



## Relatório de Consultoria

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

Informações referentes a Fevereiro/2018

#### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Fevereiro/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	8.156.340,59	0,52%	0,73%	72,00%
BB Perfil	3.585.506,43	0,47%	0,73%	64,18%
BB IRF-M1	3.854.497,63	0,52%	0,73%	72,00%
BB Fluxo	219.448,97	0,37%	0,73%	50,85%
BB Perfil	465.731,50	0,47%	0,73%	64,18%
Caixa IRF-M1	15.087.691,17	0,53%	0,73%	72,83%
Caixa Ref. DI LP	4.701.869,48	0,44%	0,73%	60,51%
Bradesco IRF-M1 TP	1.980.367,67	0,47%	0,73%	64,92%
Santander Ativo FIC FI	807.927,92	0,60%	0,73%	82,02%
NTN-B - 2024	1.401.329,44	0,73%	0,73%	99,53%
NTN-B - 2024	1.640.506,02	0,73%	0,73%	99,53%
TOTAL / MÉDIA	41.901.216,82	0,53%	0,73%	72,05%

#### 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	19,47%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB Perfil	8,56%	20%	Art. 7º, IV, "a"
BB IRF-M1	9,20%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB Fluxo	0,52%	100%	Art. 7º, I, "b"
BB Perfil	1,11%	20%	Art. 7º, IV, "a"
Caixa IRF-M1	36,01%	100%	Art. 7º, I, "b"
Caixa Ref. DI LP	11,22%	20%	Art. 7º, III, "a"
Bradesco IRF-M1 TP	4,73%	100%	Art. 7º, I, "b"
Santander Ativo FIC FI	1,93%	20%	Art. 7º, IV, "a"
NTN-B - 2024	3,34%	100%	Art. 7º, I, "a"
NTN-B - 2024	3,92%	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			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	1,15%	1,43%	80,60%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,15%, enquanto que a meta acumulada no período é de 1,43%, sendo assim o RPPS atingiu 80,6% 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	8.156.340,59	5.931,57	0,01%
BB Perfil	3.585.506,43	1.503,74	0,00%
BB IRF-M1	3.854.497,63	2.803,12	0,01%
BB Fluxo	219.448,97	34,23	0,00%
BB Perfil	465.731,50	195,33	0,00%
Caixa IRF-M1	15.087.691,17	10.874,30	0,03%
Caixa Ref. DI LP	4.701.869,48	1.167,13	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	1.980.367,67	1.509,95	0,00%
Santander Ativo FIC FI	807.927,92	6.578,52	0,02%
NTN-B - 2024	1.401.329,44	34.744,66	0,08%
NTN-B - 2024	1.640.506,02	40.674,82	0,10%
Carteira	41.901.216,82	83.902,67	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	0,05
BB Perfil	0,02
BB IRF-M1	0,05
BB Fluxo	-
BB Perfil	0,02
Caixa IRF-M1	0,06
Caixa Ref. DI LP	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,05
Santander Ativo FIC FI	-
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-