

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

Relatório Trimestral de Rentabilidade e Riscos dos Investimentos de Abril/2021 A Junho/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.

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.

## 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.

#### 4.1. Abril

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	243.041,64	0,00	0,00	0,00	245.019,90	1.978,26	0,81%	0,75%	108,10%
BB IMA-B TP	136.923,89	0,00	0,00	0,00	137.812,10	888,21	0,65%	0,75%	86,15%
BB FLUXO	31.545,65	51.548,49	80.338,01	0,00	2.791,23	35,10	0,11%	0,75%	14,78%
BB IRF-M	6.733.963,84	0,00	0,00	0,00	6.788.775,48	54.811,64	0,81%	0,75%	108,10%
BB IRF-M1 TP	6.436.363,64	0,00	0,00	0,00	6.451.989,86	15.626,22	0,24%	0,75%	32,24%
BB IMA-B 5+	2.772.575,29	0,00	520.000,00	0,00	2.266.806,72	14.231,43	0,51%	0,75%	68,17%
BB QUANTITATIVO	1.534.172,00	600.000,00	0,00	0,00	2.166.374,21	32.202,21	1,51%	0,75%	200,39%
BB JUROS E MOEDAS	0,00	800.000,00	0,00	0,00	800.203,13	203,13	0,03%	0,75%	3,37%
BB RETORNO AÇÕES	1.587.245,96	600.000,00	0,00	0,00	2.310.768,16	123.522,20	5,65%	0,75%	750,00%
BB IRF-M1 TP	8.209.736,52	0,00	3.120.000,00	0,00	5.108.060,07	18.323,55	0,22%	0,75%	29,64%
BB FLUXO	817.582,10	626.725,80	1.434.185,40	0,00	10.837,74	715,24	0,09%	0,75%	11,62%
BB PERFIL	420.582,36	0,00	0,00	0,00	421.421,25	838,89	0,20%	0,75%	26,49%
BB AÇÕES GLOBAIS	0,00	400.000,00	0,00	0,00	397.613,89	-2.386,11	-0,60%	0,75%	-79,22%
BB IRF-M 1+	3.434.614,55	0,00	1.840.000,00	0,00	1.631.608,71	36.994,16	1,08%	0,75%	143,04%
BB RETORNO TOTAL	0,00	2.680.000,00	0,00	0,00	2.684.545,31	4.545,31	0,17%	0,75%	22,52%
BB AÇÕES BOLSA	0,00	400.000,00	0,00	0,00	400.151,13	151,13	0,04%	0,75%	5,02%
BRDESCO IRF-M 1 TP	3.530.616,29	0,00	0,00	0,00	3.537.823,16	7.206,87	0,20%	0,75%	27,11%
CAIXA IMA-B	7.202.418,94	0,00	0,00	0,00	7.247.811,81	45.392,87	0,63%	0,75%	83,70%
CAIXA IRF-M1 TP	8.427.370,43	0,00	0,00	0,00	8.451.172,45	23.802,02	0,28%	0,75%	37,51%
CAIXA TP	700.009,22	0,00	0,00	0,00	700.881,42	872,20	0,12%	0,75%	16,55%
CAIXA IRF-M1 TP	7.609.592,60	0,00	0,00	0,00	7.631.084,90	21.492,30	0,28%	0,75%	37,51%
CAIXA IRF-M	2.419.090,11	0,00	0,00	0,00	2.437.875,01	18.784,90	0,78%	0,75%	103,13%
CAIXA REF DI	240.337,12	0,00	0,00	0,00	240.971,13	634,01	0,26%	0,75%	35,03%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.069.392,43	590.000,00	0,00	0,00	4.701.323,89	41.931,46	0,90%	0,75%	119,52%
CAIXA IRF-M 1+	1.504.195,33	0,00	0,00	0,00	1.520.817,62	16.622,29	1,11%	0,75%	146,76%
CAIXA IRF-M 1+	1.088.721,11	0,00	0,00	0,00	1.100.752,15	12.031,04	1,11%	0,75%	146,76%
CAIXA IMA-B 5	4.376.175,84	350.000,00	0,00	0,00	4.763.883,11	37.707,27	0,80%	0,75%	105,96%



