

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

Informações referentes a Janeiro/2021

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Janeiro/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.179.672,10	0,10%	0,69%	13,99%
BB IPCA IV	700.811,71	0,29%	0,69%	41,80%
BB IDKA 2A	10.169.687,94	0,18%	0,69%	25,67%
BB FLUXO	38.487,98	0,08%	0,69%	11,39%
BB PERFIL	1.925.001,37	0,11%	0,69%	16,33%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.699.776,05	-0,55%	0,69%	-80,11%
BB IRF-M1 TP	4.854.838,06	0,03%	0,69%	4,55%
BB FLUXO	1.375.011,09	0,03%	0,69%	4,26%
BB XI TP	410.526,91	0,29%	0,69%	41,50%
BRASESCO FEDERAL EXTRA	567.664,60	0,15%	0,69%	22,00%
CAIXA RIO BRAVO	570.550,00	-16,11%	0,69%	-2335,67%
CAIXA DIVIDENDOS	660.979,29	-3,76%	0,69%	-545,68%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.211.157,19	0,03%	0,69%	3,67%
CAIXA IRF-M1 TP	806.701,33	0,03%	0,69%	3,66%
CAIXA IMA-B	2.056.747,63	-0,87%	0,69%	-126,53%
CAIXA MATRIZ	2.714.939,07	0,17%	0,69%	24,51%
CAIXA TP	2.436.594,63	0,20%	0,69%	29,14%
CAIXA IMA-GERAL	2.021.452,54	-0,46%	0,69%	-66,27%
CAIXA NOVO IMA-B LP	6.057.609,90	-0,88%	0,69%	-127,90%
CAIXA IMA-B 5	8.848.621,84	0,08%	0,69%	12,07%
DAYCOVAL IMA-B 5	183.172,98	-0,04%	0,69%	-5,84%
PREMIUM FIDC	228.421,61	-0,20%	0,69%	-29,66%
TOTAL / MÉDIA	56.718.425,82	-0,35%	0,69%	-50,12%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,84%	20%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,24%	20%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	17,93%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,07%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	3,39%	20%	Art. 7º, IV, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	8,29%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,56%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	2,42%	20%	Art. 7º, IV, a
BB XI TP	0,72%	20%	Art. 7º, I, b
BRASESCO FEDERAL EXTRA	1,00%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA RIO BRAVO	1,01%	5%	Art. 8º, IV, b
CAIXA DIVIDENDOS	1,17%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	5,66%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	1,42%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,63%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	4,79%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA TP	4,30%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IMA-GERAL	3,56%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA NOVO IMA-B LP	10,68%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	15,60%	20%	Art. 7º, I, b
DAYCOVAL IMA-B 5	0,32%	20%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,40%	5%	Art. 7º, VII, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,35%	0,69%	-50,12%
Fevereiro			
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,35%	0,69%	-50,12%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,35%, enquanto que a meta acumulada no período é de 0,69%, sendo assim o RPPS atingiu -50,12% 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 Kansal

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	2.179.672,10	24.857,36	0,04%
BB IPCA IV	700.811,71	5.733,61	0,01%
BB IDKA 2A	10.169.687,94	99.637,77	0,18%
BB FLUXO	38.487,98	41,31	0,00%
BB PERFIL	1.925.001,37	2.369,66	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.699.776,05	70.620,14	0,12%
BB IRF-M1 TP	4.854.838,06	8.653,16	0,02%
BB FLUXO	1.375.011,09	1.475,73	0,00%
BB XI TP	410.526,91	3.359,67	0,01%
BRASESCO FEDERAL EXTRA	567.664,60	1.104,53	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	570.550,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	660.979,29	61.847,97	0,11%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.211.157,19	34.932,14	0,06%
CAIXA IRF-M1 TP	806.701,33	1.261,28	0,00%
CAIXA IMA-B	2.056.747,63	58.982,95	0,10%
CAIXA MATRIZ	2.714.939,07	5.478,27	0,01%
CAIXA TP	2.436.594,63	8.478,00	0,01%
CAIXA IMA-GERAL	2.021.452,54	25.712,21	0,05%
CAIXA NOVO IMA-B LP	6.057.609,90	173.104,39	0,31%
CAIXA IMA-B 5	8.848.621,84	100.653,35	0,18%
DAYCOVAL IMA-B 5	183.172,98	2.055,27	0,00%
PREMIUM FIDC	228.421,61	0,00	0,00%
Carteira	56.718.425,82	619.485,81	1,09%

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	0,00
BB IDKA 2A	0,00
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,01
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB XI TP	0,00
BRASESCO FEDERAL EXTRA	0,01
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA MATRIZ	0,02
CAIXA TP	0,03
CAIXA IMA-GERAL	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	-