

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

Informações referentes a Outubro/2020

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Outubro/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.248.504,12	0,18%	1,35%	13,30%
BB IPCA TP	1.678.897,58	-0,37%	1,35%	-27,16%
BB IMA-B 5+	1.419.683,46	0,20%	1,35%	15,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.436.737,16	-0,07%	1,35%	-5,20%
CAIXA IMA-B 5+	3.201.576,28	0,22%	1,35%	16,12%
SICREDI IRF-M	1.477.256,45	-0,42%	1,35%	-30,89%
BB NIVEL I	322.471,97	-1,83%	1,35%	-135,13%
BB ENERGIA	407.193,96	1,28%	1,35%	94,71%
BB SMALL CAP	352.806,47	-2,47%	1,35%	-182,92%
BB RETORNO TOTAL	374.374,35	-0,20%	1,35%	-14,98%
BB CONSUMO	408.336,75	-2,96%	1,35%	-219,04%
BB SETOR FINANCEIRO	176.640,41	-0,50%	1,35%	-37,09%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	284.547,11	-2,58%	1,35%	-191,05%
CAIXA IRF-M	1.013.482,33	-0,34%	1,35%	-25,29%
CAIXA IRF-M1 TP	1.234.684,98	0,12%	1,35%	9,24%
TOTAL / MÉDIA	17.037.193,38	-0,20%	1,35%	-14,91%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,20%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA TP	9,85%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	8,33%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	14,30%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	18,79%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M	8,67%	20%	Art. 7º, III, a
BB NIVEL I	1,89%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	2,39%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAP	2,07%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO TOTAL	2,20%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	2,40%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	1,04%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,67%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	5,95%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	7,25%	20%	Art. 7º, I, b

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,33%	0,70%	-46,59%
Fevereiro	-0,84%	0,74%	-113,27%
Março	-8,32%	0,56%	-1493,85%
Abril	2,13%	0,18%	1215,91%
Maior	1,74%	0,10%	1655,39%
Junho	2,63%	0,75%	351,83%
Julho	4,29%	0,85%	506,05%
Agosto	-1,72%	0,73%	-235,96%
Setembro	-1,98%	1,13%	-174,92%
Outubro	-0,20%	1,35%	-14,91%
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-3,11%	7,31%	-42,53%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -3,11%, enquanto que a meta acumulada no período é de 7,31%, sendo assim o RPPS atingiu -42,53% 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	2.248.504,12	68.246,19	0,40%
BB IPCA TP	1.678.897,58	23.448,53	0,14%
BB IMA-B 5+	1.419.683,46	68.329,50	0,40%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.436.737,16	36.468,85	0,21%
CAIXA IMA-B 5+	3.201.576,28	154.438,77	0,91%
SICREDI IRF-M	1.477.256,45	5.930,04	0,03%
BB NIVEL I	322.471,97	32.499,74	0,19%
BB ENERGIA	407.193,96	36.543,98	0,21%
BB SMALL CAP	352.806,47	40.523,35	0,24%
BB RETORNO TOTAL	374.374,35	39.834,49	0,23%
BB CONSUMO	408.336,75	44.973,15	0,26%
BB SETOR FINANCEIRO	176.640,41	24.558,30	0,14%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	284.547,11	48.564,63	0,29%
CAIXA IRF-M	1.013.482,33	14.456,52	0,08%
CAIXA IRF-M1 TP	1.234.684,98	1.956,05	0,01%
Carteira	17.037.193,38	536.519,60	3,15%

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	0,01
BB IPCA TP	-
BB IMA-B 5+	0,01
BB ALOCAÇÃO ATIVA	0,00
CAIXA IMA-B 5+	0,01
SICREDI IRF-M	-
BB NIVEL I	-
BB ENERGIA	0,01
BB SMALL CAP	-
BB RETORNO TOTAL	0,02
BB CONSUMO	-
BB SETOR FINANCEIRO	0,00
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	-
CAIXA IRF-M	-
CAIXA IRF-M1 TP	0,00

