

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

Relatório Trimestral de Rentabilidade e Riscos dos Investimentos de Julho/2021 A Setembro/2021

Aos _____ de _____ de 2021, 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.



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.



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.



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.

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. Julho

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	245.833,50	0,00	0,00	0,00	244.607,45	-1.226,05	-0,50%	1,41%	-35,48%
BB IMA-B TP	139.788,81	0,00	0,00	0,00	139.252,67	-536,14	-0,38%	1,41%	-27,28%
BB FLUXO	30.418,20	51.548,49	40.548,00	0,00	41.516,23	97,54	0,24%	1,41%	16,75%
BB PERFIL	185.655,22	0,00	0,00	0,00	186.385,15	729,93	0,39%	1,41%	27,97%
BB IRF-M	6.811.317,98	0,00	0,00	0,00	6.777.347,69	-33.970,29	-0,50%	1,41%	-35,48%
BB IRF-M1 TP	6.475.103,39	0,00	0,00	0,00	6.485.744,72	10.641,33	0,16%	1,41%	11,69%
BB IMA-B 5+	189.668,24	0,00	0,00	0,00	188.195,69	-1.472,55	-0,78%	1,41%	-55,22%
BB QUANTITATIVO	3.192.641,78	0,00	0,00	0,00	3.103.837,53	-88.804,25	-2,78%	1,41%	-197,85%
BB JUROS E MOEDAS	2.008.787,67	0,00	0,00	0,00	2.015.332,72	6.545,05	0,33%	1,41%	23,18%
BB RETORNO AÇÕES	3.276.618,60	200.000,00	0,00	0,00	3.321.691,09	-154.927,51	-4,46%	1,41%	-316,98%
BB IRF-M1 TP	431.380,81	0,00	0,00	0,00	432.089,75	708,94	0,16%	1,41%	11,69%
BB FLUXO	318.940,25	538.230,38	825.550,24	0,00	32.633,16	1.012,77	0,32%	1,41%	22,59%
BB PERFIL	412.959,27	0,00	13.200,00	0,00	401.365,97	1.606,70	0,39%	1,41%	27,67%
BB AÇÕES GLOBAIS	960.384,91	200.000,00	0,00	0,00	1.214.624,54	54.239,63	4,67%	1,41%	332,49%
BB IRF-M 1+	182.712,48	0,00	0,00	0,00	181.174,64	-1.537,84	-0,84%	1,41%	-59,87%
BB RETORNO TOTAL	8.056.962,01	0,00	0,00	0,00	8.048.004,90	-8.957,11	-0,11%	1,41%	-7,91%
BB AÇÕES BOLSA	1.029.780,55	200.000,00	0,00	0,00	1.258.120,07	28.339,52	2,30%	1,41%	163,92%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.551.922,07	0,00	0,00	0,00	3.558.727,10	6.805,03	0,19%	1,41%	13,63%
CAIXA IMA-B	7.352.772,41	0,00	0,00	0,00	7.323.461,24	-29.311,17	-0,40%	1,41%	-28,36%
CAIXA IRF-M1 TP	8.481.527,76	0,00	0,00	0,00	8.495.646,47	14.118,71	0,17%	1,41%	11,84%
CAIXA TP	705.072,21	0,00	0,00	0,00	707.748,69	2.676,48	0,38%	1,41%	27,00%
CAIXA IRF-M1 TP	7.658.494,58	0,00	0,00	0,00	7.671.243,27	12.748,69	0,17%	1,41%	11,84%
CAIXA IRF-M	2.446.459,70	0,00	0,00	0,00	2.434.988,44	-11.471,26	-0,47%	1,41%	-33,35%
CAIXA REF DI	242.296,61	0,00	0,00	0,00	243.391,17	1.094,56	0,45%	1,41%	32,13%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.727.842,58	0,00	0,00	0,00	4.724.772,43	-3.070,15	-0,06%	1,41%	-4,62%
CAIXA IRF-M 1+	191.482,96	0,00	0,00	0,00	189.819,86	-1.663,10	-0,87%	1,41%	-61,78%
CAIXA IRF-M 1+	1.104.219,43	0,00	0,00	0,00	1.094.628,87	-9.590,56	-0,87%	1,41%	-61,78%



