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

Relatório Trimestral de Rentabilidade e Riscos dos Investimentos de Julho/2022 A Setembro/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. Julho

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	40.733,79	0,00	0,00	0,00	41.194,60	460,81	1,13%	-0,28%	-
BB IMA-B TP	39.058,89	0,00	0,00	0,00	38.713,01	-345,88	-0,89%	-0,28%	-
BB FLUXO	309.184,22	77.565,88	51.296,98	0,00	338.525,17	3.072,05	0,92%	-0,28%	-
BB IRF-M	649.838,60	0,00	0,00	0,00	657.190,02	7.351,42	1,13%	-0,28%	-
BB IRF-M1 TP	6.923.313,49	0,00	0,00	0,00	6.995.463,64	72.150,15	1,04%	-0,28%	-
BB IMA-B 5+	184.961,18	0,00	0,00	0,00	181.529,55	-3.431,63	-1,86%	-0,28%	-
BB QUANTITATIVO	2.623.379,11	0,00	2.629.582,16	0,00	0,00	6.203,05	0,24%	-0,28%	-
BB JUROS E MOEDAS	2.179.205,39	0,00	0,00	0,00	2.196.142,79	16.937,40	0,78%	-0,28%	-
BB RETORNO AÇÕES	2.326.967,30	0,00	2.334.846,80	0,00	0,00	7.879,50	0,34%	-0,28%	-
BB IRF-M1 TP	461.241,22	2.629.582,16	0,00	0,00	3.119.110,76	28.287,38	0,92%	-0,28%	-
BB FLUXO	1.998.920,05	3.268.602,21	355.396,17	0,00	4.952.409,69	40.283,60	0,82%	-0,28%	-
BB PERFIL	7.017.039,16	2.002.380,21	0,00	0,00	9.109.876,22	90.456,85	1,00%	-0,28%	-
BB IRF-M 1+	180.377,54	0,00	0,00	0,00	182.502,69	2.125,15	1,18%	-0,28%	-
BB RETORNO TOTAL	8.481.638,91	0,00	0,00	0,00	8.535.820,64	54.181,73	0,64%	-0,28%	-
BB AÇÕES BOLSA	1.989.514,38	0,00	2.002.380,21	0,00	0,00	12.865,83	0,65%	-0,28%	-
BRASESCO IRF-M 1 TP	3.800.471,33	0,00	0,00	0,00	3.839.776,22	39.304,89	1,03%	-0,28%	-
CAIXA IMA-B	7.611.615,16	0,00	0,00	0,00	7.541.220,76	-70.394,40	-0,92%	-0,28%	-
CAIXA IRF-M1 TP	9.070.518,02	0,00	0,00	0,00	9.164.095,38	93.577,36	1,03%	-0,28%	-
CAIXA TP	1.087.247,48	0,00	0,00	0,00	1.098.360,02	11.112,54	1,02%	-0,28%	-
CAIXA IRF-M1 TP	8.190.330,24	0,00	0,00	0,00	8.274.826,99	84.496,75	1,03%	-0,28%	-
CAIXA IRF-M	2.486.346,58	0,00	0,00	0,00	2.514.233,17	27.886,59	1,12%	-0,28%	-
CAIXA REF DI	264.553,10	0,00	0,00	0,00	267.216,86	2.663,76	1,01%	-0,28%	-
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.818.737,13	0,00	0,00	0,00	5.801.719,74	-17.017,39	-0,29%	-0,28%	-
CAIXA IRF-M 1+	188.914,55	0,00	0,00	0,00	191.087,25	2.172,70	1,15%	-0,28%	-
CAIXA IRF-M 1+	1.089.408,29	0,00	0,00	0,00	1.101.937,49	12.529,20	1,15%	-0,28%	-
CAIXA IMA-B 5	5.735.687,48	0,00	0,00	0,00	5.736.873,64	1.186,16	0,02%	-0,28%	-
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.841.095,00	0,00	0,00	0,00	2.863.429,02	22.334,02	0,79%	-0,28%	-
BB PERFIL	517.850,51	0,00	0,00	0,00	523.216,55	5.366,04	1,04%	-0,28%	-

