



Relatório de Consultoria

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BURI

Informações referentes a Março/2019

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Março/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1	8.737.253,93	0,44%	1,16%	37,78%
BB Perfil	4.312.563,48	0,46%	1,16%	39,72%
Caixa IRF-M1	8.434.991,84	0,39%	1,16%	33,40%
Caixa Ref. DI LP	5.767.210,98	0,44%	1,16%	37,99%
Bradesco IRF-M1 TP	7.362.617,59	0,45%	1,16%	39,05%
NTN-B - 2024	1.468.635,60	1,02%	1,16%	87,65%
NTN-B - 2024	1.719.299,88	1,02%	1,16%	87,65%
Santander Ativo FIC FI	855.691,38	0,74%	1,16%	63,65%
Caixa IDKA 2A	7.976.996,84	-0,29%	1,16%	-24,78%
TOTAL / MÉDIA	46.635.261,52	0,42%	1,16%	36,59%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1	18,74%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	9,25%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	18,09%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	12,37%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	15,79%	20%	Art. 7º, I, b
NTN-B - 2024	3,15%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,69%	100%	Art. 7º, I, a
Santander Ativo FIC FI	1,83%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	17,11%	20%	Art. 7º, I, b

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,58%	0,73%	79,38%
Fevereiro	0,47%	0,84%	56,01%
Março	0,42%	1,16%	36,59%
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	1,48%	2,75%	53,78%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,48%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,75%, sendo assim o RPPS atingiu 53,78% 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	8.737.253,93	7.512,51	0,02%
BB Perfil	4.312.563,48	509,08	0,00%
Caixa IRF-M1	8.434.991,84	6.814,49	0,01%
Caixa Ref. DI LP	5.767.210,98	373,78	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	7.362.617,59	6.011,10	0,01%
NTN-B - 2024	1.468.635,60	41.972,70	0,09%
NTN-B - 2024	1.719.299,88	49.136,52	0,11%
Santander Ativo FIC FI	855.691,38	9.944,85	0,02%
Caixa IDKA 2A	7.976.996,84	53.568,18	0,11%
Carteira	46.635.261,52	138.060,95	0,30%

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	-
Caixa IRF-M1	-
Caixa Ref. DI LP	-
Bradesco IRF-M1 TP	-
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
Santander Ativo FIC FI	0,01
Caixa IDKA 2A	0,01