

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

Relatório Trimestral de Rentabilidade e Riscos dos Investimentos de Abril/2022 A Junho/2022

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

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---



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



#### 4.1. Abril

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	40.405,73	0,00	0,00	0,00	40.364,00	-41,73	-0,10%	0,40%	-25,70%
BB IMA-B TP	38.515,12	0,00	0,00	0,00	38.824,65	309,53	0,80%	0,40%	200,00%
BB FLUXO	200.686,55	78.976,96	45.584,93	0,00	235.471,89	1.393,31	0,60%	0,40%	148,13%
BB PERFIL	503.248,30	0,00	0,00	0,00	507.184,29	3.935,99	0,78%	0,40%	194,64%
BB IRF-M	644.604,98	0,00	0,00	0,00	643.939,26	-665,72	-0,10%	0,40%	-25,70%
BB IRF-M1 TP	6.750.450,24	0,00	0,00	0,00	6.797.680,99	47.230,75	0,70%	0,40%	174,12%
BB IMA-B 5+	184.893,40	0,00	0,00	0,00	184.973,95	80,55	0,04%	0,40%	10,84%
BB QUANTITATIVO	3.153.525,70	0,00	0,00	0,00	2.900.477,95	-253.047,75	-8,02%	0,40%	-1996,92%
BB JUROS E MOEDAS	2.119.635,48	0,00	0,00	0,00	2.137.673,79	18.038,31	0,85%	0,40%	211,78%
BB RETORNO AÇÕES	2.781.573,34	0,00	0,00	0,00	2.564.424,33	-217.149,01	-7,81%	0,40%	-1942,77%
BB IRF-M1 TP	449.724,82	0,00	0,00	0,00	452.871,40	3.146,58	0,70%	0,40%	174,12%
BB FLUXO	1.049.917,95	365.362,19	96.751,71	0,00	1.328.174,52	9.646,09	0,73%	0,40%	182,06%
BB PERFIL	6.819.174,51	0,00	0,00	0,00	6.872.508,51	53.334,00	0,78%	0,40%	194,64%
BB IRF-M 1+	180.613,64	0,00	0,00	0,00	179.644,11	-969,53	-0,54%	0,40%	-133,59%
BB RETORNO TOTAL	8.313.685,78	0,00	0,00	0,00	8.364.827,88	51.142,10	0,62%	0,40%	153,09%
BB AÇÕES BOLSA	2.336.591,36	0,00	0,00	0,00	2.134.579,42	-202.011,94	-8,65%	0,40%	-2151,54%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.705.669,61	0,00	0,00	0,00	3.730.842,41	25.172,80	0,68%	0,40%	169,05%
CAIXA IMA-B	7.507.264,75	0,00	0,00	0,00	7.567.432,63	60.167,88	0,80%	0,40%	199,45%
CAIXA IRF-M1 TP	8.842.094,09	0,00	0,00	0,00	8.906.066,87	63.972,78	0,72%	0,40%	180,05%
CAIXA TP	1.056.906,10	0,00	0,00	0,00	1.064.799,84	7.893,74	0,75%	0,40%	185,87%
CAIXA IRF-M1 TP	7.984.072,20	0,00	0,00	0,00	8.041.837,14	57.764,94	0,72%	0,40%	180,05%
CAIXA IRF-M	2.467.563,79	0,00	0,00	0,00	2.463.312,12	-4.251,67	-0,17%	0,40%	-42,88%
CAIXA REF DI	256.932,95	0,00	0,00	0,00	258.988,70	2.055,75	0,80%	0,40%	199,12%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.677.092,44	0,00	0,00	0,00	5.756.598,81	79.506,37	1,40%	0,40%	348,52%
CAIXA IRF-M 1+	189.124,01	0,00	0,00	0,00	188.128,57	-995,44	-0,53%	0,40%	-130,99%
CAIXA IRF-M 1+	1.090.616,17	0,00	0,00	0,00	1.084.875,78	-5.740,39	-0,53%	0,40%	-130,99%
CAIXA IMA-B 5	5.587.426,40	0,00	0,00	0,00	5.673.238,12	85.811,72	1,54%	0,40%	382,20%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.779.372,79	0,00	0,00	0,00	2.804.693,06	25.320,27	0,91%	0,40%	226,71%
Carteira	82.711.382,20	444.339,15	142.336,64	0,00	82.924.434,99	-88.949,72	-0,11%	0,40%	-26,67%



