

**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO
MUNICÍPIO DE PARANÁIBA**

Informações referentes a Setembro/2022

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Setembro/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	3.647.473,90	1,45%	0,12%	1215,55%
BB IPCA	1.744.150,37	0,08%	0,12%	70,04%
BB IMA-B 5+	3.446.804,67	2,36%	0,12%	1974,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.462.689,78	1,24%	0,12%	1036,65%
BB AÇÕES BOLSA	1.951.773,12	-8,03%	0,12%	-6726,18%
BB AÇÕES AGRO	556.633,59	-3,39%	0,12%	-2839,64%
BB TECNOLOGIA	346.158,87	-2,65%	0,12%	-2218,40%
BB ENERGIA	438.471,93	-4,35%	0,12%	-3641,86%
BB SMALL CAPS	522.902,91	-1,95%	0,12%	-1634,92%
BB RETORNO AÇÕES	376.471,05	-2,86%	0,12%	-2395,32%
BB CONSUMO	289.795,27	-1,21%	0,12%	-1009,32%
BB SETOR FINANCEIRO	571.230,59	2,76%	0,12%	2309,66%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	420.767,29	10,98%	0,12%	9197,99%
CAIXA IRF-M	1.561.882,28	1,22%	0,12%	1019,53%
CAIXA IRF-M1 TP	2.558.137,58	1,09%	0,12%	910,80%
CAIXA IMA-B 5+	3.399.510,31	2,37%	0,12%	1988,44%
SICREDI IRF-M LP	1.591.771,75	1,45%	0,12%	1216,16%
BI - MASSA FALIDA	205.357,53	0,18%	0,12%	151,16%
TOTAL / MÉDIA	27.091.982,79	0,51%	0,12%	423,38%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,46%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	6,44%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	12,72%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	12,78%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	7,20%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,05%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,28%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,62%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,93%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,39%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	1,07%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,11%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,55%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	5,77%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	9,44%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	12,55%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,88%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,76%	-	Não enquadrado

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,51%	0,95%	-53,89%
Fevereiro	-0,23%	1,42%	-16,36%
Março	3,08%	2,04%	150,97%
Abril	-1,39%	1,47%	-94,32%
Mai	0,76%	0,88%	85,89%
Junho	-2,16%	1,08%	-199,60%
Julho	0,92%	-0,27%	-337,82%
Agosto	1,69%	0,05%	3450,13%
Setembro	0,51%	0,12%	423,38%
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,59%	8,00%	32,38%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,59%, enquanto que a meta acumulada no período é de 8%, sendo assim o RPPS atingiu 32,38% 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	3.647.473,90	91.460,94	0,34%
BB IPCA	1.744.150,37	15.998,45	0,06%
BB IMA-B 5+	3.446.804,67	137.174,19	0,51%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.462.689,78	35.905,94	0,13%
BB AÇÕES BOLSA	1.951.773,12	219.505,50	0,81%
BB AÇÕES AGRO	556.633,59	42.945,34	0,16%
BB TECNOLOGIA	346.158,87	40.580,20	0,15%
BB ENERGIA	438.471,93	32.430,51	0,12%
BB SMALL CAPS	522.902,91	64.183,04	0,24%
BB RETORNO AÇÕES	376.471,05	33.809,15	0,12%
BB CONSUMO	289.795,27	33.123,60	0,12%
BB SETOR FINANCEIRO	571.230,59	56.179,98	0,21%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	420.767,29	56.920,91	0,21%
CAIXA IRF-M	1.561.882,28	23.707,78	0,09%
CAIXA IRF-M1 TP	2.558.137,58	4.254,15	0,02%
CAIXA IMA-B 5+	3.399.510,31	135.738,30	0,50%
SICREDI IRF-M LP	1.591.771,75	24.626,05	0,09%
BI - MASSA FALIDA	205.357,53	0,00	0,00%
Carteira	27.091.982,79	757.500,11	2,80%

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	0,00
BB IPCA	-
BB IMA-B 5+	0,01
BB ALOCAÇÃO ATIVA	0,00
BB AÇÕES BOLSA	-
BB AÇÕES AGRO	-
BB TECNOLOGIA	-
BB ENERGIA	-
BB SMALL CAPS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB CONSUMO	-
BB SETOR FINANCEIRO	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	-
CAIXA IRF-M	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	0,00
CAIXA IMA-B 5+	0,01
SICREDI IRF-M LP	0,00
BI - MASSA FALIDA	-