#### 4.1.1 Abril

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.714.475,66	0,00	0,00	0,00	2.732.514,11	18.038,45	0,66%	0,75%	88,25%
BB PERFIL	140.119,21	44.100,00	0,00	0,00	184.522,34	303,13	0,16%	0,75%	21,85%
Carteira	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%



www.kansaiasset.com.br -  
claudenir@kansaiasset.com.br  
Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.1518  
Endereço: Luiz Alonso Perez, Nº 339 - Bairro: Indalá -  
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	245.019,90	0,00%	3.539,27
BB IMA-B TP	137.812,10	0,00%	3.465,94
BB FLUXO	2.791,23	0,00%	0,34
BB IRF-M	6.788.775,48	0,13%	98.062,69
BB IRF-M1 TP	6.451.989,86	0,01%	10.046,51
BB IMA-B 5+	2.266.806,72	0,11%	86.884,13
BB QUANTITATIVO	2.166.374,21	0,28%	214.800,67
BB JUROS E MOEDAS	800.203,13	0,00%	944,33
BB RETORNO AÇÕES	2.310.768,16	0,29%	225.474,63
BB IRF-M1 TP	5.108.060,07	0,01%	7.953,86
BB FLUXO	10.837,74	0,00%	1,32
BB PERFIL	421.421,25	0,00%	130,40
BB AÇÕES GLOBAIS	397.613,89	0,05%	38.008,80
BB IRF-M 1+	1.631.608,71	0,05%	38.230,70
BB RETORNO TOTAL	2.684.545,31	0,05%	40.106,32
BB AÇÕES BOLSA	400.151,13	0,03%	26.447,88
BRDESCO IRF-M 1 TP	3.537.823,16	0,01%	5.484,39
CAIXA IMA-B	7.247.811,81	0,24%	182.303,37
CAIXA IRF-M1 TP	8.451.172,45	0,02%	12.998,04
CAIXA TP	700.881,42	0,00%	236,10
CAIXA IRF-M1 TP	7.631.084,90	0,02%	11.736,73
CAIXA IRF-M	2.437.875,01	0,05%	35.353,29
CAIXA REF DI	240.971,13	0,00%	220,86
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.701.323,89	0,08%	60.168,14
CAIXA IRF-M 1+	1.520.817,62	0,05%	35.448,26
CAIXA IRF-M 1+	1.100.752,15	0,03%	25.657,09

#### 4.1.2. Índice Sharpe

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



#### 4.1.1.1 VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
CAIXA IMA-B 5	4.763.883,11	0,08%	59.785,34
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.732.514,11	0,03%	26.235,83
BB PERFIL	184.522,34	0,00%	57,10
Carteira	77.076.211,99	1,22%	936.976,09

#### 4.1.2.1 Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
CAIXA IMA-B 5	0,01
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	0,01
BB PERFIL	-



#### 4.1.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IRF-M	245.019,90	0,32%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	137.812,10	0,18%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	2.791,23	0,00%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB IRF-M	6.788.775,48	8,81%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,09%
BB IRF-M1 TP	6.451.989,86	8,37%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,09%
BB IMA-B 5+	2.266.806,72	2,94%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,17%
BB QUANTITATIVO	2.166.374,21	2,81%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,25%
BB JUROS E MOEDAS	800.203,13	1,04%	10%	FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III	0,02%
BB RETORNO AÇÕES	2.310.768,16	3,00%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,15%
BB IRF-M1 TP	5.108.060,07	6,63%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,07%
BB FLUXO	10.837,74	0,01%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB PERFIL	421.421,25	0,55%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
BB AÇÕES GLOBAIS	397.613,89	0,52%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III	0,04%
BB IRF-M 1+	1.631.608,71	2,12%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,60%
BB RETORNO TOTAL	2.684.545,31	3,48%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,07%
BB AÇÕES BOLSA	400.151,13	0,52%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,04%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.537.823,16	4,59%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,44%
CAIXA IMA-B	7.247.811,81	9,40%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,12%
CAIXA IRF-M1 TP	8.451.172,45	10,96%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,09%
CAIXA TP	700.881,42	0,91%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,02%
CAIXA IRF-M1 TP	7.631.084,90	9,90%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,08%
CAIXA IRF-M	2.437.875,01	3,16%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,13%
CAIXA REF DI	240.971,13	0,31%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.701.323,89	6,10%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,04%
CAIXA IRF-M 1+	1.520.817,62	1,97%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,08%
CAIXA IRF-M 1+	1.100.752,15	1,43%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,06%





#### 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	4.763.883,11	6,18%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,03%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.732.514,11	3,55%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%
BB PERFIL	184.522,34	0,24%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%



