



Relatório de Consultoria

INSTITUTO DE PREVIDENCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PUBLICOS DE BURITIS RO

Informações referentes a Março/2019

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Março/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	89.238,92	0,56%	1,24%	45,03%
BB Perfil	212.059,28	0,45%	1,24%	36,56%
BB IRF-M	2.353.627,95	0,57%	1,24%	45,86%
BB IRF-M1	1.919.166,02	0,44%	1,24%	35,34%
BB IRF-M1	19.750.541,15	0,44%	1,24%	35,34%
BB Perfil	890.022,31	0,46%	1,24%	37,16%
Bradesco IRF-M1 TP	3.250.696,53	0,45%	1,24%	36,53%
Caixa IMA-B	3.826.781,95	0,52%	1,24%	41,66%
Caixa IRF-M1	26.652.808,25	0,44%	1,24%	35,79%
Caixa Brasil TP	2.795.701,71	0,45%	1,24%	36,54%
TOTAL / MÉDIA	61.740.644,07	0,45%	1,24%	36,49%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B TP	0,14%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	0,34%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	3,81%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	3,11%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	31,99%	20%	Art. 7º, I, b
BB Perfil	1,44%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	5,27%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	6,20%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	43,17%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,53%	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	0,45%	1,24%	36,49%
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	1,73%	3,00%	57,68%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,73%, enquanto que a meta acumulada no período é de 3%, sendo assim o RPPS atingiu 57,68% 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	89.238,92	2.199,50	0,00%
BB Perfil	212.059,28	25,03	0,00%
BB IRF-M	2.353.627,95	26.622,07	0,04%
BB IRF-M1	1.919.166,02	1.650,15	0,00%
BB IRF-M1	19.750.541,15	16.982,00	0,03%
BB Perfil	890.022,31	105,06	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	3.250.696,53	2.653,98	0,00%
Caixa IMA-B	3.826.781,95	94.409,42	0,15%
Caixa IRF-M1	26.652.808,25	21.532,35	0,03%
Caixa Brasil TP	2.795.701,71	416,12	0,00%
Carteira	61.740.644,07	148.342,98	0,24%

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	0,00
BB Perfil	-
BB IRF-M	0,00
BB IRF-M1	-
BB IRF-M1	-
BB Perfil	-
Bradesco IRF-M1 TP	-
Caixa IMA-B	0,00
Caixa IRF-M1	-
Caixa Brasil TP	-