

Imprimir



DI BLASI
Consultoria Financeira

**INSTITUTO DE PREVIDENCIA
MUNICIPAL DE SÃO
SEBASTIÃO DA BOA VISTA**
Informações referentes ao período
de Maio de 2021



Rentabilidade Média

Fundo de Renda Fixa

Fundo	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 399,59	0,6701%	1,2785%	52,4130%
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 203,29	0,1774%	1,2785%	13,8756%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R\$ 1.550.974,69	0,1676%	1,2785%	13,1091%

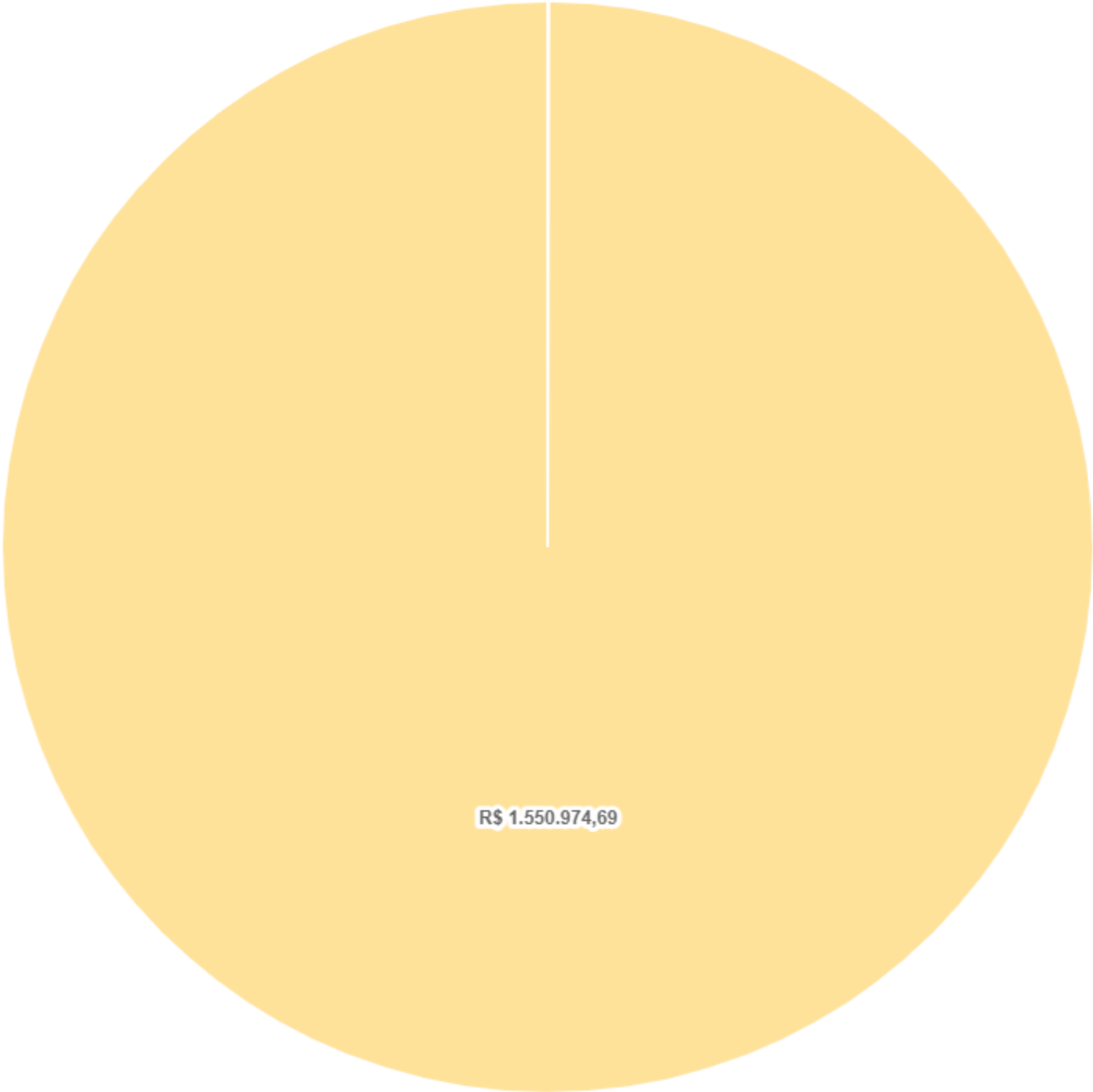
Total	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
	R\$ 1.551.577,57	13,1202%	1,2785%	13,1202%

Total: R\$ R\$ 1.551.577,57

A rentabilidade média da carteira é de 0,1677%, enquanto que a meta atuarial foi de 1,2785%, sendo assim, atingindo 13,1202% da meta Atuarial

Carteira Atual

BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF



R\$ 1.550.974,69

Comparativo com a Meta Atuarial

Mês	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
JANEIRO	0,0253%	0,6959%	3,6290%
FEVEREIRO	0,0179%	1,3086%	1,3704%
MARÇO	0,0093%	1,3789%	0,6716%
ABRIL	0,2616%	0,7562%	34,5878%
MAIO	0,1677%	1,2785%	13,1202%

	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
Total	0,4824%	5,5346%	8,7164%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,4824% enquanto que a meta acumulada no período é de 5,5346%, sendo assim o RPPS atingiu 8,7164% da meta atuarial

Gerenciamento de Risco

VaR - VALUE AT RISK

Value-at-Risk ou Valor sob Risco pode se definido como perda máxima num determinado Período sob condições normais de mercado com determinado grau de confiança

Nome	Saldo	VAR 12M
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 399,59	0,003120%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 203,29	0,000105%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 1.550.974,69	0,000097%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 0,00	0,000021%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 0,00	0,004164%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 0,00	0,000051%

	Saldo	VAR 12M
Geral	R\$ 1.551.577,57	0,001260%

O fundo BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI obteve o menor VaR% dentre os fundos da carteira, sendo assim, é o fundo que apresenta menor risco.

carteira, sendo assim, e o fundo que apresenta menor risco.

ÍNDICE SHARPE

O índice de Sharpe é uma medida que permite a classificação do fundo em termos de desempenho global, sendo considerados melhores os fundos com maior índice. Vale lembrar ainda que o índice varia se o resultado for calculado com base e rentabilidades semanais, mensais ou anuais

Nome	Sharpe
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	28,773959%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	30,889709%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	30,427771%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	31,549151%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	28,452346%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	29,882364%
PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	

	Sharpe
Geral	29,995883%

O fundo BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI teve o melhor Índice Sharpe positivo, portanto foi o fundo que teve melhor desempenho analisando a relação risco/retorno.

