



Relatório de Consultoria

INSTITUTO DE PREVIDENCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PUBLICOS DE BURITIS RO

Informações referentes a Dezembro/2018

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Dezembro/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	84.618,87	1,62%	0,64%	253,40%
BB Perfil	188.994,79	0,47%	0,64%	74,08%
BB IRF-M	2.286.947,61	1,51%	0,64%	237,23%
BB IRF-M1	1.735.755,21	0,54%	0,64%	84,08%
BB IRF-M1	19.466.420,35	0,53%	0,64%	82,65%
BB Perfil	1.015.688,68	0,47%	0,64%	73,43%
Bradesco IRF-M1 TP	3.203.837,20	0,54%	0,64%	84,49%
Caixa IMA-B	3.489.910,12	1,63%	0,64%	255,62%
Caixa IRF-M1	26.267.588,14	0,54%	0,64%	84,19%
Caixa Brasil TP	2.656.123,35	0,48%	0,64%	75,87%
TOTAL / MÉDIA	60.395.884,32	0,63%	0,64%	98,92%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B TP	0,14%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	0,31%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	3,79%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	2,87%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	32,23%	100%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	1,68%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	5,30%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	5,78%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	43,49%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,40%	100%	Art. 7º, I, b

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,75%	0,87%	86,25%
Fevereiro	0,54%	0,82%	66,15%
Março	0,67%	0,58%	115,71%
Abril	0,45%	0,71%	63,30%
Maior	-0,06%	0,89%	-6,59%
Junho	0,43%	1,75%	24,73%
Julho	0,78%	0,82%	95,51%
Agosto	0,31%	0,40%	78,54%
Setembro	0,57%	0,97%	58,63%
Outubro	1,32%	0,94%	140,63%
Novembro	0,56%	0,28%	203,44%
Dezembro	0,63%	0,64%	98,92%
Acumulado	7,17%	10,08%	71,18%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 7,17%, enquanto que a meta acumulada no período é de 10,08%, sendo assim o RPPS atingiu 71,18% 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 IMA-B TP	84.618,87	2.469,42	0,00%
BB Perfil	188.994,79	47,89	0,00%
BB IRF-M	2.286.947,61	40.254,70	0,07%
BB IRF-M1	1.735.755,21	3.431,41	0,01%
BB IRF-M1	19.466.420,35	38.483,08	0,06%
BB Perfil	1.015.688,68	257,34	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	3.203.837,20	6.223,26	0,01%
Caixa IMA-B	3.489.910,12	102.328,29	0,17%
Caixa IRF-M1	26.267.588,14	51.082,58	0,08%
Caixa Brasil TP	2.656.123,35	894,08	0,00%
Carteira	60.395.884,32	217.384,51	0,36%

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 IMA-B TP	0,06
BB Perfil	-
BB IRF-M	0,07
BB IRF-M1	0,05
BB IRF-M1	0,05
BB Perfil	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,05
Caixa IMA-B	0,06
Caixa IRF-M1	0,05
Caixa Brasil TP	-