

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

Informações referentes a Novembro/2022

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Novembro/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	4.165.412,07	-0,76%	0,82%	-92,29%
BB IPCA	1.744.989,34	0,73%	0,82%	88,54%
BB IMA-B 5+	3.726.151,97	-1,25%	0,82%	-151,70%
BB ALOCAÇÃO AT	3.545.363,31	-0,07%	0,82%	-8,36%
BB AÇÕES BOLSA	2.220.545,28	5,64%	0,82%	685,50%
BB AÇÕES AGRO	621.267,21	-4,78%	0,82%	-581,15%
BB TECNOLOGIA	360.860,65	-6,28%	0,82%	-763,53%
BB ENERGIA	448.950,35	-3,95%	0,82%	-479,89%
BB SMALL CAPS	490.821,56	-12,07%	0,82%	-1467,51%
BB RETORNO AÇ	363.221,12	-9,13%	0,82%	-1109,78%
BB CONSUMO	262.091,14	-14,61%	0,82%	-1776,75%
BB SETOR FINAN	532.168,73	-12,60%	0,82%	-1532,82%
BB CONSTRUÇÃO	358.132,76	-16,55%	0,82%	-2012,31%
CAIXA IRF-M	1.286.410,32	0,78%	0,82%	94,30%
CAIXA IRF-M1 TP	2.372.677,47	0,85%	0,82%	103,94%
CAIXA IMA-B 5+	3.380.407,57	-1,20%	0,82%	-145,48%
SICREDI IRF-M LP	1.593.583,64	-0,76%	0,82%	-92,75%
BI - MASSA FALID	205.974,27	0,15%	0,82%	18,33%
TOTAL / MÉDIA	27.679.028,76	-1,22%	0,82%	-148,85%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	15,05%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	6,30%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	13,46%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO AT	12,81%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	8,02%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,24%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,30%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,62%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,77%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇ	1,31%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,95%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINAN	1,92%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO	1,29%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	4,65%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	8,57%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	12,21%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,76%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALID	0,74%	-	-

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			
Acumulado	3,49%	9,98%	34,96%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 3,49%, enquanto que a meta acumulada no período é de 9,98%, sendo assim o RPPS atingiu 34,96% 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	4.165.412,07	123.782,56	0,45%
BB IPCA	1.744.989,34	12.752,68	0,05%
BB IMA-B 5+	3.726.151,97	172.590,99	0,62%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.545.363,31	47.068,09	0,17%
BB AÇÕES BOLSA	2.220.545,28	244.164,75	0,88%
BB AÇÕES AGRO	621.267,21	51.598,06	0,19%
BB TECNOLOGIA	360.860,65	38.500,81	0,14%
BB ENERGIA	448.950,35	45.597,96	0,16%
BB SMALL CAPS	490.821,56	70.575,51	0,25%
BB RETORNO AÇÕES	363.221,12	43.145,54	0,16%
BB CONSUMO	262.091,14	37.480,38	0,14%
BB SETOR FINANCEIRO	532.168,73	70.723,64	0,26%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	358.132,76	62.955,82	0,23%
CAIXA IRF-M	1.286.410,32	24.682,91	0,09%
CAIXA IRF-M1 TP	2.372.677,47	3.730,88	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	3.380.407,57	156.717,84	0,57%
SICREDI IRF-M LP	1.593.583,64	31.062,83	0,11%
BI - MASSA FALIDA	205.974,27	0,00	0,00%
Carteira	27.679.028,76	898.362,24	3,25%

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 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	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B 5+	-
SICREDI IRF-M LP	-
BI - MASSA FALIDA	-