

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 5 | 0,02 |
| BB IDKA 2A | 0,02 |
| BB FLUXO | - |
| BB PERFIL | - |
| BB RETORNO TOTAL | 0,02 |
| BB IRF-M1 TP | 0,01 |
| BB FLUXO | - |
| BB IMA-B 5 | 0,02 |
| BB IRF-M1 TP | 0,01 |
| BB FLUXO | - |
| BB PERFIL | - |
| BB RETORNO TOTAL | 0,02 |
| BB FLUXO | - |
| BB FLUXO | - |
| CAIXA RIO BRAVO | - |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | 0,02 |
| CAIXA IMA-B | 0,02 |
| CAIXA MATRIZ | 0,03 |
| CAIXA TP | - |
| CAIXA NOVO IMA-B LP | 0,02 |
| CAIXA IMA-B 5 | 0,02 |
| PREMIUM FIDC | - |