

SERVIÇO PREVIDÊNCIA, SAÚDE E ASSISTÊNCIA MUNICIPAL
DE JABOTICABAL - SEPTEM

Informações referentes a Maio/2024

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Maio/2024				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	80.295,64	1,03%	0,85%	120,09%
BB IDKA 2A	31.618,49	1,05%	0,85%	122,78%
BB FLUXO	558.958,20	0,31%	0,85%	35,86%
BB PERFIL	0,00	0,79%	0,85%	92,84%
BB RETORNO TOTAL	1.764.329,16	0,72%	0,85%	84,39%
BB IRF-M1 TP	4.251,10	0,74%	0,85%	87,10%
BB FLUXO	966.740,54	0,25%	0,85%	28,76%
BB IMA-B 5	76.574,36	1,03%	0,85%	120,09%
BB IRF-M1 TP	14.311.836,74	0,74%	0,85%	87,09%
BB FLUXO	992.294,48	0,75%	0,85%	87,19%
BB PERFIL	27.373,95	0,83%	0,85%	97,54%
BB RETORNO TOTAL	24.317,07	0,72%	0,85%	84,39%
BB FLUXO	530.899,87	0,08%	0,85%	9,38%
BB FLUXO	1.575.087,95	0,71%	0,85%	83,26%
CAIXA RIO BRAVO	391.950,00	-0,23%	0,85%	-26,60%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,00	0,70%	0,85%	82,17%
CAIXA IMA-B	0,00	1,25%	0,85%	146,67%
CAIXA MATRIZ	0,00	0,76%	0,85%	88,42%
CAIXA TP	0,00	0,73%	0,85%	84,81%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.559.176,27	1,30%	0,85%	152,62%
CAIXA IMA-B 5	302.729,69	1,03%	0,85%	120,22%
PREMIUM FIDC	82.578,91	-0,29%	0,85%	-33,41%
SANTANDER IRF-M 1 FI	18.071.515,03	0,75%	0,85%	88,10%
SANTANDER REF DI	2.036.517,45	0,84%	0,85%	97,93%
SANTANDER MAXI EMPRESARIAL	216.996,14	0,03%	0,85%	3,69%
TOTAL / MÉDIA	47.606.041,04	0,80%	0,85%	93,10%

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	1,17%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,00%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	3,71%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	0,01%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	2,03%	20%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5	0,16%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	30,06%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	2,08%	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	1,12%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	3,31%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,82%	5%	Art. 11º
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	0,00%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	0,00%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA NOVO IMA-B LP	11,68%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	0,64%	100%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,17%	5%	7º, V, a
SANTANDER IRF-M 1 FI	37,96%	100%	Art. 7º, I, b
SANTANDER REF DI	4,28%	20%	Art. 7º, III, a
SANTANDER MAXI EMPRESARIAL	0,46%	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			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	3,10%	4,41%	70,36%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 3,1%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,41%, sendo assim o RPPS atingiu 70,36% 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	80.295,64	498,63	0,00%
BB IDKA 2A	31.618,49	215,40	0,00%
BB FLUXO	558.958,20	73,02	0,00%
BB PERFIL	0,00	0,00	0,00%
BB RETORNO TOTAL	1.764.329,16	4.966,94	0,01%
BB IRF-M1 TP	4.251,10	8,03	0,00%
BB FLUXO	966.740,54	126,29	0,00%
BB IMA-B 5	76.574,36	475,52	0,00%
BB IRF-M1 TP	14.311.836,74	27.023,27	0,06%
BB FLUXO	992.294,48	129,63	0,00%
BB PERFIL	27.373,95	4,78	0,00%
BB RETORNO TOTAL	24.317,07	68,46	0,00%
BB FLUXO	530.899,87	69,36	0,00%
BB FLUXO	1.575.087,95	205,77	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	391.950,00	0,00	0,00%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,00	0,00	0,00%
CAIXA IMA-B	0,00	0,00	0,00%
CAIXA MATRIZ	0,00	0,00	0,00%
CAIXA TP	0,00	0,00	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.559.176,27	73.783,68	0,15%
CAIXA IMA-B 5	302.729,69	1.878,62	0,00%
PREMIUM FIDC	82.578,91	0,00	0,00%
SANTANDER IRF-M 1 FI	18.071.515,03	34.840,16	0,07%
SANTANDER REF DI	2.036.517,45	761,54	0,00%
SANTANDER MAXI EMPRESARIAL	216.996,14	0,00	0,00%
Carteira	47.606.041,04	132.057,68	0,28%

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	0,00
BB IDKA 2A	0,00
BB FLUXO	-
BB PERFIL	-
BB RETORNO TOTAL	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB IMA-B 5	0,00
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	-
BB RETORNO TOTAL	-
BB FLUXO	-
BB FLUXO	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-
CAIXA IMA-B	0,00
CAIXA MATRIZ	-
CAIXA TP	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	0,00
CAIXA IMA-B 5	0,00
PREMIUM FIDC	-
SANTANDER IRF-M 1 FI	-
SANTANDER REF DI	0,01
SANTANDER MAXI EMPRESARIAL	-