



Relatório de Consultoria

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA

Informações referentes a Janeiro/2019

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Janeiro/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IPCA TP	1.519.674,01	2,14%	0,78%	274,40%
BB IRF-M1	0,00	0,06%	0,78%	7,29%
BB IMA-B 5+	10.865.923,38	6,27%	0,78%	805,65%
BB IMA-B TP	2.320.775,07	4,34%	0,78%	557,99%
Caixa IRF-M1	0,00	0,08%	0,78%	10,12%
Caixa IRF-M1	683.350,87	0,57%	0,78%	72,98%
Caixa IMA-B 5+	0,00	2,46%	0,78%	315,71%
Sicredi IRF-M	1.290.392,71	1,42%	0,78%	182,34%
Caixa IMA-B 5+	6.562.990,28	2,81%	0,78%	361,30%
TOTAL / MÉDIA	23.243.106,32	4,44%	0,78%	570,79%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IPCA TP	6,54%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	0,00%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	46,75%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B TP	9,98%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	0,00%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	2,94%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B 5+	0,00%	20%	Art. 7º, I, b
Sicredi IRF-M	5,55%	20%	Art. 7º, III, a
Caixa IMA-B 5+	28,24%	20%	Art. 7º, I, b

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	4,44%	0,78%	570,79%
Fevereiro			
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	4,44%	0,78%	570,79%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 4,44%, enquanto que a meta acumulada no período é de 0,78%, sendo assim o RPPS atingiu 570,79% 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 IPCA TP	1.519.674,01	27.350,11	0,12%
BB IRF-M1	0,00	0,00	0,00%
BB IMA-B 5+	10.865.923,38	403.693,41	1,74%
BB IMA-B TP	2.320.775,07	57.157,19	0,25%
Caixa IRF-M1	0,00	0,00	0,00%
Caixa IRF-M1	683.350,87	1.074,94	0,00%
Caixa IMA-B 5+	0,00	0,00	0,00%
Sicredi IRF-M	1.290.392,71	18.423,30	0,08%
Caixa IMA-B 5+	6.562.990,28	242.499,81	1,04%
Carteira	23.243.106,32	674.583,23	2,90%

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 IPCA TP	0,07
BB IRF-M1	0,02
BB IMA-B 5+	0,11
BB IMA-B TP	0,11
Caixa IRF-M1	0,01
Caixa IRF-M1	0,01
Caixa IMA-B 5+	0,11
Sicredi IRF-M	0,04
Caixa IMA-B 5+	0,11