

REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA DO INSTITUTO DE PREVIDENCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PUBLICOS DE BURITIS
RO

Relatório Trimestral de Rentabilidade e Riscos dos Investimentos de Janeiro/2022 A Março/2022

Aos _____ de _____ de 2022, reuniu-se o Conselho do Regime Próprio de Previdência Social, os seguintes conselheiros:



www.kansalasset.com.br -
claudenir@kansalasset.com.br
Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.1518
Endereço: Luiz Alonso Perez, Nº 339 - Bairro: Indalá -
Bertioga /SP -CEP: 11250-000.

O Presidente do RPPS: _____

Para em conjunto do cumprimento previsto no item V do Artigo 1º da Portaria MPS 519/2011 que em consonância com a Resolução CMN 3.922 de 25 de novembro de 2010, deliberam sobre a rentabilidade e riscos dos investimentos nos meses em questão:

1. RENTABILIDADE VERSUS META ATUARIAL

Comparativo da rentabilidade de cada fundo de investimento com a meta atuarial.

2. GERENCIAMENTO DE RISCO

Em atendimento a legislação em vigor o gerenciamento de risco é feita através de análises de risco de mercado. Para essa análise será utilizado os conceitos de VaR e Índice Sharpe.

2.1. VaR - Valor em risco dos investimentos

Considerando que os fatos do passado que interferiram na oscilação (volatilidade) das cotas se repitam no futuro, adicionamos como medida de perda esperada para o próximo período (um dia) o cálculo do VaR - Value at Risk.

O VaR é uma medida de risco absoluto bastante interessante, pois ilustra a perda “máxima” a ser incorrida em um dia com certa probabilidade, por outro lado deve ser sempre bem compreendido para que não seja exigido dele uma segurança, uma previsão de perda máxima efetiva, que ele não pode propiciar.



2.2. Índice Sharpe

O Índice Sharpe é o mais utilizado na análise de fundos de investimento. Ele avalia se um determinado fundo de investimento apresenta uma rentabilidade ponderada ao risco que o investidor está exposto, ou seja, quanto maior o retorno e menor o risco do investimento, melhor será o Índice Sharpe.

O Sharpe é calculado a partir de resultados obtidos pelo fundo num determinado período. Sendo assim ele mostra o passado do fundo. Mas ele é um bom indicativo de volatilidade futura.

O cálculo do Índice Sharpe é feito dividindo a média aritmética dos retornos excedentes oferecidos pelo fundo em certa periodicidade pelo desvio padrão desses retornos. O retorno excedente é a parcela do rendimento oferecido pelo fundo que ficou acima ou abaixo da rentabilidade de um indexador adotado que no caso de fundos de renda fixa seria o CDI e para fundos de renda variável o Ibovespa.

Quando a rentabilidade do fundo é menor que o indexador adotado o valor do Índice Sharpe será negativo e, portanto desconsiderado.

3. ENQUADRAMENTO

Verificar se a carteira de investimento do RPPS está de acordo com sua Política de Investimento e com os limites previstos da Resolução CMN 3922/10.

4. ANÁLISE DOS INVESTIMENTOS



www.kansaiasset.com.br -
claudenir@kansaiasset.com.br
Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.1518
Endereço: Luiz Alonso Perez, Nº 339 - Bairro: Indaiá -
Bertioga /SP -CEP: 11250-000.



www.kansalasset.com.br -
claudenir@kansalasset.com.br
Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.1518
Endereço: Luiz Alonso Perez, Nº 339 - Bairro: Indalá -
Bertioga /SP -CEP: 11250-000.

