

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

Informações referentes a Junho/2022

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Junho/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.417.485,76	0,32%	1,08%	29,32%
BB IPCA IV	736.421,15	0,31%	1,08%	28,85%
BB IDKA 2A	11.309.257,16	0,27%	1,08%	24,56%
BB FLUXO	845.054,80	0,81%	1,08%	74,39%
BB PERFIL	160.188,66	0,18%	1,08%	16,37%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.881.817,34	0,33%	1,08%	30,41%
BB IRF-M1 TP	4.072.687,97	0,92%	1,08%	84,75%
BB FLUXO	97.331,91	0,79%	1,08%	72,46%
BB XI TP	431.621,12	0,31%	1,08%	28,67%
BB FLUXO	10.558.552,44	0,88%	1,08%	81,19%
BB FLUXO	590.487,32	0,09%	1,08%	8,72%
BRABESCO FEDERAL EXTRA	621.962,77	1,00%	1,08%	92,07%
CAIXA RIO BRAVO	316.400,00	1,37%	1,08%	126,07%
CAIXA DIVIDENDOS	622.863,67	-9,04%	1,08%	-834,22%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.935.524,34	0,23%	1,08%	21,27%
CAIXA IRF-M1 TP	440.746,89	0,91%	1,08%	84,00%
CAIXA IMA-B	2.129.952,83	-0,38%	1,08%	-34,93%
CAIXA MATRIZ	1.431.770,75	1,04%	1,08%	95,78%
CAIXA TP	2.677.227,60	1,02%	1,08%	94,47%
CAIXA IMA-GERAL	152.587,28	0,40%	1,08%	36,62%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.721.693,89	-0,36%	1,08%	-32,96%
CAIXA IMA-B 5	8.350.776,78	0,33%	1,08%	30,79%
DAYCOVAL IMA-B 5	201.184,39	0,33%	1,08%	30,05%
PREMIUM FIDC	88.170,87	-0,59%	1,08%	-54,82%
TOTAL / MÉDIA	60.791.767,69	0,33%	1,08%	30,77%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,98%	100%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,21%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	18,60%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	1,39%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	0,26%	20%	Art. 7º, III, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	8,03%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	6,70%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,16%	20%	Art. 7º, III, a
BB XI TP	0,71%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	17,37%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	0,97%	20%	Art. 7º, III, a
BRABESCO FEDERAL EXTRA	1,02%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,52%	5%	Art. 11º
CAIXA DIVIDENDOS	1,02%	20%	Art. 8º, I
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	4,83%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	0,73%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,50%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	2,36%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	4,40%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-GERAL	0,25%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA NOVO IMA-B LP	7,77%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	13,74%	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%
Maior	0,66%	0,88%	74,42%
Junho	0,33%	1,08%	30,77%
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	4,95%	8,11%	61,02%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 4,95%, enquanto que a meta acumulada no período é de 8,11%, sendo assim o RPPS atingiu 61,02% 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	2.417.485,76	28.378,24	0,05%
BB IPCA IV	736.421,15	6.924,76	0,01%
BB IDKA 2A	11.309.257,16	142.273,10	0,23%
BB FLUXO	845.054,80	6.140,38	0,01%
BB PERFIL	160.188,66	1.281,58	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.881.817,34	53.266,94	0,09%
BB IRF-M1 TP	4.072.687,97	30.732,19	0,05%
BB FLUXO	97.331,91	707,24	0,00%
BB XI TP	431.621,12	4.055,93	0,01%
BB FLUXO	10.558.552,44	76.721,05	0,13%
BB FLUXO	590.487,32	4.290,63	0,01%
BRABESCO FEDERAL EXTRA	621.962,77	4.833,23	0,01%
CAIXA RIO BRAVO	316.400,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	622.863,67	66.750,60	0,11%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.935.524,34	28.557,73	0,05%
CAIXA IRF-M1 TP	440.746,89	3.297,67	0,01%
CAIXA IMA-B	2.129.952,83	46.754,40	0,08%
CAIXA MATRIZ	1.431.770,75	11.588,92	0,02%
CAIXA TP	2.677.227,60	21.390,18	0,04%
CAIXA IMA-GERAL	152.587,28	1.695,04	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	4.721.693,89	105.146,73	0,17%
CAIXA IMA-B 5	8.350.776,78	97.278,36	0,16%
DAYCOVAL IMA-B 5	201.184,39	2.380,89	0,00%
PREMIUM FIDC	88.170,87	0,00	0,00%
Carteira	60.791.767,69	528.489,88	0,87%

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	0,02
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	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA MATRIZ	0,01
CAIXA TP	0,01
CAIXA IMA-GERAL	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	-
DAYCOVAL IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-