

SERVIÇO PREVIDÊNCIA, SAÚDE E ASSISTÊNCIA MUNICIPAL  
DE JABOTICABAL - SEPTEM

Informações referentes a Março/2022

## 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Março/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B 5	2.355.439,85	2,58%	2,04%	126,58%
BB IPCA IV	714.759,85	2,29%	2,04%	112,60%
BB IDKA 2A	11.028.845,44	2,62%	2,04%	128,61%
BB FLUXO	287.957,34	0,79%	2,04%	38,81%
BB PERFIL	3.133.231,42	0,96%	2,04%	47,30%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.801.445,20	1,34%	2,04%	65,89%
BB IRF-M1 TP	3.970.999,95	0,87%	2,04%	42,57%
BB FLUXO	180.466,00	0,76%	2,04%	37,38%
BB XI TP	418.947,73	2,29%	2,04%	112,50%
BB FLUXO	7.440.926,57	0,77%	2,04%	37,81%
BB FLUXO	482.278,11	0,19%	2,04%	9,14%
BRABESCO FEDERAL EXTRA	605.344,10	0,90%	2,04%	44,18%
CAIXA RIO BRAVO	323.350,00	0,31%	2,04%	15,11%
CAIXA DIVIDENDOS	711.115,54	7,07%	2,04%	347,06%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.871.750,66	0,82%	2,04%	40,46%
CAIXA IRF-M1 TP	429.647,51	0,87%	2,04%	42,50%
CAIXA IMA-B	2.100.752,53	3,06%	2,04%	150,36%
CAIXA MATRIZ	1.390.831,69	0,93%	2,04%	45,44%
CAIXA TP	2.602.515,28	0,88%	2,04%	43,24%
CAIXA IMA-GERAL	149.838,95	1,56%	2,04%	76,36%
CAIXA NOVO IMA-B LP	6.186.927,88	3,06%	2,04%	150,43%
CAIXA IMA-B 5	8.134.918,58	2,22%	2,04%	108,94%
DAYCOVAL IMA-B 5	196.269,20	2,46%	2,04%	120,64%
PREMIUM FIDC	215.126,15	0,14%	2,04%	6,66%
TOTAL / MÉDIA	60.733.685,53	1,89%	2,04%	92,64%

## 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B 5	3,88%	100%	Art. 7º, I, b
BB IPCA IV	1,18%	100%	Art. 7º, I, b
BB IDKA 2A	18,16%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,47%	20%	Art. 7º, III, a
BB PERFIL	5,16%	20%	Art. 7º, III, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA	7,91%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1 TP	6,54%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	0,30%	20%	Art. 7º, III, a
BB XI TP	0,69%	100%	Art. 7º, I, b
BB FLUXO	12,25%	20%	Art. 7º, III, a
BB FLUXO	0,79%	20%	Art. 7º, III, a
BRABESCO FEDERAL EXTRA	1,00%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA RIO BRAVO	0,53%	5%	Art. 11º
CAIXA DIVIDENDOS	1,17%	20%	Art. 8º, I
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	4,73%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	0,71%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B	3,46%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA MATRIZ	2,29%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA TP	4,29%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-GERAL	0,25%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA NOVO IMA-B LP	10,19%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IMA-B 5	13,39%	100%	Art. 7º, I, b
DAYCOVAL IMA-B 5	0,32%	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			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,97%	4,48%	66,24%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,97%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,48%, sendo assim o RPPS atingiu 66,24% 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	2.355.439,85	26.557,69	0,04%
BB IPCA IV	714.759,85	5.506,29	0,01%
BB IDKA 2A	11.028.845,44	130.183,71	0,21%
BB FLUXO	287.957,34	101,53	0,00%
BB PERFIL	3.133.231,42	1.328,63	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	4.801.445,20	49.080,43	0,08%
BB IRF-M1 TP	3.970.999,95	12.133,51	0,02%
BB FLUXO	180.466,00	63,63	0,00%
BB XI TP	418.947,73	3.226,78	0,01%
BB FLUXO	7.440.926,57	2.623,55	0,00%
BB FLUXO	482.278,11	170,04	0,00%
BRABESCO FEDERAL EXTRA	605.344,10	227,00	0,00%
CAIXA RIO BRAVO	323.350,00	0,00	0,00%
CAIXA DIVIDENDOS	711.115,54	57.721,06	0,10%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.871.750,66	9.109,01	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	429.647,51	1.306,29	0,00%
CAIXA IMA-B	2.100.752,53	45.324,37	0,07%
CAIXA MATRIZ	1.390.831,69	940,05	0,00%
CAIXA TP	2.602.515,28	1.387,27	0,00%
CAIXA IMA-GERAL	149.838,95	1.635,20	0,00%
CAIXA NOVO IMA-B LP	6.186.927,88	135.224,18	0,22%
CAIXA IMA-B 5	8.134.918,58	90.875,42	0,15%
DAYCOVAL IMA-B 5	196.269,20	2.259,33	0,00%
PREMIUM FIDC	215.126,15	0,00	0,00%
Carteira	60.733.685,53	503.246,26	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	0,02
BB IPCA IV	0,03
BB IDKA 2A	0,02
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,02
BB ALOCAÇÃO ATIVA	0,01
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB XI TP	0,03
BB FLUXO	-
BB FLUXO	-
BRABESCO FEDERAL EXTRA	-
CAIXA RIO BRAVO	-
CAIXA DIVIDENDOS	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B	0,01
CAIXA MATRIZ	0,00
CAIXA TP	-
CAIXA IMA-GERAL	0,01
CAIXA NOVO IMA-B LP	0,01
CAIXA IMA-B 5	0,02
DAYCOVAL IMA-B 5	0,02
PREMIUM FIDC	-