4.1. Janeiro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	39.891,94	0,00	0,00	0,00	39.841,17	-50,77	-0,13%	0,94%	-13,48%
BB IMA-B TP	37.479,11	0,00	0,00	0,00	37.191,31	-287,80	-0,77%	0,94%	-81,34%
BB FLUXO	69.105,00	71.269,05	5.065,31	0,00	135.746,94	438,20	0,32%	0,94%	34,31%
BB PERFIL	490.654,17	0,00	0,00	0,00	494.497,75	3.843,58	0,78%	0,94%	82,98%
BB IRF-M	636.408,30	0,00	0,00	0,00	635.598,30	-810,00	-0,13%	0,94%	-13,48%
BB IRF-M1 TP	6.602.896,08	0,00	0,00	0,00	6.643.441,26	40.545,18	0,61%	0,94%	65,05%
BB IMA-B 5+	181.596,31	0,00	0,00	0,00	178.640,00	-2.956,31	-1,63%	0,94%	-172,45%
BB QUANTITATIVO	2.828.266,34	0,00	0,00	0,00	3.011.691,97	183.425,63	6,49%	0,94%	687,02%
BB JUROS E MOEDAS	2.070.222,97	0,00	0,00	0,00	2.084.817,27	14.594,30	0,70%	0,94%	74,68%
BB RETORNO AÇÕES	2.675.349,72	0,00	0,00	0,00	2.705.261,49	29.911,77	1,12%	0,94%	118,44%
BB IRF-M1 TP	439.894,54	0,00	0,00	0,00	442.595,72	2.701,18	0,61%	0,94%	65,05%
BB FLUXO	523.230,40	103.344,64	3.331,35	0,00	626.731,35	3.487,66	0,56%	0,94%	59,28%
BB PERFIL	4.750.711,07	0,00	0,00	0,00	4.787.926,14	37.215,07	0,78%	0,94%	82,98%
BB AÇÕES GLOBAIS	2.428.299,77	0,00	0,00	0,00	2.170.483,39	-257.816,38	-10,62%	0,94%	-1124,70%
BB IRF-M 1+	179.162,94	0,00	0,00	0,00	178.119,11	-1.043,83	-0,58%	0,94%	-61,72%
BB RETORNO TOTAL	8.132.036,30	0,00	0,00	0,00	8.147.551,45	15.515,15	0,19%	0,94%	20,21%
BB AÇÕES BOLSA	2.420.787,00	0,00	0,00	0,00	2.289.870,60	-130.916,40	-5,41%	0,94%	-572,88%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.623.924,33	0,00	0,00	0,00	3.646.272,33	22.348,00	0,62%	0,94%	65,33%
CAIXA IMA-B	7.301.233,49	0,00	0,00	0,00	7.245.953,14	-55.280,35	-0,76%	0,94%	-80,21%
CAIXA IRF-M1 TP	8.650.436,95	0,00	0,00	0,00	8.703.117,93	52.680,98	0,61%	0,94%	64,51%
CAIXA TP	1.030.385,16	0,00	0,00	0,00	1.038.567,10	8.181,94	0,79%	0,94%	84,12%
CAIXA IRF-M1 TP	7.811.013,13	0,00	0,00	0,00	7.858.582,03	47.568,90	0,61%	0,94%	64,51%
CAIXA IRF-M	2.434.053,37	0,00	0,00	0,00	2.432.305,79	-1.747,58	-0,07%	0,94%	-7,61%
CAIXA REF DI	250.531,94	0,00	0,00	0,00	252.503,46	1.971,52	0,79%	0,94%	83,36%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.468.083,10	0,00	0,00	0,00	5.469.111,79	1.028,69	0,02%	0,94%	1,99%
CAIXA IRF-M 1+	187.756,37	0,00	0,00	0,00	186.748,06	-1.008,31	-0,54%	0,94%	-56,89%
CAIXA IRF-M 1+	1.082.729,43	0,00	0,00	0,00	1.076.914,86	-5.814,57	-0,54%	0,94%	-56,89%
CAIXA IMA-B 5	5.385.049,15	0,00	0,00	0,00	5.389.916,04	4.866,89	0,09%	0,94%	9,57%



4.1.1 Janeiro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.716.483,32	0,00	0,00	0,00	2.734.618,75	18.135,43	0,67%	0,94%	70,72%
Carteira	80.447.671,70	174.613,69	8.396,66	0,00	80.644.616,50	30.727,77	0,04%	0,94%	4,04%



www.kansalasset.com.br -
claudenir@kansalasset.com.br
Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.1518
Endereço: Luiz Alonso Perez, Nº 339 - Bairro: Indaiá -
Bertioga /SP -CEP: 11250-000.