4.1.1 Julho

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
CAIXA IMA-B 5	4.788.592,06	0,00	0,00	0,00	4.789.257,70	665,64	0,01%	1,41%	0,99%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.738.953,72	0,00	0,00	0,00	2.717.709,83	-21.243,89	-0,78%	1,41%	-55,17%
Carteira	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%



4.1.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M	244.607,45	0,00%	3.092,10
BB IMA-B TP	139.252,67	0,00%	3.217,01
BB FLUXO	41.516,23	0,00%	9,38
BB PERFIL	186.385,15	0,00%	63,97
BB IRF-M	6.777.347,69	0,11%	85.672,90
BB IRF-M1 TP	6.485.744,72	0,02%	11.943,20
BB IMA-B 5+	188.195,69	0,01%	6.437,18
BB QUANTITATIVO	3.103.837,53	0,28%	219.394,36
BB JUROS E MOEDAS	2.015.332,72	0,00%	1.880,62
BB RETORNO AÇÕES	3.321.691,09	0,31%	238.700,48
BB IRF-M1 TP	432.089,75	0,00%	795,67
BB FLUXO	32.633,16	0,00%	7,37
BB PERFIL	401.365,97	0,00%	137,74
BB AÇÕES GLOBAIS	1.214.624,54	0,12%	90.884,14
BB IRF-M 1+	181.174,64	0,00%	3.426,99
BB RETORNO TOTAL	8.048.004,90	0,13%	104.684,35
BB AÇÕES BOLSA	1.258.120,07	0,08%	65.443,28
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.558.727,10	0,01%	6.566,71
CAIXA IMA-B	7.323.461,24	0,22%	168.464,59
CAIXA IRF-M1 TP	8.495.646,47	0,02%	15.339,71
CAIXA TP	707.748,69	0,00%	289,96
CAIXA IRF-M1 TP	7.671.243,27	0,02%	13.851,17
CAIXA IRF-M	2.434.988,44	0,04%	30.706,21
CAIXA REF DI	243.391,17	0,00%	153,85
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.724.772,43	0,08%	59.396,96
CAIXA IRF-M 1+	189.819,86	0,00%	3.602,41

4.1.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M	-
BB IMA-B TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,05
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	0,05
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	0,03
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+	1.094.628,87	0,03%	20.773,92
CAIXA IMA-B 5	4.789.257,70	0,07%	58.368,38
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.717.709,83	0,04%	31.981,71
Carteira	78.023.319,04	1,15%	897.000,91

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	244.607,45	0,31%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	139.252,67	0,18%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	41.516,23	0,05%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB PERFIL	186.385,15	0,24%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB IRF-M	6.777.347,69	8,69%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,10%
BB IRF-M1 TP	6.485.744,72	8,31%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,10%
BB IMA-B 5+	188.195,69	0,24%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%
BB QUANTITATIVO	3.103.837,53	3,98%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,24%
BB JUROS E MOEDAS	2.015.332,72	2,58%	10%	FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III	0,03%
BB RETORNO AÇÕES	3.321.691,09	4,26%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,18%
BB IRF-M1 TP	432.089,75	0,55%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%
BB FLUXO	32.633,16	0,04%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB PERFIL	401.365,97	0,51%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
BB AÇÕES GLOBAIS	1.214.624,54	1,56%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, I	0,12%
BB IRF-M 1+	181.174,64	0,23%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,07%
BB RETORNO TOTAL	8.048.004,90	10,31%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,18%
BB AÇÕES BOLSA	1.258.120,07	1,61%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,07%
BRASESCO IRF-M 1 TP	3.558.727,10	4,56%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,51%
CAIXA IMA-B	7.323.461,24	9,39%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,13%
CAIXA IRF-M1 TP	8.495.646,47	10,89%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,11%
CAIXA TP	707.748,69	0,91%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	7.671.243,27	9,83%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,10%
CAIXA IRF-M	2.434.988,44	3,12%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,15%
CAIXA REF DI	243.391,17	0,31%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.724.772,43	6,06%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,04%
CAIXA IRF-M 1+	189.819,86	0,24%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%



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+	1.094.628,87	1,40%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,07%
CAIXA IMA-B 5	4.789.257,70	6,14%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,04%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.717.709,83	3,48%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%



