

SERVIÇO PREVIDÊNCIA, SAÚDE E ASSISTÊNCIA MUNICIPAL
DE JABOTICABAL - SEPREM

Informações referentes a Janeiro/2024

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Janeiro/2024				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	78.611,40	0,24%	0,93%	25,88%
BB IDKA 2A	2.119.479,03	0,54%	0,93%	58,53%
BB FLUXO	183.329,35	0,88%	0,93%	95,13%
BB PERFIL	194.922,89	0,97%	0,93%	104,50%
BB RETORNO TOTAL	4.079.237,69	0,81%	0,93%	87,78%
BB IRF-M1 TP	1.675.577,30	0,86%	0,93%	93,46%
BB FLUXO	363.957,47	0,72%	0,93%	77,44%
BB IMA-B 5	74.968,18	0,62%	0,93%	66,89%
BB IRF-M1 TP	12.958.548,99	0,86%	0,93%	93,46%
BB FLUXO	7.549,49	0,82%	0,93%	88,22%
BB PERFIL	26.469,58	0,75%	0,93%	81,28%
BB RETORNO TOTAL	23.707,77	0,80%	0,93%	86,26%
BB FLUXO	109.659,32	0,25%	0,93%	27,39%
BB FLUXO	2.574.710,69	0,35%	0,93%	37,40%
CAIXA RIO BRAVO	421.500,00	5,98%	0,93%	646,39%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	1.161.098,16	0,66%	0,93%	70,81%
CAIXA IMA-B	692.842,93	-0,47%	0,93%	-50,29%
CAIXA MATRIZ	50.574,43	1,01%	0,93%	108,82%
CAIXA TP	77.879,72	0,95%	0,93%	102,73%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.544.139,83	-0,49%	0,93%	-52,93%
CAIXA IMA-B 5	296.359,93	0,66%	0,93%	71,76%
PREMIUM FIDC	82.105,93	-0,75%	0,93%	-80,77%
SANTANDER IRF-M 1 FI	19.531.356,67	0,16%	0,93%	17,38%
TOTAL / MÉDIA	52.328.586,75	0,70%	0,93%	75,17%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	0,15%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	4,05%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,35%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,37%	20%	Art. 7º, III, a
BB RETORNO TOTAL	7,80%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	3,20%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,70%	20%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5	0,14%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	24,76%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,01%	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	0,21%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	4,92%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,81%	5%	Art. 11º
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2,22%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	1,32%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	0,10%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	0,15%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA NOVO IMA-B LP	10,59%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	0,57%	100%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,16%	5%	7º, V, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,70%	0,93%	75,17%
Fevereiro			
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,70%	0,93%	75,17%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,7%, enquanto que a meta acumulada no período é de 0,93%, sendo assim o RPPS atingiu 75,17% 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	78.611,40	741,96	0,00%
BB IDKA 2A	2.119.479,03	18.572,47	0,04%
BB FLUXO	183.329,35	27,84	0,00%
BB PERFIL	194.922,89	28,53	0,00%
BB RETORNO TOTAL	4.079.237,69	6.677,23	0,01%
BB IRF-M1 TP	1.675.577,30	1.509,95	0,00%
BB FLUXO	363.957,47	55,27	0,00%
BB IMA-B 5	74.968,18	707,58	0,00%
BB IRF-M1 TP	12.958.548,99	11.677,62	0,02%
BB FLUXO	7.549,49	1,15	0,00%
BB PERFIL	26.469,58	3,87	0,00%
BB RETORNO TOTAL	23.707,77	38,81	0,00%
BB FLUXO	109.659,32	16,65	0,00%
BB FLUXO	2.574.710,69	391,01	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	421.500,00	0,00	0,00%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	1.161.098,16	6.921,50	0,01%
CAIXA IMA-B	692.842,93	15.110,47	0,03%
CAIXA MATRIZ	50.574,43	15,06	0,00%
CAIXA TP	77.879,72	18,26	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.544.139,83	124.828,67	0,24%
CAIXA IMA-B 5	296.359,93	2.789,32	0,01%
PREMIUM FIDC	82.105,93	0,00	0,00%
Carteira	52.328.586,75	192.986,04	0,37%

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	0,04
CAIXA TP	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-
SANTANDER IRF-M 1 FI	-