

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

Informações referentes a Dezembro/2021

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Dezembro/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.270.525,24	0,76%	1,17%	65,06%
BB IPCA IV	706.596,30	0,58%	1,17%	49,84%
BB IDKA 2A	10.623.336,66	0,71%	1,17%	60,27%
BB FLUXO	163.819,72	0,14%	1,17%	11,89%
BB PERFIL	3.054.820,19	0,80%	1,17%	68,18%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.707.049,99	0,91%	1,17%	78,02%
BB IRF-M1 TP	4.628.996,60	0,79%	1,17%	67,75%
BB FLUXO	94.340,63	1,21%	1,17%	103,43%
BB XI TP	414.155,98	0,58%	1,17%	49,59%
BB FLUXO	4.429.140,10	0,69%	1,17%	58,93%
BB FLUXO	416.834,14	0,06%	1,17%	4,96%
BRASESCO FEDERAL EXTRA	591.033,52	0,73%	1,17%	62,38%
CAIXA RIO BRAVO	341.200,00	1,01%	1,17%	86,61%
CAIXA DIVIDENDOS	614.707,76	-0,32%	1,17%	-27,66%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.806.770,94	0,83%	1,17%	70,47%
CAIXA IRF-M1 TP	420.334,67	0,85%	1,17%	72,42%
CAIXA IMA-B	2.043.098,94	0,21%	1,17%	17,87%
CAIXA MATRIZ	1.998.615,52	0,75%	1,17%	64,42%
CAIXA TP	2.537.210,37	0,78%	1,17%	66,32%
CAIXA IMA-GERAL	2.037.801,80	0,94%	1,17%	80,13%
CAIXA NOVO IMA-B LP	6.020.071,99	0,22%	1,17%	18,88%
CAIXA IMA-B 5	9.222.556,05	0,77%	1,17%	65,50%
DAYCOVAL IMA-B 5	189.675,19	0,75%	1,17%	63,86%
PREMIUM FIDC	215.550,03	-0,30%	1,17%	-25,32%
TOTAL / MÉDIA	60.548.242,33	0,68%	1,17%	57,90%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,75%	20%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,17%	20%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	17,55%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,27%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	5,05%	20%	Art. 7º, IV, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	7,77%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	7,65%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,16%	20%	Art. 7º, IV, a
BB XI TP	0,68%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	7,32%	20%	Art. 7º, IV, a
BB FLUXO	0,69%	20%	Art. 7º, IV, a
BRASESCO FEDERAL EXTRA	0,98%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA RIO BRAVO	0,56%	5%	Art. 8º, IV, b
CAIXA DIVIDENDOS	1,02%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	4,64%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	0,69%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,37%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	3,30%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA TP	4,19%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IMA-GERAL	3,37%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA NOVO IMA-B LP	9,94%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	15,23%	20%	Art. 7º, I, b
DAYCOVAL IMA-B 5	0,31%	20%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,36%	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%
Maior	0,59%	1,27%	46,25%
Junho	0,01%	0,97%	1,51%
Julho	-0,15%	1,40%	-10,34%
Agosto	-0,14%	1,31%	-10,77%
Setembro	0,43%	1,60%	26,57%
Outubro	-0,97%	1,69%	-57,22%
Novembro	1,76%	1,39%	126,18%
Dezembro	0,68%	1,17%	57,90%
Acumulado	1,81%	15,99%	11,29%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,81%, enquanto que a meta acumulada no período é de 15,99%, sendo assim o RPPS atingiu 11,29% 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	2.270.525,24	31.065,90	0,05%
BB IPCA IV	706.596,30	5.165,45	0,01%
BB IDKA 2A	10.623.336,66	135.155,60	0,22%
BB FLUXO	163.819,72	70,50	0,00%
BB PERFIL	3.054.820,19	1.631,27	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.707.049,99	66.066,70	0,11%
BB IRF-M1 TP	4.628.996,60	19.756,98	0,03%
BB FLUXO	94.340,63	40,60	0,00%
BB XI TP	414.155,98	3.026,79	0,00%
BB FLUXO	4.429.140,10	1.906,21	0,00%
BB FLUXO	416.834,14	179,40	0,00%
BRASESCO FEDERAL EXTRA	591.033,52	216,38	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	341.200,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	614.707,76	59.284,51	0,10%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.806.770,94	25.431,61	0,04%
CAIXA IRF-M1 TP	420.334,67	1.788,18	0,00%
CAIXA IMA-B	2.043.098,94	62.513,07	0,10%
CAIXA MATRIZ	1.998.615,52	1.967,66	0,00%
CAIXA TP	2.537.210,37	1.277,48	0,00%
CAIXA IMA-GERAL	2.037.801,80	30.205,01	0,05%
CAIXA NOVO IMA-B LP	6.020.071,99	186.092,50	0,31%
CAIXA IMA-B 5	9.222.556,05	124.539,53	0,21%
DAYCOVAL IMA-B 5	189.675,19	2.661,98	0,00%
PREMIUM FIDC	215.550,03	0,00	0,00%
Carteira	60.548.242,33	679.772,16	1,12%

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 IPCA IV	-
BB IDKA 2A	0,00
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,02
BB ALOCAÇÃO ATIVA	0,00
BB IRF-M1 TP	0,00
BB FLUXO	-
BB XI TP	-
BB FLUXO	-
BB FLUXO	-
BRASESCO FEDERAL EXTRA	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	0,00
CAIXA IMA-B	-
CAIXA MATRIZ	-
CAIXA TP	0,00
CAIXA IMA-GERAL	0,00
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	0,00
DAYCOVAL IMA-B 5	0,00
PREMIUM FIDC	-