4.1.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M	39.841,17	0,00%	936,35
BB IMA-B TP	37.191,31	0,00%	1.098,59
BB FLUXO	135.746,94	0,00%	3.880,88
BB PERFIL	494.497,75	0,02%	19.163,24
BB IRF-M	635.598,30	0,02%	14.937,81
BB IRF-M1 TP	6.643.441,26	0,20%	162.621,85
BB IMA-B 5+	178.640,00	0,02%	12.242,45
BB QUANTITATIVO	3.011.691,97	0,38%	306.002,22
BB JUROS E MOEDAS	2.084.817,27	0,00%	0,00
BB RETORNO AÇÕES	2.705.261,49	0,43%	345.697,66
BB IRF-M1 TP	442.595,72	0,01%	10.834,10
BB FLUXO	626.731,35	0,02%	17.917,65
BB PERFIL	4.787.926,14	0,23%	185.546,24
BB AÇÕES GLOBAIS	2.170.483,39	0,00%	0,00
BB IRF-M 1+	178.119,11	0,01%	7.917,09
BB RETORNO TOTAL	8.147.551,45	0,14%	111.075,60
BB AÇÕES BOLSA	2.289.870,60	0,00%	0,00
BRASESCO IRF-M 1 TP	3.646.272,33	0,11%	89.861,36
CAIXA IMA-B	7.245.953,14	0,26%	212.996,73
CAIXA IRF-M1 TP	8.703.117,93	0,27%	216.813,84
CAIXA TP	1.038.567,10	0,05%	37.920,44
CAIXA IRF-M1 TP	7.858.582,03	0,24%	195.774,59
CAIXA IRF-M	2.432.305,79	0,07%	55.929,50
CAIXA REF DI	252.503,46	0,01%	9.748,05
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.469.111,79	0,24%	197.376,94
CAIXA IRF-M 1+	186.748,06	0,01%	8.219,26
CAIXA IRF-M 1+	1.076.914,86	0,06%	47.397,81

4.1.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M	-
BB IMA-B TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,04
BB IRF-M	-
BB IRF-M1 TP	-
BB IMA-B 5+	-
BB QUANTITATIVO	-
BB JUROS E MOEDAS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,04
BB AÇÕES GLOBAIS	-
BB IRF-M 1+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BB AÇÕES BOLSA	-
BRASESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA TP	0,06
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IRF-M	-
CAIXA REF DI	0,02
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
CAIXA IRF-M 1+	-
CAIXA IRF-M 1+	-



4.1.1.1 VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
CAIXA IMA-B 5	5.389.916,04	0,23%	186.229,58
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.734.618,75	0,02%	18.983,52
Carteira	80.644.616,50	1,83%	1.476.891,17

4.1.2.1 Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
CAIXA IMA-B 5	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-



4.1.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IRF-M	39.841,17	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	37.191,31	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	135.746,94	0,17%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,00%
BB PERFIL	494.497,75	0,61%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
BB IRF-M	635.598,30	0,79%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,01%
BB IRF-M1 TP	6.643.441,26	8,24%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,13%
BB IMA-B 5+	178.640,00	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
BB QUANTITATIVO	3.011.691,97	3,73%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,20%
BB JUROS E MOEDAS	2.084.817,27	2,59%	10%	Fundos Multimercados- Art. 10º, I, a	-
BB RETORNO AÇÕES	2.705.261,49	3,35%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,20%
BB IRF-M1 TP	442.595,72	0,55%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,01%
BB FLUXO	626.731,35	0,78%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,02%
BB PERFIL	4.787.926,14	5,94%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,07%
BB AÇÕES GLOBAIS	2.170.483,39	2,69%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, I	-
BB IRF-M 1+	178.119,11	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,10%
BB RETORNO TOTAL	8.147.551,45	10,10%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,19%
BB AÇÕES BOLSA	2.289.870,60	2,84%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	-
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.646.272,33	4,52%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,56%
CAIXA IMA-B	7.245.953,14	8,99%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,16%
CAIXA IRF-M1 TP	8.703.117,93	10,79%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,14%
CAIXA TP	1.038.567,10	1,29%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	7.858.582,03	9,74%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,12%
CAIXA IRF-M	2.432.305,79	3,02%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,20%
CAIXA REF DI	252.503,46	0,31%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.469.111,79	6,78%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%
CAIXA IRF-M 1+	186.748,06	0,23%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
CAIXA IRF-M 1+	1.076.914,86	1,34%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,10%



