

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

Informações referentes a Novembro/2021

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Novembro/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M	39.157,08	1,50%	1,40%	107,19%
BB IMA-B TP	37.403,04	2,98%	1,40%	213,19%
BB FLUXO	87.847,96	0,11%	1,40%	7,52%
BB PERFIL	486.765,51	0,27%	1,40%	19,06%
BB IRF-M	624.684,77	1,47%	1,40%	105,38%
BB IRF-M1 TP	6.547.608,32	0,77%	1,40%	55,37%
BB IMA-B 5+	182.191,15	4,44%	1,40%	317,96%
BB QUANTITATIVO	2.730.956,90	-1,49%	1,40%	-106,79%
BB JUROS E MOEDAS	2.055.160,88	0,69%	1,40%	49,48%
BB RETORNO AÇÕES	2.635.721,21	-3,26%	1,40%	-233,35%
BB IRF-M1 TP	436.211,19	0,77%	1,40%	55,37%
BB FLUXO	251.211,71	0,37%	1,40%	26,15%
BB PERFIL	4.713.059,56	0,13%	1,40%	9,24%
BB AÇÕES GLOBAIS	2.359.921,99	-1,33%	1,40%	-95,50%
BB IRF-M 1+	175.146,26	2,26%	1,40%	161,96%
BB RETORNO TOTAL	8.070.608,18	1,54%	1,40%	110,42%
BB AÇÕES BOLSA	2.299.474,72	-1,14%	1,40%	-81,53%
BRASESCO IRF-M 1 TP	3.593.315,88	0,78%	1,40%	55,69%
CAIXA IMA-B	7.285.980,75	3,44%	1,40%	246,40%
CAIXA IRF-M1 TP	8.577.651,27	0,78%	1,40%	55,89%
CAIXA TP	1.022.440,94	0,50%	1,40%	35,69%
CAIXA IRF-M1 TP	7.745.290,44	0,78%	1,40%	55,89%
CAIXA IRF-M	2.389.343,21	1,81%	1,40%	129,32%
CAIXA REF DI	248.655,85	0,62%	1,40%	44,59%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.429.009,90	2,35%	1,40%	168,62%
CAIXA IRF-M 1+	183.593,41	2,19%	1,40%	156,99%
CAIXA IRF-M 1+	1.058.722,99	2,19%	1,40%	156,99%
CAIXA IMA-B 5	5.153.881,40	2,47%	1,40%	176,80%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.694.237,39	0,91%	1,40%	64,90%
TOTAL / MÉDIA	79.115.253,86	1,11%	1,40%	79,82%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M	0,05%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B TP	0,05%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,11%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	0,62%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	0,79%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,28%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	0,23%	20%	Art. 7º, I, b
BB QUANTITATIVO	3,45%	20%	Art. 8º, II, a
BB JUROS E MOEDAS	2,60%	10%	Art. 8º, III
BB RETORNO AÇÕES	3,33%	20%	Art. 8º, II, a
BB IRF-M1 TP	0,55%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,32%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	5,96%	20%	Art. 7º, IV, a
BB AÇÕES GLOBAIS	2,98%	10%	Art. 9º, A, I
BB IRF-M 1+	0,22%	20%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	10,20%	20%	Art. 7º, IV, a
BB AÇÕES BOLSA	2,91%	20%	Art. 8º, II, a
BRASESCO IRF-M 1 TP	4,54%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	9,21%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	10,84%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA TP	1,29%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IRF-M1 TP	9,79%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M	3,02%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA REF DI	0,31%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IDKA IPCA 2A	6,86%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M 1+	0,23%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M 1+	1,34%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5	6,51%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3,41%	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	-0,26%	1,32%	-19,53%
Setembro	-0,32%	1,61%	-19,62%
Outubro	-1,29%	1,70%	-76,18%
Novembro	1,11%	1,40%	79,82%
Dezembro			
Acumulado	-0,86%	14,69%	-5,84%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,86%, enquanto que a meta acumulada no período é de 14,69%, sendo assim o RPPS atingiu -5,84% 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	39.157,08	1.011,18	0,00%
BB IMA-B TP	37.403,04	1.755,82	0,00%
BB FLUXO	87.847,96	361,26	0,00%
BB PERFIL	486.765,51	2.529,05	0,00%
BB IRF-M	624.684,77	16.131,65	0,02%
BB IRF-M1 TP	6.547.608,32	51.651,78	0,07%
BB IMA-B 5+	182.191,15	12.596,83	0,02%
BB QUANTITATIVO	2.730.956,90	265.283,90	0,34%
BB JUROS E MOEDAS	2.055.160,88	12.313,43	0,02%
BB RETORNO AÇÕES	2.635.721,21	293.594,67	0,37%
BB IRF-M1 TP	436.211,19	3.441,12	0,00%
BB FLUXO	251.211,71	1.033,06	0,00%
BB PERFIL	4.713.059,56	24.487,33	0,03%
BB AÇÕES GLOBAIS	2.359.921,99	170.672,90	0,22%
BB IRF-M 1+	175.146,26	6.009,06	0,01%
BB RETORNO TOTAL	8.070.608,18	153.131,55	0,19%
BB AÇÕES BOLSA	2.299.474,72	136.131,67	0,17%
BRASESCO IRF-M 1 TP	3.593.315,88	28.513,68	0,04%
CAIXA IMA-B	7.285.980,75	340.505,84	0,43%
CAIXA IRF-M1 TP	8.577.651,27	68.017,31	0,09%
CAIXA TP	1.022.440,94	4.975,35	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	7.745.290,44	61.417,03	0,08%
CAIXA IRF-M	2.389.343,21	61.731,05	0,08%
CAIXA REF DI	248.655,85	1.287,00	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.429.009,90	139.213,53	0,18%
CAIXA IRF-M 1+	183.593,41	6.220,88	0,01%
CAIXA IRF-M 1+	1.058.722,99	35.873,80	0,05%
CAIXA IMA-B 5	5.153.881,40	137.421,11	0,17%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.694.237,39	40.932,98	0,05%
Carteira	79.115.253,86	1.267.437,11	1,60%

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	0,01
BB IMA-B TP	0,01
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,03
BB IRF-M	0,01
BB IRF-M1 TP	0,01
BB IMA-B 5+	0,01
BB QUANTITATIVO	-
BB JUROS E MOEDAS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB IRF-M1 TP	0,01
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,03
BB AÇÕES GLOBAIS	-
BB IRF-M 1+	0,01
BB RETORNO TOTAL	0,01
BB AÇÕES BOLSA	-
BRASESCO IRF-M 1 TP	0,01
CAIXA IMA-B	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	0,01
CAIXA TP	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	0,01
CAIXA IRF-M	0,01
CAIXA REF DI	0,01
CAIXA IDKA IPCA 2A	0,03
CAIXA IRF-M 1+	0,01
CAIXA IRF-M 1+	0,01
CAIXA IMA-B 5	0,02
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,01