

Ciclo de Gestão

2023

Designação do Serviço/Organismo:

Instituto de Gestão de Fundos de Capitalização da Segurança Social

Missão:

O IGFCSS,IP tem por missão a gestão de fundos de capitalização no âmbito do financiamento do sistema da segurança social do Estado e de outros sistemas previdenciais

Objetivos Estratégicos (OE)

OE1:	Maximizar rentabilidade dos fundos geridos
OE2:	Maximizar o excess return anual dos fundos geridos
OE3:	Minimização do risco dos fundos geridos
OE 4:	Reforço da confiança no IGFCSS
OES:	Otimização da despesa do IGFCSS

Objetivos Operacionais (OP)

EFICÁCIA PESO: 20%

OP1: Assegurar Retorno de longo prazo do FEFS adequado PESO: 20%

Indicadores	Realizado 2020	Realizado 2021	Realizado 2022 (YTD)	Meta 2023	Tolerância	Valor Crítico	Peso	Fórmula de Cálculo	Resultado	Taxa de Realização	Desvio
Ind.1 Diferença entre o retorno médio anual do FEFS e o custo aparente da dívida pública portuguesa (período móvel de 5 anos)	1.01%	2.04%	-1.93%	0.00%	0.50%	0.63%	100.00%	$(((1 + \text{retorno médio anual FEFS horizonte 5 anos}) / (1 + \text{custo aparente DPP horizonte 5 anos}) - 1) \times 100$			
Taxa de Realização do OP1										0%	

OP2: Controlar volatilidade do FEFS PESO: 40%

Indicadores	Realizado 2020	Realizado 2021	Realizado 2022 (YTD)	Meta 2023	Tolerância	Valor Crítico	Peso	Fórmula de Cálculo	Resultado	Taxa de Realização	Desvio
Ind.2 Percentagem de semanas com o tracking error exponencial do FEFS fora do limite	0.0%	0%	0%	17.5%	2.5%	13.13%	100.0%	$(\text{Numero de semanas fora limite}/50) \times 100$			
Taxa de Realização do OP2										0%	

OP3: Controlar a Volatilidade dos Fundos PESO: 40%

Indicadores	Realizado 2020	Realizado 2021	Realizado 2022 (YTD)	Meta 2023	Tolerância	Valor Crítico	Peso	Fórmula de Cálculo	Resultado	Taxa de Realização	Desvio
Ind.3 Percentagem de semanas com o tracking error exponencial do FCR fora do limite	6%	0	0%	17.5%	2.5%	13.13%	75%	$(\text{Numero de semanas fora limite}/50) \times 100$			
Ind.4 Percentagem de semanas com o tracking error exponencial do FCT fora do limite	0.0%	0%	0%	17.5%	2.5%	13.13%	25%	$(\text{Numero de semanas fora limite}/50) \times 100$			
Taxa de Realização do OP3										0%	

EFICIÊNCIA PESO: 20%

OP4: Garantir contenção dos custos de transação PESO: 50%

Indicadores	Realizado 2020	Realizado 2021	Realizado 2022 (YTD)	Meta 2023	Tolerância	Valor Crítico	Peso	Fórmula de Cálculo	Resultado	Taxa de Realização	Desvio
Ind.5 Percentagem que os custos de transação representam no valor das operações efectuadas	0.010%	0.010%	0.007%	0.025%	0.0025%	0.0188%	100.000%	$(\text{Custos de Tramação}/(\text{Compras} + \text{Vendas de ações e Futuros})) \times 100$			
Taxa de Realização do OP5										0%	

OP5: Controlar o crescimento da Estrutura PESO: 50%

Indicadores	Realizado 2020	Realizado 2021	Realizado 2022 (YTD)	Meta 2023	Tolerância	Valor Crítico	Peso	Fórmula de Cálculo	Resultado	Taxa de Realização	Desvio
Ind.6 Percentagem que os custos de gestão (IGFCSS) representam no valor médio sobre gestão (FEFS)	0.0100%	0.0100%	0.0060%	0.0200%	0.0050%	0.0150%	100.00%	$(\text{custos de gestão IGFCSS}/\text{valor médio sobre gestão do FEFS ajustado de entradas/saídas do ano}) \times 100$			
Taxa de Realização do OP6										0%	

QUALIDADE PESO: 60%

OP6: Controlar Processos PESO: 10%

Indicadores	Realizado 2020	Realizado 2021	Realizado 2022 (YTD)	Meta 2023	Tolerância	Valor Crítico	Peso	Fórmula de Cálculo	Resultado	Taxa de Realização	Desvio
Ind. 7 Percentagem de indicadores de processos de negócios superados	67.86%	78.57%	80.49%	62.50%	2.50%	78.13%	50.00%	$(\text{Nº de indicadores que atingiram o valor de superação}/\text{Nº de indicadores}) \times 100$			
Ind. 8 Percentagem de indicadores de processos de suporte superados	75.00%	93.75%	100.00%	82.50%	2.50%	93.75%	50.00%	$(\text{Nº de indicadores que atingiram o valor de superação}/\text{Nº de indicadores}) \times 100$			
Taxa de Realização do OP7										0%	

OP7: Serviço prestado aos participantes nos fundos (artigo 28.º da LOE 2021) PESO: 45%