4.2. Agosto

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	244.607,45	0,00	0,00	0,00	243.028,52	-1.578,93	-0,65%	1,32%	-49,07%
BB IMA-B TP	139.252,67	0,00	0,00	0,00	137.679,16	-1.573,51	-1,13%	1,32%	-85,90%
BB FLUXO	41.516,23	48.959,11	38.469,69	0,00	52.161,76	156,11	0,30%	1,32%	22,82%
BB PERFIL	186.385,15	0,00	0,00	0,00	187.218,53	833,38	0,45%	1,32%	33,99%
BB IRF-M	6.777.347,69	0,00	0,00	0,00	6.733.600,41	-43.747,28	-0,65%	1,32%	-49,07%
BB IRF-M1 TP	6.485.744,72	0,00	0,00	0,00	6.507.436,96	21.692,24	0,33%	1,32%	25,43%
BB IMA-B 5+	188.195,69	0,00	0,00	0,00	183.977,47	-4.218,22	-2,24%	1,32%	-170,39%
BB QUANTITATIVO	3.103.837,53	0,00	0,00	0,00	3.039.926,91	-63.910,62	-2,06%	1,32%	-156,53%
BB JUROS E MOEDAS	2.015.332,72	0,00	0,00	0,00	2.023.958,97	8.626,25	0,43%	1,32%	32,54%
BB RETORNO AÇÕES	3.321.691,09	0,00	0,00	0,00	3.226.328,70	-95.362,39	-2,87%	1,32%	-218,24%
BB IRF-M1 TP	432.089,75	0,00	0,00	0,00	433.534,92	1.445,17	0,33%	1,32%	25,43%
BB FLUXO	32.633,16	646.547,21	233.614,89	0,00	446.465,50	900,02	0,20%	1,32%	15,36%
BB PERFIL	401.365,97	0,00	0,00	0,00	403.160,59	1.794,62	0,45%	1,32%	33,99%
BB AÇÕES GLOBAIS	1.214.624,54	0,00	0,00	0,00	1.251.067,74	36.443,20	3,00%	1,32%	228,09%
BB IRF-M 1+	181.174,64	0,00	0,00	0,00	179.020,96	-2.153,68	-1,19%	1,32%	-90,37%
BB RETORNO TOTAL	8.048.004,90	0,00	0,00	0,00	8.011.396,56	-36.608,34	-0,45%	1,32%	-34,58%
BB AÇÕES BOLSA	1.258.120,07	0,00	0,00	0,00	1.299.121,84	41.001,77	3,26%	1,32%	247,74%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.558.727,10	0,00	0,00	0,00	3.571.173,21	12.446,11	0,35%	1,32%	26,59%
CAIXA IMA-B	7.323.461,24	0,00	0,00	0,00	7.240.184,44	-83.276,80	-1,14%	1,32%	-86,44%
CAIXA IRF-M1 TP	8.495.646,47	0,00	0,00	0,00	8.524.854,25	29.207,78	0,34%	1,32%	26,14%
CAIXA TP	707.748,69	0,00	0,00	0,00	710.597,46	2.848,77	0,40%	1,32%	30,60%
CAIXA IRF-M1 TP	7.671.243,27	0,00	0,00	0,00	7.697.616,75	26.373,48	0,34%	1,32%	26,14%
CAIXA IRF-M	2.434.988,44	0,00	0,00	0,00	2.419.567,69	-15.420,75	-0,63%	1,32%	-48,14%
CAIXA REF DI	243.391,17	0,00	0,00	0,00	244.585,84	1.194,67	0,49%	1,32%	37,31%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.724.772,43	0,00	0,00	0,00	4.733.953,76	9.181,33	0,19%	1,32%	14,77%
CAIXA IRF-M 1+	189.819,86	0,00	0,00	0,00	187.622,20	-2.197,66	-1,16%	1,32%	-88,01%
CAIXA IRF-M 1+	1.094.628,87	0,00	0,00	0,00	1.081.955,69	-12.673,18	-1,16%	1,32%	-88,01%



4.2.1 Agosto

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
CAIXA IMA-B 5	4.789.257,70	0,00	0,00	0,00	4.795.667,69	6.409,99	0,13%	1,32%	10,17%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.717.709,83	0,00	0,00	0,00	2.678.314,35	-39.395,48	-1,45%	1,32%	-110,20%
Carteira	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%



