



Relatório de Consultoria

INSTITUTO DE PREVIDENCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PUBLICOS DE BURITIS RO

Informações referentes a Janeiro/2019

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Janeiro/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	88.304,90	4,36%	0,81%	538,91%
BB Perfil	197.344,77	0,51%	0,81%	63,14%
BB IRF-M	2.318.165,01	1,37%	0,81%	168,87%
BB IRF-M1	1.745.741,48	0,58%	0,81%	71,18%
BB IRF-M1	19.578.416,03	0,58%	0,81%	71,18%
BB Perfil	881.665,42	0,50%	0,81%	62,36%
Bradesco IRF-M1 TP	3.221.677,85	0,56%	0,81%	68,89%
Caixa IMA-B	3.643.252,27	4,39%	0,81%	543,59%
Caixa IRF-M1	26.416.763,24	0,57%	0,81%	70,26%
Caixa Brasil TP	2.670.136,99	0,53%	0,81%	65,27%
TOTAL / MÉDIA	60.761.467,96	0,82%	0,81%	101,88%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B TP	0,15%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	0,32%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	3,82%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	2,87%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	32,22%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	1,45%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	5,30%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	6,00%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	43,48%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,39%	20%	Art. 7º, I, b

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,82%	0,81%	101,88%
Fevereiro			
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,82%	0,81%	101,88%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,82%, enquanto que a meta acumulada no período é de 0,81%, sendo assim o RPPS atingiu 101,88% 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	88.304,90	2.174,82	0,00%
BB Perfil	197.344,77	47,05	0,00%
BB IRF-M	2.318.165,01	32.476,39	0,05%
BB IRF-M1	1.745.741,48	2.832,05	0,00%
BB IRF-M1	19.578.416,03	31.761,30	0,05%
BB Perfil	881.665,42	210,20	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	3.221.677,85	5.010,98	0,01%
Caixa IMA-B	3.643.252,27	90.574,04	0,15%
Caixa IRF-M1	26.416.763,24	41.554,86	0,07%
Caixa Brasil TP	2.670.136,99	588,41	0,00%
Carteira	60.761.467,96	179.958,19	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 IMA-B TP	0,11
BB Perfil	-
BB IRF-M	0,04
BB IRF-M1	0,02
BB IRF-M1	0,02
BB Perfil	-
Bradesco IRF-M1 TP	0,01
Caixa IMA-B	0,11
Caixa IRF-M1	0,01
Caixa Brasil TP	-