

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

Informações referentes a Setembro/2021

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Setembro/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.227.358,30	0,98%	1,60%	60,96%
BB IPCA IV	693.935,64	1,30%	1,60%	81,02%
BB IDKA 2A	10.429.321,53	1,03%	1,60%	64,45%
BB FLUXO	3.231.864,41	0,43%	1,60%	26,76%
BB PERFIL	5.003.525,28	0,38%	1,60%	23,76%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.660.710,07	-0,01%	1,60%	-0,33%
BB IRF-M1 TP	4.927.464,30	0,37%	1,60%	22,84%
BB FLUXO	290.711,50	0,12%	1,60%	7,38%
BB XI TP	406.756,22	1,30%	1,60%	80,91%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	580.478,87	0,45%	1,60%	27,86%
CAIXA RIO BRAVO	360.100,00	-2,01%	1,60%	-125,57%
CAIXA DIVIDENDOS	636.932,37	-6,49%	1,60%	-404,46%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.777.156,11	0,35%	1,60%	22,14%
CAIXA IRF-M1 TP	415.799,09	0,38%	1,60%	23,59%
CAIXA IMA-B	2.022.859,60	-0,16%	1,60%	-9,71%
CAIXA MATRIZ	1.961.910,81	0,51%	1,60%	32,01%
CAIXA TP	2.489.822,04	0,43%	1,60%	26,87%
CAIXA IMA-GERAL	2.011.030,55	-0,02%	1,60%	-1,05%
CAIXA IMA-B	5.961.360,14	-0,14%	1,60%	-8,89%
CAIXA IMA-B 5	9.044.412,86	0,98%	1,60%	61,18%
DAYCOVAL IMA-B 5	186.285,84	0,89%	1,60%	55,36%
PREMIUM FIDC	217.757,51	-0,18%	1,60%	-11,32%
TOTAL / MÉDIA	60.537.553,04	0,42%	1,60%	26,33%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	3,68%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA IV	1,15%	20%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	17,23%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	5,34%	20%	Art. 7º, IV, a
BB PERFIL	8,27%	20%	Art. 7º, IV, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	7,70%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	8,14%	20%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,48%	20%	Art. 7º, IV, a
BB XI TP	0,67%	20%	Art. 7º, I, b
BRADESCO FEDERAL EXTRA	0,96%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA RIO BRAVO	0,59%	5%	Art. 8º, IV, b
CAIXA DIVIDENDOS	1,05%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	4,59%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	0,69%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,34%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	3,24%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA TP	4,11%	20%	Art. 7º, IV, a
CAIXA IMA-GERAL	3,32%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	9,85%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5	14,94%	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	0,42%	1,60%	26,33%
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,34%	11,19%	3,06%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,34%, enquanto que a meta acumulada no período é de 11,19%, sendo assim o RPPS atingiu 3,06% 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	2.227.358,30	55.914,38	0,09%
BB IPCA IV	693.935,64	4.113,97	0,01%
BB IDKA 2A	10.429.321,53	104.633,73	0,17%
BB FLUXO	3.231.864,41	680,11	0,00%
BB PERFIL	5.003.525,28	1.406,30	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.660.710,07	52.344,44	0,09%
BB IRF-M1 TP	4.927.464,30	10.030,51	0,02%
BB FLUXO	290.711,50	61,18	0,00%
BB XI TP	406.756,22	2.412,37	0,00%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	580.478,87	130,87	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	360.100,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	636.932,37	50.359,69	0,08%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.777.156,11	37.167,26	0,06%
CAIXA IRF-M1 TP	415.799,09	838,85	0,00%
CAIXA IMA-B	2.022.859,60	50.437,87	0,08%
CAIXA MATRIZ	1.961.910,81	1.781,20	0,00%
CAIXA TP	2.489.822,04	695,33	0,00%
CAIXA IMA-GERAL	2.011.030,55	21.654,55	0,04%
CAIXA IMA-B	5.961.360,14	148.640,23	0,25%
CAIXA IMA-B 5	9.044.412,86	103.325,97	0,17%
DAYCOVAL IMA-B 5	186.285,84	2.215,85	0,00%
PREMIUM FIDC	217.757,51	0,00	0,00%
Carteira	60.537.553,04	579.765,82	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	-
BB IPCA IV	0,02
BB IDKA 2A	0,01
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,01
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB XI TP	0,02
BRADESCO FEDERAL EXTRA	0,01
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA MATRIZ	0,01
CAIXA TP	-
CAIXA IMA-GERAL	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA IMA-B 5	0,01
DAYCOVAL IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-