#### 4.1.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M	40.364,00	0,00%	620,92
BB IMA-B TP	38.824,65	0,00%	835,57
BB FLUXO	235.471,89	0,00%	68,02
BB PERFIL	507.184,29	0,00%	184,48
BB IRF-M	643.939,26	0,01%	9.905,72
BB IRF-M1 TP	6.797.680,99	0,02%	20.161,75
BB IMA-B 5+	184.973,95	0,01%	6.406,45
BB QUANTITATIVO	2.900.477,95	0,28%	233.797,23
BB JUROS E MOEDAS	2.137.673,79	0,00%	2.278,76
BB RETORNO AÇÕES	2.564.424,33	0,25%	210.620,90
BB IRF-M1 TP	452.871,40	0,00%	1.343,21
BB FLUXO	1.328.174,52	0,00%	383,67
BB PERFIL	6.872.508,51	0,00%	2.499,81
BB IRF-M 1+	179.644,11	0,01%	4.181,37
BB RETORNO TOTAL	8.364.827,88	0,08%	64.453,89
BB AÇÕES BOLSA	2.134.579,42	0,26%	214.764,18
BRDESCO IRF-M 1 TP	3.730.842,41	0,01%	10.983,67
CAIXA IMA-B	7.567.432,63	0,20%	163.814,60
CAIXA IRF-M1 TP	8.906.066,87	0,03%	26.183,33
CAIXA TP	1.064.799,84	0,00%	564,67
CAIXA IRF-M1 TP	8.041.837,14	0,03%	23.642,54
CAIXA IRF-M	2.463.312,12	0,05%	37.699,17
CAIXA REF DI	258.988,70	0,00%	121,24
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.756.598,81	0,08%	68.975,29
CAIXA IRF-M 1+	188.128,57	0,01%	4.359,11
CAIXA IRF-M 1+	1.084.875,78	0,03%	25.137,57
CAIXA IMA-B 5	5.673.238,12	0,07%	61.449,29
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.804.693,06	0,01%	9.247,72
Carteira	82.924.434,99	1,08%	892.473,67

#### 4.1.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M	-
BB IMA-B TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	-
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	-
BB IRF-M 1+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BB AÇÕES BOLSA	-
BRDESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA TP	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IRF-M	-
CAIXA REF DI	-
CAIXA IDKA IPCA 2A	0,01
CAIXA IRF-M 1+	-
CAIXA IRF-M 1+	-
CAIXA IMA-B 5	0,01
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,00



#### 4.1.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IRF-M	40.364,00	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	38.824,65	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	235.471,89	0,28%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
BB PERFIL	507.184,29	0,61%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
BB IRF-M	643.939,26	0,78%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
BB IRF-M1 TP	6.797.680,99	8,20%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,14%
BB IMA-B 5+	184.973,95	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
BB QUANTITATIVO	2.900.477,95	3,50%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,20%
BB JUROS E MOEDAS	2.137.673,79	2,58%	10%	Fundos Multimercados- Art. 10º, I, a	0,01%
BB RETORNO AÇÕES	2.564.424,33	3,09%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,22%
BB IRF-M1 TP	452.871,40	0,55%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,01%
BB FLUXO	1.328.174,52	1,60%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,04%
BB PERFIL	6.872.508,51	8,29%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,07%
BB IRF-M 1+	179.644,11	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,13%
BB RETORNO TOTAL	8.364.827,88	10,09%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,22%
BB AÇÕES BOLSA	2.134.579,42	2,57%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,11%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.730.842,41	4,50%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,61%
CAIXA IMA-B	7.567.432,63	9,13%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,18%
CAIXA IRF-M1 TP	8.906.066,87	10,74%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,16%
CAIXA TP	1.064.799,84	1,28%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	8.041.837,14	9,70%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,14%
CAIXA IRF-M	2.463.312,12	2,97%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,29%
CAIXA REF DI	258.988,70	0,31%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.756.598,81	6,94%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%
CAIXA IRF-M 1+	188.128,57	0,23%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
CAIXA IRF-M 1+	1.084.875,78	1,31%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,13%
CAIXA IMA-B 5	5.673.238,12	6,84%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.804.693,06	3,38%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,03%



