

1. RENTABILIDADE MÉDIA

| Junho/2023 | | | | |
|--------------------------|---------------|---------------|-------|----------|
| Nome do Fundo | Aplicação | Rentabilidade | Meta | % Meta |
| BB IMA-B 5 | 2.660.342,05 | 1,03% | 0,33% | 314,42% |
| BB IDKA 2A | 7.723.946,69 | 1,02% | 0,33% | 310,94% |
| BB FLUXO | 893.733,02 | 0,98% | 0,33% | 298,17% |
| BB PERFIL | 181.878,40 | 1,09% | 0,33% | 333,21% |
| BB RETORNO TOTAL | 5.558.320,08 | 1,80% | 0,33% | 550,24% |
| BB IRF-M1 TP | 2.853.559,12 | 0,90% | 0,33% | 274,41% |
| BB FLUXO | 293.208,50 | 0,33% | 0,33% | 99,29% |
| BB IMA-B 5 | 9.238.314,82 | 1,03% | 0,33% | 314,42% |
| BB IRF-M1 TP | 10.257.191,48 | 1,16% | 0,33% | 353,35% |
| BB FLUXO | 0,00 | 0,95% | 0,33% | 288,76% |
| BB PERFIL | 2.371.782,81 | 1,09% | 0,33% | 333,21% |
| BB RETORNO TOTAL | 2.274.796,96 | 0,48% | 0,33% | 146,42% |
| BB FLUXO | 542.844,55 | 0,18% | 0,33% | 53,58% |
| BB FLUXO | 1.336.083,34 | 0,95% | 0,33% | 289,48% |
| CAIXA RIO BRAVO | 393.400,00 | 16,50% | 0,33% | 5030,81% |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | 3.363.745,53 | 2,10% | 0,33% | 641,93% |
| CAIXA IMA-B | 971.575,25 | 2,35% | 0,33% | 717,77% |
| CAIXA MATRIZ | 646.704,70 | 1,16% | 0,33% | 352,88% |
| CAIXA TP | 1.671.894,74 | 1,13% | 0,33% | 344,07% |
| CAIXA NOVO IMA-B LP | 5.346.185,13 | 2,37% | 0,33% | 723,94% |
| CAIXA IMA-B 5 | 2.252.232,57 | 1,03% | 0,33% | 314,61% |
| PREMIUM FIDC | 88.905,23 | -0,50% | 0,33% | -153,10% |
| TOTAL / MÉDIA | 60.920.644,97 | 1,39% | 0,33% | 422,49% |

2. ENQUADRAMENTO

| Nome do Fundo | % PL do RPPS | % Resolução | Enquadramento |
|--------------------------|--------------|-------------|-----------------|
| BB IMA-B 5 | 4,37% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB IDKA 2A | 12,68% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB FLUXO | 1,47% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB PERFIL | 0,30% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB RETORNO TOTAL | 9,12% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB IRF-M1 TP | 4,68% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB FLUXO | 0,48% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB IMA-B 5 | 15,16% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB IRF-M1 TP | 16,84% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB FLUXO | 0,00% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB PERFIL | 3,89% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB RETORNO TOTAL | 3,73% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB FLUXO | 0,89% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB FLUXO | 2,19% | 20% | Art. 7º, III, a |
| CAIXA RIO BRAVO | 0,65% | 5% | Art. 11º |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | 5,52% | 100% | Art. 7º, I, b |
| CAIXA IMA-B | 1,59% | 100% | Art. 7º, I, b |
| CAIXA MATRIZ | 1,06% | 20% | Art. 7º, III, a |
| CAIXA TP | 2,74% | 20% | Art. 7º, III, a |
| CAIXA NOVO IMA-B LP | 8,78% | 20% | Art. 7º, III, a |
| CAIXA IMA-B 5 | 3,70% | 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 | | | |
| Agosto | | | |
| Setembro | | | |
| Outubro | | | |
| Novembro | | | |
| Dezembro | | | |
| Acumulado | 7,08% | 5,41% | 130,82% |

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 7,08%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,41%, sendo assim o RPPS atingiu 130,82% 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 | 2.660.342,05 | 22.558,73 | 0,04% |
| BB IDKA 2A | 7.723.946,69 | 72.650,99 | 0,12% |
| BB FLUXO | 893.733,02 | 88,83 | 0,00% |
| BB PERFIL | 181.878,40 | 101,59 | 0,00% |
| BB RETORNO TOTAL | 5.558.320,08 | 50.589,32 | 0,08% |
| BB IRF-M1 TP | 2.853.559,12 | 5.555,94 | 0,01% |
| BB FLUXO | 293.208,50 | 29,14 | 0,00% |
| BB IMA-B 5 | 9.238.314,82 | 78.337,55 | 0,13% |
| BB IRF-M1 TP | 10.257.191,48 | 19.970,96 | 0,03% |
| BB FLUXO | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| BB PERFIL | 2.371.782,81 | 1.324,85 | 0,00% |
| BB RETORNO TOTAL | 2.274.796,96 | 20.704,18 | 0,03% |
| BB FLUXO | 542.844,55 | 53,95 | 0,00% |
| BB FLUXO | 1.336.083,34 | 132,79 | 0,00% |
| CAIXA RIO BRAVO | 393.400,00 | 0,00 | 0,00% |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | 3.363.745,53 | 17.633,45 | 0,03% |
| CAIXA IMA-B | 971.575,25 | 18.045,68 | 0,03% |
| CAIXA MATRIZ | 646.704,70 | 309,77 | 0,00% |
| CAIXA TP | 1.671.894,74 | 737,35 | 0,00% |
| CAIXA NOVO IMA-B LP | 5.346.185,13 | 102.326,94 | 0,17% |
| CAIXA IMA-B 5 | 2.252.232,57 | 18.797,07 | 0,03% |
| PREMIUM FIDC | 88.905,23 | 0,00 | 0,00% |
| Carteira | 60.920.644,97 | 385.762,94 | 0,63% |

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 | 0,04 |
| BB RETORNO TOTAL | 0,01 |
| BB IRF-M1 TP | 0,01 |
| BB FLUXO | - |
| BB IMA-B 5 | - |
| BB IRF-M1 TP | 0,01 |
| BB FLUXO | - |
| BB PERFIL | 0,04 |
| BB RETORNO TOTAL | 0,01 |
| BB FLUXO | - |
| BB FLUXO | - |
| CAIXA RIO BRAVO | - |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | 0,02 |
| CAIXA IMA-B | 0,01 |
| CAIXA MATRIZ | 0,05 |
| CAIXA TP | 0,02 |
| CAIXA NOVO IMA-B LP | 0,01 |
| CAIXA IMA-B 5 | - |
| PREMIUM FIDC | - |