



Relatório de Consultoria

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BURI

Informações referentes a Dezembro/2018

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Dezembro/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	8.611.564,44	0,54%	0,56%	96,06%
BB Perfil	3.773.335,97	0,47%	0,56%	83,88%
BB IRF-M1	4.082.564,36	0,54%	0,56%	96,06%
BB Perfil	711.116,66	0,47%	0,56%	83,88%
Caixa IRF-M1	16.699.589,96	0,53%	0,56%	94,88%
Caixa Ref. DI LP	5.189.245,49	0,48%	0,56%	86,20%
Bradesco IRF-M1 TP	2.184.946,80	0,54%	0,56%	96,52%
NTN-B - 2024	1.474.228,29	0,38%	0,56%	67,28%
NTN-B - 2024	1.725.847,12	0,38%	0,56%	67,28%
Santander Ativo FIC FI	829.174,15	1,15%	0,56%	206,06%
TOTAL / MÉDIA	45.281.613,24	0,52%	0,56%	93,27%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	19,02%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	8,33%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M1	9,02%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	1,57%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	36,88%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	11,46%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	4,83%	100%	Art. 7º, I, b
NTN-B - 2024	3,26%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,81%	100%	Art. 7º, I, a
Santander Ativo FIC FI	1,83%	20%	Art. 7º, IV, 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	0,55%	1,67%	32,70%
Julho	0,69%	0,74%	93,46%
Agosto	0,55%	0,32%	173,63%
Setembro	0,56%	0,89%	62,62%
Outubro	0,85%	0,86%	99,03%
Novembro	0,53%	0,20%	267,36%
Dezembro	0,52%	0,56%	93,27%
Acumulado	6,97%	8,93%	78,03%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 6,97%, enquanto que a meta acumulada no período é de 8,93%, sendo assim o RPPS atingiu 78,03% 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	8.611.564,44	17.024,16	0,04%
BB Perfil	3.773.335,97	956,04	0,00%
BB IRF-M1	4.082.564,36	8.070,80	0,02%
BB Perfil	711.116,66	180,17	0,00%
Caixa IRF-M1	16.699.589,96	32.475,69	0,07%
Caixa Ref. DI LP	5.189.245,49	557,09	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	2.184.946,80	4.244,12	0,01%
NTN-B - 2024	1.474.228,29	0,00	0,00%
NTN-B - 2024	1.725.847,12	0,00	0,00%
Santander Ativo FIC FI	829.174,15	3.595,40	0,01%
Carteira	45.281.613,24	59.525,55	0,13%

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	-
BB IRF-M1	0,05
BB Perfil	-
Caixa IRF-M1	0,05
Caixa Ref. DI LP	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,05
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
Santander Ativo FIC FI	0,06