

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Maio/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.633.196,07	0,61%	0,64%	95,59%
BB IDKA 2A	7.645.995,61	0,39%	0,64%	60,83%
BB FLUXO	812.421,21	1,01%	0,64%	158,09%
BB PERFIL	179.912,79	1,15%	0,64%	180,08%
BB RETORNO TOTAL	5.459.817,25	1,88%	0,64%	294,80%
BB IRF-M1 TP	3.819.195,96	1,12%	0,64%	175,47%
BB FLUXO	1.388.066,76	1,04%	0,64%	162,59%
BB IMA-B 5	9.144.047,57	0,61%	0,64%	95,59%
BB IRF-M1 TP	10.139.714,81	1,12%	0,64%	175,47%
BB FLUXO	1.289.804,88	0,54%	0,64%	84,75%
BB PERFIL	2.346.150,37	1,15%	0,64%	180,07%
BB FLUXO	546.683,84	0,09%	0,64%	14,29%
BB FLUXO	1.410.700,25	1,03%	0,64%	161,54%
CAIXA RIO BRAVO	340.100,00	8,62%	0,64%	1348,01%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.294.405,50	1,81%	0,64%	282,42%
CAIXA IMA-B	949.235,45	2,53%	0,64%	396,53%
CAIXA MATRIZ	639.307,72	1,24%	0,64%	194,20%
CAIXA TP	1.653.243,98	1,22%	0,64%	191,53%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.222.226,79	2,57%	0,64%	402,57%
CAIXA IMA-B 5	2.229.236,83	0,63%	0,64%	98,65%
PREMIUM FIDC	89.353,77	-6,65%	0,64%	-1040,07%
TOTAL / MÉDIA	61.232.817,41	1,17%	0,64%	182,42%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	4,30%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	12,49%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	1,33%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,29%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	8,92%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M1 TP	6,24%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	2,27%	20%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5	14,93%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	16,56%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	2,11%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	3,83%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	0,89%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	2,30%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,56%	5%	Art. 11º
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	5,38%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	1,55%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	1,04%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	2,70%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA NOVO IMA-B LP	8,53%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	3,64%	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			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	5,62%	5,07%	110,85%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 5,62%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,07%, sendo assim o RPPS atingiu 110,85% 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	2.633.196,07	22.981,44	0,04%
BB IDKA 2A	7.645.995,61	76.371,82	0,12%
BB FLUXO	812.421,21	80,62	0,00%
BB PERFIL	179.912,79	100,17	0,00%
BB RETORNO TOTAL	5.459.817,25	53.453,19	0,09%
BB IRF-M1 TP	3.819.195,96	8.011,36	0,01%
BB FLUXO	1.388.066,76	137,74	0,00%
BB IMA-B 5	9.144.047,57	79.805,45	0,13%
BB IRF-M1 TP	10.139.714,81	21.269,63	0,03%
BB FLUXO	1.289.804,88	127,99	0,00%
BB PERFIL	2.346.150,37	1.306,22	0,00%
BB FLUXO	546.683,84	54,25	0,00%
BB FLUXO	1.410.700,25	139,98	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	340.100,00	0,00	0,00%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.294.405,50	11.541,40	0,02%
CAIXA IMA-B	949.235,45	18.632,52	0,03%
CAIXA MATRIZ	639.307,72	293,42	0,00%
CAIXA TP	1.653.243,98	659,29	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.222.226,79	105.790,23	0,17%
CAIXA IMA-B 5	2.229.236,83	19.223,58	0,03%
PREMIUM FIDC	89.353,77	0,00	0,00%
Carteira	61.232.817,41	375.111,93	0,61%

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	0,02
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB IMA-B 5	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,02
BB FLUXO	-
BB FLUXO	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,02
CAIXA IMA-B	0,02
CAIXA MATRIZ	0,04
CAIXA TP	0,03
CAIXA NOVO IMA-B LP	0,02
CAIXA IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-