#### 4.2. Maio

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	40.364,00	0,00	0,00	0,00	40.596,43	232,43	0,58%	0,87%	65,91%
BB IMA-B TP	38.824,65	0,00	0,00	0,00	39.197,16	372,51	0,96%	0,87%	109,81%
BB FLUXO	235.471,89	68.481,64	30.674,63	0,00	275.284,67	2.005,77	0,73%	0,87%	84,00%
BB PERFIL	507.184,29	0,00	0,00	0,00	512.591,77	5.407,48	1,07%	0,87%	122,03%
BB IRF-M	643.939,26	0,00	0,00	0,00	647.647,22	3.707,96	0,58%	0,87%	65,90%
BB IRF-M1 TP	6.797.680,99	0,00	0,00	0,00	6.860.328,01	62.647,02	0,92%	0,87%	105,48%
BB IMA-B 5+	184.973,95	0,00	0,00	0,00	187.026,38	2.052,43	1,11%	0,87%	126,99%
BB QUANTITATIVO	2.900.477,95	0,00	0,00	0,00	3.007.240,55	106.762,60	3,68%	0,87%	421,29%
BB JUROS E MOEDAS	2.137.673,79	0,00	0,00	0,00	2.156.531,19	18.857,40	0,88%	0,87%	100,96%
BB RETORNO AÇÕES	2.564.424,33	0,00	0,00	0,00	2.639.360,04	74.935,71	2,92%	0,87%	334,45%
BB IRF-M1 TP	452.871,40	0,00	0,00	0,00	457.045,03	4.173,63	0,92%	0,87%	105,48%
BB FLUXO	1.328.174,52	876.937,75	257.333,44	0,00	1.963.678,57	15.899,74	0,82%	0,87%	93,43%
BB PERFIL	6.872.508,51	0,00	0,00	0,00	6.945.781,59	73.273,08	1,07%	0,87%	122,03%
BB IRF-M 1+	179.644,11	0,00	0,00	0,00	180.362,65	718,54	0,40%	0,87%	45,78%
BB RETORNO TOTAL	8.364.827,88	0,00	0,00	0,00	8.442.581,35	77.753,47	0,93%	0,87%	106,39%
BB AÇÕES BOLSA	2.134.579,42	0,00	0,00	0,00	2.149.515,17	14.935,75	0,70%	0,87%	80,08%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.730.842,41	0,00	0,00	0,00	3.765.814,42	34.972,01	0,94%	0,87%	107,29%
CAIXA IMA-B	7.567.432,63	0,00	0,00	0,00	7.640.526,91	73.094,28	0,97%	0,87%	110,55%
CAIXA IRF-M1 TP	8.906.066,87	0,00	0,00	0,00	8.988.722,80	82.655,93	0,93%	0,87%	106,22%
CAIXA TP	1.064.799,84	0,00	0,00	0,00	1.076.232,87	11.433,03	1,07%	0,87%	122,89%
CAIXA IRF-M1 TP	8.041.837,14	0,00	0,00	0,00	8.116.472,26	74.635,12	0,93%	0,87%	106,22%
CAIXA IRF-M	2.463.312,12	0,00	0,00	0,00	2.477.817,88	14.505,76	0,59%	0,87%	67,40%
CAIXA REF DI	258.988,70	0,00	0,00	0,00	261.776,66	2.787,96	1,08%	0,87%	123,21%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.756.598,81	0,00	0,00	0,00	5.805.712,72	49.113,91	0,85%	0,87%	97,65%
CAIXA IRF-M 1+	188.128,57	0,00	0,00	0,00	188.830,24	701,67	0,37%	0,87%	42,69%
CAIXA IRF-M 1+	1.084.875,78	0,00	0,00	0,00	1.088.922,05	4.046,27	0,37%	0,87%	42,69%
CAIXA IMA-B 5	5.673.238,12	0,00	0,00	0,00	5.716.618,04	43.379,92	0,76%	0,87%	87,52%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.804.693,06	0,00	0,00	0,00	2.834.563,81	29.870,75	1,07%	0,87%	121,90%
Carteira	82.924.434,99	945.419,39	288.008,07	0,00	84.466.778,44	884.932,13	1,06%	0,87%	121,18%



