

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

Informações referentes a Fevereiro/2021

**1. RENTABILIDADE MÉDIA**

Fevereiro/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.166.277,20	-0,61%	1,30%	-47,19%
BB IPCA IV	682.791,04	0,00%	1,30%	-0,05%
BB IDKA 2A	10.113.933,76	-0,55%	1,30%	-42,10%
BB FLUXO	55.405,54	0,06%	1,30%	4,30%
BB PERFIL	1.926.836,47	0,10%	1,30%	7,32%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.656.823,09	-0,91%	1,30%	-70,18%
BB IRF-M1 TP	4.855.043,01	0,00%	1,30%	0,32%
BB FLUXO	606.514,96	0,01%	1,30%	1,07%
BB XI TP	400.107,32	0,00%	1,30%	-0,18%
BRAPESCO FEDERAL EXTRA	568.154,95	0,09%	1,30%	6,63%
CAIXA RIO BRAVO	490.000,00	-13,59%	1,30%	-1043,78%
CAIXA DIVIDENDOS	632.472,42	-4,31%	1,30%	-331,19%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.194.859,20	-0,51%	1,30%	-38,98%
CAIXA IRF-M1 TP	806.847,01	0,02%	1,30%	1,39%
CAIXA IMA-B	2.025.062,47	-1,54%	1,30%	-118,30%
CAIXA MATRIZ	2.716.720,84	0,07%	1,30%	5,04%
CAIXA TP	2.438.413,31	0,07%	1,30%	5,73%
CAIXA IMA-GERAL	2.004.671,18	-0,83%	1,30%	-63,75%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.963.648,60	-1,55%	1,30%	-119,12%
CAIXA IMA-B 5	8.793.783,48	-0,62%	1,30%	-47,59%
DAYCOVAL IMA-B 5	182.022,66	-0,63%	1,30%	-48,23%
PREMIUM FIDC	227.969,10	-0,20%	1,30%	-15,21%
TOTAL / MÉDIA	55.508.357,61	-0,75%	1,30%	-57,79%

**2. ENQUADRAMENTO**

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,90%	20%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,23%	20%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	18,22%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,10%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	3,47%	20%	Art. 7º, IV, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	8,39%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,75%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	1,09%	20%	Art. 7º, IV, a
BB XI TP	0,72%	20%	Art. 7º, I, b
BRAPESCO FEDERAL EXTRA	1,02%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA RIO BRAVO	0,88%	5%	Art. 8º, IV, b
CAIXA DIVIDENDOS	1,14%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	5,76%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	1,45%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,65%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	4,89%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA TP	4,39%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IMA-GERAL	3,61%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA NOVO IMA-B LP	10,74%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	15,84%	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			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-1,10%	2,00%	-54,76%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -1,1%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2%, sendo assim o RPPS atingiu -54,76% 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	2.166.277,20	22.180,77	0,04%
BB IPCA IV	682.791,04	4.885,82	0,01%
BB IDKA 2A	10.113.933,76	93.576,66	0,17%
BB FLUXO	55.405,54	57,78	0,00%
BB PERFIL	1.926.836,47	2.156,68	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.656.823,09	60.427,18	0,11%
BB IRF-M1 TP	4.855.043,01	8.230,12	0,01%
BB FLUXO	606.514,96	632,53	0,00%
BB XI TP	400.107,32	2.864,00	0,01%
BRAPESCO FEDERAL EXTRA	568.154,95	1.069,85	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	490.000,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	632.472,42	62.912,03	0,11%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.194.859,20	28.667,26	0,05%
CAIXA IRF-M1 TP	806.847,01	1.246,52	0,00%
CAIXA IMA-B	2.025.062,47	48.577,28	0,09%
CAIXA MATRIZ	2.716.720,84	5.003,94	0,01%
CAIXA TP	2.438.413,31	8.072,49	0,01%
CAIXA IMA-GERAL	2.004.671,18	22.023,66	0,04%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.963.648,60	142.734,56	0,26%
CAIXA IMA-B 5	8.793.783,48	89.710,57	0,16%
DAYCOVAL IMA-B 5	182.022,66	1.830,24	0,00%
PREMIUM FIDC	227.969,10	0,00	0,00%
Carteira	55.508.357,61	533.671,33	0,96%

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