

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

Informações referentes a Dezembro/2022

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Dezembro/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	4.155.546,89	-0,24%	1,03%	-22,92%
BB IPCA	1.761.653,42	0,95%	1,03%	92,43%
BB IMA-B 5+	3.681.843,75	-1,19%	1,03%	-115,10%
BB ALOCAÇÃO AT	0,00	-0,39%	1,03%	-37,36%
BB RETORNO TOT	3.574.807,56	1,22%	1,03%	118,20%
BB AÇÕES BOLSA	2.118.779,62	-4,58%	1,03%	-443,59%
BB AÇÕES AGRO	604.932,77	-2,63%	1,03%	-254,49%
BB TECNOLOGIA	385.031,27	-6,29%	1,03%	-608,50%
BB ENERGIA	441.737,55	-2,77%	1,03%	-268,15%
BB SMALL CAPS	502.758,75	-2,66%	1,03%	-257,92%
BB RETORNO AÇ	352.826,02	-2,86%	1,03%	-277,01%
BB CONSUMO	248.280,06	-5,27%	1,03%	-510,05%
BB SETOR FINAN	572.937,62	0,13%	1,03%	13,01%
BB CONSTRUÇÃO	364.013,04	-3,73%	1,03%	-361,43%
CAIXA IRF-M	1.151.949,99	1,21%	1,03%	116,92%
CAIXA IRF-M1 TP	1.766.545,34	0,80%	1,03%	76,97%
CAIXA IMA-B 5+	3.338.731,34	-1,23%	1,03%	-119,33%
SICREDI IRF-M L	1.616.067,49	1,41%	1,03%	136,56%
BI - MASSA FALID	206.401,05	0,21%	1,03%	20,06%
TOTAL / MÉDIA	26.844.843,53	-0,72%	1,03%	-70,03%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	15,48%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	6,56%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	13,72%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO AT	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOT	13,32%	20%	Art. 7º, III, a
BB AÇÕES BOLSA	7,89%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,25%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,43%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,65%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,87%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇ	1,31%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,92%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINAN	2,13%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO	1,36%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	4,29%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	6,58%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	12,44%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M L	6,02%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALID	0,77%	-	-

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	2,13%	1,00%	211,98%
Novembro	-1,22%	0,82%	-148,85%
Dezembro	-0,72%	1,03%	-70,03%
Acumulado	2,74%	11,11%	24,65%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,74%, enquanto que a meta acumulada no período é de 11,11%, sendo assim o RPPS atingiu 24,65% 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	4.155.546,89	117.170,23	0,44%
BB IPCA	1.761.653,42	12.737,93	0,05%
BB IMA-B 5+	3.681.843,75	159.641,99	0,59%
BB ALOCAÇÃO ATIVA		0,00	
BB RETORNO TOTAL	3.574.807,56	50.251,40	0,19%
BB AÇÕES BOLSA	2.118.779,62	231.028,53	0,86%
BB AÇÕES AGRO	604.932,77	53.398,52	0,20%
BB TECNOLOGIA	385.031,27	39.351,13	0,15%
BB ENERGIA	441.737,55	47.155,97	0,18%
BB SMALL CAPS	502.758,75	73.011,48	0,27%
BB RETORNO AÇÕES	352.826,02	43.055,49	0,16%
BB CONSUMO	248.280,06	37.624,41	0,14%
BB SETOR FINANCEIRO	572.937,62	80.201,75	0,30%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	364.013,04	66.387,77	0,25%
CAIXA IRF-M	1.151.949,99	22.002,55	0,08%
CAIXA IRF-M1 TP	1.766.545,34	2.021,96	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	3.338.731,34	144.497,20	0,54%
SICREDI IRF-M LP	1.616.067,49	31.032,62	0,12%
BI - MASSA FALIDA	206.401,05	0,00	0,00%
Carteira	26.844.843,53	878.509,44	3,27%

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	-
BB IPCA	-
BB IMA-B 5+	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
BB RETORNO TOTAL	-
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	0,01
CAIXA IMA-B 5+	-
SICREDI IRF-M LP	0,00
BI - MASSA FALIDA	-