

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

Informações referentes a Março/2023

**1. RENTABILIDADE MÉDIA**

Março/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.594.016,29	1,49%	1,12%	132,71%
BB IDKA 2A	7.565.140,89	1,38%	1,12%	123,32%
BB FLUXO	571.259,13	1,04%	1,12%	92,81%
BB PERFIL	176.301,86	1,16%	1,12%	103,70%
BB RETORNO TOTAL	5.291.617,06	1,88%	1,12%	167,37%
BB IRF-M1 TP	3.745.803,55	1,20%	1,12%	106,83%
BB FLUXO	872.432,48	0,87%	1,12%	77,95%
BB IMA-B 5	9.007.991,72	0,09%	1,12%	7,92%
BB IRF-M1 TP	8.988.925,20	1,10%	1,12%	98,31%
BB FLUXO	318.295,16	0,94%	1,12%	84,15%
BB PERFIL	2.299.062,06	1,16%	1,12%	103,70%
BB FLUXO	546.848,67	0,21%	1,12%	18,75%
BB FLUXO	1.555.423,01	1,03%	1,12%	92,27%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	0,00	0,16%	1,12%	14,37%
CAIXA RIO BRAVO	312.550,00	2,32%	1,12%	206,93%
CAIXA DIVIDENDOS	637.377,68	-1,50%	1,12%	-133,45%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.207.987,91	1,21%	1,12%	108,14%
CAIXA IMA-B	1.705.816,95	2,65%	1,12%	236,32%
CAIXA MATRIZ	625.939,95	1,16%	1,12%	103,47%
CAIXA TP	1.619.648,67	1,14%	1,12%	101,46%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.988.854,24	2,69%	1,12%	239,91%
CAIXA IMA-B 5	2.195.830,18	0,83%	1,12%	74,46%
DAYCOVAL IMA-B 5	0,00	1,58%	1,12%	141,36%
PREMIUM FIDC	96.097,76	-0,43%	1,12%	-38,80%
TOTAL / MÉDIA	58.923.220,42	1,37%	1,12%	122,30%

**2. ENQUADRAMENTO**

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	4,40%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	12,84%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,97%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,30%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	8,98%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M1 TP	6,36%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	1,48%	20%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5	15,29%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	15,26%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,54%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	3,90%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	0,93%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	2,64%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO FEDERAL EXTRA	0,00%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,53%	5%	Art. 11º
CAIXA DIVIDENDOS	1,08%	20%	Art. 8º, I
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	5,44%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	2,89%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	1,06%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	2,75%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA NOVO IMA-B LP	8,47%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	3,73%	100%	Art. 7º, I, b
DAYCOVAL IMA-B 5	0,00%	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	1,37%	1,12%	122,30%
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	3,34%	3,35%	99,69%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 3,34%, enquanto que a meta acumulada no período é de 3,35%, sendo assim o RPPS atingiu 99,69% 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	2.594.016,29	34.045,46	0,06%
BB IDKA 2A	7.565.140,89	104.822,89	0,18%
BB FLUXO	571.259,13	29,09	0,00%
BB PERFIL	176.301,86	95,86	0,00%
BB RETORNO TOTAL	5.291.617,06	78.898,01	0,13%
BB IRF-M1 TP	3.745.803,55	7.487,55	0,01%
BB FLUXO	872.432,48	44,42	0,00%
BB IMA-B 5	9.007.991,72	118.226,42	0,20%
BB IRF-M1 TP	8.988.925,20	17.968,12	0,03%
BB FLUXO	318.295,16	16,21	0,00%
BB PERFIL	2.299.062,06	1.250,01	0,00%
BB FLUXO	546.848,67	27,84	0,00%
BB FLUXO	1.555.423,01	79,19	0,00%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	0,00	0,00	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	312.550,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	637.377,68	63.929,40	0,11%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.207.987,91	21.846,62	0,04%
CAIXA IMA-B	1.705.816,95	50.170,01	0,09%
CAIXA MATRIZ	625.939,95	219,20	0,00%
CAIXA TP	1.619.648,67	318,77	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.988.854,24	150.109,71	0,25%
CAIXA IMA-B 5	2.195.830,18	28.644,51	0,05%
DAYCOVAL IMA-B 5	0,00	0,00	0,00%
PREMIUM FIDC	96.097,76	0,00	0,00%
Carteira	58.923.220,42	621.925,36	1,06%

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