#### 4.2.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M	40.596,43	0,00%	619,40
BB IMA-B TP	39.197,16	0,00%	856,02
BB FLUXO	275.284,67	0,00%	87,47
BB PERFIL	512.591,77	0,00%	189,06
BB IRF-M	647.647,22	0,01%	9.881,50
BB IRF-M1 TP	6.860.328,01	0,02%	19.700,54
BB IMA-B 5+	187.026,38	0,01%	6.557,37
BB QUANTITATIVO	3.007.240,55	0,30%	251.891,68
BB JUROS E MOEDAS	2.156.531,19	0,00%	2.913,44
BB RETORNO AÇÕES	2.639.360,04	0,26%	222.378,85
BB IRF-M1 TP	457.045,03	0,00%	1.312,48
BB FLUXO	1.963.678,57	0,00%	623,94
BB PERFIL	6.945.781,59	0,00%	2.561,77
BB IRF-M 1+	180.362,65	0,00%	4.193,65
BB RETORNO TOTAL	8.442.581,35	0,08%	66.260,02
BB AÇÕES BOLSA	2.149.515,17	0,29%	246.890,44
BRDESCO IRF-M 1 TP	3.765.814,42	0,01%	10.762,01
CAIXA IMA-B	7.640.526,91	0,20%	168.489,06
CAIXA IRF-M1 TP	8.988.722,80	0,03%	25.695,30
CAIXA TP	1.076.232,87	0,00%	575,90
CAIXA IRF-M1 TP	8.116.472,26	0,03%	23.201,87
CAIXA IRF-M	2.477.817,88	0,04%	37.690,65
CAIXA REF DI	261.776,66	0,00%	116,52
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.805.712,72	0,08%	71.433,09
CAIXA IRF-M 1+	188.830,24	0,01%	4.378,62
CAIXA IRF-M 1+	1.088.922,05	0,03%	25.250,09
CAIXA IMA-B 5	5.716.618,04	0,07%	63.100,61
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.834.563,81	0,02%	18.793,66
Carteira	84.466.778,44	1,13%	953.555,74

#### 4.2.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M	-
BB IMA-B TP	0,00
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,03
BB IRF-M	-
BB IRF-M1 TP	-
BB IMA-B 5+	0,00
BB QUANTITATIVO	-
BB JUROS E MOEDAS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,03
BB IRF-M 1+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BB AÇÕES BOLSA	-
BRDESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IMA-B	0,00
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+	-
CAIXA IMA-B 5	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,00





#### 4.2.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IRF-M	40.596,43	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	39.197,16	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	275.284,67	0,33%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
BB PERFIL	512.591,77	0,61%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
BB IRF-M	647.647,22	0,77%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
BB IRF-M1 TP	6.860.328,01	8,12%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,13%
BB IMA-B 5+	187.026,38	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
BB QUANTITATIVO	3.007.240,55	3,56%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,20%
BB JUROS E MOEDAS	2.156.531,19	2,55%	10%	Fundos Multimercados- Art. 10º, I, a	0,01%
BB RETORNO AÇÕES	2.639.360,04	3,12%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,23%
BB IRF-M1 TP	457.045,03	0,54%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,01%
BB FLUXO	1.963.678,57	2,32%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,06%
BB PERFIL	6.945.781,59	8,22%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,07%
BB IRF-M 1+	180.362,65	0,21%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,14%
BB RETORNO TOTAL	8.442.581,35	10,00%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,22%
BB AÇÕES BOLSA	2.149.515,17	2,54%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,12%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.765.814,42	4,46%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,62%
CAIXA IMA-B	7.640.526,91	9,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,18%
CAIXA IRF-M1 TP	8.988.722,80	10,64%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,17%
CAIXA TP	1.076.232,87	1,27%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	8.116.472,26	9,61%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,15%
CAIXA IRF-M	2.477.817,88	2,93%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,35%
CAIXA REF DI	261.776,66	0,31%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.805.712,72	6,87%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%
CAIXA IRF-M 1+	188.830,24	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
CAIXA IRF-M 1+	1.088.922,05	1,29%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,13%
CAIXA IMA-B 5	5.716.618,04	6,77%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.834.563,81	3,36%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,04%



