



Relatório de Consultoria

INSTITUTO DE PREVIDENCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PUBLICOS DE BURITIS RO

Informações referentes a Fevereiro/2019

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Fevereiro/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	88.743,27	0,50%	0,92%	54,03%
BB Perfil	198.092,41	0,48%	0,92%	52,72%
BB IRF-M	2.340.315,97	0,27%	0,92%	29,89%
BB IRF-M1	1.910.788,82	0,41%	0,92%	44,90%
BB IRF-M1	19.664.329,62	0,44%	0,92%	47,76%
BB Perfil	885.938,74	0,48%	0,92%	52,75%
Bradesco IRF-M1 TP	3.236.033,48	0,45%	0,92%	48,49%
Caixa IMA-B	3.662.107,56	0,52%	0,92%	56,32%
Caixa IRF-M1	26.535.024,46	0,45%	0,92%	48,72%
Caixa Brasil TP	2.783.088,81	0,47%	0,92%	50,88%
TOTAL / MÉDIA	61.304.463,14	0,44%	0,92%	48,19%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B TP	0,14%	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	3,12%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	32,08%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	1,45%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	5,28%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	5,97%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	43,28%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,54%	20%	Art. 7º, I, b

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,82%	0,81%	101,88%
Fevereiro	0,44%	0,92%	48,19%
Março			
Abril			
Mai			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	1,27%	1,73%	73,22%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,27%, enquanto que a meta acumulada no período é de 1,73%, sendo assim o RPPS atingiu 73,22% 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	88.743,27	2.257,44	0,00%
BB Perfil	198.092,41	24,15	0,00%
BB IRF-M	2.340.315,97	31.792,04	0,05%
BB IRF-M1	1.910.788,82	2.922,01	0,00%
BB IRF-M1	19.664.329,62	30.071,05	0,05%
BB Perfil	885.938,74	108,03	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	3.236.033,48	4.795,48	0,01%
Caixa IMA-B	3.662.107,56	93.631,69	0,15%
Caixa IRF-M1	26.535.024,46	39.750,09	0,06%
Caixa Brasil TP	2.783.088,81	478,29	0,00%
Carteira	61.304.463,14	184.601,26	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	0,01
BB Perfil	-
BB IRF-M	0,01
BB IRF-M1	-
BB IRF-M1	-
BB Perfil	-
Bradesco IRF-M1 TP	-
Caixa IMA-B	0,01
Caixa IRF-M1	-
Caixa Brasil TP	-