

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

Informações referentes a Março/2021

**1. RENTABILIDADE MÉDIA**

Março/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.173.243,36	0,32%	1,37%	23,43%
BB IPCA IV	685.477,00	0,39%	1,37%	28,66%
BB IDKA 2A	10.151.357,84	0,37%	1,37%	26,96%
BB FLUXO	119.572,41	0,09%	1,37%	6,82%
BB PERFIL	1.931.467,22	0,24%	1,37%	17,51%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.637.211,12	-0,42%	1,37%	-30,68%
BB IRF-M1 TP	4.855.859,42	0,02%	1,37%	1,23%
BB FLUXO	1.033.366,75	0,05%	1,37%	3,68%
BB XI TP	401.675,66	0,39%	1,37%	28,56%
BRABESCO FEDERAL EXTRA	569.204,85	-0,54%	1,37%	-39,28%
CAIXA RIO BRAVO	497.450,00	2,13%	1,37%	155,38%
CAIXA DIVIDENDOS	668.002,36	5,62%	1,37%	409,29%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.204.477,30	0,30%	1,37%	21,93%
CAIXA IRF-M1 TP	806.921,08	0,01%	1,37%	0,67%
CAIXA IMA-B	2.015.447,74	-0,47%	1,37%	-34,59%
CAIXA MATRIZ	1.919.169,38	0,09%	1,37%	6,57%
CAIXA TP	2.442.198,97	0,16%	1,37%	11,31%
CAIXA IMA-GERAL	1.996.768,82	-0,39%	1,37%	-28,72%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.934.402,20	-0,49%	1,37%	-35,73%
CAIXA IMA-B 5	8.821.173,91	0,31%	1,37%	22,69%
DAYCOVAL IMA-B 5	182.441,92	0,23%	1,37%	16,78%
PREMIUM FIDC	227.518,37	-0,20%	1,37%	-14,41%
TOTAL / MÉDIA	55.274.407,68	0,13%	1,37%	9,78%

**2. ENQUADRAMENTO**

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,93%	20%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,24%	20%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	18,37%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,22%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	3,49%	20%	Art. 7º, IV, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	8,39%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,79%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	1,87%	20%	Art. 7º, IV, a
BB XI TP	0,73%	20%	Art. 7º, I, b
BRABESCO FEDERAL EXTRA	1,03%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA RIO BRAVO	0,90%	5%	Art. 8º, IV, b
CAIXA DIVIDENDOS	1,21%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	5,80%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	1,46%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,65%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	3,47%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA TP	4,42%	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	15,96%	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			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,96%	3,40%	-28,31%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,96%, enquanto que a meta acumulada no período é de 3,4%, sendo assim o RPPS atingiu -28,31% 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	2.173.243,36	26.062,30	0,05%
BB IPCA IV	685.477,00	5.428,39	0,01%
BB IDKA 2A	10.151.357,84	113.688,35	0,21%
BB FLUXO	119.572,41	16,22	0,00%
BB PERFIL	1.931.467,22	649,96	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.637.211,12	64.029,76	0,12%
BB IRF-M1 TP	4.855.859,42	7.324,43	0,01%
BB FLUXO	1.033.366,75	140,22	0,00%
BB XI TP	401.675,66	3.182,13	0,01%
BRABESCO FEDERAL EXTRA	569.204,85	106,94	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	497.450,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	668.002,36	64.599,45	0,12%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.204.477,30	30.259,19	0,05%
CAIXA IRF-M1 TP	806.921,08	1.196,80	0,00%
CAIXA IMA-B	2.015.447,74	52.542,02	0,10%
CAIXA MATRIZ	1.919.169,38	1.972,63	0,00%
CAIXA TP	2.442.198,97	903,22	0,00%
CAIXA IMA-GERAL	1.996.768,82	24.053,66	0,04%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.934.402,20	154.598,44	0,28%
CAIXA IMA-B 5	8.821.173,91	105.992,11	0,19%
DAYCOVAL IMA-B 5	182.441,92	2.196,95	0,00%
PREMIUM FIDC	227.518,37	0,00	0,00%
Carteira	55.274.407,68	595.512,96	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	0,00
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
BRABESCO FEDERAL EXTRA	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA MATRIZ	-
CAIXA TP	-
CAIXA IMA-GERAL	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	0,00
DAYCOVAL IMA-B 5	0,00
PREMIUM FIDC	-