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

Relatório Trimestral de Rentabilidade e Riscos dos Investimentos de Outubro/2021 A Dezembro/2021

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. Outubro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	242.115,15	0,00	0,00	0,00	235.631,50	-6.483,65	-2,68%	1,70%	-157,79%
BB IMA-B TP	137.467,75	0,00	0,00	0,00	133.918,04	-3.549,71	-2,58%	1,70%	-152,15%
BB FLUXO	32.497,15	50.845,79	64.380,40	0,00	19.141,23	178,69	0,55%	1,70%	32,40%
BB PERFIL	188.078,12	0,00	0,00	0,00	188.997,63	919,51	0,49%	1,70%	28,81%
BB IRF-M	6.708.293,57	0,00	0,00	0,00	6.528.650,75	-179.642,82	-2,68%	1,70%	-157,79%
BB IRF-M1 TP	6.531.274,77	0,00	0,00	0,00	6.497.394,28	-33.880,49	-0,52%	1,70%	-30,57%
BB IMA-B 5+	181.582,61	0,00	0,00	0,00	174.448,95	-7.133,66	-3,93%	1,70%	-231,48%
BB QUANTITATIVO	2.918.876,47	0,00	0,00	0,00	2.772.278,30	-146.598,17	-5,02%	1,70%	-295,94%
BB JUROS E MOEDAS	2.033.291,76	0,00	0,00	0,00	2.041.063,40	7.771,64	0,38%	1,70%	22,52%
BB RETORNO AÇÕES	2.977.466,67	0,00	0,00	0,00	2.724.458,41	-253.008,26	-8,50%	1,70%	-500,69%
BB IRF-M1 TP	435.123,03	0,00	0,00	0,00	432.865,86	-2.257,17	-0,52%	1,70%	-30,57%
BB FLUXO	328.266,18	354.449,18	51.246,63	0,00	633.499,79	2.031,06	0,32%	1,70%	18,95%
BB PERFIL	405.011,65	0,00	0,00	0,00	406.991,74	1.980,09	0,49%	1,70%	28,81%
BB AÇÕES GLOBAIS	1.258.830,94	0,00	0,00	0,00	1.391.803,51	132.972,57	10,56%	1,70%	622,41%
BB IRF-M 1+	177.556,39	0,00	0,00	0,00	171.274,38	-6.282,01	-3,54%	1,70%	-208,47%
BB RETORNO TOTAL	8.019.985,95	0,00	0,00	0,00	7.948.105,84	-71.880,11	-0,90%	1,70%	-52,81%
BB AÇÕES BOLSA	1.236.992,96	0,00	0,00	0,00	1.325.943,89	88.950,93	7,19%	1,70%	423,71%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.585.148,64	0,00	0,00	0,00	3.565.597,35	-19.551,29	-0,55%	1,70%	-32,13%
CAIXA IMA-B	7.228.905,97	0,00	0,00	0,00	7.043.727,53	-185.178,44	-2,56%	1,70%	-150,94%
CAIXA IRF-M1 TP	8.557.095,29	0,00	0,00	0,00	8.511.257,71	-45.837,58	-0,54%	1,70%	-31,56%
CAIXA TP	713.659,45	0,00	0,00	0,00	717.373,02	3.713,57	0,52%	1,70%	30,66%
CAIXA IRF-M1 TP	7.726.729,16	0,00	0,00	0,00	7.685.339,59	-41.389,57	-0,54%	1,70%	-31,56%
CAIXA IRF-M	2.410.636,43	0,00	0,00	0,00	2.346.977,61	-63.658,82	-2,64%	1,70%	-155,60%
CAIXA REF DI	245.881,53	0,00	0,00	0,00	247.117,91	1.236,38	0,50%	1,70%	29,63%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.135.531,64	0,00	0,00	0,00	5.069.167,71	-66.363,93	-1,29%	1,70%	-76,14%
CAIXA IRF-M 1+	186.159,67	0,00	0,00	0,00	179.656,68	-6.502,99	-3,49%	1,70%	-205,83%

