

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

Informações referentes a Setembro/2023

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Setembro/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.704.221,79	0,11%	0,41%	27,23%
BB IDKA 2A	7.871.071,37	0,21%	0,41%	51,86%
BB FLUXO	262.828,11	0,80%	0,41%	195,72%
BB PERFIL	187.741,32	0,97%	0,41%	237,62%
BB RETORNO TOTAL	5.709.964,16	0,88%	0,41%	215,17%
BB IRF-M1 TP	1.615.915,45	0,90%	0,41%	221,49%
BB FLUXO	370.036,80	0,85%	0,41%	208,72%
BB IMA-B 5	9.390.691,79	0,11%	0,41%	27,23%
BB IRF-M1 TP	11.550.516,22	0,90%	0,41%	221,49%
BB FLUXO	2.167,85	136,27%	0,41%	33382,44%
BB PERFIL	2.448.238,24	0,97%	0,41%	237,62%
BB RETORNO TOTAL	4.283.442,45	0,72%	0,41%	176,75%
BB FLUXO	96.276,96	0,14%	0,41%	34,68%
BB FLUXO	1.131.809,33	0,85%	0,41%	208,04%
CAIXA RIO BRAVO	407.800,00	-2,23%	0,41%	-545,36%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	1.120.780,46	0,16%	0,41%	40,10%
CAIXA IMA-B	966.392,69	-0,96%	0,41%	-234,46%
CAIXA MATRIZ	48.640,29	1,02%	0,41%	249,50%
CAIXA TP	75.053,03	0,95%	0,41%	233,60%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.318.175,00	-1,00%	0,41%	-243,75%
CAIXA IMA-B 5	2.289.800,16	0,11%	0,41%	27,42%
PREMIUM FIDC	87.686,70	-0,46%	0,41%	-112,42%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	4,67%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	13,59%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,45%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,32%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	9,86%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	2,79%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,64%	20%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5	16,21%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	19,94%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,00%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	4,23%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	7,39%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,17%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	1,95%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,70%	5%	Art. 11º
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	1,93%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	1,67%	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	9,18%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	3,95%	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	0,75%	0,64%	116,69%
Setembro	0,35%	0,41%	85,78%
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	9,26%	7,09%	130,65%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 9,26%, enquanto que a meta acumulada no período é de 7,09%, sendo assim o RPPS atingiu 130,65% 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	2.704.221,79	23.349,01	0,04%
BB IDKA 2A	7.871.071,37	61.785,48	0,11%
BB FLUXO	262.828,11	33,31	0,00%
BB PERFIL	187.741,32	29,76	0,00%
BB RETORNO TOTAL	5.709.964,16	32.378,48	0,06%
BB IRF-M1 TP	1.615.915,45	2.107,18	0,00%
BB FLUXO	370.036,80	46,90	0,00%
BB IMA-B 5	9.390.691,79	81.081,86	0,14%
BB IRF-M1 TP	11.550.516,22	15.062,05	0,03%
BB FLUXO	2.167,85	0,27	0,00%
BB PERFIL	2.448.238,24	388,10	0,00%
BB RETORNO TOTAL	4.283.442,45	24.289,36	0,04%
BB FLUXO	96.276,96	12,20	0,00%
BB FLUXO	1.131.809,33	143,45	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	407.800,00	0,00	0,00%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	1.120.780,46	8.925,21	0,02%
CAIXA IMA-B	966.392,69	18.718,57	0,03%
CAIXA MATRIZ	48.640,29	18,43	0,00%
CAIXA TP	75.053,03	31,61	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.318.175,00	105.370,26	0,18%
CAIXA IMA-B 5	2.289.800,16	19.417,08	0,03%
PREMIUM FIDC	87.686,70	0,00	0,00%
Carteira	57.939.250,17	349.659,17	0,60%

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	0,02
CAIXA TP	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-