

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Agosto/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.701.219,34	0,58%	0,64%	90,88%
BB IDKA 2A	7.854.443,43	0,74%	0,64%	115,66%
BB FLUXO	148.583,90	0,87%	0,64%	136,82%
BB PERFIL	185.937,76	1,16%	0,64%	180,72%
BB RETORNO TOTAL	5.660.248,42	1,04%	0,64%	162,57%
BB IRF-M1 TP	1.601.436,28	1,12%	0,64%	174,57%
BB FLUXO	286.662,15	0,95%	0,64%	148,90%
BB IMA-B 5	9.380.265,48	0,58%	0,64%	90,88%
BB IRF-M1 TP	11.447.019,56	1,05%	0,64%	164,83%
BB FLUXO	917,53	1,94%	0,64%	303,33%
BB PERFIL	2.424.718,91	1,16%	0,64%	180,72%
BB RETORNO TOTAL	3.290.846,81	1,04%	0,64%	162,57%
BB FLUXO	545.857,29	0,09%	0,64%	13,40%
BB FLUXO	1.206.528,93	1,05%	0,64%	163,80%
CAIXA RIO BRAVO	420.000,00	5,61%	0,64%	877,24%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.415.189,74	0,63%	0,64%	98,68%
CAIXA IMA-B	975.731,11	-0,37%	0,64%	-58,01%
CAIXA MATRIZ	48.149,89	1,22%	0,64%	190,50%
CAIXA TP	74.344,11	1,13%	0,64%	176,50%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.371.622,73	-0,34%	0,64%	-53,97%
CAIXA IMA-B 5	2.287.240,45	0,60%	0,64%	93,42%
PREMIUM FIDC	88.090,96	-0,45%	0,64%	-70,02%
TOTAL / MÉDIA	59.415.054,78	0,75%	0,64%	116,69%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	4,55%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	13,22%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,25%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,31%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	9,53%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	2,70%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,48%	20%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5	15,79%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	19,27%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,00%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	4,08%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	5,54%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,92%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	2,03%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,71%	5%	Art. 11º
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	5,75%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	1,64%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	0,08%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	0,13%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA NOVO IMA-B LP	9,04%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	3,85%	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			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	8,88%	6,65%	133,47%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 8,88%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,65%, sendo assim o RPPS atingiu 133,47% 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	2.701.219,34	21.421,65	0,04%
BB IDKA 2A	7.854.443,43	59.370,96	0,10%
BB FLUXO	148.583,90	16,56	0,00%
BB PERFIL	185.937,76	32,26	0,00%
BB RETORNO TOTAL	5.660.248,42	38.766,45	0,07%
BB IRF-M1 TP	1.601.436,28	2.238,60	0,00%
BB FLUXO	286.662,15	31,94	0,00%
BB IMA-B 5	9.380.265,48	74.388,91	0,13%
BB IRF-M1 TP	11.447.019,56	16.001,46	0,03%
BB FLUXO	917,53	0,10	0,00%
BB PERFIL	2.424.718,91	420,63	0,00%
BB RETORNO TOTAL	3.290.846,81	22.538,67	0,04%
BB FLUXO	545.857,29	60,82	0,00%
BB FLUXO	1.206.528,93	134,44	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	420.000,00	0,00	0,00%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.415.189,74	25.661,62	0,04%
CAIXA IMA-B	975.731,11	17.087,46	0,03%
CAIXA MATRIZ	48.149,89	20,93	0,00%
CAIXA TP	74.344,11	35,60	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.371.622,73	96.223,80	0,16%
CAIXA IMA-B 5	2.287.240,45	17.746,46	0,03%
PREMIUM FIDC	88.090,96	0,00	0,00%
Carteira	59.415.054,78	348.097,76	0,59%

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