Indicadores	Realizado 2020	Realizado 2021	Realizado 2022 (YTD)	Meta 2023	Tolerância	Valor Crítico	Peso	Fórmula de Cálculo	Resultado	Taxa de Realização	Desvio
Ind. 9 Questionário RPC				100.00%	2.50%	105.00%	75.00%	$[\text{QS mail} / \text{Máximo}(\text{AVGlobal}; 3.00)] \times 100$			
Ind.10 Nº de meses em que publicação do folheto do FCT ocorre na data prevista			9	11		12	25.00%	$\text{Nº meses sem atraso na publicação}$			
Taxa de Realização do OP8										0%	

OP8: Capacitação e motivação dos colaboradores (artigo 28.º da LOE 2021) PESO: 45%

Indicadores	Realizado 2020	Realizado 2021	Realizado 2022 (YTD)	Meta 2023	Tolerância	Valor Crítico	Peso	Fórmula de Cálculo	Resultado	Taxa de Realização	Desvio
Ind.11 Percentagem de colaboradores que frequentaram pelo menos uma ação de formação			55%	33%	5%	41.67%	100.0%	$[\text{Nº de colaboradores do IGFCSS que frequentaram pelo menos uma ação de formação no ano n} / \text{Nº de colaboradores do IGFCSS no ano n}] \times 100$			
Taxa de Realização do OP8										0%	

Objetivos Estratégicos vs Operacionais matriz de enquadramento	OP1	OP2	OP3	OP4	OP5	OP6	OP7	OP8		
Maximizar rentabilidade dos fundos geridos	X					X				
Maximizar o excess return anual dos fundos geridos	X					X				
Minimização do risco dos fundos geridos		X	X			X				
Reforço da confiança no IGFCSS	X	X	X				X	X		
Otimização da despesa do IGFCSS				X	X	X		X		
OBJETIVOS RELEVANTES (n.º 1 do art.18.º da Lei 66-B/2007, de 28.12)				Peso dos parâmetros na avaliação final	Peso dos objetivos no respetivo parâmetro	Peso de cada objetivo na avaliação final		Objetivos Relevantes		
Eficácia					100%					
OP1 Assegurar Retorno de longo prazo do FEFSS adequado				20%	20%	4%				
OP2 Controlar volatilidade do FEFSS					40%	8%				
OP3 Controlar a Volatilidade dos Fundos					40%	8%				
Eficiência					100%					
OP4: Garantir contenção dos custos de transação				20%	50%	10%		Relevante		
OP5: Controlar o crescimento da Estrutura					50%	10%		Relevante		
Qualidade					100%					
OP6: Controlar Processos				60%	10%	6%				
OP7: Serviço prestado aos participantes nos fundos (artigo 28.º da LOE 2021)					45%	27%		Relevante		
OP8: Capacitação e motivação dos colaboradores (artigo 28.º da LOE 2021)					45%	27%		Relevante		
Total				100%	São considerados objetivos mais relevantes aqueles que, somando os pesos por ordem decrescente de contribuição para a avaliação final, perfizem uma percentagem superior a 50%, resultante do apuramento de, pelo menos, metade dos objetivos.		74%			
RECURSOS HUMANOS							Dias úteis 2023 (só considerados feriados e tolerância carnava)		226	
DESIGNAÇÃO	Pontuação CCAS	Pontuação efetivos planeados 2023			Pontuação efetivos Executados 2023			Desvio (em n.º)	Pontuação Executada / Pontuação Planeada	UERHE / UERHP
		N.º de efetivos planeados (Mapa de Pessoal)	UERHP	Pontuação Planeada	N.º de efetivos a 31.dez (Balanço Social)	UERHE	Pontuação Executada			
Dirigentes - Direção Superior	20	3	678	60		0	0	-3	0.00%	0.00%
Dirigentes - Direção Intermédia e Chefes de equipa	16	3	678	48		144	0	-3	0.00%	21.24%
Técnico Superior	12	31	7006	372		11532	0	-31	0.00%	164.60%
Especialista de Informática	12		0	0		0	0	0	#DIV/0!	#DIV/0!
Coordenador Técnico	9		0	0		0	0	0	#DIV/0!	#DIV/0!
Técnico de informática	8		0	0		0	0	0	#DIV/0!	#DIV/0!
Assistente Técnico	8	3	678	24		72	0	-3	0.00%	10.62%
Assistente Operacional	5		0	0		0	0	0	#DIV/0!	#DIV/0!
		40	9,040	504	0	11,748	0	-40	0.00%	129.96%
RECURSOS FINANCEIROS IGFCSS										
DESIGNAÇÃO	Planeado	Corrigido	Execução (30.jun.23)	Execução (31.dez.23)	Taxa de Execução (face ao planeado)	Taxa de Execução (face ao corrigido)				
Orçamento de Atividades (Funcionamento)	3,761,398.00 €									
Despesas c/Pessoal	1,943,373.00 €									
Aquisições de Bens e Serviços	1,806,425.00 €									
Outras despesas correntes	8,000.00 €									
Despesas de Capital	3,600.00 €									
Orçamento de Projetos (Investimento)	415,000.00 €									
Despesas correntes										
Despesas de capital	415,000.00 €									
Outras										
Total	4,176,398.00 €	0.00	0.00	0.00						