

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Abril/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.617.206,62	0,89%	1,02%	87,59%
BB IDKA 2A	7.616.382,65	0,68%	1,02%	66,36%
BB FLUXO	690.494,04	0,79%	1,02%	77,72%
BB PERFIL	177.865,65	0,89%	1,02%	86,90%
BB RETORNO TOTAL	5.358.846,62	1,27%	1,02%	124,47%
BB IRF-M1 TP	3.776.837,07	0,83%	1,02%	81,17%
BB FLUXO	1.356.188,22	1,33%	1,02%	130,52%
BB IMA-B 5	9.088.522,54	0,89%	1,02%	87,59%
BB IRF-M1 TP	10.027.254,73	0,77%	1,02%	75,33%
BB FLUXO	320.944,12	0,83%	1,02%	81,54%
BB PERFIL	2.319.454,71	0,89%	1,02%	86,90%
BB FLUXO	23.088,83	0,08%	1,02%	7,60%
BB FLUXO	1.423.848,74	0,79%	1,02%	77,79%
CAIXA RIO BRAVO	315.700,00	1,90%	1,02%	186,51%
CAIXA DIVIDENDOS	0,00	3,83%	1,02%	374,79%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.235.994,08	0,87%	1,02%	85,53%
CAIXA IMA-B	925.772,42	1,17%	1,02%	114,61%
CAIXA MATRIZ	631.469,86	0,88%	1,02%	86,55%
CAIXA TP	1.633.250,23	0,84%	1,02%	82,28%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.091.229,08	2,05%	1,02%	201,05%
CAIXA IMA-B 5	2.215.268,43	0,89%	1,02%	86,73%
PREMIUM FIDC	95.716,60	-0,40%	1,02%	-38,86%
TOTAL / MÉDIA	58.941.335,24	1,03%	1,02%	101,30%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	4,44%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	12,92%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	1,17%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,30%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	9,09%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M1 TP	6,41%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	2,30%	20%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5	15,42%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	17,01%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,54%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	3,94%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	0,04%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	2,42%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,54%	5%	Art. 11º
CAIXA DIVIDENDOS	0,00%	20%	Art. 8º, I
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	5,49%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	1,57%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	1,07%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	2,77%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA NOVO IMA-B LP	8,64%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	3,76%	100%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,16%	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			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	4,40%	4,40%	100,07%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 4,4%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,4%, sendo assim o RPPS atingiu 100,07% 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	2.617.206,62	26.307,48	0,04%
BB IDKA 2A	7.616.382,65	85.784,72	0,15%
BB FLUXO	690.494,04	55,96	0,00%
BB PERFIL	177.865,65	96,92	0,00%
BB RETORNO TOTAL	5.358.846,62	60.334,62	0,10%
BB IRF-M1 TP	3.776.837,07	8.418,66	0,01%
BB FLUXO	1.356.188,22	109,90	0,00%
BB IMA-B 5	9.088.522,54	91.355,48	0,15%
BB IRF-M1 TP	10.027.254,73	22.350,98	0,04%
BB FLUXO	320.944,12	26,01	0,00%
BB PERFIL	2.319.454,71	1.263,93	0,00%
BB FLUXO	23.088,83	1,87	0,00%
BB FLUXO	1.423.848,74	115,39	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	315.700,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	0,00	0,00	0,00%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.235.994,08	9.246,81	0,02%
CAIXA IMA-B	925.772,42	20.976,84	0,04%
CAIXA MATRIZ	631.469,86	233,23	0,00%
CAIXA TP	1.633.250,23	411,33	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.091.229,08	118.509,68	0,20%
CAIXA IMA-B 5	2.215.268,43	22.183,06	0,04%
PREMIUM FIDC	95.716,60	0,00	0,00%
Carteira	58.941.335,24	430.064,31	0,73%

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