4.1.1 Outubro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
CAIXA IRF-M 1+	1.073.521,77	0,00	0,00	0,00	1.036.021,14	-37.500,63	-3,49%	1,70%	-205,83%
CAIXA IMA-B 5	5.093.117,55	0,00	0,00	0,00	5.029.757,08	-63.360,47	-1,24%	1,70%	-73,30%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.687.821,13	0,00	0,00	0,00	2.670.048,45	-17.772,68	-0,66%	1,70%	-38,96%
Carteira	78.456.919,35	405.294,97	115.627,03	0,00	77.728.509,28	-1.018.078,01	-1,29%	1,70%	-76,18%

4.1.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M	235.631,50	0,01%	4.267,80
BB IMA-B TP	133.918,04	0,00%	3.709,21
BB FLUXO	19.141,23	0,00%	5,22
BB PERFIL	188.997,63	0,00%	70,51
BB IRF-M	6.528.650,75	0,15%	118.247,99
BB IRF-M1 TP	6.497.394,28	0,03%	25.543,42
BB IMA-B 5+	174.448,95	0,01%	7.457,14
BB QUANTITATIVO	2.772.278,30	0,32%	246.280,00
BB JUROS E MOEDAS	2.041.063,40	0,00%	2.719,64
BB RETORNO AÇÕES	2.724.458,41	0,35%	268.810,70
BB IRF-M1 TP	432.865,86	0,00%	1.701,74
BB FLUXO	633.499,79	0,00%	172,81
BB PERFIL	406.991,74	0,00%	151,85
BB AÇÕES GLOBAIS	1.391.803,51	0,12%	94.116,11
BB IRF-M 1+	171.274,38	0,01%	4.306,88
BB RETORNO TOTAL	7.948.105,84	0,12%	96.791,31
BB AÇÕES BOLSA	1.325.943,89	0,09%	71.186,70
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.565.597,35	0,02%	14.001,08
CAIXA IMA-B	7.043.727,53	0,25%	193.603,91
CAIXA IRF-M1 TP	8.511.257,71	0,04%	33.265,28
CAIXA TP	717.373,02	0,00%	263,47
CAIXA IRF-M1 TP	7.685.339,59	0,04%	30.037,28
CAIXA IRF-M	2.346.977,61	0,05%	42.491,75
CAIXA REF DI	247.117,91	0,00%	202,22
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.069.167,71	0,09%	68.976,32
CAIXA IRF-M 1+	179.656,68	0,01%	4.494,81

4.1.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M	-
BB IMA-B TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,00
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	0,00
BB AÇÕES GLOBAIS	-
BB IRF-M 1+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BB AÇÕES BOLSA	-
BRADESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IMA-B	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA TP	0,02
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IRF-M	-
CAIXA REF DI	0,00
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
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 IRF-M 1+	1.036.021,14	0,03%	25.920,12
CAIXA IMA-B 5	5.029.757,08	0,09%	70.475,68
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.670.048,45	0,05%	35.225,71
Carteira	77.728.509,28	1,33%	1.030.940,18

4.1.2.1 Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
CAIXA IRF-M 1+	-
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	235.631,50	0,30%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	133.918,04	0,17%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	19.141,23	0,02%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB PERFIL	188.997,63	0,24%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB IRF-M	6.528.650,75	8,40%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,13%
BB IRF-M1 TP	6.497.394,28	8,36%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,09%
BB IMA-B 5+	174.448,95	0,22%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%
BB QUANTITATIVO	2.772.278,30	3,57%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,22%
BB JUROS E MOEDAS	2.041.063,40	2,63%	10%	FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III	0,02%
BB RETORNO AÇÕES	2.724.458,41	3,51%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,18%
BB IRF-M1 TP	432.865,86	0,56%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%
BB FLUXO	633.499,79	0,82%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,03%
BB PERFIL	406.991,74	0,52%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
BB AÇÕES GLOBAIS	1.391.803,51	1,79%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, I	0,10%
BB IRF-M 1+	171.274,38	0,22%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,09%
BB RETORNO TOTAL	7.948.105,84	10,23%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,18%
BB AÇÕES BOLSA	1.325.943,89	1,71%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,06%
BRDESCO IRF-M 1 TP	3.565.597,35	4,59%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,57%
CAIXA IMA-B	7.043.727,53	9,06%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,15%
CAIXA IRF-M1 TP	8.511.257,71	10,95%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,13%
CAIXA TP	717.373,02	0,92%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	7.685.339,59	9,89%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,12%
CAIXA IRF-M	2.346.977,61	3,02%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,18%
CAIXA REF DI	247.117,91	0,32%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.069.167,71	6,52%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,05%