### 4.3. Junho

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	40.596,43	0,00	0,00	0,00	40.733,79	137,36	0,34%	1,07%	31,49%
BB IMA-B TP	39.197,16	0,00	0,00	0,00	39.058,89	-138,27	-0,35%	1,07%	-32,83%
BB FLUXO	275.284,67	77.812,25	46.408,77	0,00	309.184,22	2.496,07	0,81%	1,07%	75,74%
BB IRF-M	647.647,22	0,00	0,00	0,00	649.838,60	2.191,38	0,34%	1,07%	31,49%
BB IRF-M1 TP	6.860.328,01	0,00	0,00	0,00	6.923.313,49	62.985,48	0,92%	1,07%	85,44%
BB IMA-B 5+	187.026,38	0,00	0,00	0,00	184.961,18	-2.065,20	-1,10%	1,07%	-102,76%
BB QUANTITATIVO	3.007.240,55	0,00	0,00	0,00	2.623.379,11	-383.861,44	-12,76%	1,07%	-1187,93%
BB JUROS E MOEDAS	2.156.531,19	0,00	0,00	0,00	2.179.205,39	22.674,20	1,05%	1,07%	97,85%
BB RETORNO AÇÕES	2.639.360,04	0,00	0,00	0,00	2.326.967,30	-312.392,74	-11,84%	1,07%	-1101,50%
BB IRF-M1 TP	457.045,03	0,00	0,00	0,00	461.241,22	4.196,19	0,92%	1,07%	85,44%
BB FLUXO	1.963.678,57	177.100,83	160.509,78	0,00	1.998.920,05	18.650,43	0,94%	1,07%	87,65%
BB PERFIL	6.945.781,59	0,00	0,00	0,00	7.017.039,16	71.257,57	1,03%	1,07%	95,48%
BB IRF-M 1+	180.362,65	0,00	0,00	0,00	180.377,54	14,89	0,01%	1,07%	0,77%
BB RETORNO TOTAL	8.442.581,35	0,00	0,00	0,00	8.481.638,91	39.057,56	0,46%	1,07%	43,05%
BB AÇÕES BOLSA	2.149.515,17	0,00	0,00	0,00	1.989.514,38	-160.000,79	-7,44%	1,07%	-692,73%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.765.814,42	0,00	0,00	0,00	3.800.471,33	34.656,91	0,92%	1,07%	85,65%
CAIXA IMA-B	7.640.526,91	0,00	0,00	0,00	7.611.615,16	-28.911,75	-0,38%	1,07%	-35,22%
CAIXA IRF-M1 TP	8.988.722,80	0,00	0,00	0,00	9.070.518,02	81.795,22	0,91%	1,07%	84,69%
CAIXA TP	1.076.232,87	0,00	0,00	0,00	1.087.247,48	11.014,61	1,02%	1,07%	95,25%
CAIXA IRF-M1 TP	8.116.472,26	0,00	0,00	0,00	8.190.330,24	73.857,98	0,91%	1,07%	84,69%
CAIXA IRF-M	2.477.817,88	0,00	0,00	0,00	2.486.346,58	8.528,70	0,34%	1,07%	32,03%
CAIXA REF DI	261.776,66	0,00	0,00	0,00	264.553,10	2.776,44	1,06%	1,07%	98,71%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.805.712,72	0,00	0,00	0,00	5.818.737,13	13.024,41	0,22%	1,07%	20,88%
CAIXA IRF-M 1+	188.830,24	0,00	0,00	0,00	188.914,55	84,31	0,04%	1,07%	4,16%
CAIXA IRF-M 1+	1.088.922,05	0,00	0,00	0,00	1.089.408,29	486,24	0,04%	1,07%	4,16%
CAIXA IMA-B 5	5.716.618,04	0,00	0,00	0,00	5.735.687,48	19.069,44	0,33%	1,07%	31,04%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.834.563,81	0,00	0,00	0,00	2.841.095,00	6.531,19	0,23%	1,07%	21,44%
BB PERFIL	512.591,77	0,00	0,00	0,00	517.850,51	5.258,74	1,03%	1,07%	95,48%
Carteira	84.466.778,44	254.913,08	206.918,55	0,00	84.108.148,10	-406.624,87	-0,48%	1,07%	-44,78%



