



Relatório de Consultoria

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BURI

Informações referentes a Março/2018

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Março/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	8.208.035,46	0,63%	0,50%	127,33%
BB Perfil	3.604.852,75	0,54%	0,50%	108,40%
BB IRF-M1	3.891.259,63	0,63%	0,50%	127,20%
BB Fluxo	220.421,99	0,44%	0,50%	89,07%
BB Perfil	679.364,59	0,45%	0,50%	89,77%
Caixa IRF-M1	15.184.124,48	0,64%	0,50%	128,40%
Caixa Ref. DI LP	4.726.083,59	0,51%	0,50%	103,46%
Bradesco IRF-M1 TP	1.993.218,24	0,65%	0,50%	130,36%
Santander Ativo FIC FI	814.740,18	0,84%	0,50%	169,39%
NTN-B - 2024	1.410.781,93	0,67%	0,50%	135,51%
NTN-B - 2024	1.651.571,84	0,67%	0,50%	135,51%
TOTAL / MÉDIA	42.384.454,68	0,62%	0,50%	124,16%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	19,37%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB Perfil	8,51%	20%	Art. 7º, IV, "a"
BB IRF-M1	9,18%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB Fluxo	0,52%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB Perfil	1,60%	20%	Art. 7º, IV, "a"
Caixa IRF-M1	35,82%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa Ref. DI LP	11,15%	20%	Art. 7º, III, "a"
Bradesco IRF-M1 TP	4,70%	100%	Art. 7º, I, "b"
Santander Ativo FIC FI	1,92%	20%	Art. 7º, IV, "a"
NTN-B - 2024	3,33%	100%	Art. 7º, I, "a"
NTN-B - 2024	3,90%	100%	Art. 7º, I, "a"

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,63%	0,70%	89,63%
Fevereiro	0,53%	0,73%	72,05%
Março	0,62%	0,50%	124,16%
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	1,78%	1,94%	91,87%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,78%, enquanto que a meta acumulada no período é de 1,94%, sendo assim o RPPS atingiu 91,87% 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 Conexão Consultores.

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	8.208.035,46	7.073,42	0,02%
BB Perfil	3.604.852,75	1.356,51	0,00%
BB IRF-M1	3.891.259,63	3.353,36	0,01%
BB Fluxo	220.421,99	21,34	0,00%
BB Perfil	679.364,59	255,65	0,00%
Caixa IRF-M1	15.184.124,48	266.710,07	0,63%
Caixa Ref. DI LP	4.726.083,59	772,54	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	1.993.218,24	1.786,07	0,00%
Santander Ativo FIC FI	814.740,18	6.187,24	0,01%
NTN-B - 2024	1.410.781,93	44.173,66	0,10%
NTN-B - 2024	1.651.571,84	51.713,15	0,12%
Carteira	42.384.454,68	369.947,88	0,87%

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	0,05
BB Perfil	0,05
BB IRF-M1	0,05
BB Fluxo	-
BB Perfil	0,05
Caixa IRF-M1	0,05
Caixa Ref. DI LP	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,05
Santander Ativo FIC FI	-
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-