

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

Informações referentes a Novembro/2021

**1. RENTABILIDADE MÉDIA**

Novembro/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.253.349,82	2,47%	1,39%	177,60%
BB IPCA IV	702.493,75	1,74%	1,39%	124,81%
BB IDKA 2A	10.548.840,53	2,43%	1,39%	174,43%
BB FLUXO	1.329.037,66	0,40%	1,39%	28,69%
BB PERFIL	3.030.609,37	0,63%	1,39%	45,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.664.412,58	1,73%	1,39%	124,51%
BB IRF-M1 TP	4.939.787,01	0,77%	1,39%	55,50%
BB FLUXO	149.673,99	0,47%	1,39%	34,03%
BB XI TP	411.763,35	1,74%	1,39%	124,62%
BB FLUXO	3.939.180,68	0,43%	1,39%	30,82%
BB FLUXO	12.133,86	0,13%	1,39%	9,00%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	586.745,48	0,57%	1,39%	40,82%
CAIXA RIO BRAVO	340.000,00	-3,56%	1,39%	-255,95%
CAIXA DIVIDENDOS	616.706,66	1,18%	1,39%	84,80%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.783.785,63	0,91%	1,39%	65,05%
CAIXA IRF-M1 TP	416.797,93	0,78%	1,39%	56,02%
CAIXA IMA-B	2.038.830,79	3,44%	1,39%	246,97%
CAIXA MATRIZ	1.983.643,52	0,64%	1,39%	46,10%
CAIXA TP	2.517.648,61	0,59%	1,39%	42,67%
CAIXA IMA-GERAL	2.018.847,04	1,85%	1,39%	132,91%
CAIXA NOVO IMA-B LP	6.006.785,66	3,40%	1,39%	244,32%
CAIXA IMA-B 5	9.152.317,93	2,47%	1,39%	177,21%
DAYCOVAL IMA-B 5	188.266,50	2,43%	1,39%	174,15%
PREMIUM FIDC	216.191,49	-0,55%	1,39%	-39,49%
TOTAL / MÉDIA	60.847.849,84	1,76%	1,39%	126,18%

**2. ENQUADRAMENTO**

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,70%	20%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,15%	20%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	17,34%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	2,18%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	4,98%	20%	Art. 7º, IV, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	7,67%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,12%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,25%	20%	Art. 7º, IV, a
BB XI TP	0,68%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	6,47%	20%	Art. 7º, IV, a
BB FLUXO	0,02%	20%	Art. 7º, IV, a
BRADESCO FEDERAL EXTRA	0,96%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA RIO BRAVO	0,56%	5%	Art. 8º, IV, b
CAIXA DIVIDENDOS	1,01%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	4,57%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	0,68%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,35%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	3,26%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA TP	4,14%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IMA-GERAL	3,32%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA NOVO IMA-B LP	9,87%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	15,04%	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%
Mai	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			
Acumulado	1,12%	14,65%	7,64%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,12%, enquanto que a meta acumulada no período é de 14,65%, sendo assim o RPPS atingiu 7,64% 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	2.253.349,82	60.405,92	0,10%
BB IPCA IV	702.493,75	11.021,82	0,02%
BB IDKA 2A	10.548.840,53	268.087,31	0,44%
BB FLUXO	1.329.037,66	5.465,43	0,01%
BB PERFIL	3.030.609,37	15.745,93	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.664.412,58	103.038,36	0,17%
BB IRF-M1 TP	4.939.787,01	38.968,24	0,06%
BB FLUXO	149.673,99	615,51	0,00%
BB XI TP	411.763,35	6.452,94	0,01%
BB FLUXO	3.939.180,68	16.199,19	0,03%
BB FLUXO	12.133,86	49,90	0,00%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	586.745,48	2.726,94	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	340.000,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	616.706,66	58.985,30	0,10%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.783.785,63	42.293,47	0,07%
CAIXA IRF-M1 TP	416.797,93	3.305,04	0,01%
CAIXA IMA-B	2.038.830,79	95.283,51	0,16%
CAIXA MATRIZ	1.983.643,52	10.557,55	0,02%
CAIXA TP	2.517.648,61	12.251,26	0,02%
CAIXA IMA-GERAL	2.018.847,04	46.906,11	0,08%
CAIXA NOVO IMA-B LP	6.006.785,66	281.020,35	0,46%
CAIXA IMA-B 5	9.152.317,93	244.033,88	0,40%
DAYCOVAL IMA-B 5	188.266,50	5.058,63	0,01%
PREMIUM FIDC	216.191,49	0,00	0,00%
Carteira	60.847.849,84	1.237.385,58	2,03%

**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	0,02
BB IPCA IV	0,02
BB IDKA 2A	0,03
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,03
BB ALOCAÇÃO ATIVA	0,01
BB IRF-M1 TP	0,01
BB FLUXO	-
BB XI TP	0,02
BB FLUXO	-
BB FLUXO	-
BRADESCO FEDERAL EXTRA	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	0,01
CAIXA IMA-B	0,01
CAIXA MATRIZ	0,01
CAIXA TP	0,01
CAIXA IMA-GERAL	0,01
CAIXA NOVO IMA-B LP	0,01
CAIXA IMA-B 5	0,02
DAYCOVAL IMA-B 5	0,02
PREMIUM FIDC	-