## 4.2. Maio

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	245.019,90	0,00	0,00	0,00	245.409,29	389,39	0,16%	1,28%	12,46%
BB IMA-B TP	137.812,10	0,00	0,00	0,00	139.265,65	1.453,55	1,05%	1,28%	82,71%
BB FLUXO	2.791,23	50.574,86	33.960,33	0,00	19.441,44	35,68	0,18%	1,28%	14,42%
BB PERFIL	184.522,34	0,00	0,00	0,00	185.046,61	524,27	0,28%	1,28%	22,28%
BB IRF-M	6.788.775,48	0,00	0,00	0,00	6.799.564,49	10.789,01	0,16%	1,28%	12,46%
BB IRF-M1 TP	6.451.989,86	0,00	0,00	0,00	6.463.466,05	11.476,19	0,18%	1,28%	13,95%
BB IMA-B 5+	2.266.806,72	0,00	2.080.000,00	0,00	188.223,29	1.416,57	0,06%	1,28%	4,90%
BB QUANTITATIVO	2.166.374,21	900.000,00	0,00	0,00	3.218.327,98	151.953,77	4,96%	1,28%	388,58%
BB JUROS E MOEDAS	800.203,13	1.200.000,00	0,00	0,00	2.003.380,30	3.177,17	0,16%	1,28%	12,46%
BB RETORNO AÇÕES	2.310.768,16	900.000,00	0,00	0,00	3.285.065,76	74.297,60	2,31%	1,28%	181,45%
BB IRF-M1 TP	5.108.060,07	0,00	4.680.000,00	0,00	430.605,51	2.545,44	0,05%	1,28%	3,91%
BB FLUXO	10.837,74	2.544.394,35	2.061.370,32	0,00	494.311,45	449,68	0,09%	1,28%	7,14%
BB PERFIL	421.421,25	0,00	11.000,00	0,00	411.605,51	1.184,26	0,28%	1,28%	22,04%
BB AÇÕES GLOBAIS	397.613,89	600.000,00	0,00	0,00	983.271,39	-14.342,50	-1,44%	1,28%	-112,73%
BB IRF-M 1+	1.631.608,71	0,00	1.440.000,00	0,00	182.430,87	-9.177,84	-0,56%	1,28%	-44,11%
BB RETORNO TOTAL	2.684.545,31	5.320.000,00	0,00	0,00	8.053.190,91	48.645,60	0,61%	1,28%	47,65%
BB AÇÕES BOLSA	400.151,13	600.000,00	0,00	0,00	1.002.742,66	2.591,53	0,26%	1,28%	20,32%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.537.823,16	0,00	0,00	0,00	3.544.757,83	6.934,67	0,20%	1,28%	15,37%
CAIXA IMA-B	7.247.811,81	0,00	0,00	0,00	7.323.378,95	75.567,14	1,04%	1,28%	81,76%
CAIXA IRF-M1 TP	8.451.172,45	0,00	0,00	0,00	8.465.558,74	14.386,29	0,17%	1,28%	13,35%
CAIXA TP	700.881,42	0,00	0,00	0,00	702.890,68	2.009,26	0,29%	1,28%	22,48%
CAIXA IRF-M1 TP	7.631.084,90	0,00	0,00	0,00	7.644.075,18	12.990,28	0,17%	1,28%	13,35%
CAIXA IRF-M	2.437.875,01	0,00	0,00	0,00	2.442.008,34	4.133,33	0,17%	1,28%	13,29%
CAIXA REF DI	240.971,13	0,00	0,00	0,00	241.557,93	586,80	0,24%	1,28%	19,09%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.701.323,89	0,00	0,00	0,00	4.740.989,28	39.665,39	0,84%	1,28%	66,16%
CAIXA IRF-M 1+	1.520.817,62	0,00	1.320.010,45	0,00	191.161,84	-9.645,33	-0,63%	1,28%	-49,73%
CAIXA IRF-M 1+	1.100.752,15	0,00	0,00	0,00	1.102.367,65	1.615,50	0,15%	1,28%	11,51%



#### 4.2.1 Maio

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
CAIXA IMA-B 5	4.763.883,11	0,00	0,00	0,00	4.795.771,77	31.888,66	0,67%	1,28%	52,49%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.732.514,11	0,00	0,00	0,00	2.739.036,33	6.522,22	0,24%	1,28%	18,72%
Carteira	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%



