

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

Informações referentes a Dezembro/2022

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Dezembro/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M	43.315,18	1,43%	1,02%	139,93%
BB IMA-B TP	39.762,82	-0,22%	1,02%	-21,29%
BB FLUXO	348.199,33	1,05%	1,02%	102,22%
BB PERFIL	552.412,53	1,12%	1,02%	109,58%
BB IRF-M	691.020,27	1,43%	1,02%	139,93%
BB IRF-M1 TP	7.377.441,35	1,16%	1,02%	112,96%
BB IMA-B 5+	186.945,58	-1,19%	1,02%	-116,09%
BB JUROS E MOEDAS	2.307.086,84	1,01%	1,02%	99,04%
BB IRF-M1 TP	3.289.425,53	1,16%	1,02%	112,96%
BB FLUXO	5.061.933,77	0,75%	1,02%	73,17%
BB PERFIL	9.618.215,89	1,12%	1,02%	109,58%
BB IRF-M 1+	191.818,92	1,54%	1,02%	150,54%
BB RETORNO TOTAL	8.888.340,47	0,77%	1,02%	74,93%
CAIXA IMA-B	7.753.534,39	-0,24%	1,02%	-23,12%
CAIXA IRF-M1 TP	9.665.887,55	1,15%	1,02%	112,72%
CAIXA TP	1.158.415,97	1,09%	1,02%	106,82%
CAIXA IRF-M	2.646.381,15	1,44%	1,02%	140,96%
CAIXA REF DI	282.274,93	1,15%	1,02%	112,24%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.962.410,89	1,23%	1,02%	120,46%
CAIXA IRF-M 1+	200.823,17	1,57%	1,02%	153,36%
CAIXA IMA-B 5	5.905.699,26	0,92%	1,02%	90,02%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.007.134,97	1,14%	1,02%	111,22%
CAIXA IRF-M1 TP	8.727.926,09	1,15%	1,02%	112,72%
CAIXA IRF-M 1+	1.158.081,34	1,57%	1,02%	153,36%
BRADESCO IRF-M 1 TP	4.050.770,56	1,15%	1,02%	112,61%
TOTAL / MÉDIA	89.115.258,75	0,96%	1,02%	93,71%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M	0,05%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B TP	0,04%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,39%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,62%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M	0,78%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,28%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	0,21%	100%	Art. 7º, I, b
BB JUROS E MOEDAS	2,59%	10%	Art. 10º, I, a
BB IRF-M1 TP	3,69%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	5,68%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	10,79%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M 1+	0,22%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	9,97%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B	8,70%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	10,85%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA TP	1,30%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IRF-M	2,97%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA REF DI	0,32%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IDKA IPCA 2A	6,69%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M 1+	0,23%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5	6,63%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3,37%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	9,79%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M 1+	1,30%	100%	Art. 7º, I, b
BRADESCO IRF-M 1 TP	4,55%	100%	Art. 7º, I, b

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,04%	0,94%	4,04%
Fevereiro	0,33%	1,42%	23,49%
Março	1,63%	2,03%	80,34%
Abril	-0,11%	0,40%	-26,67%
Mai	1,06%	0,87%	121,18%
Junho	-0,48%	1,07%	-44,78%
Julho	0,65%	-0,28%	-232,69%
Agosto	1,08%	0,04%	###
Setembro	1,08%	0,40%	268,38%
Outubro	1,12%	0,99%	112,46%
Novembro	0,35%	0,81%	42,59%
Dezembro	0,96%	1,02%	93,71%
Acumulado	7,96%	10,16%	78,41%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 7,96%, enquanto que a meta acumulada no período é de 10,16%, sendo assim o RPPS atingiu 78,41% 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	43.315,18	838,60	0,00%
BB IMA-B TP	39.762,82	1.120,28	0,00%
BB FLUXO	348.199,33	16,38	0,00%
BB PERFIL	552.412,53	77,52	0,00%
BB IRF-M	691.020,27	13.378,41	0,02%
BB IRF-M1 TP	7.377.441,35	8.519,71	0,01%
BB IMA-B 5+	186.945,58	8.105,82	0,01%
BB JUROS E MOEDAS	2.307.086,84	4.412,59	0,00%
BB IRF-M1 TP	3.289.425,53	3.798,73	0,00%
BB FLUXO	5.061.933,77	238,15	0,00%
BB PERFIL	9.618.215,89	1.349,69	0,00%
BB IRF-M 1+	191.818,92	5.522,67	0,01%
BB RETORNO TOTAL	8.888.340,47	124.944,23	0,14%
CAIXA IMA-B	7.753.534,39	221.535,97	0,25%
CAIXA IRF-M1 TP	9.665.887,55	11.063,43	0,01%
CAIXA TP	1.158.415,97	255,25	0,00%
CAIXA IRF-M	2.646.381,15	50.546,57	0,06%
CAIXA REF DI	282.274,93	65,88	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.962.410,89	85.660,07	0,10%
CAIXA IRF-M 1+	200.823,17	5.759,11	0,01%
CAIXA IMA-B 5	5.905.699,26	77.006,07	0,09%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.007.134,97	23.316,64	0,03%
CAIXA IRF-M1 TP	8.727.926,09	9.989,85	0,01%
CAIXA IRF-M 1+	1.158.081,34	33.210,87	0,04%
BRADESCO IRF-M 1 TP	4.050.770,56	4.646,48	0,01%
Carteira	89.115.258,75	653.593,61	0,73%

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	0,00
BB IMA-B TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	-
BB IRF-M	0,00
BB IRF-M1 TP	0,01
BB IMA-B 5+	-
BB JUROS E MOEDAS	-
BB IRF-M1 TP	0,01
BB FLUXO	-
BB PERFIL	-
BB IRF-M 1+	0,00
BB RETORNO TOTAL	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA IRF-M1 TP	0,01
CAIXA TP	-
CAIXA IRF-M	0,00
CAIXA REF DI	0,01
CAIXA IDKA IPCA 2A	0,00
CAIXA IRF-M 1+	0,00
CAIXA IMA-B 5	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	0,01
CAIXA IRF-M 1+	0,00
BRADESCO IRF-M 1 TP	0,01