



## 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%	0,70%	82,36%
BB Perfil	3.793.344,18	0,53%	0,70%	75,90%
BB IRF-M1	0,00	0,22%	0,70%	31,22%
BB Perfil	0,00	0,24%	0,70%	34,57%
Caixa IRF-M1	16.794.427,84	0,57%	0,70%	81,29%
Caixa Ref. DI LP	5.216.693,96	0,53%	0,70%	75,72%
Bradesco IRF-M1 TP	7.204.271,19	0,27%	0,70%	38,50%
NTN-B - 2024	1.485.843,32	0,79%	0,70%	112,78%
NTN-B - 2024	1.739.444,59	0,79%	0,70%	112,78%
Santander Ativo FIC FI	845.258,82	1,94%	0,70%	277,68%
<b>TOTAL / MÉDIA</b>	<b>45.740.393,04</b>	<b>0,58%</b>	<b>0,70%</b>	<b>82,81%</b>

#### 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%	0,70%	82,81%
Fevereiro			
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
<b>Acumulado</b>	<b>0,58%</b>	<b>0,70%</b>	<b>82,81%</b>

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,58%, enquanto que a meta acumulada no período é de 0,7%, sendo assim o RPPS atingiu 82,81% 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