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	245.409,29	0,00%	3.654,54
BB IMA-B TP	139.265,65	0,00%	3.647,06
BB FLUXO	19.441,44	0,00%	3,84
BB PERFIL	185.046,61	0,00%	67,51
BB IRF-M	6.799.564,49	0,13%	101.256,42
BB IRF-M1 TP	6.463.466,05	0,01%	10.576,61
BB IMA-B 5+	188.223,29	0,01%	7.456,73
BB QUANTITATIVO	3.218.327,98	0,41%	319.102,21
BB JUROS E MOEDAS	2.003.380,30	0,00%	2.184,13
BB RETORNO AÇÕES	3.285.065,76	0,42%	328.827,99
BB IRF-M1 TP	430.605,51	0,00%	704,63
BB FLUXO	494.311,45	0,00%	97,62
BB PERFIL	411.605,51	0,00%	150,16
BB AÇÕES GLOBAIS	983.271,39	0,12%	93.223,12
BB IRF-M 1+	182.430,87	0,01%	4.358,26
BB RETORNO TOTAL	8.053.190,91	0,16%	123.364,59
BB AÇÕES BOLSA	1.002.742,66	0,09%	69.683,77
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.544.757,83	0,01%	5.802,85
CAIXA IMA-B	7.323.378,95	0,25%	191.535,79
CAIXA IRF-M1 TP	8.465.558,74	0,02%	13.752,59
CAIXA TP	702.890,68	0,00%	254,68
CAIXA IRF-M1 TP	7.644.075,18	0,02%	12.418,06
CAIXA IRF-M	2.442.008,34	0,05%	36.465,01
CAIXA REF DI	241.557,93	0,00%	140,79
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.740.989,28	0,08%	63.374,48
CAIXA IRF-M 1+	191.161,84	0,01%	4.544,04

#### 4.2.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M	0,00
BB IMA-B TP	0,01
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,01
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	0,01
BB AÇÕES GLOBAIS	-
BB IRF-M 1+	0,00
BB RETORNO TOTAL	0,01
BB AÇÕES BOLSA	#N/D
BRADESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IMA-B	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA TP	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IRF-M	0,00
CAIXA REF DI	-
CAIXA IDKA IPCA 2A	0,01
CAIXA IRF-M 1+	0,00



#### 4.2.1.1 VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
CAIXA IRF-M 1+	1.102.367,65	0,03%	26.204,01
CAIXA IMA-B 5	4.795.771,77	0,08%	62.542,65
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.739.036,33	0,04%	29.402,57
Carteira	78.038.903,68	1,41%	1.098.617,86

#### 4.2.2.1 Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
CAIXA IRF-M 1+	0,00
CAIXA IMA-B 5	0,01
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	245.409,29	0,31%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	139.265,65	0,18%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	19.441,44	0,02%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB PERFIL	185.046,61	0,24%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB IRF-M	6.799.564,49	8,71%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,10%
BB IRF-M1 TP	6.463.466,05	8,28%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,08%
BB IMA-B 5+	188.223,29	0,24%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%
BB QUANTITATIVO	3.218.327,98	4,12%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,32%
BB JUROS E MOEDAS	2.003.380,30	2,57%	10%	FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III	0,04%
BB RETORNO AÇÕES	3.285.065,76	4,21%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,19%
BB IRF-M1 TP	430.605,51	0,55%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%
BB FLUXO	494.311,45	0,63%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,02%
BB PERFIL	411.605,51	0,53%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
BB AÇÕES GLOBAIS	983.271,39	1,26%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, I	0,09%
BB IRF-M 1+	182.430,87	0,23%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,07%
BB RETORNO TOTAL	8.053.190,91	10,32%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,20%
BB AÇÕES BOLSA	1.002.742,66	1,28%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,08%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.544.757,83	4,54%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,45%
CAIXA IMA-B	7.323.378,95	9,38%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,13%
CAIXA IRF-M1 TP	8.465.558,74	10,85%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,10%
CAIXA TP	702.890,68	0,90%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,02%
CAIXA IRF-M1 TP	7.644.075,18	9,80%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,09%
CAIXA IRF-M	2.442.008,34	3,13%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,15%
CAIXA REF DI	241.557,93	0,31%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.740.989,28	6,08%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,04%
CAIXA IRF-M 1+	191.161,84	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+	1.102.367,65	1,41%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,06%
CAIXA IMA-B 5	4.795.771,77	6,15%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,03%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.739.036,33	3,51%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%



