

SERVIÇO PREVIDÊNCIA, SAÚDE E ASSISTÊNCIA MUNICIPAL DE  
JABOTICABAL - SEPTEM

Informações referentes a Agosto/2024

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Agosto /2024				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	81.737,96	0,52%	0,37%	139,13%
BB IDKA 2A	32.144,41	0,64%	0,37%	170,36%
BB FLUXO	968.662,86	0,76%	0,37%	204,84%
BB RETORNO TOTAL	1.806.372,49	0,95%	0,37%	253,85%
BB IRF-M1 TP	4.347,65	0,74%	0,37%	199,24%
BB FLUXO	15.289,97	0,24%	0,37%	63,60%
BB IMA-B 5	77.949,83	0,52%	0,37%	139,13%
BB IRF-M1 TP	6.461.351,32	0,74%	0,37%	199,20%
BB FLUXO	1.017.749,22	0,60%	0,37%	159,98%
BB PERFIL	8.226.019,51	0,89%	0,37%	239,09%
BB RETORNO TOTAL	24.896,53	0,95%	0,37%	253,85%
BB VERT 2024	0,00	0,66%	0,37%	176,67%
BB FLUXO	528.753,07	0,14%	0,37%	37,11%
BB FLUXO	1.260.011,36	0,73%	0,37%	196,93%
CAIXA RIO BRAVO	398.350,00	1,88%	0,37%	503,69%
CAIXA NOVO IMA-B LP	2.600.240,79	0,70%	0,37%	188,13%
CAIXA IMA-B 5	308.349,92	0,58%	0,37%	155,67%
PREMIUM FIDC	81.427,98	-0,41%	0,37%	-108,79%
SANTANDER IRF-M 1 FI	13.334.751,90	0,64%	0,37%	172,81%
SANTANDER REF DI	7.258.333,85	0,90%	0,37%	241,55%
SANTANDER MAXI EMPRESARIAL	59.455,77	0,00%	0,37%	1,10%
TOTAL / MÉDIA	44.546.196,39	0,79%	0,37%	211,24%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	0,18%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	0,07%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	2,17%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	4,06%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	0,01%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,03%	20%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5	0,17%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	14,50%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	2,28%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	18,47%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	0,06%	100%	Art. 7º, I, b
BB VERT 2024	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	1,19%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	2,83%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,89%	5%	Art. 11º
CAIXA NOVO IMA-B LP	5,84%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	0,69%	100%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,18%	5%	7º, V, a
SANTANDER IRF-M 1 FI	29,93%	100%	Art. 7º, I, b
SANTANDER REF DI	16,29%	20%	Art. 7º, III, a
SANTANDER MAXI EMPRESARIAL	0,13%	20%	Art. 7º, IV

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,70%	0,93%	75,17%
Fevereiro	0,85%	1,23%	69,62%
Março	0,47%	0,55%	85,50%
Abril	0,25%	0,77%	32,59%
Maio	0,80%	0,85%	93,10%
Junho	0,45%	0,60%	75,16%
Julho	0,95%	0,77%	122,51%
Agosto	0,79%	0,37%	211,24%
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	5,38%	6,23%	86,27%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 5,38%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,23%, sendo assim o RPPS atingiu 86,27% 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	81.737,96	710,16	0,00%
BB IDKA 2A	32.144,41	313,71	0,00%
BB FLUXO	968.662,86	60,03	0,00%
BB RETORNO TOTAL	1.806.372,49	8.008,24	0,02%
BB IRF-M1 TP	4.347,65	11,88	0,00%
BB FLUXO	15.289,97	0,95	0,00%
BB IMA-B 5	77.949,83	677,25	0,00%
BB IRF-M1 TP	6.461.351,32	17.658,05	0,04%
BB FLUXO	1.017.749,22	63,08	0,00%
BB PERFIL	8.226.019,51	1.921,71	0,00%
BB RETORNO TOTAL	24.896,53	110,37	0,00%
BB VERT 2024	0,00	0,00	0,00%
BB FLUXO	528.753,07	32,77	0,00%
BB FLUXO	1.260.011,36	78,09	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	398.350,00	0,00	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	2.600.240,79	53.045,00	0,12%
CAIXA IMA-B 5	308.349,92	2.660,56	0,01%
PREMIUM FIDC	81.427,98	0,00	0,00%
SANTANDER IRF-M 1 FI	13.334.751,90	36.570,78	0,08%
SANTANDER REF DI	7.258.333,85	2.099,68	0,00%
SANTANDER MAXI EMPRESARIAL	59.455,77	0,00	0,00%
Carteira	44.546.196,39	112.284,07	0,25%

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 RETORNO TOTAL	0,00
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB IMA-B 5	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,04
BB RETORNO TOTAL	0,00
BB VERT 2024	0,01
BB FLUXO	-
BB FLUXO	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-
SANTANDER IRF-M 1 FI	-
SANTANDER REF DI	0,02
SANTANDER MAXI EMPRESARIAL	-