

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

Informações referentes a Fevereiro/2022

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Fevereiro/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.296.227,22	1,05%	1,42%	74,00%
BB IPCA IV	698.731,12	1,11%	1,42%	78,01%
BB IDKA 2A	10.747.250,01	1,16%	1,42%	81,19%
BB FLUXO	279.260,46	0,59%	1,42%	41,61%
BB PERFIL	3.103.328,57	0,80%	1,42%	56,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.737.845,13	0,62%	1,42%	43,24%
BB IRF-M1 TP	3.936.859,93	0,63%	1,42%	44,36%
BB FLUXO	188.962,19	0,54%	1,42%	37,65%
BB XI TP	409.561,05	1,11%	1,42%	77,92%
BB FLUXO	6.422.132,10	0,60%	1,42%	42,29%
BB FLUXO	419.755,19	0,00%	1,42%	0,16%
BRASESCO FEDERAL EXTRA	599.943,81	0,76%	1,42%	53,32%
CAIXA RIO BRAVO	324.900,00	-4,39%	1,42%	-308,42%
CAIXA DIVIDENDOS	664.157,05	-0,71%	1,42%	-49,51%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.848.275,51	0,81%	1,42%	56,55%
CAIXA IRF-M1 TP	425.959,62	0,72%	1,42%	50,87%
CAIXA IMA-B	2.038.316,29	0,53%	1,42%	36,99%
CAIXA MATRIZ	1.378.074,58	0,62%	1,42%	43,66%
CAIXA TP	2.579.787,50	0,88%	1,42%	61,56%
CAIXA IMA-GERAL	147.543,78	0,72%	1,42%	50,21%
CAIXA NOVO IMA-B LP	6.002.962,27	0,48%	1,42%	33,89%
CAIXA IMA-B 5	9.327.900,88	1,05%	1,42%	73,76%
DAYCOVAL IMA-B 5	191.561,22	0,95%	1,42%	66,82%
PREMIUM FIDC	214.834,47	-0,16%	1,42%	-11,54%
TOTAL / MÉDIA	59.984.129,95	0,79%	1,42%	55,24%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,83%	100%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,16%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	17,92%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,47%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	5,17%	20%	Art. 7º, III, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	7,90%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	6,56%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,32%	20%	Art. 7º, III, a
BB XI TP	0,68%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	10,71%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	0,70%	20%	Art. 7º, III, a
BRASESCO FEDERAL EXTRA	1,00%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,54%	5%	Art. 11º
CAIXA DIVIDENDOS	1,11%	20%	Art. 8º, I
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	4,75%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	0,71%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,40%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	2,30%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	4,30%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-GERAL	0,25%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA NOVO IMA-B LP	10,01%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	15,55%	100%	Art. 7º, I, b
DAYCOVAL IMA-B 5	0,32%	100%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,36%	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			
Abril			
Mai			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	1,06%	2,39%	44,26%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,06%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,39%, sendo assim o RPPS atingiu 44,26% 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	2.296.227,22	31.580,23	0,05%
BB IPCA IV	698.731,12	5.590,17	0,01%
BB IDKA 2A	10.747.250,01	144.803,68	0,24%
BB FLUXO	279.260,46	111,61	0,00%
BB PERFIL	3.103.328,57	1.695,51	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.737.845,13	64.799,66	0,11%
BB IRF-M1 TP	3.936.859,93	18.146,35	0,03%
BB FLUXO	188.962,19	75,52	0,00%
BB XI TP	409.561,05	3.275,74	0,01%
BB FLUXO	6.422.132,10	2.566,63	0,00%
BB FLUXO	419.755,19	167,76	0,00%
BRASESCO FEDERAL EXTRA	599.943,81	247,27	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	324.900,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	664.157,05	57.306,01	0,10%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.848.275,51	15.831,14	0,03%
CAIXA IRF-M1 TP	425.959,62	1.957,10	0,00%
CAIXA IMA-B	2.038.316,29	56.447,25	0,09%
CAIXA MATRIZ	1.378.074,58	1.208,52	0,00%
CAIXA TP	2.579.787,50	1.610,84	0,00%
CAIXA IMA-GERAL	147.543,78	2.098,57	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	6.002.962,27	168.021,64	0,28%
CAIXA IMA-B 5	9.327.900,88	126.781,03	0,21%
DAYCOVAL IMA-B 5	191.561,22	2.702,22	0,00%
PREMIUM FIDC	214.834,47	0,00	0,00%
Carteira	59.984.129,95	629.237,95	1,05%

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	0,01
BB IDKA 2A	0,00
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,02
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB XI TP	0,01
BB FLUXO	-
BB FLUXO	-
BRASESCO FEDERAL EXTRA	0,00
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA MATRIZ	0,03
CAIXA TP	0,03
CAIXA IMA-GERAL	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	0,00
DAYCOVAL IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-