

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

Informações referentes a Março/2023

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Março/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	4.314.972,73	2,60%	1,09%	237,86%
BB IRF-M	1.608.996,95	2,12%	1,09%	194,06%
BB IPCA	1.825.819,35	1,18%	1,09%	108,27%
BB IMA-B 5+	3.810.673,16	3,63%	1,09%	331,71%
BB RETORNO TOTAL	3.701.274,56	1,88%	1,09%	171,55%
BB AÇÕES BOLSA	2.286.134,63	3,57%	1,09%	326,49%
BB AÇÕES AGRO	562.306,74	-4,79%	1,09%	-438,05%
BB TECNOLOGIA	444.952,33	5,44%	1,09%	497,30%
BB ENERGIA	416.091,63	1,19%	1,09%	108,61%
BB SMALL CAPS	452.155,49	-2,10%	1,09%	-191,58%
BB RETORNO AÇÕES	328.757,48	-4,98%	1,09%	-455,69%
BB CONSUMO	215.964,74	-6,39%	1,09%	-584,43%
BB SETOR FINANCEIRO	608.693,94	-1,49%	1,09%	-136,39%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	369.196,89	-0,66%	1,09%	-60,30%
CAIXA IRF-M	1.281.625,53	1,16%	1,09%	106,32%
CAIXA IRF-M1 TP	1.241.273,26	0,64%	1,09%	58,50%
CAIXA IMA-B 5+	3.455.420,81	3,66%	1,09%	334,38%
SICREDI IRF-M LP	1.679.775,86	2,15%	1,09%	196,65%
BI - MASSA FALIDA	207.497,38	0,24%	1,09%	21,87%
TOTAL / MÉDIA	28.811.583,46	2,04%	1,09%	186,81%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	14,98%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M	5,58%	100%	Art. 7º, I, b
BB IPCA	6,34%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	13,23%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	12,85%	20%	Art. 7º, III, a
BB AÇÕES BOLSA	7,93%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	1,95%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,54%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,44%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,57%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,14%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,75%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,11%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,28%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	4,45%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	4,31%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	11,99%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,83%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,72%	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			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,87%	3,27%	87,77%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,87%, enquanto que a meta acumulada no período é de 3,27%, sendo assim o RPPS atingiu 87,77% 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	4.314.972,73	124.867,49	0,43%
BB IRF-M	1.608.996,95	32.724,46	0,11%
BB IPCA	1.825.819,35	11.789,23	0,04%
BB IMA-B 5+	3.810.673,16	170.390,54	0,59%
BB RETORNO TOTAL	3.701.274,56	55.186,00	0,19%
BB AÇÕES BOLSA	2.286.134,63	217.667,32	0,76%
BB AÇÕES AGRO	562.306,74	46.802,47	0,16%
BB TECNOLOGIA	444.952,33	43.239,74	0,15%
BB ENERGIA	416.091,63	42.929,91	0,15%
BB SMALL CAPS	452.155,49	61.692,27	0,21%
BB RETORNO AÇÕES	328.757,48	38.360,07	0,13%
BB CONSUMO	215.964,74	31.524,66	0,11%
BB SETOR FINANCEIRO	608.693,94	86.647,55	0,30%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	369.196,89	63.095,62	0,22%
CAIXA IRF-M	1.281.625,53	25.677,01	0,09%
CAIXA IRF-M1 TP	1.241.273,26	2.422,17	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	3.455.420,81	154.719,47	0,54%
SICREDI IRF-M LP	1.679.775,86	33.174,87	0,12%
BI - MASSA FALIDA	207.497,38	0,00	0,00%
Carteira	28.811.583,46	916.429,01	3,18%

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	0,01
BB IPCA	-
BB IMA-B 5+	0,02
BB RETORNO TOTAL	0,01
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	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	0,00
CAIXA IMA-B 5+	0,02
SICREDI IRF-M LP	0,01
BI - MASSA FALIDA	-