4.1.3.1 Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
CAIXA IRF-M 1+	179.656,68	0,23%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%
CAIXA IRF-M 1+	1.036.021,14	1,33%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,08%
CAIXA IMA-B 5	5.029.757,08	6,47%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,05%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.670.048,45	3,44%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%

4.2. Novembro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	235.631,50	0,00	200.000,00	0,00	39.157,08	3.525,58	1,50%	1,40%	107,19%
BB IMA-B TP	133.918,04	0,00	100.500,00	0,00	37.403,04	3.985,00	2,98%	1,40%	213,19%
BB FLUXO	19.141,23	389.801,86	321.187,30	0,00	87.847,96	92,17	0,11%	1,40%	7,52%
BB PERFIL	188.997,63	300.000,00	3.524,00	0,00	486.765,51	1.291,88	0,27%	1,40%	19,06%
BB IRF-M	6.528.650,75	0,00	6.000.000,00	0,00	624.684,77	96.034,02	1,47%	1,40%	105,38%
BB IRF-M1 TP	6.497.394,28	0,00	0,00	0,00	6.547.608,32	50.214,04	0,77%	1,40%	55,37%
BB IMA-B 5+	174.448,95	0,00	0,00	0,00	182.191,15	7.742,20	4,44%	1,40%	317,96%
BB QUANTITATIVO	2.772.278,30	0,00	0,00	0,00	2.730.956,90	-41.321,40	-1,49%	1,40%	-106,79%
BB JUROS E MOEDAS	2.041.063,40	0,00	0,00	0,00	2.055.160,88	14.097,48	0,69%	1,40%	49,48%
BB RETORNO AÇÕES	2.724.458,41	0,00	0,00	0,00	2.635.721,21	-88.737,20	-3,26%	1,40%	-233,35%
BB IRF-M1 TP	432.865,86	0,00	0,00	0,00	436.211,19	3.345,33	0,77%	1,40%	55,37%
BB FLUXO	633.499,79	649.142,06	1.033.742,71	0,00	251.211,71	2.312,57	0,37%	1,40%	26,15%
BB PERFIL	406.991,74	4.300.000,00	0,00	0,00	4.713.059,56	6.067,82	0,13%	1,40%	9,24%
BB AÇÕES GLOBAIS	1.391.803,51	1.000.000,00	0,00	0,00	2.359.921,99	-31.881,52	-1,33%	1,40%	-95,50%
BB IRF-M 1+	171.274,38	0,00	0,00	0,00	175.146,26	3.871,88	2,26%	1,40%	161,96%
BB RETORNO TOTAL	7.948.105,84	0,00	0,00	0,00	8.070.608,18	122.502,34	1,54%	1,40%	110,42%
BB AÇÕES BOLSA	1.325.943,89	1.000.000,00	0,00	0,00	2.299.474,72	-26.469,17	-1,14%	1,40%	-81,53%
BRADERCO IRF-M 1 TP	3.565.597,35	0,00	0,00	0,00	3.593.315,88	27.718,53	0,78%	1,40%	55,69%
CAIXA IMA-B	7.043.727,53	0,00	0,00	0,00	7.285.980,75	242.253,22	3,44%	1,40%	246,40%
CAIXA IRF-M1 TP	8.511.257,71	0,00	0,00	0,00	8.577.651,27	66.393,56	0,78%	1,40%	55,89%
CAIXA TP	717.373,02	300.000,00	0,00	0,00	1.022.440,94	5.067,92	0,50%	1,40%	35,69%
CAIXA IRF-M1 TP	7.685.339,59	0,00	0,00	0,00	7.745.290,44	59.950,85	0,78%	1,40%	55,89%
CAIXA IRF-M	2.346.977,61	0,00	0,00	0,00	2.389.343,21	42.365,60	1,81%	1,40%	129,32%
CAIXA REF DI	247.117,91	0,00	0,00	0,00	248.655,85	1.537,94	0,62%	1,40%	44,59%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.069.167,71	235.000,00	0,00	0,00	5.429.009,90	124.842,19	2,35%	1,40%	168,62%
CAIXA IRF-M 1+	179.656,68	0,00	0,00	0,00	183.593,41	3.936,73	2,19%	1,40%	156,99%
CAIXA IRF-M 1+	1.036.021,14	0,00	0,00	0,00	1.058.722,99	22.701,85	2,19%	1,40%	156,99%

