

**INSTITUTO DE PREVIDENCIA SOCIAL DOS SERVIDORES
PUBLICOS DE BURITIS RO**

Informações referentes a Agosto/2021

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Agosto/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M	243.028,52	-0,65%	1,32%	-49,07%
BB IMA-B TP	137.679,16	-1,13%	1,32%	-85,90%
BB FLUXO	52.161,76	0,30%	1,32%	22,82%
BB PERFIL	187.218,53	0,45%	1,32%	33,99%
BB IRF-M	6.733.600,41	-0,65%	1,32%	-49,07%
BB IRF-M1 TP	6.507.439,96	0,33%	1,32%	25,43%
BB IMA-B 5+	183.977,47	-2,24%	1,32%	-170,39%
BB QUANTITATIVO	3.039.926,91	-2,06%	1,32%	-156,53%
BB JUROS E MOEDAS	2.023.958,97	0,43%	1,32%	32,54%
BB RETORNO AÇÕES	3.226.328,70	-2,87%	1,32%	-218,24%
BB IRF-M1 TP	433.534,92	0,33%	1,32%	25,43%
BB FLUXO	446.465,50	0,20%	1,32%	15,36%
BB PERFIL	403.160,59	0,45%	1,32%	33,99%
BB AÇÕES GLOBAIS	1.254.067,74	3,25%	1,32%	246,86%
BB IRF-M 1+	179.020,96	-1,19%	1,32%	-90,37%
BB RETORNO TOTAL	8.011.396,56	-0,45%	1,32%	-34,58%
BB AÇÕES BOLSA	1.299.121,84	3,26%	1,32%	247,74%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.571.173,21	0,35%	1,32%	26,59%
CAIXA IMA-B	7.240.184,44	-1,14%	1,32%	-86,44%
CAIXA IRF-M1 TP	8.524.854,25	0,34%	1,32%	26,14%
CAIXA TP	710.597,46	0,40%	1,32%	30,60%
CAIXA IRF-M1 TP	7.697.616,75	0,34%	1,32%	26,14%
CAIXA IRF-M	2.419.567,69	-0,63%	1,32%	-48,14%
CAIXA REF DI	244.585,84	0,49%	1,32%	37,31%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.733.953,76	0,19%	1,32%	14,77%
CAIXA IRF-M 1+	187.622,20	-1,16%	1,32%	-88,01%
CAIXA IRF-M 1+	1.081.955,69	-1,16%	1,32%	-88,01%
CAIXA IMA-B 5	4.795.667,69	0,13%	1,32%	10,17%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.678.314,35	-1,45%	1,32%	-110,20%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M	0,31%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B TP	0,18%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,07%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	0,24%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	8,61%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,32%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	0,24%	20%	Art. 7º, I, b
BB QUANTITATIVO	3,88%	20%	Art. 8º, II, a
BB JUROS E MOEDAS	2,59%	10%	Art. 8º, III
BB RETORNO AÇÕES	4,12%	20%	Art. 8º, II, a
BB IRF-M1 TP	0,55%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,57%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	0,52%	20%	Art. 7º, IV, a
BB AÇÕES GLOBAIS	1,60%	10%	Art. 9º-A, I
BB IRF-M 1+	0,23%	20%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	10,24%	20%	Art. 7º, IV, a
BB AÇÕES BOLSA	1,66%	20%	Art. 8º, II, a
BRADESCO IRF-M 1 TP	4,56%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	9,25%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	10,89%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA TP	0,91%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IRF-M1 TP	9,84%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M	3,09%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA REF DI	0,31%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IDKA IPCA 2A	6,05%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M 1+	0,24%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M 1+	1,38%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5	6,13%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3,42%	20%	Art. 7º, I, b

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,50%	0,69%	-72,38%
Fevereiro	-0,75%	1,31%	-57,18%
Março	0,04%	1,38%	2,86%
Abril	0,72%	0,75%	95,01%
Mai	0,61%	1,28%	47,93%
Junho	0,08%	0,97%	8,57%
Julho	-0,29%	1,41%	-20,52%
Agosto	-0,25%	1,32%	-19,24%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,35%	9,46%	-3,68%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,35%, enquanto que a meta acumulada no período é de 9,46%, sendo assim o RPPS atingiu -3,68% 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 IRF-M	243.028,52	3.113,72	0,00%
BB IMA-B TP	137.679,16	3.534,80	0,00%
BB FLUXO	52.161,76	11,25	0,00%
BB PERFIL	187.218,53	64,61	0,00%
BB IRF-M	6.733.600,41	86.271,92	0,11%
BB IRF-M1 TP	6.507.439,96	10.939,51	0,01%
BB IMA-B 5+	183.977,47	7.206,91	0,01%
BB QUANTITATIVO	3.039.926,91	206.985,32	0,26%
BB JUROS E MOEDAS	2.023.958,97	1.879,64	0,00%
BB RETORNO AÇÕES	3.226.328,70	238.182,21	0,30%
BB IRF-M1 TP	433.534,92	728,81	0,00%
BB FLUXO	446.465,50	96,25	0,00%
BB PERFIL	403.160,59	139,13	0,00%
BB AÇÕES GLOBAIS	1.254.067,74	85.299,90	0,11%
BB IRF-M 1+	179.020,96	3.386,19	0,00%
BB RETORNO TOTAL	8.011.396,56	103.816,89	0,13%
BB AÇÕES BOLSA	1.299.121,84	64.643,19	0,08%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.571.173,21	6.014,59	0,01%
CAIXA IMA-B	7.240.184,44	184.911,74	0,24%
CAIXA IRF-M1 TP	8.524.854,25	14.236,74	0,02%
CAIXA TP	710.597,46	267,04	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	7.697.616,75	12.855,23	0,02%
CAIXA IRF-M	2.419.567,69	30.937,94	0,04%
CAIXA REF DI	244.585,84	146,76	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.733.953,76	57.243,63	0,07%
CAIXA IRF-M 1+	187.622,20	3.561,10	0,00%
CAIXA IRF-M 1+	1.081.955,69	20.535,71	0,03%
CAIXA IMA-B 5	4.795.667,69	59.076,69	0,08%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.678.314,35	37.965,10	0,05%
Carteira	78.248.181,83	903.325,48	1,15%

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 IRF-M	-
BB IMA-B TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,01
BB IRF-M	-
BB IRF-M1 TP	-
BB IMA-B 5+	-
BB QUANTITATIVO	-
BB JUROS E MOEDAS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,01
BB AÇÕES GLOBAIS	-
BB IRF-M 1+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BB AÇÕES BOLSA	-
BRADESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA TP	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IRF-M	-
CAIXA REF DI	0,01
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
CAIXA IRF-M 1+	-
CAIXA IRF-M 1+	-
CAIXA IMA-B 5	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-