4.1.3.1 Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
CAIXA IMA-B 5	5.389.916,04	6,68%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,04%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.734.618,75	3,39%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%



4.2. Fevereiro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	39.841,17	0,00	0,00	0,00	40.067,43	226,26	0,57%	1,42%	40,11%
BB IMA-B TP	37.191,31	0,00	0,00	0,00	37.389,75	198,44	0,53%	1,42%	37,68%
BB FLUXO	135.746,94	0,00	28.413,92	0,00	108.106,42	773,40	0,57%	1,42%	40,24%
BB PERFIL	494.497,75	0,00	0,00	0,00	498.445,41	3.947,66	0,80%	1,42%	56,38%
BB IRF-M	635.598,30	0,00	0,00	0,00	639.207,86	3.609,56	0,57%	1,42%	40,11%
BB IRF-M1 TP	6.643.441,26	0,00	0,00	0,00	6.692.414,37	48.973,11	0,74%	1,42%	52,06%
BB IMA-B 5+	178.640,00	0,00	0,00	0,00	178.602,70	-37,30	-0,02%	1,42%	-1,47%
BB QUANTITATIVO	3.011.691,97	0,00	0,00	0,00	3.001.556,13	-10.135,84	-0,34%	1,42%	-23,77%
BB JUROS E MOEDAS	2.084.817,27	0,00	0,00	0,00	2.099.689,09	14.871,82	0,71%	1,42%	50,38%
BB RETORNO AÇÕES	2.705.261,49	0,00	0,00	0,00	2.636.300,07	-68.961,42	-2,55%	1,42%	-180,04%
BB IRF-M1 TP	442.595,72	0,00	0,00	0,00	445.858,38	3.262,66	0,74%	1,42%	52,06%
BB FLUXO	626.731,35	256.665,39	23.077,30	0,00	865.820,54	5.501,10	0,64%	1,42%	45,16%
BB PERFIL	4.787.926,14	0,00	0,00	0,00	4.826.149,00	38.222,86	0,80%	1,42%	56,38%
BB AÇÕES GLOBAIS	2.170.483,39	0,00	0,00	0,00	2.044.079,51	-126.403,88	-5,82%	1,42%	-411,31%
BB IRF-M 1+	178.119,11	0,00	0,00	0,00	178.981,15	862,04	0,48%	1,42%	34,18%
BB RETORNO TOTAL	8.147.551,45	0,00	0,00	0,00	8.202.055,99	54.504,54	0,67%	1,42%	47,25%
BB AÇÕES BOLSA	2.289.870,60	0,00	0,00	0,00	2.231.192,97	-58.677,63	-2,56%	1,42%	-180,98%
BRASESCO IRF-M 1 TP	3.646.272,33	0,00	0,00	0,00	3.673.577,77	27.305,44	0,75%	1,42%	52,89%
CAIXA IMA-B	7.245.953,14	0,00	0,00	0,00	7.284.142,16	38.189,02	0,53%	1,42%	37,22%
CAIXA IRF-M1 TP	8.703.117,93	0,00	0,00	0,00	8.766.197,79	63.079,86	0,72%	1,42%	51,19%
CAIXA TP	1.038.567,10	0,00	0,00	0,00	1.047.676,13	9.109,03	0,88%	1,42%	61,95%
CAIXA IRF-M1 TP	7.858.582,03	0,00	0,00	0,00	7.915.540,72	56.958,69	0,72%	1,42%	51,19%
CAIXA IRF-M	2.432.305,79	0,00	0,00	0,00	2.446.693,21	14.387,42	0,59%	1,42%	41,78%
CAIXA REF DI	252.503,46	0,00	0,00	0,00	254.571,65	2.068,19	0,82%	1,42%	57,85%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.469.111,79	0,00	0,00	0,00	5.531.801,52	62.689,73	1,15%	1,42%	80,96%
CAIXA IRF-M 1+	186.748,06	0,00	0,00	0,00	187.588,65	840,59	0,45%	1,42%	31,79%
CAIXA IRF-M 1+	1.076.914,86	0,00	0,00	0,00	1.081.762,25	4.847,39	0,45%	1,42%	31,79%
CAIXA IMA-B 5	5.389.916,04	0,00	0,00	0,00	5.446.560,00	56.643,96	1,05%	1,42%	74,22%



