



## Relatório

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

Informações referentes a Fevereiro/2024

#### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Fevereiro/2024				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	79.063,93	0,58%	1,23%	46,94%
BB IDKA 2A	1.817.004,50	0,36%	1,23%	28,95%
BB FLUXO	287.219,12	0,66%	1,23%	53,73%
BB PERFIL	196.488,35	0,80%	1,23%	65,49%
BB RETORNO TOTAL	4.110.789,43	0,77%	1,23%	63,07%
BB IRF-M1 TP	1.687.991,37	0,74%	1,23%	60,42%
BB FLUXO	254.290,52	0,53%	1,23%	43,04%
BB IMA-B 5	75.399,74	0,58%	1,23%	46,94%
BB IRF-M1 TP	13.054.556,72	0,74%	1,23%	60,42%
BB FLUXO	972.062,78	0,27%	1,23%	22,03%
BB PERFIL	26.682,17	0,80%	1,23%	65,49%
BB RETORNO TOTAL	23.891,14	0,77%	1,23%	63,07%
BB FLUXO	97.528,22	0,26%	1,23%	21,55%
BB FLUXO	1.784.472,50	0,52%	1,23%	42,36%
CAIXA RIO BRAVO	510.000,00	21,68%	1,23%	1768,26%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	61.575,74	0,04%	1,23%	3,35%
CAIXA IMA-B	696.572,82	0,54%	1,23%	43,90%
CAIXA MATRIZ	602,44	0,06%	1,23%	4,52%
CAIXA TP	7.971,38	0,12%	1,23%	9,60%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.576.819,11	0,59%	1,23%	48,07%
CAIXA IMA-B 5	298.069,06	0,58%	1,23%	47,03%
PREMIUM FIDC	81.955,01	-0,18%	1,23%	-14,99%
SANTANDER IRF-M 1 FI	19.677.702,30	0,75%	1,23%	61,10%
TOTAL / MÉDIA	51.378.708,35	0,85%	1,23%	69,62%

#### 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	0,15%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	3,54%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,56%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,38%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	8,00%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	3,29%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,49%	20%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5	0,15%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	25,41%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	1,89%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,05%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	0,05%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,19%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	3,47%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,99%	5%	Art. 11º
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,12%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	1,36%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	0,00%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	0,02%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA NOVO IMA-B LP	10,85%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	0,58%	100%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,16%	5%	7º, V, a
SANTANDER IRF-M 1 FI	38,30%	100%	Art. 7º, I, b

#### 3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,70%	0,93%	75,17%
Fevereiro	0,85%	1,23%	69,62%
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	1,56%	2,16%	71,90%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,56%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,16%, sendo assim o RPPS atingiu 71,9% 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	79.063,93	613,79	0,00%
BB IDKA 2A	1.817.004,50	13.764,10	0,03%
BB FLUXO	287.219,12	41,54	0,00%
BB PERFIL	196.488,35	29,54	0,00%
BB RETORNO TOTAL	4.110.789,43	5.983,22	0,01%
BB IRF-M1 TP	1.687.991,37	1.565,80	0,00%
BB FLUXO	254.290,52	36,78	0,00%
BB IMA-B 5	75.399,74	585,34	0,00%
BB IRF-M1 TP	13.054.556,72	12.109,57	0,02%
BB FLUXO	972.062,78	140,58	0,00%
BB PERFIL	26.682,17	4,01	0,00%
BB RETORNO TOTAL	23.891,14	34,77	0,00%
BB FLUXO	97.528,22	14,10	0,00%
BB FLUXO	1.784.472,50	258,07	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	510.000,00	0,00	0,00%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	61.575,74	316,24	0,00%
CAIXA IMA-B	696.572,82	12.383,75	0,02%
CAIXA MATRIZ	602,44	0,21	0,00%
CAIXA TP	7.971,38	2,49	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.576.819,11	102.401,90	0,20%
CAIXA IMA-B 5	298.069,06	2.308,57	0,00%
PREMIUM FIDC	81.955,01	0,00	0,00%
SANTANDER IRF-M 1 FI	19.677.702,30	20.254,37	0,04%
Carteira	51.378.708,35	157.575,86	0,31%

###### 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	0,01
BB RETORNO TOTAL	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB IMA-B 5	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,01
BB RETORNO TOTAL	-
BB FLUXO	-
BB FLUXO	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA MATRIZ	0,01
CAIXA TP	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-
SANTANDER IRF-M 1 FI	-