



Relatório de Consultoria

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BURI

Informações referentes a Abril/2018

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Abril/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	8.247.430,96	0,48%	0,63%	76,39%
BB Perfil	3.623.511,27	0,52%	0,63%	82,38%
BB IRF-M1	3.909.936,22	0,48%	0,63%	76,39%
BB Fluxo	233.423,37	0,42%	0,63%	67,39%
BB Perfil	682.880,94	0,52%	0,63%	82,38%
Caixa IRF-M1	15.335.091,98	0,49%	0,63%	77,52%
Caixa Ref. DI LP	4.750.190,37	0,51%	0,63%	81,18%
Bradesco IRF-M1	2.003.087,60	0,50%	0,63%	78,81%
Santander Ativo F	817.086,37	0,29%	0,63%	45,83%
NTN-B - 2024	1.420.409,70	0,68%	0,63%	108,62%
NTN-B - 2024	1.662.842,87	0,68%	0,63%	108,62%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	19,32%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB Perfil	8,49%	20%	Art. 7º, IV, "a"
BB IRF-M1	9,16%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB Fluxo	0,55%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB Perfil	1,60%	20%	Art. 7º, IV, "a"
Caixa IRF-M1	35,93%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa Ref. DI LP	11,13%	20%	Art. 7º, III, "a"
Bradesco IRF-M1	4,69%	100%	Art. 7º, I, "b"
Santander Ativo F	1,91%	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	0,50%	0,63%	79,74%
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,29%	2,58%	88,82%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,29%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,58%, sendo assim o RPPS atingiu 88,82% 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	8.247.430,96	7.494,92	0,02%
BB Perfil	3.623.511,27	1.252,46	0,00%
BB IRF-M1	3.909.936,22	3.553,19	0,01%
BB Fluxo	233.423,37	18,60	0,00%
BB Perfil	682.880,94	236,04	0,00%
Caixa IRF-M1	15.335.091,98	13.361,99	0,03%
Caixa Ref. DI LP	4.750.190,37	700,00	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	2.003.087,60	1.877,21	0,00%
Santander Ativo FIC FI	817.086,37	6.028,56	0,01%
NTN-B - 2024	1.420.409,70	33.378,12	0,08%
NTN-B - 2024	1.662.842,87	39.075,04	0,09%

Carteira	42.685.891,65	84.252,08	0,20%
----------	---------------	-----------	-------

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	-