4.2.1 Fevereiro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.734.618,75	0,00	0,00	0,00	2.756.652,77	22.034,02	0,81%	1,42%	56,91%
Carteira	80.644.616,50	256.665,39	51.491,22	0,00	81.118.681,39	268.890,72	0,33%	1,42%	23,49%



www.kansalasset.com.br -
claudenir@kansalasset.com.br
Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.1518
Endereço: Luiz Alonso Perez, Nº 339 - Bairro: Indaiá -
Bertioga /SP -CEP: 11250-000.

4.2.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M	40.067,43	0,00%	809,59
BB IMA-B TP	37.389,75	0,00%	1.040,54
BB FLUXO	108.106,42	0,00%	43,21
BB PERFIL	498.445,41	0,00%	272,33
BB IRF-M	639.207,86	0,02%	12.915,64
BB IRF-M1 TP	6.692.414,37	0,04%	30.847,66
BB IMA-B 5+	178.602,70	0,01%	7.937,36
BB QUANTITATIVO	3.001.556,13	0,32%	262.701,81
BB JUROS E MOEDAS	2.099.689,09	0,00%	3.585,23
BB RETORNO AÇÕES	2.636.300,07	0,31%	248.497,52
BB IRF-M1 TP	445.858,38	0,00%	2.055,12
BB FLUXO	865.820,54	0,00%	346,03
BB PERFIL	4.826.149,00	0,00%	2.636,78
BB AÇÕES GLOBAIS	2.044.079,51	0,25%	201.752,72
BB IRF-M 1+	178.981,15	0,01%	4.985,25
BB RETORNO TOTAL	8.202.055,99	0,10%	83.865,34
BB AÇÕES BOLSA	2.231.192,97	0,22%	179.512,72
BRANCO IRF-M 1 TP	3.673.577,77	0,02%	16.956,03
CAIXA IMA-B	7.284.142,16	0,25%	201.720,32
CAIXA IRF-M1 TP	8.766.197,79	0,05%	40.276,91
CAIXA TP	1.047.676,13	0,00%	654,18
CAIXA IRF-M1 TP	7.915.540,72	0,04%	36.368,51
CAIXA IRF-M	2.446.693,21	0,06%	49.393,42
CAIXA REF DI	254.571,65	0,00%	180,51
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.531.801,52	0,09%	76.668,11
CAIXA IRF-M 1+	187.588,65	0,01%	5.186,94
CAIXA IRF-M 1+	1.081.762,25	0,04%	29.911,39

4.2.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M	-
BB IMA-B TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,02
BB IRF-M	-
BB IRF-M1 TP	-
BB IMA-B 5+	-
BB QUANTITATIVO	-
BB JUROS E MOEDAS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,02
BB AÇÕES GLOBAIS	-
BB IRF-M 1+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BB AÇÕES BOLSA	-
BRANCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA TP	0,03
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IRF-M	-
CAIXA REF DI	0,02
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
CAIXA IRF-M 1+	-
CAIXA IRF-M 1+	-



4.2.1.1 VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
CAIXA IMA-B 5	5.446.560,00	0,09%	74.027,43
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.756.652,77	0,02%	15.321,88
Carteira	81.118.681,39	1,22%	988.509,27