4.2.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M	243.028,52	0,00%	3.113,72
BB IMA-B TP	137.679,16	0,00%	3.534,80
BB FLUXO	52.161,76	0,00%	11,25
BB PERFIL	187.218,53	0,00%	64,61
BB IRF-M	6.733.600,41	0,11%	86.271,92
BB IRF-M1 TP	6.507.436,96	0,01%	10.939,50
BB IMA-B 5+	183.977,47	0,01%	7.206,91
BB QUANTITATIVO	3.039.926,91	0,26%	206.985,32
BB JUROS E MOEDAS	2.023.958,97	0,00%	1.879,64
BB RETORNO AÇÕES	3.226.328,70	0,30%	238.182,21
BB IRF-M1 TP	433.534,92	0,00%	728,81
BB FLUXO	446.465,50	0,00%	96,25
BB PERFIL	403.160,59	0,00%	139,13
BB AÇÕES GLOBAIS	1.251.067,74	0,11%	85.095,85
BB IRF-M 1+	179.020,96	0,00%	3.386,19
BB RETORNO TOTAL	8.011.396,56	0,13%	103.816,89
BB AÇÕES BOLSA	1.299.121,84	0,08%	64.643,19
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.571.173,21	0,01%	6.014,59
CAIXA IMA-B	7.240.184,44	0,24%	184.911,74
CAIXA IRF-M1 TP	8.524.854,25	0,02%	14.236,74
CAIXA TP	710.597,46	0,00%	267,04
CAIXA IRF-M1 TP	7.697.616,75	0,02%	12.855,23
CAIXA IRF-M	2.419.567,69	0,04%	30.937,94
CAIXA REF DI	244.585,84	0,00%	146,76
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.733.953,76	0,07%	57.243,63
CAIXA IRF-M 1+	187.622,20	0,00%	3.561,10

4.2.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M	-
BB IMA-B TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,01
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	0,01
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	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IRF-M	-
CAIXA REF DI	0,01
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
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 IRF-M 1+	1.081.955,69	0,03%	20.535,71
CAIXA IMA-B 5	4.795.667,69	0,08%	59.076,69
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.678.314,35	0,05%	37.965,10
Carteira	78.245.178,83	1,15%	903.364,56

4.2.2.1 Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
CAIXA IRF-M 1+	-
CAIXA IMA-B 5	-
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	243.028,52	0,31%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	137.679,16	0,18%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	52.161,76	0,07%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB PERFIL	187.218,53	0,24%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB IRF-M	6.733.600,41	8,61%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,10%
BB IRF-M1 TP	6.507.436,96	8,32%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,09%
BB IMA-B 5+	183.977,47	0,24%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%
BB QUANTITATIVO	3.039.926,91	3,89%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,23%
BB JUROS E MOEDAS	2.023.958,97	2,59%	10%	FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III	0,03%
BB RETORNO AÇÕES	3.226.328,70	4,12%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,17%
BB IRF-M1 TP	433.534,92	0,55%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%
BB FLUXO	446.465,50	0,57%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,02%
BB PERFIL	403.160,59	0,52%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
BB AÇÕES GLOBAIS	1.251.067,74	1,60%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, I	0,11%
BB IRF-M 1+	179.020,96	0,23%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,07%
BB RETORNO TOTAL	8.011.396,56	10,24%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,18%
BB AÇÕES BOLSA	1.299.121,84	1,66%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,06%
BRASESCO IRF-M 1 TP	3.571.173,21	4,56%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,53%
CAIXA IMA-B	7.240.184,44	9,25%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,13%
CAIXA IRF-M1 TP	8.524.854,25	10,90%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,12%
CAIXA TP	710.597,46	0,91%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	7.697.616,75	9,84%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,11%
CAIXA IRF-M	2.419.567,69	3,09%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,16%
CAIXA REF DI	244.585,84	0,31%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.733.953,76	6,05%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,04%
CAIXA IRF-M 1+	187.622,20	0,24%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%



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+	1.081.955,69	1,38%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,07%
CAIXA IMA-B 5	4.795.667,69	6,13%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,04%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.678.314,35	3,42%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%



