

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

Informações referentes a Janeiro/2022

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Janeiro/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.272.269,29	0,08%	0,95%	8,06%
BB IPCA IV	710.589,19	0,57%	0,95%	59,31%
BB IDKA 2A	10.624.359,85	0,01%	0,95%	1,01%
BB FLUXO	162.058,58	0,57%	0,95%	59,68%
BB PERFIL	3.078.750,36	0,78%	0,95%	82,21%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.708.838,10	0,04%	0,95%	3,99%
BB IRF-M1 TP	4.657.421,02	0,61%	0,95%	64,45%
BB FLUXO	257.429,03	0,62%	0,95%	64,94%
BB XI TP	416.490,98	0,56%	0,95%	59,17%
BB FLUXO	5.421.757,99	0,57%	0,95%	59,78%
BB FLUXO	0,00	0,03%	0,95%	3,33%
BRABESCO FEDERAL EXTRA	595.420,97	0,74%	0,95%	77,91%
CAIXA RIO BRAVO	342.500,00	1,19%	0,95%	124,58%
CAIXA DIVIDENDOS	668.875,32	8,81%	0,95%	924,83%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.825.509,13	0,67%	0,95%	70,07%
CAIXA IRF-M1 TP	422.894,50	0,61%	0,95%	63,92%
CAIXA IMA-B	2.027.629,88	-0,76%	0,95%	-79,46%
CAIXA MATRIZ	2.015.538,34	0,85%	0,95%	88,87%
CAIXA TP	2.557.357,53	0,79%	0,95%	83,34%
CAIXA IMA-GERAL	146.495,90	-0,06%	0,95%	-6,73%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.974.113,60	-0,76%	0,95%	-80,12%
CAIXA IMA-B 5	9.230.891,20	0,09%	0,95%	9,49%
DAYCOVAL IMA-B 5	189.754,68	0,04%	0,95%	4,40%
PREMIUM FIDC	215.188,41	-0,17%	0,95%	-17,61%
TOTAL / MÉDIA	59.522.133,85	0,27%	0,95%	28,23%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,82%	100%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,19%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	17,85%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,27%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	5,17%	20%	Art. 7º, III, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	7,91%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	7,82%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,43%	20%	Art. 7º, III, a
BB XI TP	0,70%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	9,11%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	0,00%	20%	Art. 7º, III, a
BRABESCO FEDERAL EXTRA	1,00%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,58%	5%	Art. 11º
CAIXA DIVIDENDOS	1,12%	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	3,41%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	3,39%	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	10,04%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	15,51%	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			
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,27%	0,95%	28,23%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,27%, enquanto que a meta acumulada no período é de 0,95%, sendo assim o RPPS atingiu 28,23% 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	2.272.269,29	77.559,97	0,13%
BB IPCA IV	710.589,19	36.118,31	0,06%
BB IDKA 2A	10.624.359,85	376.540,42	0,63%
BB FLUXO	162.058,58	4.633,10	0,01%
BB PERFIL	3.078.750,36	119.310,65	0,20%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.708.838,10	64.049,73	0,11%
BB IRF-M1 TP	4.657.421,02	114.006,94	0,19%
BB FLUXO	257.429,03	7.359,65	0,01%
BB XI TP	416.490,98	21.106,87	0,04%
BB FLUXO	5.421.757,99	155.002,90	0,26%
BB FLUXO	0,00	0,00	0,00%
BRABESCO FEDERAL EXTRA	595.420,97	21.452,55	0,04%
CAIXA RIO BRAVO	342.500,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	668.875,32	62.152,38	0,10%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.825.509,13	19.614,47	0,03%
CAIXA IRF-M1 TP	422.894,50	10.535,23	0,02%
CAIXA IMA-B	2.027.629,88	59.602,72	0,10%
CAIXA MATRIZ	2.015.538,34	77.471,51	0,13%
CAIXA TP	2.557.357,53	93.374,93	0,16%
CAIXA IMA-GERAL	146.495,90	2.276,11	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	5.974.113,60	176.695,43	0,30%
CAIXA IMA-B 5	9.230.891,20	318.940,95	0,54%
DAYCOVAL IMA-B 5	189.754,68	5.681,89	0,01%
PREMIUM FIDC	215.188,41	0,00	0,00%
Carteira	59.522.133,85	1.454.187,38	2,44%

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	0,04
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB XI TP	-
BB FLUXO	-
BB FLUXO	-
BRABESCO FEDERAL EXTRA	0,02
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA MATRIZ	0,03
CAIXA TP	0,06
CAIXA IMA-GERAL	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA IMA-B 5	-
DAYCOVAL IMA-B 5	-
PREMIUM FIDC	-