



Relatório de Consultoria

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA

Informações referentes a Março/2019

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Março/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IPCA TP	1.539.975,19	1,01%	1,24%	81,05%
BB IRF-M1	5.909.755,14	0,44%	1,24%	35,17%
BB IMA-B 5+	4.997.569,79	0,41%	1,24%	33,39%
Caixa IRF-M1	558.926,26	0,44%	1,24%	35,13%
Sicredi IRF-M	1.301.228,92	0,57%	1,24%	45,86%
BB IRF-M1	0,00	0,16%	1,24%	12,91%
Caixa IRF-M1+	5.366.603,90	0,54%	1,24%	43,28%
BB IMA-B 5+	2.297.401,44	-0,72%	1,24%	-58,21%
TOTAL / MÉDIA	21.971.460,64	0,40%	1,24%	32,14%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IPCA TP	7,01%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	26,90%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	22,75%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	2,54%	20%	Art. 7º, I, b
Sicredi IRF-M	5,92%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M1	0,00%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	24,43%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	10,46%	20%	Art. 7º, I, b

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	4,44%	0,81%	549,50%
Fevereiro	-0,49%	0,92%	-53,43%
Março	0,40%	1,24%	32,14%
Abril			
Mai			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	4,34%	3,00%	144,95%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 4,34%, enquanto que a meta acumulada no período é de 3%, sendo assim o RPPS atingiu 144,95% 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	1.539.975,19	22.289,93	0,10%
BB IRF-M1	5.909.755,14	5.081,35	0,02%
BB IMA-B 5+	4.997.569,79	188.551,16	0,86%
Caixa IRF-M1	558.926,26	451,55	0,00%
Sicredi IRF-M	1.301.228,92	15.205,31	0,07%
BB IRF-M1	0,00	0,00	0,00%
Caixa IRF-M1+	5.366.603,90	85.734,53	0,39%
BB IMA-B 5+	2.297.401,44	86.677,67	0,39%
Carteira	21.971.460,64	382.628,89	1,74%

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	0,01
BB IRF-M1	-
BB IMA-B 5+	0,00
Caixa IRF-M1	-
Sicredi IRF-M	-
BB IRF-M1	-
Caixa IRF-M1+	-
BB IMA-B 5+	0,00