

SERVIÇO PREVIDÊNCIA, SAÚDE E ASSISTÊNCIA MUNICIPAL DE  
JABOTICABAL - SEPTEM

Informações referentes a Abril/2024

## 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Abril/2024				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	79.479,69	-0,22%	0,77%	-28,92%
BB IDKA 2A	31.290,07	-0,26%	0,77%	-33,47%
BB FLUXO	1.140.721,57	0,28%	0,77%	36,23%
BB PERFIL	199.915,71	0,88%	0,77%	114,13%
BB RETORNO TOTAL	1.751.691,78	0,28%	0,77%	36,79%
BB IRF-M1 TP	4.219,68	0,62%	0,77%	79,69%
BB FLUXO	803.561,95	0,20%	0,77%	26,24%
BB IMA-B 5	75.796,22	-0,22%	0,77%	-28,92%
BB IRF-M1 TP	14.206.072,18	0,56%	0,77%	72,73%
BB FLUXO	984.953,34	0,80%	0,77%	103,19%
BB PERFIL	27.147,59	0,88%	0,77%	114,13%
BB RETORNO TOTAL	24.142,89	0,28%	0,77%	36,78%
BB FLUXO	28.524,58	0,08%	0,77%	10,61%
BB FLUXO	1.659.509,67	0,77%	0,77%	99,40%
CAIXA RIO BRAVO	395.800,00	-0,62%	0,77%	-80,45%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	61.732,98	-0,32%	0,77%	-41,39%
CAIXA IMA-B	685.566,23	-1,64%	0,77%	-211,19%
CAIXA MATRIZ	612,57	0,83%	0,77%	106,68%
CAIXA TP	8.098,84	0,80%	0,77%	103,10%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.487.578,19	-1,70%	0,77%	-219,39%
CAIXA IMA-B 5	299.650,20	-0,22%	0,77%	-28,48%
PREMIUM FIDC	82.815,41	1,55%	0,77%	200,46%
SANTANDER IRF-M 1 FI	17.936.422,94	0,56%	0,77%	72,84%
SANTANDER REF DI	2.019.610,27	0,94%	0,77%	121,59%
TOTAL / MÉDIA	47.994.914,55	0,25%	0,77%	32,59%

## 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	0,17%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	0,07%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	2,38%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,42%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	3,65%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	0,01%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	1,67%	20%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5	0,16%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	29,60%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	2,05%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,06%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	0,05%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,06%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	3,46%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,82%	5%	Art. 11º
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,13%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	1,43%	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	11,43%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	0,62%	100%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,17%	5%	7º, V, a
SANTANDER IRF-M 1 FI	37,37%	100%	Art. 7º, I, b
SANTANDER REF DI	4,21%	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	0,25%	0,77%	32,59%
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,29%	3,53%	64,91%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,29%, enquanto que a meta acumulada no período é de 3,53%, sendo assim o RPPS atingiu 64,91% 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	79.479,69	494,39	0,00%
BB IDKA 2A	31.290,07	210,51	0,00%
BB FLUXO	1.140.721,57	162,26	0,00%
BB PERFIL	199.915,71	32,27	0,00%
BB RETORNO TOTAL	1.751.691,78	4.182,15	0,01%
BB IRF-M1 TP	4.219,68	7,44	0,00%
BB FLUXO	803.561,95	114,30	0,00%
BB IMA-B 5	75.796,22	471,48	0,00%
BB IRF-M1 TP	14.206.072,18	25.047,87	0,05%
BB FLUXO	984.953,34	140,10	0,00%
BB PERFIL	27.147,59	4,38	0,00%
BB RETORNO TOTAL	24.142,89	57,64	0,00%
BB FLUXO	28.524,58	4,06	0,00%
BB FLUXO	1.659.509,67	236,05	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	395.800,00	0,00	0,00%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	61.732,98	364,32	0,00%
CAIXA IMA-B	685.566,23	9.330,15	0,02%
CAIXA MATRIZ	612,57	0,28	0,00%
CAIXA TP	8.098,84	4,35	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.487.578,19	76.502,02	0,16%
CAIXA IMA-B 5	299.650,20	1.858,39	0,00%
PREMIUM FIDC	82.815,41	0,00	0,00%
SANTANDER IRF-M 1 FI	17.936.422,94	32.542,68	0,07%
SANTANDER REF DI	2.019.610,27	713,44	0,00%
Carteira	47.994.914,55	138.100,76	0,29%

#### 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	0,00
BB RETORNO TOTAL	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB IMA-B 5	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,00
BB RETORNO TOTAL	-
BB FLUXO	-
BB FLUXO	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA MATRIZ	-
CAIXA TP	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-
SANTANDER IRF-M 1 FI	-
SANTANDER REF DI	0,01