



## Relatório

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

Informações referentes a Junho/2024

#### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Junho/2024				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	80.595,83	0,37%	0,60%	61,91%
BB IDKA 2A	31.699,39	0,26%	0,60%	42,37%
BB FLUXO	711.317,82	0,84%	0,60%	138,34%
BB RETORNO TOTAL	1.771.085,51	0,38%	0,60%	63,41%
BB IRF-M1 TP	4.276,84	0,61%	0,60%	100,27%
BB FLUXO	58.047,34	0,08%	0,60%	12,51%
BB IMA-B 5	76.860,64	0,37%	0,60%	61,91%
BB IRF-M1 TP	6.356.117,90	0,31%	0,60%	51,24%
BB FLUXO	648.357,54	0,61%	0,60%	101,18%
BB PERFIL	8.074.806,42	0,59%	0,60%	97,85%
BB RETORNO TOTAL	24.410,19	0,38%	0,60%	63,41%
BB VERT 2024	352.234,14	0,64%	0,60%	105,70%
BB FLUXO	529.814,92	0,11%	0,60%	17,65%
BB FLUXO	1.428.604,98	0,65%	0,60%	107,69%
CAIXA RIO BRAVO	410.000,00	5,36%	0,60%	887,23%
CAIXA NOVO IMA-B LP	3.998.954,59	-1,08%	0,60%	-179,39%
CAIXA IMA-B 5	303.856,94	0,37%	0,60%	61,66%
PREMIUM FIDC	82.158,82	-0,51%	0,60%	-84,24%
SANTANDER IRF-M 1 FI	11.146.964,66	0,42%	0,60%	69,14%
SANTANDER REF DI	9.090.619,08	0,60%	0,60%	99,14%
SANTANDER MAXI EMPRESARIAL	1.595.523,69	0,00%	0,60%	0,61%
TOTAL / MÉDIA	46.776.307,24	0,45%	0,60%	75,16%

#### 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	1,52%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	3,79%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	0,01%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,12%	20%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5	0,16%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	13,59%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	1,39%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	17,26%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	0,05%	100%	Art. 7º, I, b
BB VERT 2024	0,75%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	1,13%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	3,05%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,88%	5%	Art. 11º
CAIXA NOVO IMA-B LP	8,55%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	0,65%	100%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,18%	5%	7º, V, a
SANTANDER IRF-M 1 FI	23,83%	100%	Art. 7º, I, b
SANTANDER REF DI	19,43%	20%	Art. 7º, III, a
SANTANDER MAXI EMPRESARIAL	3,41%	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			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	3,57%	5,03%	71,00%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 3,57%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,03%, sendo assim o RPPS atingiu 71% 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	80.595,83	539,10	0,00%
BB IDKA 2A	31.699,39	237,04	0,00%
BB FLUXO	711.317,82	74,49	0,00%
BB RETORNO TOTAL	1.771.085,51	6.179,31	0,01%
BB IRF-M1 TP	4.276,84	9,00	0,00%
BB FLUXO	58.047,34	6,08	0,00%
BB IMA-B 5	76.860,64	514,12	0,00%
BB IRF-M1 TP	6.356.117,90	13.381,18	0,03%
BB FLUXO	648.357,54	67,90	0,00%
BB PERFIL	8.074.806,42	1.460,61	0,00%
BB RETORNO TOTAL	24.410,19	85,17	0,00%
BB VERT 2024	352.234,14	1.424,92	0,00%
BB FLUXO	529.814,92	55,48	0,00%
BB FLUXO	1.428.604,98	149,60	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	410.000,00	0,00	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	3.998.954,59	59.372,66	0,13%
CAIXA IMA-B 5	303.856,94	2.033,02	0,00%
PREMIUM FIDC	82.158,82	0,00	0,00%
SANTANDER IRF-M 1 FI	11.146.964,66	23.670,76	0,05%
SANTANDER REF DI	9.090.619,08	2.932,08	0,01%
SANTANDER MAXI EMPRESARIAL	1.595.523,69	0,00	0,00%
Carteira	46.776.307,24	100.045,64	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	-
BB IDKA 2A	-
BB FLUXO	-
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 VERT 2024	0,02
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	-