4.1.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M	41.194,60	0,00%	654,38
BB IMA-B TP	38.713,01	0,00%	904,08
BB FLUXO	338.525,17	0,00%	82,84
BB IRF-M	657.190,02	0,01%	10.439,48
BB IRF-M1 TP	6.995.463,64	0,02%	16.085,73
BB IMA-B 5+	181.529,55	0,01%	6.775,16
BB QUANTITATIVO	0,00	0,00%	0,00
BB JUROS E MOEDAS	2.196.142,79	0,01%	4.795,53
BB RETORNO AÇÕES	0,00	0,00%	0,00
BB IRF-M1 TP	3.119.110,76	0,01%	7.172,25
BB FLUXO	4.952.409,69	0,00%	1.211,86
BB PERFIL	9.109.876,22	0,00%	2.949,35
BB IRF-M 1+	182.502,69	0,01%	4.363,60
BB RETORNO TOTAL	8.535.820,64	0,08%	68.721,74
BB AÇÕES BOLSA	0,00	0,00%	0,00
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.839.776,22	0,01%	8.744,28
CAIXA IMA-B	7.541.220,76	0,21%	179.223,34
CAIXA IRF-M1 TP	9.164.095,38	0,02%	20.752,08
CAIXA TP	1.098.360,02	0,00%	507,03
CAIXA IRF-M1 TP	8.274.826,99	0,02%	18.738,33
CAIXA IRF-M	2.514.233,17	0,05%	39.800,23
CAIXA REF DI	267.216,86	0,00%	108,85
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.801.719,74	0,09%	80.431,38
CAIXA IRF-M 1+	191.087,25	0,01%	4.553,31
CAIXA IRF-M 1+	1.101.937,49	0,03%	26.257,43
CAIXA IMA-B 5	5.736.873,64	0,08%	69.586,93
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.863.429,02	0,03%	29.765,36

4.1.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M	0,00
BB IMA-B TP	-
BB FLUXO	-
BB IRF-M	0,00
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	0,00
BB IRF-M 1+	0,00
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	0,00
CAIXA REF DI	-
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
CAIXA IRF-M 1+	0,00
CAIXA IRF-M 1+	0,00
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	41.194,60	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	38.713,01	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	338.525,17	0,40%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
BB IRF-M	657.190,02	0,77%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
BB IRF-M1 TP	6.995.463,64	8,20%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,14%
BB IMA-B 5+	181.529,55	0,21%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
BB QUANTITATIVO	0,00	0,00%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	-
BB JUROS E MOEDAS	2.196.142,79	2,58%	10%	Fundos Multimercados- Art. 10º, I, a	0,01%
BB RETORNO AÇÕES	0,00	0,00%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	-
BB IRF-M1 TP	3.119.110,76	3,66%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,06%
BB FLUXO	4.952.409,69	5,81%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,16%
BB PERFIL	9.109.876,22	10,68%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,09%
BB IRF-M 1+	182.502,69	0,21%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,14%
BB RETORNO TOTAL	8.535.820,64	10,01%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,26%
BB AÇÕES BOLSA	0,00	0,00%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	-
BRADERSCO IRF-M 1 TP	3.839.776,22	4,50%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,70%
CAIXA IMA-B	7.541.220,76	8,84%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,19%
CAIXA IRF-M1 TP	9.164.095,38	10,75%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,18%
CAIXA TP	1.098.360,02	1,29%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	8.274.826,99	9,70%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,16%
CAIXA IRF-M	2.514.233,17	2,95%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,15%
CAIXA REF DI	267.216,86	0,31%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.801.719,74	6,80%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,06%
CAIXA IRF-M 1+	191.087,25	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,03%
CAIXA IRF-M 1+	1.101.937,49	1,29%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,14%
CAIXA IMA-B 5	5.736.873,64	6,73%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,06%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.863.429,02	3,36%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%