4.2.1 Novembro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
CAIXA IMA-B 5	5.029.757,08	0,00	0,00	0,00	5.153.881,40	124.124,32	2,47%	1,40%	176,80%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.670.048,45	0,00	0,00	0,00	2.694.237,39	24.188,94	0,91%	1,40%	64,90%
Carteira	77.728.509,28	8.173.943,92	7.658.954,01	0,00	79.115.253,86	871.754,67	1,11%	1,40%	79,82%

4.2.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M	39.157,08	0,00%	1.011,18
BB IMA-B TP	37.403,04	0,00%	1.755,82
BB FLUXO	87.847,96	0,00%	361,26
BB PERFIL	486.765,51	0,00%	2.529,05
BB IRF-M	624.684,77	0,02%	16.131,65
BB IRF-M1 TP	6.547.608,32	0,07%	51.651,78
BB IMA-B 5+	182.191,15	0,02%	12.596,83
BB QUANTITATIVO	2.730.956,90	0,34%	265.283,90
BB JUROS E MOEDAS	2.055.160,88	0,02%	12.313,43
BB RETORNO AÇÕES	2.635.721,21	0,37%	293.594,67
BB IRF-M1 TP	436.211,19	0,00%	3.441,12
BB FLUXO	251.211,71	0,00%	1.033,06
BB PERFIL	4.713.059,56	0,03%	24.487,33
BB AÇÕES GLOBAIS	2.359.921,99	0,22%	170.672,90
BB IRF-M 1+	175.146,26	0,01%	6.009,06
BB RETORNO TOTAL	8.070.608,18	0,19%	153.131,55
BB AÇÕES BOLSA	2.299.474,72	0,17%	136.131,67
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.593.315,88	0,04%	28.513,68
CAIXA IMA-B	7.285.980,75	0,43%	340.505,84
CAIXA IRF-M1 TP	8.577.651,27	0,09%	68.017,31
CAIXA TP	1.022.440,94	0,01%	4.975,35
CAIXA IRF-M1 TP	7.745.290,44	0,08%	61.417,03
CAIXA IRF-M	2.389.343,21	0,08%	61.731,05
CAIXA REF DI	248.655,85	0,00%	1.287,00
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.429.009,90	0,18%	139.213,53
CAIXA IRF-M 1+	183.593,41	0,01%	6.220,88

4.2.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M	0,01
BB IMA-B TP	0,01
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,03
BB IRF-M	0,01
BB IRF-M1 TP	0,01
BB IMA-B 5+	0,01
BB QUANTITATIVO	-
BB JUROS E MOEDAS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB IRF-M1 TP	0,01
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,03
BB AÇÕES GLOBAIS	-
BB IRF-M 1+	0,01
BB RETORNO TOTAL	0,01
BB AÇÕES BOLSA	-
BRADESCO IRF-M 1 TP	0,01
CAIXA IMA-B	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	0,01
CAIXA TP	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	0,01
CAIXA IRF-M	0,01
CAIXA REF DI	0,01
CAIXA IDKA IPCA 2A	0,03
CAIXA IRF-M 1+	0,01

