



Relatório de Consultoria

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BURI

Informações referentes a Janeiro/2019

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Janeiro/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	8.661.109,14	0,58%	0,73%	78,95%
BB Perfil	3.793.344,18	0,53%	0,73%	72,77%
BB IRF-M1	0,00	0,22%	0,73%	29,92%
BB Perfil	0,00	0,24%	0,73%	33,14%
Caixa IRF-M1	16.794.427,84	0,57%	0,73%	77,93%
Caixa Ref. DI LP	5.216.693,96	0,53%	0,73%	72,59%
Bradesco IRF-M1 TP	7.204.271,19	0,27%	0,73%	36,91%
NTN-B - 2024	1.485.843,32	0,79%	0,73%	108,12%
NTN-B - 2024	1.739.444,59	0,79%	0,73%	108,12%
Santander Ativo FIC FI	845.258,82	1,94%	0,73%	266,20%
TOTAL / MÉDIA	45.740.393,04	0,58%	0,73%	79,38%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	18,94%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	8,29%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M1	0,00%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	0,00%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	36,72%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	11,41%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	15,75%	20%	Art. 7º, I, b
NTN-B - 2024	3,25%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,80%	100%	Art. 7º, I, a
Santander Ativo FIC FI	1,85%	20%	Art. 7º, IV, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,58%	0,73%	79,38%
Fevereiro			
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,58%	0,73%	79,38%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,58%, enquanto que a meta acumulada no período é de 0,73%, sendo assim o RPPS atingiu 79,38% 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	8.661.109,14	14.050,58	0,03%
BB Perfil	3.793.344,18	904,40	0,00%
BB IRF-M1	0,00	0,00	0,00%
BB Perfil	0,00	0,00	0,00%
Caixa IRF-M1	16.794.427,84	26.418,46	0,06%
Caixa Ref. DI LP	5.216.693,96	552,46	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	7.204.271,19	11.205,48	0,02%
NTN-B - 2024	1.485.843,32	41.972,19	0,09%
NTN-B - 2024	1.739.444,59	49.135,93	0,11%
Santander Ativo FIC FI	845.258,82	4.915,54	0,01%
Carteira	45.740.393,04	102.249,88	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	0,02
BB Perfil	-
BB IRF-M1	0,02
BB Perfil	-
Caixa IRF-M1	0,01
Caixa Ref. DI LP	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,01
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
Santander Ativo FIC FI	0,09