

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

Informações referentes a Julho/2023

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Julho/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.685.619,09	0,95%	0,53%	179,71%
BB IDKA 2A	7.796.806,90	0,94%	0,53%	178,42%
BB FLUXO	36.536,94	1,01%	0,53%	191,33%
BB PERFIL	183.814,55	1,06%	0,53%	201,35%
BB RETORNO TOTAL	5.602.040,15	0,79%	0,53%	148,77%
BB IRF-M1 TP	1.583.764,88	1,06%	0,53%	200,21%
BB FLUXO	308.203,63	1,01%	0,53%	190,23%
BB IMA-B 5	9.326.092,00	0,95%	0,53%	179,71%
BB IRF-M1 TP	10.365.766,86	1,06%	0,53%	200,21%
BB FLUXO	900,08	0,09%	0,53%	17,02%
BB PERFIL	2.397.031,21	1,06%	0,53%	201,35%
BB RETORNO TOTAL	3.257.004,74	0,63%	0,53%	118,61%
BB FLUXO	23.122,06	0,15%	0,53%	27,55%
BB FLUXO	1.209.228,77	0,93%	0,53%	176,84%
CAIXA RIO BRAVO	400.400,00	2,54%	0,53%	480,79%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.393.785,26	0,89%	0,53%	168,91%
CAIXA IMA-B	979.362,43	0,80%	0,53%	151,60%
CAIXA MATRIZ	47.570,67	0,13%	0,53%	25,33%
CAIXA TP	73.514,77	0,10%	0,53%	18,33%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.390.215,08	0,82%	0,53%	155,77%
CAIXA IMA-B 5	2.273.664,68	0,95%	0,53%	179,99%
PREMIUM FIDC	88.486,96	-0,47%	0,53%	-88,99%
TOTAL / MÉDIA	57.422.931,71	0,92%	0,53%	173,10%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	4,68%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	13,58%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,06%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,32%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	9,76%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	2,76%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,54%	20%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5	16,24%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	18,05%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,00%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	4,17%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	5,67%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,04%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	2,11%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,70%	5%	Art. 11º
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	5,91%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	1,71%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	0,08%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	0,13%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA NOVO IMA-B LP	9,39%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	3,96%	100%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,15%	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	1,37%	1,12%	122,30%
Abril	1,03%	1,02%	101,30%
Maio	1,17%	0,64%	182,42%
Junho	1,39%	0,33%	422,49%
Julho	0,92%	0,53%	173,10%
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	8,07%	5,97%	135,11%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 8,07%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,97%, sendo assim o RPPS atingiu 135,11% 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	2.685.619,09	20.501,54	0,04%
BB IDKA 2A	7.796.806,90	61.105,69	0,11%
BB FLUXO	36.536,94	3,32	0,00%
BB PERFIL	183.814,55	32,67	0,00%
BB RETORNO TOTAL	5.602.040,15	43.835,47	0,08%
BB IRF-M1 TP	1.583.764,88	2.520,67	0,00%
BB FLUXO	308.203,63	28,03	0,00%
BB IMA-B 5	9.326.092,00	71.193,75	0,12%
BB IRF-M1 TP	10.365.766,86	16.497,83	0,03%
BB FLUXO	900,08	0,08	0,00%
BB PERFIL	2.397.031,21	426,09	0,00%
BB RETORNO TOTAL	3.257.004,74	25.485,77	0,04%
BB FLUXO	23.122,06	2,10	0,00%
BB FLUXO	1.209.228,77	109,99	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	400.400,00	0,00	0,00%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.393.785,26	23.556,21	0,04%
CAIXA IMA-B	979.362,43	16.464,23	0,03%
CAIXA MATRIZ	47.570,67	19,49	0,00%
CAIXA TP	73.514,77	33,58	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.390.215,08	93.151,13	0,16%
CAIXA IMA-B 5	2.273.664,68	17.035,99	0,03%
PREMIUM FIDC	88.486,96	0,00	0,00%
Carteira	57.422.931,71	355.433,92	0,62%

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	-
BB IDKA 2A	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	-
BB RETORNO TOTAL	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB IMA-B 5	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	-
BB RETORNO TOTAL	-
BB FLUXO	-
BB FLUXO	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA MATRIZ	0,03
CAIXA TP	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-