



## Relatório de Consultoria

### INSTITUTO DE PREVIDENCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PUBLICOS DE BURITIS RO

Informações referentes a Abril/2019

#### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Abril/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B TP	90.573,84	1,50%	1,06%	141,18%
BB Fluxo	14.385,27	0,24%	1,06%	22,56%
BB Perfil	216.288,53	0,51%	1,06%	47,83%
BB IRF-M	5.023.437,46	0,40%	1,06%	37,37%
BB IRF-M1	8.143.510,19	0,30%	1,06%	28,30%
BB IMA-B 5+	2.006.498,82	0,32%	1,06%	30,67%
BB IRF-M1	9.128.805,84	0,40%	1,06%	37,40%
BB Fluxo	16.131,88	0,49%	1,06%	46,15%
BB Perfil	855.104,09	0,53%	1,06%	50,11%
Bradesco IRF-M1 TP	3.266.309,83	0,48%	1,06%	45,33%
Caixa IMA-B	6.110.968,71	1,40%	1,06%	131,84%
Caixa IRF-M1	8.755.666,31	0,39%	1,06%	36,42%
Caixa Brasil TP	2.810.242,25	0,52%	1,06%	49,09%
Caixa IRF-M1	8.006.660,30	0,04%	1,06%	3,42%
Caixa IRF-M1+	0,00	0,05%	1,06%	4,49%
Caixa IRF-M	2.002.173,18	0,06%	1,06%	5,96%
Caixa IRF-M1+	0,00	0,05%	1,06%	4,49%
Caixa Ref. DI LP	4.006.734,19	0,17%	1,06%	15,89%
Caixa IDKA 2A	2.009.388,53	0,47%	1,06%	44,31%
TOTAL / MÉDIA	62.462.879,22	0,61%	1,06%	57,53%

#### 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B TP	0,15%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,02%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	0,35%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IRF-M	8,04%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	13,04%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	3,21%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	14,61%	20%	Art. 7º, I, b
BB Fluxo	0,03%	20%	Art. 7º, IV, a
BB Perfil	1,37%	20%	Art. 7º, IV, a
Bradesco IRF-M1 TP	5,23%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B	9,78%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	14,02%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Brasil TP	4,50%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	12,82%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	0,00%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M	3,21%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	0,00%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Ref. DI LP	6,41%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IDKA 2A	3,22%	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	0,61%	1,06%	57,53%
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,35%	4,09%	57,45%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,35%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,09%, sendo assim o RPPS atingiu 57,45% 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	90.573,84	2.156,23	0,00%
BB Fluxo	14.385,27	0,44	0,00%
BB Perfil	216.288,53	26,70	0,00%
BB IRF-M	5.023.437,46	53.437,69	0,09%
BB IRF-M1	8.143.510,19	7.218,95	0,01%
BB IMA-B 5+	2.006.498,82	73.333,74	0,12%
BB IRF-M1	9.128.805,84	8.092,38	0,01%
BB Fluxo	16.131,88	0,49	0,00%
BB Perfil	855.104,09	105,55	0,00%
Bradesco IRF-M1 TP	3.266.309,83	2.781,46	0,00%
Caixa IMA-B	6.110.968,71	145.533,60	0,23%
Caixa IRF-M1	8.755.666,31	7.227,88	0,01%
Caixa Brasil TP	2.810.242,25	605,40	0,00%
Caixa IRF-M1	8.006.660,30	6.609,57	0,01%
Caixa IRF-M1+	0,00	0,00	0,00%
Caixa IRF-M	2.002.173,18	21.901,57	0,04%
Caixa IRF-M1+	0,00	0,00	0,00%
Caixa Ref. DI LP	4.006.734,19	220,37	0,00%
Caixa IDKA 2A	2.009.388,53	12.812,72	0,02%
Carteira	62.462.879,22	319.565,50	0,51%

###### 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	0,04
BB Fluxo	-
BB Perfil	-
BB IRF-M	0,00
BB IRF-M1	-
BB IMA-B 5+	0,03
BB IRF-M1	-
BB Fluxo	-
BB Perfil	-
Bradesco IRF-M1 TP	-
Caixa IMA-B	0,04
Caixa IRF-M1	-
Caixa Brasil TP	-
Caixa IRF-M1	-
Caixa IRF-M1+	0,00
Caixa IRF-M	0,00
Caixa IRF-M1+	0,00
Caixa Ref. DI LP	-
Caixa IDKA 2A	0,05