

SERVIÇO PREVIDÊNCIA, SAÚDE E ASSISTÊNCIA MUNICIPAL DE
JABOTICABAL - SEPREM

Informações referentes a Setembro/2022

1. RENTABILIDADE MÉDIA

| Setembro/2022 | | | | |
|--------------------------|---------------|---------------|-------|----------|
| Nome do Fundo | Aplicação | Rentabilidade | Meta | % Meta |
| BB IMA-B 5 | 2.427.248,04 | 0,40% | 0,12% | 335,57% |
| BB IDKA 2A | 11.338.974,77 | 0,53% | 0,12% | 443,46% |
| BB FLUXO | 58.352,13 | 0,18% | 0,12% | 147,87% |
| BB PERFIL | 165.553,08 | 1,09% | 0,12% | 915,05% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA | 5.022.076,07 | 1,24% | 0,12% | 1036,65% |
| BB IRF-M1 TP | 3.907.367,47 | 1,02% | 0,12% | 858,22% |
| BB FLUXO | 203.647,78 | 0,71% | 0,12% | 593,30% |
| BB XI TP | 444.952,72 | 1,05% | 0,12% | 876,60% |
| BB FLUXO | 8.799.355,23 | 0,99% | 0,12% | 832,65% |
| BB PERFIL | 5.011.804,45 | 0,96% | 0,12% | 806,72% |
| BB FLUXO | 81.809,24 | 0,17% | 0,12% | 145,78% |
| BRASESCO FEDERAL EXTRA | 642.197,17 | 1,05% | 0,12% | 878,35% |
| CAIXA RIO BRAVO | 349.650,00 | 2,28% | 0,12% | 1908,01% |
| CAIXA DIVIDENDOS | 666.087,51 | -0,09% | 0,12% | -75,35% |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | 3.039.441,35 | 1,24% | 0,12% | 1039,71% |
| CAIXA IMA-B | 2.167.453,66 | 1,50% | 0,12% | 1253,21% |
| CAIXA MATRIZ | 1.480.118,44 | 1,11% | 0,12% | 933,55% |
| CAIXA TP | 2.766.256,59 | 1,09% | 0,12% | 915,31% |
| CAIXA NOVO IMA-B LP | 4.806.483,45 | 1,52% | 0,12% | 1274,18% |
| CAIXA IMA-B 5 | 5.425.570,21 | 0,43% | 0,12% | 357,71% |
| DAYCOVAL IMA-B 5 | 202.296,38 | 0,46% | 0,12% | 384,20% |
| PREMIUM FIDC | 86.833,08 | -0,46% | 0,12% | -382,79% |
| TOTAL / MÉDIA | 59.093.528,82 | 0,91% | 0,12% | 762,66% |

2. ENQUADRAMENTO

| Nome do Fundo | % PL do RPPS | % Resolução | Enquadramento |
|--------------------------|--------------|-------------|-----------------|
| BB IMA-B 5 | 4,11% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB IDKA 2A | 19,19% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB FLUXO | 0,10% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB PERFIL | 0,28% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA | 8,50% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB IRF-M1 TP | 6,61% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB FLUXO | 0,34% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB XI TP | 0,75% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB FLUXO | 14,89% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB PERFIL | 8,48% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB FLUXO | 0,14% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BRASESCO FEDERAL EXTRA | 1,09% | 20% | Art. 7º, III, a |
| CAIXA RIO BRAVO | 0,59% | 5% | Art. 11º |
| CAIXA DIVIDENDOS | 1,13% | 20% | Art. 8º, I |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | 5,14% | 100% | Art. 7º, I, b |
| CAIXA IMA-B | 3,67% | 100% | Art. 7º, I, b |
| CAIXA MATRIZ | 2,50% | 20% | Art. 7º, III, a |
| CAIXA TP | 4,68% | 20% | Art. 7º, III, a |
| CAIXA NOVO IMA-B LP | 8,13% | 20% | Art. 7º, III, a |
| CAIXA IMA-B 5 | 9,18% | 100% | Art. 7º, I, b |
| DAYCOVAL IMA-B 5 | 0,34% | 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% |
| Maior | 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 | | | |
| Novembro | | | |
| Dezembro | | | |
| Acumulado | 7,12% | 8,00% | 89,03% |

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 7,12%, enquanto que a meta acumulada no período é de 8%, sendo assim o RPPS atingiu 89,03% 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 | 2.427.248,04 | 29.203,71 | 0,05% |
| BB IDKA 2A | 11.338.974,77 | 151.725,62 | 0,26% |
| BB FLUXO | 58.352,13 | 6,93 | 0,00% |
| BB PERFIL | 165.553,08 | 26,56 | 0,00% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA | 5.022.076,07 | 52.075,80 | 0,09% |
| BB IRF-M1 TP | 3.907.367,47 | 6.570,31 | 0,01% |
| BB FLUXO | 203.647,78 | 24,19 | 0,00% |
| BB XI TP | 444.952,72 | 3.469,38 | 0,01% |
| BB FLUXO | 8.799.355,23 | 1.045,39 | 0,00% |
| BB PERFIL | 5.011.804,45 | 803,99 | 0,00% |
| BB FLUXO | 81.809,24 | 9,72 | 0,00% |
| BRASESCO FEDERAL EXTRA | 642.197,17 | 84,69 | 0,00% |
| CAIXA RIO BRAVO | 349.650,00 | 0,00 | 0,00% |
| CAIXA DIVIDENDOS | 666.087,51 | 50.510,98 | 0,09% |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | 3.039.441,35 | 33.416,94 | 0,06% |
| CAIXA IMA-B | 2.167.453,66 | 54.432,28 | 0,09% |
| CAIXA MATRIZ | 1.480.118,44 | 362,73 | 0,00% |
| CAIXA TP | 2.766.256,59 | 627,89 | 0,00% |
| CAIXA NOVO IMA-B LP | 4.806.483,45 | 122.836,11 | 0,21% |
| CAIXA IMA-B 5 | 5.425.570,21 | 64.635,72 | 0,11% |
| DAYCOVAL IMA-B 5 | 202.296,38 | 2.407,81 | 0,00% |
| PREMIUM FIDC | 86.833,08 | 0,00 | 0,00% |
| Carteira | 59.093.528,82 | 504.188,64 | 0,85% |

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 | 0,02 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA | 0,00 |
| BB IRF-M1 TP | 0,00 |
| BB FLUXO | - |
| BB XI TP | - |
| BB FLUXO | - |
| BB PERFIL | 0,02 |
| BB FLUXO | - |
| BRASESCO FEDERAL EXTRA | - |
| CAIXA RIO BRAVO | - |
| CAIXA DIVIDENDOS | - |
| CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | 0,00 |
| CAIXA IMA-B | 0,00 |
| CAIXA MATRIZ | 0,04 |
| CAIXA TP | 0,02 |
| CAIXA NOVO IMA-B LP | 0,00 |
| CAIXA IMA-B 5 | - |
| DAYCOVAL IMA-B 5 | - |
| PREMIUM FIDC | - |