4.2. Agosto

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	41.194,60	0,00	0,00	0,00	42.039,85	845,25	2,05%	0,04%	5080,60%
BB IMA-B TP	38.713,01	0,00	0,00	0,00	39.129,58	416,57	1,08%	0,04%	2664,41%
BB FLUXO	338.525,17	157.329,99	232.948,39	0,00	265.685,35	2.778,58	0,82%	0,04%	2032,37%
BB PERFIL	523.216,55	0,00	0,00	0,00	529.407,80	6.191,25	1,18%	0,04%	2930,00%
BB IRF-M	657.190,02	0,00	0,00	0,00	670.674,61	13.484,59	2,05%	0,04%	5080,63%
BB IRF-M1 TP	6.995.463,64	0,00	0,00	0,00	7.079.707,91	84.244,27	1,20%	0,04%	2981,91%
BB IMA-B 5+	181.529,55	0,00	0,00	0,00	185.971,39	4.441,84	2,45%	0,04%	6058,79%
BB JUROS E MOEDAS	2.196.142,79	0,00	0,00	0,00	2.217.821,57	21.678,78	0,99%	0,04%	2444,24%
BB IRF-M1 TP	3.119.110,76	0,00	0,00	0,00	3.156.673,27	37.562,51	1,20%	0,04%	2981,91%
BB FLUXO	4.952.409,69	923.679,52	640.361,84	0,00	5.289.084,87	53.357,50	1,02%	0,04%	2523,42%
BB PERFIL	9.109.876,22	0,00	0,00	0,00	9.217.673,89	107.797,67	1,18%	0,04%	2930,00%
BB IRF-M 1+	182.502,69	0,00	0,00	0,00	187.243,35	4.740,66	2,60%	0,04%	6431,91%
BB RETORNO TOTAL	8.535.820,64	0,00	0,00	0,00	8.633.793,01	97.972,37	1,15%	0,04%	2842,03%
BRASESCO IRF-M 1 TP	3.839.776,22	0,00	0,00	0,00	3.886.364,73	46.588,51	1,21%	0,04%	3004,30%
CAIXA IMA-B	7.541.220,76	0,00	0,00	0,00	7.631.428,52	90.207,76	1,20%	0,04%	2961,92%
CAIXA IRF-M1 TP	9.164.095,38	0,00	0,00	0,00	9.275.044,66	110.949,28	1,21%	0,04%	2997,82%
CAIXA TP	1.098.360,02	0,00	0,00	0,00	1.111.257,43	12.897,41	1,17%	0,04%	2907,56%
CAIXA IRF-M1 TP	8.274.826,99	0,00	0,00	0,00	8.375.009,97	100.182,98	1,21%	0,04%	2997,82%
CAIXA IRF-M	2.514.233,17	0,00	0,00	0,00	2.565.585,25	51.352,08	2,04%	0,04%	5057,35%
CAIXA REF DI	267.216,86	0,00	0,00	0,00	270.389,36	3.172,50	1,19%	0,04%	2939,73%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.801.719,74	0,00	0,00	0,00	5.795.410,30	-6.309,44	-0,11%	0,04%	-269,28%
CAIXA IRF-M 1+	191.087,25	0,00	0,00	0,00	195.997,33	4.910,08	2,57%	0,04%	6362,49%
CAIXA IRF-M 1+	1.101.937,49	0,00	0,00	0,00	1.130.252,30	28.314,81	2,57%	0,04%	6362,49%
CAIXA IMA-B 5	5.736.873,64	0,00	0,00	0,00	5.739.605,01	2.731,37	0,05%	0,04%	117,89%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.863.429,02	0,00	0,00	0,00	2.905.596,20	42.167,18	1,47%	0,04%	3646,35%
Carteira	85.266.471,87	1.081.009,51	873.310,23	0,00	86.396.847,51	922.676,36	1,08%	0,04%	2672,91%

4.2.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M	42.039,85	0,00%	626,67
BB IMA-B TP	39.129,58	0,00%	936,60
BB FLUXO	265.685,35	0,00%	56,96
BB PERFIL	529.407,80	0,00%	142,68
BB IRF-M	670.674,61	0,01%	9.997,43
BB IRF-M1 TP	7.079.707,91	0,02%	13.295,23
BB IMA-B 5+	185.971,39	0,01%	7.255,70
BB JUROS E MOEDAS	2.217.821,57	0,01%	5.367,19
BB IRF-M1 TP	3.156.673,27	0,01%	5.928,03
BB FLUXO	5.289.084,87	0,00%	1.133,97
BB PERFIL	9.217.673,89	0,00%	2.484,27
BB IRF-M 1+	187.243,35	0,00%	4.243,29
BB RETORNO TOTAL	8.633.793,01	0,08%	70.863,48
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.886.364,73	0,01%	7.228,26
CAIXA IMA-B	7.631.428,52	0,21%	185.545,89
CAIXA IRF-M1 TP	9.275.044,66	0,02%	17.216,97
CAIXA TP	1.111.257,43	0,00%	471,83
CAIXA IRF-M1 TP	8.375.009,97	0,02%	15.546,26
CAIXA IRF-M	2.565.585,25	0,04%	38.132,98
CAIXA REF DI	270.389,36	0,00%	102,78
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.795.410,30	0,09%	77.687,96
CAIXA IRF-M 1+	195.997,33	0,01%	4.419,78
CAIXA IRF-M 1+	1.130.252,30	0,03%	25.487,43
CAIXA IMA-B 5	5.739.605,01	0,08%	66.427,85
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.905.596,20	0,04%	31.099,40
Carteira	86.396.847,51	0,60%	517.121,89

