



Relatório de Consultoria

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BURI

Informações referentes a Fevereiro/2019

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Fevereiro/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	8.699.115,63	0,44%	0,84%	52,29%
BB Perfil	4.292.776,75	0,45%	0,84%	54,19%
Caixa IRF-M1	16.869.612,27	0,45%	0,84%	53,35%
Caixa Ref. DI LP	5.241.894,77	0,48%	0,84%	57,57%
Bradesco IRF-M1 TP	7.329.406,74	0,44%	0,84%	52,58%
NTN-B - 2024	1.453.847,47	0,73%	0,84%	86,78%
NTN-B - 2024	1.701.987,74	0,73%	0,84%	86,78%
Santander Ativo FIC FI	849.417,25	0,49%	0,84%	58,63%
TOTAL / MÉDIA	46.438.058,62	0,47%	0,84%	56,01%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	18,73%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	9,24%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	36,33%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	11,29%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	15,78%	20%	Art. 7º, I, b
NTN-B - 2024	3,13%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,67%	100%	Art. 7º, I, a
Santander Ativo FIC FI	1,83%	20%	Art. 7º, IV, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,58%	0,73%	79,38%
Fevereiro	0,47%	0,84%	56,01%
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	1,05%	1,57%	66,78%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,05%, enquanto que a meta acumulada no período é de 1,57%, sendo assim o RPPS atingiu 66,78% 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-M1	8.699.115,63	13.302,85	0,03%
BB Perfil	4.292.776,75	523,45	0,00%
Caixa IRF-M1	16.869.612,27	25.271,08	0,05%
Caixa Ref. DI LP	5.241.894,77	307,71	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	7.329.406,74	10.861,44	0,02%
NTN-B - 2024	1.453.847,47	40.241,78	0,09%
NTN-B - 2024	1.701.987,74	47.110,18	0,10%
Santander Ativo FIC FI	849.417,25	6.410,37	0,01%
Carteira	46.438.058,62	101.411,29	0,22%

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-M1	-
BB Perfil	-
Caixa IRF-M1	-
Caixa Ref. DI LP	-
Bradesco IRF-M1 TP	-
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
Santander Ativo FIC FI	0,01