4.2.1.1 VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
CAIXA IRF-M 1+	1.058.722,99	0,05%	35.873,80
CAIXA IMA-B 5	5.153.881,40	0,17%	137.421,11
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.694.237,39	0,05%	40.932,98
Carteira	79.115.253,86	1,60%	1.267.437,11

4.2.2.1 Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
CAIXA IRF-M 1+	0,01
CAIXA IMA-B 5	0,02
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,01

4.2.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IRF-M	39.157,08	0,05%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	37.403,04	0,05%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	87.847,96	0,11%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB PERFIL	486.765,51	0,62%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
BB IRF-M	624.684,77	0,79%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%
BB IRF-M1 TP	6.547.608,32	8,28%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,09%
BB IMA-B 5+	182.191,15	0,23%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%
BB QUANTITATIVO	2.730.956,90	3,45%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,21%
BB JUROS E MOEDAS	2.055.160,88	2,60%	10%	FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III	0,02%
BB RETORNO AÇÕES	2.635.721,21	3,33%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,18%
BB IRF-M1 TP	436.211,19	0,55%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%
BB FLUXO	251.211,71	0,32%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
BB PERFIL	4.713.059,56	5,96%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,07%
BB AÇÕES GLOBAIS	2.359.921,99	2,98%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, I	0,17%
BB IRF-M 1+	175.146,26	0,22%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,10%
BB RETORNO TOTAL	8.070.608,18	10,20%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,18%
BB AÇÕES BOLSA	2.299.474,72	2,91%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,09%
BRDESCO IRF-M 1 TP	3.593.315,88	4,54%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,57%
CAIXA IMA-B	7.285.980,75	9,21%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,15%
CAIXA IRF-M1 TP	8.577.651,27	10,84%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,13%
CAIXA TP	1.022.440,94	1,29%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	7.745.290,44	9,79%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,12%
CAIXA IRF-M	2.389.343,21	3,02%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,19%
CAIXA REF DI	248.655,85	0,31%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.429.009,90	6,86%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,05%
CAIXA IRF-M 1+	183.593,41	0,23%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%

4.2.3.1 Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
CAIXA IRF-M 1+	1.058.722,99	1,34%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,09%
CAIXA IMA-B 5	5.153.881,40	6,51%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,04%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.694.237,39	3,41%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%

