

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

Informações referentes a Novembro/2022

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Novembro/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.464.028,48	-0,37%	0,82%	-44,71%
BB IDKA 2A	10.381.743,54	-0,58%	0,82%	-71,06%
BB FLUXO	391.921,01	0,88%	0,82%	106,58%
BB PERFIL	168.983,17	1,02%	0,82%	124,31%
BB ALOCAÇÃO AT	5.068.714,76	-0,08%	0,82%	-10,27%
BB IRF-M1 TP	3.981.879,95	0,91%	0,82%	111,17%
BB FLUXO	195.836,62	0,67%	0,82%	81,94%
BB XI TP	453.923,27	1,00%	0,82%	121,88%
BB IRF-M1 TP	1.939.399,61	0,64%	0,82%	77,60%
BB FLUXO	8.966.434,58	0,94%	0,82%	114,26%
BB PERFIL	5.115.643,85	1,02%	0,82%	124,31%
BB FLUXO	518.166,41	0,04%	0,82%	5,13%
BRADESCO FEDEF	655.111,07	0,99%	0,82%	120,79%
CAIXA RIO BRAVO	344.900,00	0,33%	0,82%	40,36%
CAIXA DIVIDENDOS	683.486,21	-3,24%	0,82%	-393,60%
CAIXA GESTÃO ES	3.072.083,61	0,09%	0,82%	10,60%
CAIXA IMA-B	1.645.592,19	-0,83%	0,82%	-100,88%
CAIXA MATRIZ	1.510.418,12	1,01%	0,82%	123,25%
CAIXA TP	2.821.597,90	0,98%	0,82%	118,89%
CAIXA NOVO IMA-B	4.816.514,86	-0,88%	0,82%	-106,89%
CAIXA IMA-B 5	3.581.159,26	-0,35%	0,82%	-42,41%
DAYCOVAL IMA-B	205.267,04	-0,30%	0,82%	-36,59%
PREMIUM FIDC	86.057,75	-0,47%	0,82%	-57,60%
TOTAL / MÉDIA	59.068.863,26	0,13%	0,82%	15,35%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	4,17%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	17,58%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,66%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,29%	20%	Art. 7º, III, a
BB ALOCAÇÃO AT	8,58%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	6,74%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,33%	20%	Art. 7º, III, a
BB XI TP	0,77%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	3,28%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	15,18%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	8,66%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	0,88%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO FEDEF	1,11%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,58%	5%	Art. 11º
CAIXA DIVIDENDOS	1,16%	20%	Art. 8º, I
CAIXA GESTÃO ES	5,20%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	2,79%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	2,56%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	4,78%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA NOVO IMA-B	8,15%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	6,06%	100%	Art. 7º, I, b
DAYCOVAL IMA-B	0,35%	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	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			
Acumulado	8,64%	9,98%	86,57%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 8,64%, enquanto que a meta acumulada no período é de 9,98%, sendo assim o RPPS atingiu 86,57% 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	2.464.028,48	33.859,61	0,06%
BB IDKA 2A	10.381.743,54	153.236,00	0,26%
BB FLUXO	391.921,01	31,46	0,00%
BB PERFIL	168.983,17	28,36	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	5.068.714,76	67.292,04	0,11%
BB IRF-M1 TP	3.981.879,95	6.269,25	0,01%
BB FLUXO	195.836,62	15,72	0,00%
BB XI TP	453.923,27	561,07	0,00%
BB IRF-M1 TP	1.939.399,61	3.053,48	0,01%
BB FLUXO	8.966.434,58	719,70	0,00%
BB PERFIL	5.115.643,85	858,58	0,00%
BB FLUXO	518.166,41	41,59	0,00%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	655.111,07	65,12	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	344.900,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	683.486,21	69.853,08	0,12%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	3.072.083,61	27.004,99	0,05%
CAIXA IMA-B	1.645.592,19	49.507,72	0,08%
CAIXA MATRIZ	1.510.418,12	388,51	0,00%
CAIXA TP	2.821.597,90	696,96	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.816.514,86	147.994,51	0,25%
CAIXA IMA-B 5	3.581.159,26	48.835,78	0,08%
DAYCOVAL IMA-B 5	205.267,04	2.772,62	0,00%
PREMIUM FIDC	86.057,75	0,00	0,00%
Carteira	59.068.863,26	558.383,76	0,95%

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	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,00
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB XI TP	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,00
BB FLUXO	-
BRADESCO FEDERAL EXTRA	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA MATRIZ	-
CAIXA TP	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	-
DAYCOVAL IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-