

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

Informações referentes a Maio/2022

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Maio/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.409.829,99	0,77%	0,88%	87,24%
BB IPCA IV	734.126,70	0,65%	0,88%	73,54%
BB IDKA 2A	11.279.242,42	0,77%	0,88%	87,82%
BB FLUXO	355.661,91	0,89%	0,88%	100,89%
BB PERFIL	1.787.018,85	1,07%	0,88%	120,81%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.865.785,59	0,82%	0,88%	92,65%
BB IRF-M1 TP	4.035.636,32	0,92%	0,88%	104,43%
BB FLUXO	109.486,14	0,72%	0,88%	81,87%
BB XI TP	430.284,79	0,65%	0,88%	73,36%
BB FLUXO	9.504.576,07	0,89%	0,88%	100,38%
BB FLUXO	503.737,52	0,07%	0,88%	8,25%
BRABESCO FEDERAL EXTRA	615.820,30	1,02%	0,88%	115,80%
CAIXA RIO BRAVO	314.850,00	-2,34%	0,88%	-264,89%
CAIXA DIVIDENDOS	684.747,85	3,11%	0,88%	351,96%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.928.776,07	1,07%	0,88%	120,68%
CAIXA IRF-M1 TP	436.772,36	0,93%	0,88%	105,16%
CAIXA IMA-B	2.138.043,18	0,97%	0,88%	109,45%
CAIXA MATRIZ	1.417.066,80	1,09%	0,88%	123,74%
CAIXA TP	2.650.105,33	1,07%	0,88%	121,66%
CAIXA IMA-GERAL	151.984,31	0,91%	0,88%	103,25%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.738.611,75	0,73%	0,88%	82,17%
CAIXA IMA-B 5	8.323.012,93	0,76%	0,88%	86,64%
DAYCOVAL IMA-B 5	200.531,67	0,76%	0,88%	86,24%
PREMIUM FIDC	88.697,61	-58,66%	0,88%	-6646,88%
TOTAL / MÉDIA	60.704.406,46	0,66%	0,88%	74,42%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,97%	100%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,21%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	18,58%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,59%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	2,94%	20%	Art. 7º, III, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	8,02%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	6,65%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,18%	20%	Art. 7º, III, a
BB XI TP	0,71%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	15,66%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	0,83%	20%	Art. 7º, III, a
BRABESCO FEDERAL EXTRA	1,01%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,52%	5%	Art. 11º
CAIXA DIVIDENDOS	1,13%	20%	Art. 8º, I
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	4,82%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	0,72%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,52%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	2,33%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	4,37%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-GERAL	0,25%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA NOVO IMA-B LP	7,81%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	13,71%	100%	Art. 7º, I, b
DAYCOVAL IMA-B 5	0,33%	100%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,15%	5%	7º, V, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,27%	0,95%	28,23%
Fevereiro	0,79%	1,42%	55,24%
Março	1,89%	2,04%	92,64%
Abril	0,93%	1,47%	62,79%
Maio	0,66%	0,88%	74,42%
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	4,60%	6,95%	66,17%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 4,6%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,95%, sendo assim o RPPS atingiu 66,17% 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	2.409.829,99	26.811,71	0,04%
BB IPCA IV	734.126,70	5.513,86	0,01%
BB IDKA 2A	11.279.242,42	135.199,50	0,22%
BB FLUXO	355.661,91	113,01	0,00%
BB PERFIL	1.787.018,85	659,09	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.865.785,59	51.033,91	0,08%
BB IRF-M1 TP	4.035.636,32	11.588,98	0,02%
BB FLUXO	109.486,14	34,79	0,00%
BB XI TP	430.284,79	3.231,04	0,01%
BB FLUXO	9.504.576,07	3.020,00	0,00%
BB FLUXO	503.737,52	160,06	0,00%
BRABESCO FEDERAL EXTRA	615.820,30	203,26	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	314.850,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	684.747,85	53.876,47	0,09%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.928.776,07	19.418,30	0,03%
CAIXA IRF-M1 TP	436.772,36	1.248,56	0,00%
CAIXA IMA-B	2.138.043,18	47.148,17	0,08%
CAIXA MATRIZ	1.417.066,80	713,90	0,00%
CAIXA TP	2.650.105,33	1.418,10	0,00%
CAIXA IMA-GERAL	151.984,31	1.626,06	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.738.611,75	106.336,60	0,18%
CAIXA IMA-B 5	8.323.012,93	91.870,26	0,15%
DAYCOVAL IMA-B 5	200.531,67	2.279,13	0,00%
PREMIUM FIDC	88.697,61	0,00	0,00%
Carteira	60.704.406,46	490.234,60	0,81%

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	-
BB IDKA 2A	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,03
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB XI TP	-
BB FLUXO	-
BB FLUXO	-
BRABESCO FEDERAL EXTRA	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B	0,00
CAIXA MATRIZ	0,04
CAIXA TP	0,03
CAIXA IMA-GERAL	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	0,00
CAIXA IMA-B 5	-
DAYCOVAL IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-