

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

Informações referentes a Março/2024

**1. RENTABILIDADE MÉDIA**

Março/2024				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	79.658,10	0,75%	0,55%	135,73%
BB IDKA 2A	632.931,07	0,88%	0,55%	158,31%
BB FLUXO	1.598.029,25	0,17%	0,55%	31,40%
BB PERFIL	198.164,01	0,85%	0,55%	154,02%
BB RETORNO TOTAL	1.746.714,87	0,39%	0,55%	69,97%
BB IRF-M1 TP	501.126,59	0,78%	0,55%	140,54%
BB FLUXO	1.486.845,47	0,17%	0,55%	30,91%
BB IMA-B 5	75.966,36	0,75%	0,55%	135,72%
BB IRF-M1 TP	14.126.489,05	0,79%	0,55%	141,79%
BB FLUXO	977.143,57	0,52%	0,55%	94,08%
BB PERFIL	26.909,71	0,85%	0,55%	154,02%
BB RETORNO TOTAL	24.074,30	0,77%	0,55%	138,46%
BB FLUXO	519.546,09	0,06%	0,55%	10,41%
BB FLUXO	1.727.790,01	0,73%	0,55%	132,05%
CAIXA RIO BRAVO	401.200,00	-20,76%	0,55%	-3750,27%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	61.931,54	0,58%	0,55%	104,36%
CAIXA IMA-B	696.967,25	0,06%	0,55%	10,23%
CAIXA MATRIZ	607,55	0,85%	0,55%	153,19%
CAIXA TP	8.034,68	0,79%	0,55%	143,42%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.582.440,08	0,10%	0,55%	18,20%
CAIXA IMA-B 5	300.312,60	0,75%	0,55%	135,94%
PREMIUM FIDC	81.549,24	-0,50%	0,55%	-89,42%
SANTANDER IRF-M 1 FI	17.835.799,61	0,80%	0,55%	145,11%
SANTANDER REF DI	2.000.767,94	0,04%	0,55%	6,93%
TOTAL / MÉDIA	50.690.998,94	0,47%	0,55%	85,50%

**2. ENQUADRAMENTO**

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	0,16%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	1,25%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	3,15%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,39%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	3,45%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	0,99%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	2,93%	20%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5	0,15%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	27,87%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	1,93%	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	1,02%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	3,41%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,79%	5%	Art. 11º
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,12%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	1,37%	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	11,01%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	0,59%	100%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,16%	5%	7º, V, a
SANTANDER IRF-M 1 FI	35,19%	100%	Art. 7º, I, b
SANTANDER REF DI	3,95%	20%	Art. 7º, III, a

**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			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,04%	2,73%	74,62%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,04%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,73%, sendo assim o RPPS atingiu 74,62% 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	79.658,10	429,93	0,00%
BB IDKA 2A	632.931,07	3.456,31	0,01%
BB FLUXO	1.598.029,25	224,90	0,00%
BB PERFIL	198.164,01	27,24	0,00%
BB RETORNO TOTAL	1.746.714,87	1.768,42	0,00%
BB IRF-M1 TP	501.126,59	433,12	0,00%
BB FLUXO	1.486.845,47	209,25	0,00%
BB IMA-B 5	75.966,36	410,00	0,00%
BB IRF-M1 TP	14.126.489,05	12.209,49	0,02%
BB FLUXO	977.143,57	137,52	0,00%
BB PERFIL	26.909,71	3,70	0,00%
BB RETORNO TOTAL	24.074,30	24,37	0,00%
BB FLUXO	519.546,09	73,12	0,00%
BB FLUXO	1.727.790,01	243,16	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	401.200,00	0,00	0,00%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	61.931,54	273,56	0,00%
CAIXA IMA-B	696.967,25	9.703,45	0,02%
CAIXA MATRIZ	607,55	0,22	0,00%
CAIXA TP	8.034,68	3,50	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.582.440,08	79.821,49	0,16%
CAIXA IMA-B 5	300.312,60	1.610,87	0,00%
PREMIUM FIDC	81.549,24	0,00	0,00%
SANTANDER IRF-M 1 FI	17.835.799,61	17.170,80	0,03%
SANTANDER REF DI	2.000.767,94	626,69	0,00%
Carteira	50.690.998,94	116.109,73	0,23%

**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	0,00
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,03
BB RETORNO TOTAL	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB IMA-B 5	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,03
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	-
SANTANDER REF DI	0,03