

SERVIÇO PREVIDÊNCIA, SAÚDE E ASSISTÊNCIA MUNICIPAL DE
JABOTICABAL - SEPREM

Informações referentes a Julho/2024

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Julho/2024				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	81.315,98	0,89%	0,77%	115,36%
BB IDKA 2A	31.941,45	0,76%	0,77%	98,59%
BB FLUXO	849.588,56	0,79%	0,77%	102,11%
BB RETORNO TOTAL	1.789.429,83	1,04%	0,77%	133,72%
BB IRF-M1 TP	4.315,58	0,91%	0,77%	116,95%
BB FLUXO	64.035,81	0,81%	0,77%	104,31%
BB IMA-B 5	77.547,41	0,89%	0,77%	115,36%
BB IRF-M1 TP	6.413.699,34	0,91%	0,77%	116,96%
BB FLUXO	653.666,98	0,82%	0,77%	105,73%
BB PERFIL	8.153.311,00	0,97%	0,77%	125,52%
BB RETORNO TOTAL	24.663,02	1,04%	0,77%	133,72%
BB VERT 2024	355.701,45	0,98%	0,77%	127,09%
BB FLUXO	528.022,16	0,12%	0,77%	14,90%
BB FLUXO	1.350.437,74	0,78%	0,77%	100,27%
CAIXA RIO BRAVO	393.900,00	-3,21%	0,77%	-414,09%
CAIXA NOVO IMA-B LP	2.582.122,47	2,08%	0,77%	268,51%
CAIXA IMA-B 5	306.569,88	0,89%	0,77%	115,27%
PREMIUM FIDC	81.759,74	-0,49%	0,77%	-62,71%
SANTANDER IRF-M 1 FI	11.249.353,74	0,92%	0,77%	118,59%
SANTANDER REF DI	9.175.666,98	0,94%	0,77%	120,79%
SANTANDER MAXI EMPRESARIAL	1.552.375,22	0,00%	0,77%	0,52%
TOTAL / MÉDIA	45.719.424,34	0,95%	0,77%	122,51%

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	1,86%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	3,91%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	0,01%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,14%	20%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5	0,17%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	14,03%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	1,43%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	17,83%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	0,05%	100%	Art. 7º, I, b
BB VERT 2024	0,78%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	1,15%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	2,95%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,86%	5%	Art. 11º
CAIXA NOVO IMA-B LP	5,65%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	0,67%	100%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,18%	5%	7º, V, a
SANTANDER IRF-M 1 FI	24,61%	100%	Art. 7º, I, b
SANTANDER REF DI	20,07%	20%	Art. 7º, III, a
SANTANDER MAXI EMPRESARIAL	3,40%	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%
Maior	0,80%	0,85%	93,10%
Junho	0,45%	0,60%	75,16%
Julho	0,95%	0,77%	122,51%
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	4,55%	5,84%	77,91%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 4,55%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,84%, sendo assim o RPPS atingiu 77,91% 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	81.315,98	617,30	0,00%
BB IDKA 2A	31.941,45	271,06	0,00%
BB FLUXO	849.588,56	61,76	0,00%
BB RETORNO TOTAL	1.789.429,83	7.262,98	0,02%
BB IRF-M1 TP	4.315,58	10,52	0,00%
BB FLUXO	64.035,81	4,66	0,00%
BB IMA-B 5	77.547,41	588,69	0,00%
BB IRF-M1 TP	6.413.699,34	15.639,88	0,03%
BB FLUXO	653.666,98	47,52	0,00%
BB PERFIL	8.153.311,00	2.005,09	0,00%
BB RETORNO TOTAL	24.663,02	100,10	0,00%
BB VERT 2024	355.701,45	1.451,44	0,00%
BB FLUXO	528.022,16	38,38	0,00%
BB FLUXO	1.350.437,74	98,17	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	393.900,00	0,00	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	2.582.122,47	46.768,21	0,10%
CAIXA IMA-B 5	306.569,88	2.328,51	0,01%
PREMIUM FIDC	81.759,74	0,00	0,00%
SANTANDER IRF-M 1 FI	11.249.353,74	27.542,92	0,06%
SANTANDER REF DI	9.175.666,98	2.553,21	0,01%
SANTANDER MAXI EMPRESARIAL	1.552.375,22	0,00	0,00%
Carteira	45.719.424,34	95.723,34	0,21%

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 RETORNO TOTAL	0,01
BB IRF-M1 TP	0,00
BB FLUXO	-
BB IMA-B 5	0,00
BB IRF-M1 TP	0,00
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,03
BB RETORNO TOTAL	0,01
BB VERT 2024	0,00
BB FLUXO	-
BB FLUXO	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	0,01
CAIXA IMA-B 5	0,00
PREMIUM FIDC	-
SANTANDER IRF-M 1 FI	0,00
SANTANDER REF DI	0,03
SANTANDER MAXI EMPRESARIAL	-