



Relatório de Consultoria

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BURI

Informações referentes a Maio/2018

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Maio/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	8.262.399,59	0,18%	0,81%	22,43%
BB Perfil	3.641.905,36	0,51%	0,81%	62,74%
BB IRF-M1	3.917.032,54	0,18%	0,81%	22,43%
BB Fluxo	234.409,77	0,42%	0,81%	52,23%
BB Perfil	686.347,46	0,51%	0,81%	62,74%
Caixa IRF-M1	15.364.510,28	0,19%	0,81%	23,71%
Caixa Ref. DI LP	4.773.949,21	0,50%	0,81%	61,82%
Bradesco IRF-M1 TP	2.006.429,25	0,17%	0,81%	20,62%
Santander Ativo FIC FI	799.996,78	-2,09%	0,81%	-258,52%
NTN-B - 2024	1.429.941,47	0,67%	0,81%	82,94%
NTN-B - 2024	1.674.001,50	0,67%	0,81%	82,94%
TOTAL / MÉDIA	42.790.923,21	0,25%	0,81%	30,41%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	19,31%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	8,51%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M1	9,15%	100%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,55%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	1,60%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	35,91%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	11,16%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	4,69%	100%	Art. 7º, I, b
Santander Ativo FIC FI	1,87%	20%	Art. 7º, IV, a
NTN-B - 2024	3,34%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,91%	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	0,50%	0,63%	79,74%
Maio	0,25%	0,81%	30,41%
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,54%	3,41%	74,58%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,54%, enquanto que a meta acumulada no período é de 3,41%, sendo assim o RPPS atingiu 74,58% 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 Asset.

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	8.262.399,59	13.404,73	0,03%
BB Perfil	3.641.905,36	608,52	0,00%
BB IRF-M1	3.917.032,54	6.354,90	0,01%
BB Fluxo	234.409,77	16,87	0,00%
BB Perfil	686.347,46	114,68	0,00%
Caixa IRF-M1	15.364.510,28	25.056,73	0,06%
Caixa Ref. DI LP	4.773.949,21	557,19	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	2.006.429,25	3.356,02	0,01%
Santander Ativo FIC FI	799.996,78	8.957,20	0,02%
NTN-B - 2024	1.429.941,47	32.754,34	0,08%
NTN-B - 2024	1.674.001,50	38.344,79	0,09%
Carteira	42.790.923,21	91.586,73	0,21%

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