4.2.2.1 Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
CAIXA IMA-B 5	0,00
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-



4.2.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IRF-M	40.067,43	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	37.389,75	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	108.106,42	0,13%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,00%
BB PERFIL	498.445,41	0,61%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
BB IRF-M	639.207,86	0,79%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,01%
BB IRF-M1 TP	6.692.414,37	8,25%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,13%
BB IMA-B 5+	178.602,70	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
BB QUANTITATIVO	3.001.556,13	3,70%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,20%
BB JUROS E MOEDAS	2.099.689,09	2,59%	10%	Fundos Multimercados- Art. 10º, I, a	0,01%
BB RETORNO AÇÕES	2.636.300,07	3,25%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,21%
BB IRF-M1 TP	445.858,38	0,55%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,01%
BB FLUXO	865.820,54	1,07%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,03%
BB PERFIL	4.826.149,00	5,95%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,06%
BB AÇÕES GLOBAIS	2.044.079,51	2,52%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, I	0,18%
BB IRF-M 1+	178.981,15	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,10%
BB RETORNO TOTAL	8.202.055,99	10,11%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,20%
BB AÇÕES BOLSA	2.231.192,97	2,75%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,10%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.673.577,77	4,53%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,56%
CAIXA IMA-B	7.284.142,16	8,98%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,17%
CAIXA IRF-M1 TP	8.766.197,79	10,81%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,15%
CAIXA TP	1.047.676,13	1,29%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	7.915.540,72	9,76%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,14%
CAIXA IRF-M	2.446.693,21	3,02%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,25%
CAIXA REF DI	254.571,65	0,31%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.531.801,52	6,82%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%
CAIXA IRF-M 1+	187.588,65	0,23%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
CAIXA IRF-M 1+	1.081.762,25	1,33%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,12%



4.2.3.1 Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
CAIXA IMA-B 5	5.446.560,00	6,71%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.756.652,77	3,40%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,03%



4.3. Março

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	40.067,43	0,00	0,00	0,00	40.405,73	338,30	0,84%	2,03%	41,63%
BB IMA-B TP	37.389,75	0,00	0,00	0,00	38.515,12	1.125,37	3,01%	2,03%	148,39%
BB FLUXO	108.106,42	133.531,19	42.115,48	0,00	200.686,55	1.164,42	0,58%	2,03%	28,77%
BB PERFIL	498.445,41	0,00	0,00	0,00	503.248,30	4.802,89	0,96%	2,03%	47,51%
BB IRF-M	639.207,86	0,00	0,00	0,00	644.604,98	5.397,12	0,84%	2,03%	41,63%
BB IRF-M1 TP	6.692.414,37	0,00	0,00	0,00	6.750.450,24	58.035,87	0,87%	2,03%	42,75%
BB IMA-B 5+	178.602,70	0,00	0,00	0,00	184.893,40	6.290,70	3,52%	2,03%	173,65%
BB QUANTITATIVO	3.001.556,13	0,00	0,00	0,00	3.153.525,70	151.969,57	5,06%	2,03%	249,61%
BB JUROS E MOEDAS	2.099.689,09	0,00	0,00	0,00	2.119.635,48	19.946,39	0,95%	2,03%	46,83%
BB RETORNO AÇÕES	2.636.300,07	0,00	0,00	0,00	2.781.573,34	145.273,27	5,51%	2,03%	271,67%
BB IRF-M1 TP	445.858,38	0,00	0,00	0,00	449.724,82	3.866,44	0,87%	2,03%	42,75%
BB FLUXO	865.820,54	540.997,43	365.962,10	0,00	1.049.917,95	9.062,08	0,87%	2,03%	42,92%
BB PERFIL	4.826.149,00	1.945.680,79	0,00	0,00	6.819.174,51	47.344,72	0,70%	2,03%	34,47%
BB AÇÕES GLOBAIS	2.044.079,51	0,00	1.945.680,79	0,00	0,00	-98.398,72	-4,81%	2,03%	-237,33%
BB IRF-M 1+	178.981,15	0,00	0,00	0,00	180.613,64	1.632,49	0,91%	2,03%	44,97%
BB RETORNO TOTAL	8.202.055,99	0,00	0,00	0,00	8.313.685,78	111.629,79	1,36%	2,03%	67,10%
BB AÇÕES BOLSA	2.231.192,97	0,00	0,00	0,00	2.336.591,36	105.398,39	4,72%	2,03%	232,89%
BRASESCO IRF-M 1 TP	3.673.577,77	0,00	0,00	0,00	3.705.669,61	32.091,84	0,87%	2,03%	43,07%
CAIXA IMA-B	7.284.142,16	0,00	0,00	0,00	7.507.264,75	223.122,59	3,06%	2,03%	151,02%
CAIXA IRF-M1 TP	8.766.197,79	0,00	0,00	0,00	8.842.094,09	75.896,30	0,87%	2,03%	42,68%
CAIXA TP	1.047.676,13	0,00	0,00	0,00	1.056.906,10	9.229,97	0,88%	2,03%	43,43%
CAIXA IRF-M1 TP	7.915.540,72	0,00	0,00	0,00	7.984.072,20	68.531,48	0,87%	2,03%	42,68%
CAIXA IRF-M	2.446.693,21	0,00	0,00	0,00	2.467.563,79	20.870,58	0,85%	2,03%	42,05%
CAIXA REF DI	254.571,65	0,00	0,00	0,00	256.932,95	2.361,30	0,93%	2,03%	45,73%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.531.801,52	0,00	0,00	0,00	5.677.092,44	145.290,92	2,63%	2,03%	129,49%
CAIXA IRF-M 1+	187.588,65	0,00	0,00	0,00	189.124,01	1.535,36	0,82%	2,03%	40,35%
CAIXA IRF-M 1+	1.081.762,25	0,00	0,00	0,00	1.090.616,17	8.853,92	0,82%	2,03%	40,35%
CAIXA IMA-B 5	5.446.560,00	0,00	0,00	0,00	5.587.426,40	140.866,40	2,59%	2,03%	127,51%



