

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

Informações referentes a Abril/2021

**1. RENTABILIDADE MÉDIA**

Abril/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.192.096,39	0,87%	0,75%	115,70%
BB IPCA IV	688.262,97	0,41%	0,75%	54,21%
BB IDKA 2A	10.236.617,13	0,84%	0,75%	112,01%
BB FLUXO	462.083,58	0,09%	0,75%	12,53%
BB PERFIL	1.935.319,69	0,20%	0,75%	26,60%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.666.029,68	0,62%	0,75%	82,88%
BB IRF-M1 TP	4.867.648,48	0,24%	0,75%	32,38%
BB FLUXO	932.253,26	0,05%	0,75%	6,78%
BB XI TP	403.308,88	0,41%	0,75%	54,23%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	569.980,22	0,14%	0,75%	18,17%
CAIXA RIO BRAVO	475.000,00	-3,91%	0,75%	-521,47%
CAIXA DIVIDENDOS	684.842,09	2,52%	0,75%	336,21%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.225.771,95	0,66%	0,75%	88,63%
CAIXA IRF-M1 TP	809.200,13	0,28%	0,75%	37,67%
CAIXA IMA-B	2.028.149,99	0,63%	0,75%	84,06%
CAIXA MATRIZ	1.922.623,45	0,18%	0,75%	24,00%
CAIXA TP	2.445.241,90	0,12%	0,75%	16,62%
CAIXA IMA-GERAL	2.006.381,83	0,48%	0,75%	64,21%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.971.573,47	0,63%	0,75%	83,54%
CAIXA IMA-B 5	8.897.181,44	0,86%	0,75%	114,92%
DAYCOVAL IMA-B 5	183.940,34	0,82%	0,75%	109,54%
PREMIUM FIDC	227.303,84	-0,09%	0,75%	-12,58%
TOTAL / MÉDIA	55.830.810,71	0,57%	0,75%	76,63%

**2. ENQUADRAMENTO**

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,93%	20%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,23%	20%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	18,34%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,83%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	3,47%	20%	Art. 7º, IV, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	8,36%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,72%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	1,67%	20%	Art. 7º, IV, a
BB XI TP	0,72%	20%	Art. 7º, IV, a
BRADESCO FEDERAL EXTRA	1,02%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA RIO BRAVO	0,85%	5%	Art. 8º, IV, b
CAIXA DIVIDENDOS	1,23%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	5,78%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	1,45%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,63%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	3,44%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA TP	4,38%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IMA-GERAL	3,59%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA NOVO IMA-B LP	10,70%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	15,94%	20%	Art. 7º, I, b
DAYCOVAL IMA-B 5	0,33%	20%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,41%	5%	Art. 7º, VII, a

**3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL**

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,35%	0,69%	-50,12%
Fevereiro	-0,75%	1,30%	-57,79%
Março	0,13%	1,37%	9,78%
Abril	0,57%	0,75%	76,63%
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,39%	4,18%	-9,43%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,39%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,18%, sendo assim o RPPS atingiu - 9,43% 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	2.192.096,39	27.463,58	0,05%
BB IPCA IV	688.262,97	5.760,70	0,01%
BB IDKA 2A	10.236.617,13	123.662,94	0,22%
BB FLUXO	462.083,58	56,45	0,00%
BB PERFIL	1.935.319,69	598,86	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.666.029,68	62.189,63	0,11%
BB IRF-M1 TP	4.867.648,48	7.579,51	0,01%
BB FLUXO	932.253,26	113,89	0,00%
BB XI TP	403.308,88	3.376,89	0,01%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	569.980,22	99,97	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	475.000,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	684.842,09	61.270,30	0,11%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.225.771,95	30.971,78	0,06%
CAIXA IRF-M1 TP	809.200,13	1.244,56	0,00%
CAIXA IMA-B	2.028.149,99	51.013,82	0,09%
CAIXA MATRIZ	1.922.623,45	1.947,21	0,00%
CAIXA TP	2.445.241,90	823,72	0,00%
CAIXA IMA-GERAL	2.006.381,83	23.725,96	0,04%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.971.573,47	150.079,58	0,27%
CAIXA IMA-B 5	8.897.181,44	111.657,02	0,20%
DAYCOVAL IMA-B 5	183.940,34	2.314,28	0,00%
PREMIUM FIDC	227.303,84	0,00	0,00%
Carteira	55.830.810,71	603.862,39	1,08%

**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	0,01
BB IPCA IV	0,00
BB IDKA 2A	0,01
BB FLUXO	-
BB PERFIL	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA	0,01
BB IRF-M1 TP	0,00
BB FLUXO	-
BB XI TP	0,00
BRADESCO FEDERAL EXTRA	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	0,01
CAIXA IMA-B	0,00
CAIXA MATRIZ	-
CAIXA TP	-
CAIXA IMA-GERAL	0,00
CAIXA NOVO IMA-B LP	0,00
CAIXA IMA-B 5	0,01
DAYCOVAL IMA-B 5	0,01
PREMIUM FIDC	-