### 4.3. Junho

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	245.409,29	0,00	0,00	0,00	245.833,50	424,21	0,17%	0,97%	17,75%
BB IMA-B TP	139.265,65	0,00	0,00	0,00	139.788,81	523,16	0,38%	0,97%	38,57%
BB FLUXO	19.441,44	51.548,49	40.635,14	0,00	30.418,20	63,41	0,21%	0,97%	21,45%
BB PERFIL	185.046,61	0,00	0,00	0,00	185.655,22	608,61	0,33%	0,97%	33,77%
BB IRF-M	6.799.564,49	0,00	0,00	0,00	6.811.317,98	11.753,49	0,17%	0,97%	17,75%
BB IRF-M1 TP	6.463.466,05	0,00	0,00	0,00	6.475.103,39	11.637,34	0,18%	0,97%	18,49%
BB IMA-B 5+	188.223,29	0,00	0,00	0,00	189.668,24	1.444,95	0,77%	0,97%	78,82%
BB QUANTITATIVO	3.218.327,98	0,00	0,00	0,00	3.192.641,78	-25.686,20	-0,80%	0,97%	-81,95%
BB JUROS E MOEDAS	2.003.380,30	0,00	0,00	0,00	2.008.787,67	5.407,37	0,27%	0,97%	27,71%
BB RETORNO AÇÕES	3.285.065,76	0,00	0,00	0,00	3.276.618,60	-8.447,16	-0,26%	0,97%	-26,40%
BB IRF-M1 TP	430.605,51	0,00	0,00	0,00	431.380,81	775,30	0,18%	0,97%	18,49%
BB FLUXO	494.311,45	65.292,82	241.642,50	0,00	318.940,25	978,48	0,20%	0,97%	20,32%
BB PERFIL	411.605,51	0,00	0,00	0,00	412.959,27	1.353,76	0,33%	0,97%	33,77%
BB AÇÕES GLOBAIS	983.271,39	0,00	0,00	0,00	960.384,91	-22.886,48	-2,33%	0,97%	-238,98%
BB IRF-M 1+	182.430,87	0,00	0,00	0,00	182.712,48	281,61	0,15%	0,97%	15,85%
BB RETORNO TOTAL	8.053.190,91	0,00	0,00	0,00	8.056.962,01	3.771,10	0,05%	0,97%	4,81%
BB AÇÕES BOLSA	1.002.742,66	0,00	0,00	0,00	1.029.780,55	27.037,89	2,70%	0,97%	276,85%
BRDESCO IRF-M 1 TP	3.544.757,83	0,00	0,00	0,00	3.551.922,07	7.164,24	0,20%	0,97%	20,75%
CAIXA IMA-B	7.323.378,95	0,00	0,00	0,00	7.352.772,41	29.393,46	0,40%	0,97%	41,21%
CAIXA IRF-M1 TP	8.465.558,74	0,00	0,00	0,00	8.481.527,76	15.969,02	0,19%	0,97%	19,37%
CAIXA TP	702.890,68	0,00	0,00	0,00	705.072,21	2.181,53	0,31%	0,97%	31,87%
CAIXA IRF-M1 TP	7.644.075,18	0,00	0,00	0,00	7.658.494,58	14.419,40	0,19%	0,97%	19,37%
CAIXA IRF-M	2.442.008,34	0,00	0,00	0,00	2.446.459,70	4.451,36	0,18%	0,97%	18,72%
CAIXA REF DI	241.557,93	0,00	0,00	0,00	242.296,61	738,68	0,31%	0,97%	31,40%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.740.989,28	0,00	0,00	0,00	4.727.842,58	-13.146,70	-0,28%	0,97%	-28,47%
CAIXA IRF-M 1+	191.161,84	0,00	0,00	0,00	191.482,96	321,12	0,17%	0,97%	17,25%
CAIXA IRF-M 1+	1.102.367,65	0,00	0,00	0,00	1.104.219,43	1.851,78	0,17%	0,97%	17,25%





#### 4.3.1 Junho

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
CAIXA IMA-B 5	4.795.771,77	0,00	0,00	0,00	4.788.592,06	-7.179,71	-0,15%	0,97%	-15,37%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.739.036,33	0,00	0,00	0,00	2.738.953,72	-82,61	0,00%	0,97%	-0,31%
Carteira	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%



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.