4.3.1 Março

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.756.652,77	0,00	0,00	0,00	2.779.372,79	22.720,02	0,82%	2,03%	40,63%
Carteira	81.118.681,39	2.620.209,41	2.353.758,37	0,00	82.711.382,20	1.326.249,77	1,63%	2,03%	80,34%



www.kansalasset.com.br -
claudenir@kansalasset.com.br
Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.1518
Endereço: Luiz Alonso Perez, Nº 339 - Bairro: Indalá -
Bertioga /SP -CEP: 11250-000.

4.3.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M	40.405,73	0,00%	640,49
BB IMA-B TP	38.515,12	0,00%	829,06
BB FLUXO	200.686,55	0,00%	70,76
BB PERFIL	503.248,30	0,00%	213,40
BB IRF-M	644.604,98	0,01%	10.217,87
BB IRF-M1 TP	6.750.450,24	0,02%	20.626,20
BB IMA-B 5+	184.893,40	0,01%	6.346,10
BB QUANTITATIVO	3.153.525,70	0,33%	271.663,58
BB JUROS E MOEDAS	2.119.635,48	0,00%	2.068,76
BB RETORNO AÇÕES	2.781.573,34	0,30%	246.777,00
BB IRF-M1 TP	449.724,82	0,00%	1.374,15
BB FLUXO	1.049.917,95	0,00%	370,18
BB PERFIL	6.819.174,51	0,00%	2.891,64
BB AÇÕES GLOBAIS		0,00%	0,00
BB IRF-M 1+	180.613,64	0,01%	4.269,56
BB RETORNO TOTAL	8.313.685,78	0,08%	63.812,49
BB AÇÕES BOLSA	2.336.591,36	0,25%	210.729,68
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.705.669,61	0,01%	11.259,35
CAIXA IMA-B	7.507.264,75	0,20%	161.971,50
CAIXA IRF-M1 TP	8.842.094,09	0,03%	26.883,22
CAIXA TP	1.056.906,10	0,00%	563,38
CAIXA IRF-M1 TP	7.984.072,20	0,03%	24.274,52
CAIXA IRF-M	2.467.563,79	0,05%	39.002,46
CAIXA REF DI	256.932,95	0,00%	145,40
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.677.092,44	0,08%	68.650,52
CAIXA IRF-M 1+	189.124,01	0,01%	4.446,12

