

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

Informações referentes a Dezembro/2022

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Dezembro/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.486.543,75	0,91%	1,03%	88,44%
BB IDKA 2A	10.508.257,25	1,22%	1,03%	117,95%
BB FLUXO	368.710,56	1,47%	1,03%	141,93%
BB PERFIL	170.879,85	1,12%	1,03%	108,64%
BB ALOCAÇÃO AT	0,00	-0,39%	1,03%	-37,36%
BB RETORNO TOT	5.110.810,44	1,22%	1,03%	118,20%
BB IRF-M1 TP	4.027.953,46	1,16%	1,03%	112,00%
BB FLUXO	169.473,43	0,53%	1,03%	51,18%
BB XI TP	0,00	0,57%	1,03%	54,91%
BB IRF-M1 TP	2.927.922,27	0,92%	1,03%	88,78%
BB FLUXO	9.059.146,55	1,03%	1,03%	100,08%
BB PERFIL	5.173.062,45	1,12%	1,03%	108,64%
BB FLUXO	19.640,53	0,09%	1,03%	8,98%
BRABESCO FEDE	662.358,65	1,11%	1,03%	107,08%
CAIXA RIO BRAVO	315.000,00	-7,87%	1,03%	-761,93%
CAIXA DIVIDEND	666.913,79	-2,42%	1,03%	-234,69%
CAIXA GESTÃO ES	3.107.082,97	1,14%	1,03%	110,27%
CAIXA IMA-B	1.641.694,56	-0,24%	1,03%	-22,93%
CAIXA MATRIZ	607.216,77	0,78%	1,03%	75,61%
CAIXA TP	1.569.158,45	0,62%	1,03%	60,24%
CAIXA NOVO IMA	4.803.827,64	-0,26%	1,03%	-25,50%
CAIXA IMA-B 5	3.614.179,52	0,92%	1,03%	89,25%
DAYCOVAL IMA-B	207.039,63	0,86%	1,03%	83,58%
PREMIUM FIDC	96.625,26	12,28%	1,03%	1188,56%
TOTAL / MÉDIA	57.313.497,78	0,82%	1,03%	79,04%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	4,34%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	18,33%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,64%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,30%	20%	Art. 7º, III, a
BB ALOCAÇÃO AT	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOT	8,92%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M1 TP	7,03%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,30%	20%	Art. 7º, III, a
BB XI TP	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	5,11%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	15,81%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	9,03%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	0,03%	20%	Art. 7º, III, a
BRABESCO FEDE	1,16%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,55%	5%	Art. 11º
CAIXA DIVIDEND	1,16%	20%	Art. 8º, I
CAIXA GESTÃO ES	5,42%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	2,86%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	1,06%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	2,74%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA NOVO IMA	8,38%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	6,31%	100%	Art. 7º, I, b
DAYCOVAL IMA-B	0,36%	100%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,17%	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	0,33%	1,08%	30,77%
Julho	0,31%	-0,27%	-
Agosto	0,83%	0,05%	1698,88%
Setembro	0,91%	0,12%	762,66%
Outubro	1,29%	1,00%	128,49%
Novembro	0,13%	0,82%	15,35%
Dezembro	0,82%	1,03%	79,04%
Acumulado	9,53%	11,12%	85,70%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 9,53%, enquanto que a meta acumulada no período é de 11,12%, sendo assim o RPPS atingiu 85,7% 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	2.486.543,75	32.662,88	0,06%
BB IDKA 2A	10.508.257,25	144.293,52	0,25%
BB FLUXO	368.710,56	17,35	0,00%
BB PERFIL	170.879,85	23,98	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA		0,00	
BB RETORNO TOTAL	5.110.810,44	71.843,14	0,13%
BB IRF-M1 TP	4.027.953,46	4.651,61	0,01%
BB FLUXO	169.473,43	7,97	0,00%
BB XI TP		0,00	
BB IRF-M1 TP	2.927.922,27	3.381,26	0,01%
BB FLUXO	9.059.146,55	426,20	0,00%
BB PERFIL	5.173.062,45	725,92	0,00%
BB FLUXO	19.640,53	0,92	0,00%
BRABESCO FEDERAL EXTRA	662.358,65	45,79	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	315.000,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	666.913,79	70.533,66	0,12%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.107.082,97	24.091,61	0,04%
CAIXA IMA-B	1.641.694,56	46.906,92	0,08%
CAIXA MATRIZ	607.216,77	149,01	0,00%
CAIXA TP	1.569.158,45	345,76	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.803.827,64	140.488,47	0,25%
CAIXA IMA-B 5	3.614.179,52	47.126,30	0,08%
DAYCOVAL IMA-B 5	207.039,63	2.646,99	0,00%
PREMIUM FIDC	96.625,26	0,00	0,00%
Carteira	57.313.497,78	540.263,77	0,94%

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 IDKA 2A	0,00
BB FLUXO	-
BB PERFIL	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
BB RETORNO TOTAL	-
BB IRF-M1 TP	0,01
BB FLUXO	-
BB XI TP	-
BB IRF-M1 TP	0,01
BB FLUXO	-
BB PERFIL	-
BB FLUXO	-
BRABESCO FEDERAL EXTRA	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,00
CAIXA IMA-B	-
CAIXA MATRIZ	0,00
CAIXA TP	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	-
DAYCOVAL IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-