

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

Informações referentes a Julho/2021

**1. RENTABILIDADE MÉDIA**

Julho/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.203.512,05	0,02%	1,40%	1,61%
BB IPCA IV	700.436,31	0,66%	1,40%	46,90%
BB IDKA 2A	10.304.252,78	0,08%	1,40%	5,95%
BB FLUXO	25.184,06	0,25%	1,40%	17,57%
BB PERFIL	2.964.276,29	0,39%	1,40%	28,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.681.974,01	-0,25%	1,40%	-17,80%
BB IRF-M1 TP	4.893.114,55	0,16%	1,40%	11,72%
BB FLUXO	1.154.434,33	0,12%	1,40%	8,36%
BB XI TP	410.412,04	0,66%	1,40%	46,80%
BRASESCO FEDERAL EXTRA	575.480,90	0,38%	1,40%	26,82%
CAIXA RIO BRAVO	371.250,00	-11,36%	1,40%	-810,21%
CAIXA DIVIDENDOS	690.224,16	-3,17%	1,40%	-225,94%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.208.295,29	-0,78%	1,40%	-55,30%
CAIXA IRF-M1 TP	412.813,22	0,09%	1,40%	6,20%
CAIXA IMA-B	2.049.318,92	-0,40%	1,40%	-28,42%
CAIXA MATRIZ	1.942.619,90	0,45%	1,40%	32,06%
CAIXA TP	2.469.200,55	0,38%	1,40%	27,06%
CAIXA IMA-GERAL	2.018.984,71	-0,13%	1,40%	-9,50%
CAIXA NOVO IMA-B LP	6.037.638,46	-0,39%	1,40%	-27,47%
CAIXA IMA-B 5	8.944.571,84	0,01%	1,40%	0,99%
DAYCOVAL IMA-B 5	184.530,63	-0,08%	1,40%	-5,56%
PREMIUM FIDC	218.809,96	-0,20%	1,40%	-14,47%
TOTAL / MÉDIA	56.461.334,96	-0,15%	1,40%	-10,34%

**2. ENQUADRAMENTO**

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,90%	20%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,24%	20%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	18,25%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,04%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	5,25%	20%	Art. 7º, IV, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	8,29%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,67%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	2,04%	20%	Art. 7º, IV, a
BB XI TP	0,73%	20%	Art. 7º, I, b
BRASESCO FEDERAL EXTRA	1,02%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA RIO BRAVO	0,66%	5%	Art. 8º, IV, b
CAIXA DIVIDENDOS	1,22%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	5,68%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	0,73%	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	4,37%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IMA-GERAL	3,58%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA NOVO IMA-B LP	10,69%	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	0,39%	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			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,06%	8,02%	0,77%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,06%, enquanto que a meta acumulada no período é de 8,02%, sendo assim o RPPS atingiu 0,77% 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	2.203.512,05	27.079,50	0,05%
BB IPCA IV	700.436,31	5.731,11	0,01%
BB IDKA 2A	10.304.252,78	118.712,38	0,21%
BB FLUXO	25.184,06	5,69	0,00%
BB PERFIL	2.964.276,29	1.017,31	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.681.974,01	55.008,57	0,10%
BB IRF-M1 TP	4.893.114,55	9.010,45	0,02%
BB FLUXO	1.154.434,33	260,81	0,00%
BB XI TP	410.412,04	3.358,67	0,01%
BRASESCO FEDERAL EXTRA	575.480,90	197,73	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	371.250,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	690.224,16	46.245,73	0,08%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.208.295,29	37.754,87	0,07%
CAIXA IRF-M1 TP	412.813,22	745,37	0,00%
CAIXA IMA-B	2.049.318,92	47.141,33	0,08%
CAIXA MATRIZ	1.942.619,90	1.219,56	0,00%
CAIXA TP	2.469.200,55	1.011,63	0,00%
CAIXA IMA-GERAL	2.018.984,71	21.100,54	0,04%
CAIXA NOVO IMA-B LP	6.037.638,46	138.288,09	0,24%
CAIXA IMA-B 5	8.944.571,84	109.010,67	0,19%
DAYCOVAL IMA-B 5	184.530,63	2.305,31	0,00%
PREMIUM FIDC	218.809,96	0,00	0,00%
Carteira	56.461.334,96	567.052,70	1,00%

**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	0,01
BB IDKA 2A	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,05
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB XI TP	0,01
BRASESCO FEDERAL EXTRA	0,04
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA MATRIZ	0,02
CAIXA TP	0,02
CAIXA IMA-GERAL	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	-
DAYCOVAL IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-