

**SERVIÇO PREVIDÊNCIA, SAÚDE E ASSISTÊNCIA MUNICIPAL
DE JABOTICABAL - SEPTEM**

Informações referentes a Fevereiro/2023

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Fevereiro/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.555.989,10	1,40%	1,25%	111,76%
BB IDKA 2A	7.461.976,70	1,17%	1,25%	93,10%
BB FLUXO	480.459,61	0,80%	1,25%	63,63%
BB PERFIL	174.275,68	0,85%	1,25%	68,22%
BB RETORNO TOTAL	5.194.153,49	0,98%	1,25%	78,04%
BB IRF-M1 TP	3.701.471,37	0,96%	1,25%	76,81%
BB FLUXO	159.794,94	0,77%	1,25%	61,53%
BB IRF-M1 TP	7.928.929,13	0,55%	1,25%	43,89%
BB FLUXO	9.231.209,28	0,86%	1,25%	68,41%
BB PERFIL	2.272.639,67	0,79%	1,25%	63,30%
BB FLUXO	503.351,81	0,13%	1,25%	10,21%
BB FLUXO	1.619.952,47	0,82%	1,25%	65,78%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	675.721,90	0,91%	1,25%	72,54%
CAIXA RIO BRAVO	308.200,00	-1,89%	1,25%	-151,22%
CAIXA DIVIDENDOS	647.058,22	-6,28%	1,25%	-502,08%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.169.561,54	0,97%	1,25%	77,10%
CAIXA IMA-B	1.661.790,03	1,26%	1,25%	100,45%
CAIXA MATRIZ	618.762,52	0,79%	1,25%	63,34%
CAIXA TP	1.601.433,24	0,93%	1,25%	74,29%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.858.183,95	1,22%	1,25%	97,74%
CAIXA IMA-B 5	3.714.819,53	1,39%	1,25%	111,11%
DAYCOVAL IMA-B 5	212.557,99	1,35%	1,25%	107,74%
PREMIUM FIDC	96.517,58	0,23%	1,25%	18,43%
TOTAL / MÉDIA	58.848.809,75	0,93%	1,25%	74,58%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	4,34%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	12,68%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,82%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,30%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	8,83%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M1 TP	6,29%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,27%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M1 TP	13,47%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	15,69%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	3,86%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	0,86%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	2,75%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO FEDERAL EXTRA	1,15%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,52%	5%	Art. 11º
CAIXA DIVIDENDOS	1,10%	20%	Art. 8º, I
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	5,39%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	2,82%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	1,05%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	2,72%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA NOVO IMA-B LP	8,26%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	6,31%	100%	Art. 7º, I, b
DAYCOVAL IMA-B 5	0,36%	100%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,16%	5%	7º, V, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	1,00%	0,94%	106,12%
Fevereiro	0,93%	1,25%	74,58%
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	1,94%	2,20%	88,17%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,94%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,2%, sendo assim o RPPS atingiu 88,17% 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 5	2.555.989,10	33.546,37	0,06%
BB IDKA 2A	7.461.976,70	103.393,44	0,18%
BB FLUXO	480.459,61	24,46	0,00%
BB PERFIL	174.275,68	94,75	0,00%
BB RETORNO TOTAL	5.194.153,49	77.444,82	0,13%
BB IRF-M1 TP	3.701.471,37	7.398,94	0,01%
BB FLUXO	159.794,94	8,14	0,00%
BB IRF-M1 TP	7.928.929,13	15.849,28	0,03%
BB FLUXO	9.231.209,28	470,00	0,00%
BB PERFIL	2.272.639,67	1.235,64	0,00%
BB FLUXO	503.351,81	25,63	0,00%
BB FLUXO	1.619.952,47	82,48	0,00%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	675.721,90	37,72	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	308.200,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	647.058,22	64.900,37	0,11%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.169.561,54	21.584,94	0,04%
CAIXA IMA-B	1.661.790,03	48.875,12	0,08%
CAIXA MATRIZ	618.762,52	216,68	0,00%
CAIXA TP	1.601.433,24	315,19	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.858.183,95	146.177,97	0,25%
CAIXA IMA-B 5	3.714.819,53	48.459,66	0,08%
DAYCOVAL IMA-B 5	212.557,99	2.735,38	0,00%
PREMIUM FIDC	96.517,58	0,00	0,00%
Carteira	58.848.809,75	526.094,98	0,89%

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 5	0,01
BB IDKA 2A	0,01
BB FLUXO	-
BB PERFIL	-
BB RETORNO TOTAL	0,00
BB IRF-M1 TP	0,00
BB FLUXO	-
BB IRF-M1 TP	0,00
BB FLUXO	-
BB PERFIL	-
BB FLUXO	-
BRADESCO FEDERAL EXTRA	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,00
CAIXA IMA-B	0,00
CAIXA MATRIZ	-
CAIXA TP	0,02
CAIXA NOVO IMA-B LP	0,00
CAIXA IMA-B 5	0,01
DAYCOVAL IMA-B 5	0,01
PREMIUM FIDC	-