4.3.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M	0,00
BB IMA-B TP	0,01
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,02
BB IRF-M	0,00
BB IRF-M1 TP	-
BB IMA-B 5+	0,01
BB QUANTITATIVO	-
BB JUROS E MOEDAS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,02
BB AÇÕES GLOBAIS	-
BB IRF-M 1+	0,00
BB RETORNO TOTAL	0,01
BB AÇÕES BOLSA	-
BRADESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IMA-B	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA TP	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IRF-M	0,00
CAIXA REF DI	0,00
CAIXA IDKA IPCA 2A	0,02
CAIXA IRF-M 1+	0,00



4.3.1.1 VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
CAIXA IRF-M 1+	1.090.616,17	0,03%	25.639,32
CAIXA IMA-B 5	5.587.426,40	0,08%	62.417,31
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.779.372,79	0,01%	8.815,99
Carteira	82.711.382,20	1,11%	917.108,28

4.3.2.1 Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
CAIXA IRF-M 1+	0,00
CAIXA IMA-B 5	0,02
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	-



4.3.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IRF-M	40.405,73	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	38.515,12	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	200.686,55	0,24%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
BB PERFIL	503.248,30	0,61%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
BB IRF-M	644.604,98	0,78%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
BB IRF-M1 TP	6.750.450,24	8,16%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,13%
BB IMA-B 5+	184.893,40	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
BB QUANTITATIVO	3.153.525,70	3,81%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,20%
BB JUROS E MOEDAS	2.119.635,48	2,56%	10%	Fundos Multimercados- Art. 10º, I, a	0,01%
BB RETORNO AÇÕES	2.781.573,34	3,36%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,21%
BB IRF-M1 TP	449.724,82	0,54%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,01%
BB FLUXO	1.049.917,95	1,27%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,03%
BB PERFIL	6.819.174,51	8,24%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,08%
BB AÇÕES GLOBAIS	0,00	0,00%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, I	-
BB IRF-M 1+	180.613,64	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,11%
BB RETORNO TOTAL	8.313.685,78	10,05%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,21%
BB AÇÕES BOLSA	2.336.591,36	2,82%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,11%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.705.669,61	4,48%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,56%
CAIXA IMA-B	7.507.264,75	9,08%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,17%
CAIXA IRF-M1 TP	8.842.094,09	10,69%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,16%
CAIXA TP	1.056.906,10	1,28%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	7.984.072,20	9,65%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,14%
CAIXA IRF-M	2.467.563,79	2,98%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,27%
CAIXA REF DI	256.932,95	0,31%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.677.092,44	6,86%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%
CAIXA IRF-M 1+	189.124,01	0,23%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
CAIXA IRF-M 1+	1.090.616,17	1,32%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,12%



4.3.3.1 Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
CAIXA IMA-B 5	5.587.426,40	6,76%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.779.372,79	3,36%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,03%



Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Janeiro	80.447.671,70	174.613,69	8.396,66	0,00	80.644.616,50	30.727,77	0,04%	0,94%	4,04%
Fevereiro	80.644.616,50	256.665,39	51.491,22	0,00	81.118.681,39	268.890,72	0,33%	1,42%	23,49%
Março	81.118.681,39	2.620.209,41	2.353.758,37	0,00	82.711.382,20	1.326.249,77	1,63%	2,03%	80,34%
Acumulado	80.447.671,70	3.051.488,49	2.413.646,25	0,00	82.711.382,20	1.625.868,26	2,01%	4,45%	45,09%



www.kansalasset.com.br -
claudenir@kansalasset.com.br
 Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.1518
 Endereço: Luiz Alonso Perez, Nº 339 - Bairro: Indaiá -
 Bertoga /SP -CEP: 11250-000.