#### 4.3.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M	245.833,50	0,00%	3.502,51
BB IMA-B TP	139.788,81	0,00%	3.547,09
BB FLUXO	30.418,20	0,00%	7,57
BB PERFIL	185.655,22	0,00%	72,53
BB IRF-M	6.811.317,98	0,12%	97.044,30
BB IRF-M1 TP	6.475.103,39	0,01%	10.742,54
BB IMA-B 5+	189.668,24	0,01%	7.057,49
BB QUANTITATIVO	3.192.641,78	0,35%	275.759,22
BB JUROS E MOEDAS	2.008.787,67	0,00%	2.142,05
BB RETORNO AÇÕES	3.276.618,60	0,34%	266.431,74
BB IRF-M1 TP	431.380,81	0,00%	715,68
BB FLUXO	318.940,25	0,00%	79,36
BB PERFIL	412.959,27	0,00%	161,34
BB AÇÕES GLOBAIS	960.384,91	0,10%	76.145,03
BB IRF-M 1+	182.712,48	0,01%	4.093,10
BB RETORNO TOTAL	8.056.962,01	0,15%	120.487,74
BB AÇÕES BOLSA	1.029.780,55	0,08%	62.350,40
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.551.922,07	0,01%	5.866,84
CAIXA IMA-B	7.352.772,41	0,24%	186.264,46
CAIXA IRF-M1 TP	8.481.527,76	0,02%	13.889,99
CAIXA TP	705.072,21	0,00%	286,53
CAIXA IRF-M1 TP	7.658.494,58	0,02%	12.542,13
CAIXA IRF-M	2.446.459,70	0,04%	34.908,34
CAIXA REF DI	242.296,61	0,00%	151,88
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.727.842,58	0,09%	67.709,20
CAIXA IRF-M 1+	191.482,96	0,01%	4.264,68

#### 4.3.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M	-
BB IMA-B TP	0,00
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,02
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	0,02
BB AÇÕES GLOBAIS	-
BB IRF-M 1+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BB AÇÕES BOLSA	-
BRADESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IMA-B	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA TP	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IRF-M	-
CAIXA REF DI	-
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
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+	1.104.219,43	0,03%	24.593,01
CAIXA IMA-B 5	4.788.592,06	0,09%	66.921,97
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.738.953,72	0,04%	30.256,08
Carteira	77.938.589,76	1,33%	1.035.618,35

#### 4.3.2.1 Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
CAIXA IRF-M 1+	-
CAIXA IMA-B 5	-
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	245.833,50	0,32%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	139.788,81	0,18%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	30.418,20	0,04%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB PERFIL	185.655,22	0,24%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BB IRF-M	6.811.317,98	8,74%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,10%
BB IRF-M1 TP	6.475.103,39	8,31%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,09%
BB IMA-B 5+	189.668,24	0,24%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%
BB QUANTITATIVO	3.192.641,78	4,10%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,29%
BB JUROS E MOEDAS	2.008.787,67	2,58%	10%	FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III	0,04%
BB RETORNO AÇÕES	3.276.618,60	4,20%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,18%
BB IRF-M1 TP	431.380,81	0,55%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,01%
BB FLUXO	318.940,25	0,41%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
BB PERFIL	412.959,27	0,53%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
BB AÇÕES GLOBAIS	960.384,91	1,23%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, I	0,10%
BB IRF-M 1+	182.712,48	0,23%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,07%
BB RETORNO TOTAL	8.056.962,01	10,34%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,19%
BB AÇÕES BOLSA	1.029.780,55	1,32%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,08%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.551.922,07	4,56%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,51%
CAIXA IMA-B	7.352.772,41	9,43%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,13%
CAIXA IRF-M1 TP	8.481.527,76	10,88%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,10%
CAIXA TP	705.072,21	0,90%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	7.658.494,58	9,83%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,09%
CAIXA IRF-M	2.446.459,70	3,14%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,15%
CAIXA REF DI	242.296,61	0,31%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	4.727.842,58	6,07%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,04%
CAIXA IRF-M 1+	191.482,96	0,25%	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+	1.104.219,43	1,42%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,06%
CAIXA IMA-B 5	4.788.592,06	6,14%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,03%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.738.953,72	3,51%	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%



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.

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	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Agosto/2021	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Setembro/2021	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
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	22.028.027,18	20.514.900,17	0,00	77.938.589,76	165.451,86	0,19%	6,55%	2,95%



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

---

**OBSERVAÇÕES:**

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---



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.



---

Estando todos os presentes de acordo com os termos acima, subscrevem:

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---

---



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.