4.3. Dezembro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	39.157,08	0,00	0,00	0,00	39.891,94	734,86	1,88%	1,17%	159,74%
BB IMA-B TP	37.403,04	0,00	0,00	0,00	37.479,11	76,07	0,20%	1,17%	17,31%
BB FLUXO	87.847,96	33.690,89	52.884,85	0,00	69.105,00	451,00	0,51%	1,17%	43,70%
BB PERFIL	486.765,51	0,00	0,00	0,00	490.654,17	3.888,66	0,80%	1,17%	68,00%
BB IRF-M	624.684,77	0,00	0,00	0,00	636.408,30	11.723,53	1,88%	1,17%	159,74%
BB IRF-M1 TP	6.547.608,32	0,00	0,00	0,00	6.602.896,08	55.287,76	0,84%	1,17%	71,87%
BB IMA-B 5+	182.191,15	0,00	0,00	0,00	181.596,31	-594,84	-0,33%	1,17%	-27,79%
BB QUANTITATIVO	2.730.956,90	0,00	0,00	0,00	2.828.266,34	97.309,44	3,56%	1,17%	303,29%
BB JUROS E MOEDAS	2.055.160,88	0,00	0,00	0,00	2.070.222,97	15.062,09	0,73%	1,17%	62,38%
BB RETORNO AÇÕES	2.635.721,21	0,00	0,00	0,00	2.675.349,72	39.628,51	1,50%	1,17%	127,98%
BB IRF-M1 TP	436.211,19	0,00	0,00	0,00	439.894,54	3.683,35	0,84%	1,17%	71,87%
BB FLUXO	251.211,71	784.951,21	514.335,65	0,00	523.230,40	1.403,13	0,27%	1,17%	22,89%
BB PERFIL	4.713.059,56	0,00	0,00	0,00	4.750.711,07	37.651,51	0,80%	1,17%	68,00%
BB AÇÕES GLOBAIS	2.359.921,99	0,00	0,00	0,00	2.428.299,77	68.377,78	2,90%	1,17%	246,63%
BB IRF-M 1+	175.146,26	0,00	0,00	0,00	179.162,94	4.016,68	2,29%	1,17%	195,20%
BB RETORNO TOTAL	8.070.608,18	0,00	0,00	0,00	8.132.036,30	61.428,12	0,76%	1,17%	64,79%
BB AÇÕES BOLSA	2.299.474,72	0,00	0,00	0,00	2.420.787,00	121.312,28	5,28%	1,17%	449,05%
BRDESCO IRF-M 1 TP	3.593.315,88	0,00	0,00	0,00	3.623.924,33	30.608,45	0,85%	1,17%	72,50%
CAIXA IMA-B	7.285.980,75	0,00	0,00	0,00	7.301.233,49	15.252,74	0,21%	1,17%	17,82%
CAIXA IRF-M1 TP	8.577.651,27	0,00	0,00	0,00	8.650.436,95	72.785,68	0,85%	1,17%	72,23%
CAIXA TP	1.022.440,94	0,00	0,00	0,00	1.030.385,16	7.944,22	0,78%	1,17%	66,14%
CAIXA IRF-M1 TP	7.745.290,44	0,00	0,00	0,00	7.811.013,13	65.722,69	0,85%	1,17%	72,23%
CAIXA IRF-M	2.389.343,21	0,00	0,00	0,00	2.434.053,37	44.710,16	1,87%	1,17%	159,28%
CAIXA REF DI	248.655,85	0,00	0,00	0,00	250.531,94	1.876,09	0,75%	1,17%	64,22%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.429.009,90	0,00	0,00	0,00	5.468.083,10	39.073,20	0,72%	1,17%	61,26%
CAIXA IRF-M 1+	183.593,41	0,00	0,00	0,00	187.756,37	4.162,96	2,27%	1,17%	193,00%
CAIXA IRF-M 1+	1.058.722,99	0,00	0,00	0,00	1.082.729,43	24.006,44	2,27%	1,17%	193,00%

4.3.1 Dezembro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
CAIXA IMA-B 5	5.153.881,40	191.000,00	0,00	0,00	5.385.049,15	40.167,75	0,75%	1,17%	63,97%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.694.237,39	0,00	0,00	0,00	2.716.483,32	22.245,93	0,83%	1,17%	70,28%
Carteira	79.115.253,86	1.009.642,10	567.220,50	0,00	80.447.671,70	889.996,24	1,12%	1,17%	95,22%