4.3. Setembro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	243.028,52	0,00	0,00	0,00	242.115,15	-913,37	-0,38%	1,61%	-23,39%
BB IMA-B TP	137.679,16	0,00	0,00	0,00	137.467,75	-211,41	-0,15%	1,61%	-9,56%
BB FLUXO	52.161,76	0,00	19.832,02	0,00	32.497,15	167,41	0,32%	1,61%	19,97%
BB PERFIL	187.218,53	0,00	0,00	0,00	188.078,12	859,59	0,46%	1,61%	28,58%
BB IRF-M	6.733.600,41	0,00	0,00	0,00	6.708.293,57	-25.306,84	-0,38%	1,61%	-23,39%
BB IRF-M1 TP	6.507.436,96	0,00	0,00	0,00	6.531.274,77	23.837,81	0,37%	1,61%	22,80%
BB IMA-B 5+	183.977,47	0,00	0,00	0,00	181.582,61	-2.394,86	-1,30%	1,61%	-81,02%
BB QUANTITATIVO	3.039.926,91	0,00	0,00	0,00	2.918.876,47	-121.050,44	-3,98%	1,61%	-247,83%
BB JUROS E MOEDAS	2.023.958,97	0,00	0,00	0,00	2.033.291,76	9.332,79	0,46%	1,61%	28,70%
BB RETORNO AÇÕES	3.226.328,70	0,00	0,00	0,00	2.977.466,67	-248.862,03	-7,71%	1,61%	-480,07%
BB IRF-M1 TP	433.534,92	0,00	0,00	0,00	435.123,03	1.588,11	0,37%	1,61%	22,80%
BB FLUXO	446.465,50	507.954,87	628.334,07	0,00	328.266,18	2.179,88	0,49%	1,61%	30,39%
BB PERFIL	403.160,59	0,00	0,00	0,00	405.011,65	1.851,06	0,46%	1,61%	28,58%
BB AÇÕES GLOBAIS	1.251.067,74	0,00	0,00	0,00	1.258.830,94	7.763,20	0,62%	1,61%	38,62%
BB IRF-M 1+	179.020,96	0,00	0,00	0,00	177.556,39	-1.464,57	-0,82%	1,61%	-50,92%
BB RETORNO TOTAL	8.011.396,56	0,00	0,00	0,00	8.019.985,95	8.589,39	0,11%	1,61%	6,67%
BB AÇÕES BOLSA	1.299.121,84	0,00	0,00	0,00	1.236.992,96	-62.128,88	-4,78%	1,61%	-297,65%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.571.173,21	0,00	0,00	0,00	3.585.148,64	13.975,43	0,39%	1,61%	24,36%
CAIXA IMA-B	7.240.184,44	0,00	0,00	0,00	7.228.905,97	-11.278,47	-0,16%	1,61%	-9,70%
CAIXA IRF-M1 TP	8.524.854,25	0,00	0,00	0,00	8.557.095,29	32.241,04	0,38%	1,61%	23,54%
CAIXA TP	710.597,46	0,00	0,00	0,00	713.659,45	3.061,99	0,43%	1,61%	26,82%
CAIXA IRF-M1 TP	7.697.616,75	0,00	0,00	0,00	7.726.729,16	29.112,41	0,38%	1,61%	23,54%
CAIXA IRF-M	2.419.567,69	0,00	0,00	0,00	2.410.636,43	-8.931,26	-0,37%	1,61%	-22,97%
CAIXA REF DI	244.585,84	0,00	0,00	0,00	245.881,53	1.295,69	0,53%	1,61%	32,97%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.733.953,76	350.001,65	0,00	0,00	5.135.531,64	51.576,23	1,01%	1,61%	63,14%
CAIXA IRF-M 1+	187.622,20	0,00	0,00	0,00	186.159,67	-1.462,53	-0,78%	1,61%	-48,51%
CAIXA IRF-M 1+	1.081.955,69	0,00	0,00	0,00	1.073.521,77	-8.433,92	-0,78%	1,61%	-48,51%



4.3.1 Setembro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
CAIXA IMA-B 5	4.795.667,69	250.000,00	0,00	0,00	5.093.117,55	47.449,86	0,94%	1,61%	58,53%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.678.314,35	0,00	0,00	0,00	2.687.821,13	9.506,78	0,35%	1,61%	22,09%
Carteira	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%



