



## Relatório de Consultoria

### INSTITUTO DE PREVIDENCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BURI

Informações referentes a Abril/2019

#### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Abril/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	8.780.793,47	0,50%	0,98%	50,86%
BB Perfil	4.886.327,19	0,49%	0,98%	49,88%
Caixa IRF-M1	8.477.291,20	0,50%	0,98%	51,18%
Caixa Ref. DI LP	5.796.427,60	0,51%	0,98%	51,71%
Bradesco IRF-M1 TP	7.397.980,73	0,48%	0,98%	49,02%
NTN-B - 2024	1.487.839,53	1,31%	0,98%	133,47%
NTN-B - 2024	1.741.781,50	1,31%	0,98%	133,47%
Santander Ativo FIC FI	863.592,35	0,92%	0,98%	94,24%
Caixa IDKA 2A	8.062.181,46	1,07%	0,98%	109,00%
<b>TOTAL / MÉDIA</b>	<b>47.494.215,03</b>	<b>0,65%</b>	<b>0,98%</b>	<b>66,83%</b>

#### 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	18,49%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	10,29%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	17,85%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	12,20%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	15,58%	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	1,82%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	16,98%	20%	Art. 7º, I, b

#### 3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,58%	0,73%	79,38%
Fevereiro	0,47%	0,84%	56,01%
Março	0,42%	1,16%	36,59%
Abril	0,65%	0,98%	66,83%
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
<b>Acumulado</b>	<b>2,14%</b>	<b>3,76%</b>	<b>57,05%</b>

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,14%, enquanto que a meta acumulada no período é de 3,76%, sendo assim o RPPS atingiu 57,05% 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	8.780.793,47	7.783,88	0,02%
BB Perfil	4.886.327,19	603,12	0,00%
Caixa IRF-M1	8.477.291,20	6.998,08	0,01%
Caixa Ref. DI LP	5.796.427,60	318,81	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	7.397.980,73	6.299,83	0,01%
NTN-B - 2024	1.487.839,53	208.747,99	0,44%
NTN-B - 2024	1.741.781,50	244.376,75	0,51%
Santander Ativo FIC FI	863.592,35	10.078,28	0,02%
Caixa IDKA 2A	8.062.181,46	51.407,91	0,11%
Carteira	47.494.215,03	461.439,75	0,97%

###### 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	0,03
Caixa IDKA 2A	0,05