#### 4.3.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M	40.733,79	0,00%	644,27
BB IMA-B TP	39.058,89	0,00%	845,58
BB FLUXO	309.184,22	0,00%	2.246,61
BB IRF-M	649.838,60	0,01%	10.278,27
BB IRF-M1 TP	6.923.313,49	0,06%	52.242,78
BB IMA-B 5+	184.961,18	0,01%	6.506,85
BB QUANTITATIVO	2.623.379,11	0,43%	358.274,05
BB JUROS E MOEDAS	2.179.205,39	0,02%	18.144,82
BB RETORNO AÇÕES	2.326.967,30	0,36%	304.813,88
BB IRF-M1 TP	461.241,22	0,00%	3.480,49
BB FLUXO	1.998.920,05	0,02%	14.524,65
BB PERFIL	7.017.039,16	0,07%	56.139,22
BB IRF-M 1+	180.377,54	0,01%	4.213,98
BB RETORNO TOTAL	8.481.638,91	0,09%	74.032,94
BB AÇÕES BOLSA	1.989.514,38	0,33%	275.300,93
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.800.471,33	0,03%	28.709,38
CAIXA IMA-B	7.611.615,16	0,20%	167.081,88
CAIXA IRF-M1 TP	9.070.518,02	0,08%	67.865,72
CAIXA TP	1.087.247,48	0,01%	8.686,76
CAIXA IRF-M1 TP	8.190.330,24	0,07%	61.280,14
CAIXA IRF-M	2.486.346,58	0,05%	39.213,21
CAIXA REF DI	264.553,10	0,00%	2.186,70
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.818.737,13	0,09%	74.473,84
CAIXA IRF-M 1+	188.914,55	0,01%	4.399,85
CAIXA IRF-M 1+	1.089.408,29	0,03%	25.372,47
CAIXA IMA-B 5	5.735.687,48	0,08%	66.815,13
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.841.095,00	0,03%	27.639,09
BB PERFIL	517.850,51	0,00%	4.143,02
Carteira	84.108.148,10	1,14%	958.055,12

#### 4.3.2. Índice Sharpe

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



### 4.3.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IRF-M	40.733,79	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	39.058,89	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	309.184,22	0,37%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
BB IRF-M	649.838,60	0,77%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
BB IRF-M1 TP	6.923.313,49	8,23%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,14%
BB IMA-B 5+	184.961,18	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
BB QUANTITATIVO	2.623.379,11	3,12%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,20%
BB JUROS E MOEDAS	2.179.205,39	2,59%	10%	Fundos Multimercados- Art. 10º, I, a	0,01%
BB RETORNO AÇÕES	2.326.967,30	2,77%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,23%
BB IRF-M1 TP	461.241,22	0,55%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,01%
BB FLUXO	1.998.920,05	2,38%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,06%
BB PERFIL	7.017.039,16	8,34%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,07%
BB IRF-M 1+	180.377,54	0,21%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,14%
BB RETORNO TOTAL	8.481.638,91	10,08%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,23%
BB AÇÕES BOLSA	1.989.514,38	2,37%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,13%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.800.471,33	4,52%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,64%
CAIXA IMA-B	7.611.615,16	9,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,19%
CAIXA IRF-M1 TP	9.070.518,02	10,78%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,18%
CAIXA TP	1.087.247,48	1,29%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	8.190.330,24	9,74%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,16%
CAIXA IRF-M	2.486.346,58	2,96%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,37%
CAIXA REF DI	264.553,10	0,31%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.818.737,13	6,92%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%
CAIXA IRF-M 1+	188.914,55	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,01%
CAIXA IRF-M 1+	1.089.408,29	1,30%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,06%
CAIXA IMA-B 5	5.735.687,48	6,82%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.841.095,00	3,38%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,04%
BB PERFIL	517.850,51	0,62%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%



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%

Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Abril	82.711.382,20	444.339,15	142.336,64	0,00	82.924.434,99	-88.949,72	-0,11%	0,40%	-26,67%
Maió	82.924.434,99	945.419,39	288.008,07	0,00	84.466.778,44	884.932,13	1,06%	0,87%	121,18%
Junho	84.466.778,44	254.913,08	206.918,55	0,00	84.108.148,10	-406.624,87	-0,48%	1,07%	-44,78%
Acumulado	82.711.382,20	1.644.671,62	637.263,26	0,00	84.108.148,10	389.357,54	0,46%	2,37%	19,63%



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%
Abril	82.711.382,20	444.339,15	142.336,64	0,00	82.924.434,99	-88.949,72	-0,11%	0,40%	-26,67%
Mai	82.924.434,99	945.419,39	288.008,07	0,00	84.466.778,44	884.932,13	1,06%	0,87%	121,18%
Junho	84.466.778,44	254.913,08	206.918,55	0,00	84.108.148,10	-406.624,87	-0,48%	1,07%	-44,78%
Acumulado	80.447.671,70	4.696.160,11	3.050.909,51	0,00	84.108.148,10	2.015.225,80	2,48%	6,92%	35,83%





