

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

Informações referentes a Janeiro/2023

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Janeiro/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.520.727,09	1,37%	0,94%	146,19%
BB IDKA 2A	8.957.598,10	1,30%	0,94%	137,71%
BB FLUXO	366.979,12	0,89%	0,94%	94,12%
BB PERFIL	172.800,17	1,12%	0,94%	119,50%
BB RETORNO TOTAL	5.143.910,88	0,65%	0,94%	68,87%
BB IRF-M1 TP	3.666.226,95	0,95%	0,94%	101,04%
BB FLUXO	65.739,01	0,49%	0,94%	52,09%
BB IRF-M1 TP	3.923.699,29	0,87%	0,94%	92,58%
BB FLUXO	9.152.839,75	1,03%	0,94%	109,98%
BB PERFIL	5.231.196,36	1,12%	0,94%	119,50%
BB FLUXO	522.455,77	0,04%	0,94%	4,66%
BB FLUXO	1.689.793,35	0,52%	0,94%	54,87%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	669.642,21	1,10%	0,94%	116,94%
CAIXA RIO BRAVO	317.000,00	1,52%	0,94%	162,04%
CAIXA DIVIDENDOS	690.447,38	3,53%	0,94%	375,25%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.139.267,60	1,04%	0,94%	110,15%
CAIXA IMA-B	1.641.155,25	-0,03%	0,94%	-3,49%
CAIXA MATRIZ	613.895,51	1,10%	0,94%	116,96%
CAIXA TP	1.586.679,62	1,12%	0,94%	118,74%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.799.470,72	-0,09%	0,94%	-9,64%
CAIXA IMA-B 5	3.663.866,95	1,37%	0,94%	146,20%
DAYCOVAL IMA-B 5	209.729,76	1,30%	0,94%	138,17%
PREMIUM FIDC	96.295,51	-0,34%	0,94%	-36,29%
TOTAL / MÉDIA	58.841.416,35	1,00%	0,94%	106,12%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	4,28%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	15,22%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,62%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,29%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	8,74%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M1 TP	6,23%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,11%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M1 TP	6,67%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	15,56%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	8,89%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	0,89%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	2,87%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO FEDERAL EXTRA	1,14%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,54%	5%	Art. 11º
CAIXA DIVIDENDOS	1,17%	20%	Art. 8º, I
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	5,34%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	2,79%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	1,04%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	2,70%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA NOVO IMA-B LP	8,16%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	6,23%	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			
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	1,00%	0,94%	106,12%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1%, enquanto que a meta acumulada no período é de 0,94%, sendo assim o RPPS atingiu 106,12% 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	2.520.727,09	33.155,16	0,06%
BB IDKA 2A	8.957.598,10	122.682,01	0,21%
BB FLUXO	366.979,12	18,47	0,00%
BB PERFIL	172.800,17	25,50	0,00%
BB RETORNO TOTAL	5.143.910,88	75.547,13	0,13%
BB IRF-M1 TP	3.666.226,95	5.804,56	0,01%
BB FLUXO	65.739,01	3,31	0,00%
BB IRF-M1 TP	3.923.699,29	6.212,21	0,01%
BB FLUXO	9.152.839,75	460,66	0,00%
BB PERFIL	5.231.196,36	771,98	0,00%
BB FLUXO	522.455,77	26,29	0,00%
BB FLUXO	1.689.793,35	85,05	0,00%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	669.642,21	41,70	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	317.000,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	690.447,38	75.811,88	0,13%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.139.267,60	23.516,69	0,04%
CAIXA IMA-B	1.641.155,25	47.586,60	0,08%
CAIXA MATRIZ	613.895,51	162,40	0,00%
CAIXA TP	1.586.679,62	329,97	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.799.470,72	142.259,25	0,24%
CAIXA IMA-B 5	3.663.866,95	47.882,29	0,08%
DAYCOVAL IMA-B 5	209.729,76	2.690,91	0,00%
PREMIUM FIDC	96.295,51	0,00	0,00%
Carteira	58.841.416,35	537.484,93	0,91%

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