4.3.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M	242.115,15	0,00%	3.119,73
BB IMA-B TP	137.467,75	0,00%	3.454,25
BB FLUXO	32.497,15	0,00%	6,84
BB PERFIL	188.078,12	0,00%	52,86
BB IRF-M	6.708.293,57	0,11%	86.438,41
BB IRF-M1 TP	6.531.274,77	0,02%	13.295,27
BB IMA-B 5+	181.582,61	0,01%	7.204,01
BB QUANTITATIVO	2.918.876,47	0,31%	239.947,61
BB JUROS E MOEDAS	2.033.291,76	0,00%	1.764,02
BB RETORNO AÇÕES	2.977.466,67	0,34%	263.130,26
BB IRF-M1 TP	435.123,03	0,00%	885,75
BB FLUXO	328.266,18	0,00%	69,08
BB PERFIL	405.011,65	0,00%	113,83
BB AÇÕES GLOBAIS	1.258.830,94	0,10%	80.198,41
BB IRF-M 1+	177.556,39	0,00%	3.377,54
BB RETORNO TOTAL	8.019.985,95	0,12%	92.626,33
BB AÇÕES BOLSA	1.236.992,96	0,08%	66.341,61
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.585.148,64	0,01%	7.282,33
CAIXA IMA-B	7.228.905,97	0,23%	180.245,15
CAIXA IRF-M1 TP	8.557.095,29	0,02%	17.263,50
CAIXA TP	713.659,45	0,00%	199,30
CAIXA IRF-M1 TP	7.726.729,16	0,02%	15.588,28
CAIXA IRF-M	2.410.636,43	0,04%	31.036,63
CAIXA REF DI	245.881,53	0,00%	194,46
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.135.531,64	0,07%	56.358,37
CAIXA IRF-M 1+	186.159,67	0,00%	3.538,21

4.3.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M	-
BB IMA-B TP	-
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,01
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	0,01
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	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IRF-M	-
CAIXA REF DI	0,01
CAIXA IDKA IPCA 2A	0,01
CAIXA IRF-M 1+	-



4.3.1.1 VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
CAIXA IRF-M 1+	1.073.521,77	0,03%	20.403,72
CAIXA IMA-B 5	5.093.117,55	0,07%	58.185,24
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.687.821,13	0,05%	35.971,67
Carteira	78.456.919,35	1,18%	922.485,70

4.3.2.1 Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
CAIXA IRF-M 1+	-
CAIXA IMA-B 5	0,01
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	242.115,15	0,31%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	137.467,75	0,18%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	32.497,15	0,04%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB PERFIL	188.078,12	0,24%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB IRF-M	6.708.293,57	8,55%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,11%
BB IRF-M1 TP	6.531.274,77	8,32%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,09%
BB IMA-B 5+	181.582,61	0,23%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%
BB QUANTITATIVO	2.918.876,47	3,72%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,22%
BB JUROS E MOEDAS	2.033.291,76	2,59%	10%	FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III	0,02%
BB RETORNO AÇÕES	2.977.466,67	3,80%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,17%
BB IRF-M1 TP	435.123,03	0,55%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%
BB FLUXO	328.266,18	0,42%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
BB PERFIL	405.011,65	0,52%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
BB AÇÕES GLOBAIS	1.258.830,94	1,60%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, I	0,11%
BB IRF-M 1+	177.556,39	0,23%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,08%
BB RETORNO TOTAL	8.019.985,95	10,22%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,18%
BB AÇÕES BOLSA	1.236.992,96	1,58%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,06%
BRASESCO IRF-M 1 TP	3.585.148,64	4,57%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,54%
CAIXA IMA-B	7.228.905,97	9,21%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,14%
CAIXA IRF-M1 TP	8.557.095,29	10,91%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,13%
CAIXA TP	713.659,45	0,91%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	7.726.729,16	9,85%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,11%
CAIXA IRF-M	2.410.636,43	3,07%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,17%
CAIXA REF DI	245.881,53	0,31%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.135.531,64	6,55%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,05%
CAIXA IRF-M 1+	186.159,67	0,24%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%



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+	1.073.521,77	1,37%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,07%
CAIXA IMA-B 5	5.093.117,55	6,49%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,05%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.687.821,13	3,43%	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%
Maio	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%





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.

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	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Novembro/2021	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Dezembro/2021	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Acumulado	76.260.010,89	25.021.268,89	22.314.449,08	0,00	78.456.919,35	-509.911,35	-0,67%	#####	-5,94%





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.



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.

