

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

Informações referentes a Abril/2022

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Abril/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.391.418,77	1,53%	1,47%	103,56%
BB IPCA IV	729.392,56	2,05%	1,47%	138,80%
BB IDKA 2A	11.192.500,82	1,48%	1,47%	100,61%
BB FLUXO	246.085,10	0,59%	1,47%	39,78%
BB PERFIL	1.768.167,07	0,48%	1,47%	32,32%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.826.324,18	0,52%	1,47%	35,13%
BB IRF-M1 TP	3.998.783,77	0,70%	1,47%	47,44%
BB FLUXO	150.046,14	0,63%	1,47%	42,44%
BB XI TP	427.516,97	2,05%	1,47%	138,68%
BB FLUXO	8.459.201,44	0,67%	1,47%	45,48%
BB FLUXO	480.861,35	0,10%	1,47%	6,67%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	609.590,27	0,70%	1,47%	47,56%
CAIXA RIO BRAVO	325.100,00	1,33%	1,47%	90,16%
CAIXA DIVIDENDOS	664.119,16	-6,61%	1,47%	-448,07%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.897.912,51	0,91%	1,47%	61,77%
CAIXA IRF-M1 TP	432.756,02	0,72%	1,47%	49,05%
CAIXA IMA-B	2.117.589,26	0,80%	1,47%	54,34%
CAIXA MATRIZ	1.401.758,81	0,79%	1,47%	53,27%
CAIXA TP	2.621.952,74	0,75%	1,47%	50,64%
CAIXA IMA-GERAL	150.611,88	0,52%	1,47%	34,97%
CAIXA NOVO IMA-B LP	6.233.411,38	0,75%	1,47%	50,94%
CAIXA IMA-B 5	8.259.854,68	1,54%	1,47%	104,13%
DAYCOVAL IMA-B 5	199.017,05	1,40%	1,47%	94,92%
PREMIUM FIDC	214.559,67	-0,26%	1,47%	-17,85%
TOTAL / MÉDIA	60.798.531,60	0,93%	1,47%	62,79%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,93%	100%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,20%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	18,41%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,40%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	2,91%	20%	Art. 7º, III, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	7,94%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	6,58%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,25%	20%	Art. 7º, III, a
BB XI TP	0,70%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	13,91%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	0,79%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO FEDERAL EXTRA	1,00%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,53%	5%	Art. 11º
CAIXA DIVIDENDOS	1,09%	20%	Art. 8º, I
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	4,77%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	0,71%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,48%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	2,31%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	4,31%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-GERAL	0,25%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA NOVO IMA-B LP	10,25%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	13,59%	100%	Art. 7º, I, b
DAYCOVAL IMA-B 5	0,33%	100%	Art. 7º, I, b
PREMIUM FIDC	0,35%	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			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	3,92%	6,02%	65,12%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 3,92%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,02%, sendo assim o RPPS atingiu 65,12% 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	2.391.418,77	26.077,17	0,04%
BB IPCA IV	729.392,56	5.174,71	0,01%
BB IDKA 2A	11.192.500,82	130.537,07	0,21%
BB FLUXO	246.085,10	71,09	0,00%
BB PERFIL	1.768.167,07	643,15	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.826.324,18	49.705,99	0,08%
BB IRF-M1 TP	3.998.783,77	11.860,29	0,02%
BB FLUXO	150.046,14	43,34	0,00%
BB XI TP	427.516,97	3.032,48	0,00%
BB FLUXO	8.459.201,44	2.443,59	0,00%
BB FLUXO	480.861,35	138,91	0,00%
BRADESCO FEDERAL EXTRA	609.590,27	172,04	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	325.100,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	664.119,16	50.999,07	0,08%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.897.912,51	9.555,09	0,02%
CAIXA IRF-M1 TP	432.756,02	1.272,28	0,00%
CAIXA IMA-B	2.117.589,26	45.840,12	0,08%
CAIXA MATRIZ	1.401.758,81	817,10	0,00%
CAIXA TP	2.621.952,74	1.390,43	0,00%
CAIXA IMA-GERAL	150.611,88	1.614,26	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	6.233.411,38	136.977,09	0,23%
CAIXA IMA-B 5	8.259.854,68	89.466,06	0,15%
DAYCOVAL IMA-B 5	199.017,05	2.226,63	0,00%
PREMIUM FIDC	214.559,67	0,00	0,00%
Carteira	60.798.531,60	504.253,31	0,83%

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