

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

Informações referentes a Maio/2023

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Maio/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	4.921.070,57	2,48%	0,61%	405,93%
BB IRF-M	2.166.567,70	1,89%	0,61%	309,47%
BB IPCA	0,00	0,64%	0,61%	104,14%
BB IMA-B 5+	4.491.470,65	3,85%	0,61%	629,10%
BB RETORNO TOTAL	4.221.841,33	1,77%	0,61%	289,70%
BB AÇÕES BOLSA	2.343.967,23	1,33%	0,61%	217,96%
BB AÇÕES AGRO	675.259,97	2,36%	0,61%	386,45%
BB TECNOLOGIA	491.729,41	12,56%	0,61%	2053,04%
BB ENERGIA	471.585,41	3,09%	0,61%	504,33%
BB SMALL CAPS	528.636,87	14,77%	0,61%	2413,40%
BB RETORNO AÇÕES	337.558,23	1,99%	0,61%	324,39%
BB CONSUMO	243.626,44	12,47%	0,61%	2037,57%
BB SETOR FINANCEIRO	706.587,04	5,33%	0,61%	871,24%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	458.156,54	16,49%	0,61%	2693,87%
CAIXA IRF-M	1.323.897,59	2,20%	0,61%	358,73%
CAIXA IRF-M1 TP	1.496.086,82	0,66%	0,61%	107,25%
CAIXA IMA-B 5+	3.699.984,74	3,98%	0,61%	651,16%
SICREDI IRF-M LP	1.729.678,25	2,23%	0,61%	364,46%
BI - MASSA FALIDA	208.113,60	0,21%	0,61%	35,08%
TOTAL / MÉDIA	30.515.818,39	3,20%	0,61%	523,45%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	16,13%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M	7,10%	100%	Art. 7º, I, b
BB IPCA	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	14,72%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	13,83%	20%	Art. 7º, III, a
BB AÇÕES BOLSA	7,68%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,21%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,61%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,55%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,73%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,11%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,80%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,32%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,50%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	4,34%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	4,90%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	12,12%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,67%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,68%	0%	Não enquadrado

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,91%	0,92%	98,20%
Fevereiro	-0,10%	1,22%	-8,22%
Março	2,04%	1,09%	186,81%
Abril	1,90%	0,99%	190,76%
Maio	3,20%	0,61%	523,45%
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	8,18%	4,93%	166,04%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 8,18%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,93%, sendo assim o RPPS atingiu 166,04% 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	4.921.070,57	96.540,16	0,32%
BB IRF-M	2.166.567,70	28.619,69	0,09%
BB IPCA	0,00	0,00	0,00%
BB IMA-B 5+	4.491.470,65	140.214,06	0,46%
BB RETORNO TOTAL	4.221.841,33	41.333,05	0,14%
BB AÇÕES BOLSA	2.343.967,23	156.743,82	0,51%
BB AÇÕES AGRO	675.259,97	47.692,69	0,16%
BB TECNOLOGIA	491.729,41	41.087,76	0,13%
BB ENERGIA	471.585,41	35.787,16	0,12%
BB SMALL CAPS	528.636,87	61.022,85	0,20%
BB RETORNO AÇÕES	337.558,23	29.635,12	0,10%
BB CONSUMO	243.626,44	29.908,72	0,10%
BB SETOR FINANCEIRO	706.587,04	80.199,39	0,26%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	458.156,54	61.071,78	0,20%
CAIXA IRF-M	1.323.897,59	17.486,93	0,06%
CAIXA IRF-M1 TP	1.496.086,82	3.143,94	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	3.699.984,74	115.103,92	0,38%
SICREDI IRF-M LP	1.729.678,25	21.955,38	0,07%
BI - MASSA FALIDA	208.113,60	0,00	0,00%
Carteira	30.515.818,39	711.037,01	2,33%

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	0,02
BB IRF-M	0,02
BB IPCA	0,01
BB IMA-B 5+	0,02
BB RETORNO TOTAL	0,02
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	0,02
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B 5+	0,02
SICREDI IRF-M LP	0,02
BI - MASSA FALIDA	-