4.3.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M	39.891,94	0,00%	799,60
BB IMA-B TP	37.479,11	0,00%	1.154,36
BB FLUXO	69.105,00	0,00%	29,74
BB PERFIL	490.654,17	0,00%	262,01
BB IRF-M	636.408,30	0,02%	12.756,28
BB IRF-M1 TP	6.602.896,08	0,04%	28.181,77
BB IMA-B 5+	181.596,31	0,01%	9.073,66
BB QUANTITATIVO	2.828.266,34	0,34%	276.159,02
BB JUROS E MOEDAS	2.070.222,97	0,00%	3.537,51
BB RETORNO AÇÕES	2.675.349,72	0,36%	286.893,24
BB IRF-M1 TP	439.894,54	0,00%	1.877,51
BB FLUXO	523.230,40	0,00%	225,19
BB PERFIL	4.750.711,07	0,00%	2.536,88
BB AÇÕES GLOBAIS	2.428.299,77	0,23%	187.457,31
BB IRF-M 1+	179.162,94	0,01%	4.892,13
BB RETORNO TOTAL	8.132.036,30	0,11%	91.112,36
BB AÇÕES BOLSA	2.420.787,00	0,19%	156.062,05
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.623.924,33	0,02%	15.454,93
CAIXA IMA-B	7.301.233,49	0,28%	223.397,17
CAIXA IRF-M1 TP	8.650.436,95	0,05%	36.800,49
CAIXA TP	1.030.385,16	0,00%	518,80
CAIXA IRF-M1 TP	7.811.013,13	0,04%	33.229,43
CAIXA IRF-M	2.434.053,37	0,06%	48.793,57
CAIXA REF DI	250.531,94	0,00%	204,94
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.468.083,10	0,09%	71.774,75
CAIXA IRF-M 1+	187.756,37	0,01%	5.099,67

4.3.2. Índice Sharpe

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

4.3.1.1 VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
CAIXA IRF-M 1+	1.082.729,43	0,04%	29.408,13
CAIXA IMA-B 5	5.385.049,15	0,09%	72.718,61
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.716.483,32	0,03%	24.613,53
Carteira	80.447.671,70	1,29%	1.039.338,12

4.3.2.1 Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
CAIXA IRF-M 1+	0,01
CAIXA IMA-B 5	0,00
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,00

4.3.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IRF-M	39.891,94	0,05%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	37.479,11	0,05%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	69.105,00	0,09%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB PERFIL	490.654,17	0,61%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
BB IRF-M	636.408,30	0,79%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%
BB IRF-M1 TP	6.602.896,08	8,21%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,11%
BB IMA-B 5+	181.596,31	0,23%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%
BB QUANTITATIVO	2.828.266,34	3,52%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,20%
BB JUROS E MOEDAS	2.070.222,97	2,57%	10%	FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III	0,01%
BB RETORNO AÇÕES	2.675.349,72	3,33%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,19%
BB IRF-M1 TP	439.894,54	0,55%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%
BB FLUXO	523.230,40	0,65%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,02%
BB PERFIL	4.750.711,07	5,91%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,07%
BB AÇÕES GLOBAIS	2.428.299,77	3,02%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, I	0,17%
BB IRF-M 1+	179.162,94	0,22%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,10%
BB RETORNO TOTAL	8.132.036,30	10,11%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,18%
BB AÇÕES BOLSA	2.420.787,00	3,01%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,09%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.623.924,33	4,50%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,56%
CAIXA IMA-B	7.301.233,49	9,08%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,16%
CAIXA IRF-M1 TP	8.650.436,95	10,75%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,13%
CAIXA TP	1.030.385,16	1,28%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	7.811.013,13	9,71%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,12%
CAIXA IRF-M	2.434.053,37	3,03%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,20%
CAIXA REF DI	250.531,94	0,31%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.468.083,10	6,80%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,05%
CAIXA IRF-M 1+	187.756,37	0,23%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%

4.3.3.1 Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
CAIXA IRF-M 1+	1.082.729,43	1,35%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,09%
CAIXA IMA-B 5	5.385.049,15	6,69%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,04%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.716.483,32	3,38%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%

Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Janeiro	76.260.010,89	820.609,49	680.119,70	0,00	76.017.416,44	-383.084,24	-0,50%	0,69%	-72,38%
Fevereiro	76.017.416,44	770.515,82	668.280,67	0,00	75.551.505,91	-568.145,68	-0,75%	1,31%	-57,18%
Março	75.551.505,91	1.062.717,06	263.357,65	0,00	76.380.861,73	29.996,41	0,04%	1,38%	2,86%
Acumulado	76.260.010,89	2.653.842,37	1.611.758,02	0,00	76.380.861,73	-921.233,51	-1,21%	3,41%	-35,34%

Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Abril	76.380.861,73	7.142.374,29	6.994.523,41	0,00	77.076.211,99	547.499,38	0,72%	0,75%	95,01%
Mai	77.076.211,99	12.114.969,21	11.626.341,10	0,00	78.038.903,68	474.063,58	0,61%	1,28%	47,93%
Junho	78.038.903,68	116.841,31	282.277,64	0,00	77.938.589,76	65.122,41	0,08%	0,97%	8,57%
Acumulado	76.380.861,73	19.374.184,81	18.903.142,15	0,00	77.938.589,76	1.086.685,37	1,42%	3,03%	46,69%

Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Julho	77.938.589,76	1.189.778,87	879.298,24	0,00	78.023.319,04	-225.751,35	-0,29%	1,41%	-20,52%
Agosto	78.023.319,04	695.506,32	272.084,58	0,00	78.245.178,83	-201.561,95	-0,26%	1,32%	-19,53%
Setembro	78.245.178,83	1.107.956,52	648.166,09	0,00	78.456.919,35	-248.049,91	-0,32%	1,61%	-19,62%
Acumulado	77.938.589,76	2.993.241,71	1.799.548,91	0,00	78.456.919,35	-675.363,21	-0,86%	4,39%	-19,55%

Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Outubro	78.456.919,35	405.294,97	115.627,03	0,00	77.728.509,28	-1.018.078,01	-1,29%	1,70%	-76,18%
Novembro	77.728.509,28	8.173.943,92	7.658.954,01	0,00	79.115.253,86	871.754,67	1,11%	1,40%	79,82%
Dezembro	79.115.253,86	1.009.642,10	567.220,50	0,00	80.447.671,70	889.996,24	1,12%	1,17%	95,22%
Acumulado	78.456.919,35	9.588.880,99	8.341.801,54	0,00	80.447.671,70	743.672,90	0,92%	4,33%	21,34%

Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Janeiro/2021	76.260.010,89	820.609,49	680.119,70	0,00	76.017.416,44	-383.084,24	-0,50%	0,69%	-72,38%
Fevereiro/2021	76.017.416,44	770.515,82	668.280,67	0,00	75.551.505,91	-568.145,68	-0,75%	1,31%	-57,18%
Março/2021	75.551.505,91	1.062.717,06	263.357,65	0,00	76.380.861,73	29.996,41	0,04%	1,38%	2,86%
Abril/2021	76.380.861,73	7.142.374,29	6.994.523,41	0,00	77.076.211,99	547.499,38	0,72%	0,75%	95,01%
Maió/2021	77.076.211,99	12.114.969,21	11.626.341,10	0,00	78.038.903,68	474.063,58	0,61%	1,28%	47,93%
Junho/2021	78.038.903,68	116.841,31	282.277,64	0,00	77.938.589,76	65.122,41	0,08%	0,97%	8,57%
Julho/2021	77.938.589,76	1.189.778,87	879.298,24	0,00	78.023.319,04	-225.751,35	-0,29%	1,41%	-20,52%
Agosto/2021	78.023.319,04	695.506,32	272.084,58	0,00	78.245.178,83	-201.561,95	-0,26%	1,32%	-19,53%
Setembro/2021	78.245.178,83	1.107.956,52	648.166,09	0,00	78.456.919,35	-248.049,91	-0,32%	1,61%	-19,62%
Outubro/2021	78.456.919,35	405.294,97	115.627,03	0,00	77.728.509,28	-1.018.078,01	-1,29%	1,70%	-76,18%
Novembro/2021	77.728.509,28	8.173.943,92	7.658.954,01	0,00	79.115.253,86	871.754,67	1,11%	1,40%	79,82%
Dezembro/2021	79.115.253,86	1.009.642,10	567.220,50	0,00	80.447.671,70	889.996,24	1,12%	1,17%	95,22%
Acumulado	76.260.010,89	34.610.149,88	30.656.250,62	0,00	80.447.671,70	233.761,55	0,25%	16,04%	1,56%