4.2.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M	0,00
BB IMA-B TP	0,00
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,00
BB IRF-M	0,00
BB IRF-M1 TP	0,00
BB IMA-B 5+	0,00
BB JUROS E MOEDAS	-
BB IRF-M1 TP	0,00
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,00
BB IRF-M 1+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BRADESCO IRF-M 1 TP	0,00
CAIXA IMA-B	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	0,00
CAIXA TP	-
CAIXA IRF-M1 TP	0,00
CAIXA IRF-M	0,00
CAIXA REF DI	-
CAIXA IDKA IPCA 2A	0,01
CAIXA IRF-M 1+	0,00
CAIXA IRF-M 1+	0,00
CAIXA IMA-B 5	0,01
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	42.039,85	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	39.129,58	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	265.685,35	0,31%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
BB PERFIL	529.407,80	0,61%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,00%
BB IRF-M	670.674,61	0,78%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
BB IRF-M1 TP	7.079.707,91	8,19%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,12%
BB IMA-B 5+	185.971,39	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
BB JUROS E MOEDAS	2.217.821,57	2,57%	10%	Fundos Multimercados- Art. 10º, I, a	0,01%
BB IRF-M1 TP	3.156.673,27	3,65%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%
BB FLUXO	5.289.084,87	6,12%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,16%
BB PERFIL	9.217.673,89	10,67%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,08%
BB IRF-M 1+	187.243,35	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,14%
BB RETORNO TOTAL	8.633.793,01	9,99%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,28%
BRDESCO IRF-M 1 TP	3.886.364,73	4,50%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,79%
CAIXA IMA-B	7.631.428,52	8,83%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,20%
CAIXA IRF-M1 TP	9.275.044,66	10,74%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,19%
CAIXA TP	1.111.257,43	1,29%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	8.375.009,97	9,69%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,17%
CAIXA IRF-M	2.565.585,25	2,97%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,13%
CAIXA REF DI	270.389,36	0,31%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.795.410,30	6,71%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,06%
CAIXA IRF-M 1+	195.997,33	0,23%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,03%
CAIXA IRF-M 1+	1.130.252,30	1,31%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,16%
CAIXA IMA-B 5	5.739.605,01	6,64%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,06%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.905.596,20	3,36%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%

4.3. Setembro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M	42.039,85	0,00	0,00	0,00	42.618,43	578,58	1,38%	0,40%	342,50%
BB IMA-B TP	39.129,58	0,00	0,00	0,00	39.697,14	567,56	1,45%	0,40%	360,96%
BB FLUXO	265.685,35	78.439,28	47.080,62	0,00	300.029,62	2.985,61	1,01%	0,40%	250,13%
BB PERFIL	529.407,80	0,00	0,00	0,00	535.192,37	5.784,57	1,09%	0,40%	271,92%
BB IRF-M	670.674,61	0,00	0,00	0,00	679.904,73	9.230,12	1,38%	0,40%	342,49%
BB IRF-M1 TP	7.079.707,91	0,00	0,00	0,00	7.156.580,78	76.872,87	1,09%	0,40%	270,22%
BB IMA-B 5+	185.971,39	0,00	0,00	0,00	190.355,04	4.383,65	2,36%	0,40%	586,60%
BB JUROS E MOEDAS	2.217.821,57	0,00	0,00	0,00	2.241.554,22	23.732,65	1,07%	0,40%	266,30%
BB IRF-M1 TP	3.156.673,27	0,00	0,00	0,00	3.190.949,06	34.275,79	1,09%	0,40%	270,22%
BB FLUXO	5.289.084,87	132.506,36	78.603,37	0,00	5.395.812,85	52.824,99	0,99%	0,40%	246,04%
BB PERFIL	9.217.673,89	0,00	0,00	0,00	9.318.390,74	100.716,85	1,09%	0,40%	271,92%
BB IRF-M 1+	187.243,35	0,00	0,00	0,00	190.101,79	2.858,44	1,53%	0,40%	379,91%
BB RETORNO TOTAL	8.633.793,01	0,00	0,00	0,00	8.742.126,32	108.333,31	1,25%	0,40%	312,26%
BRASESCO IRF-M 1 TP	3.886.364,73	0,00	0,00	0,00	3.928.986,99	42.622,26	1,10%	0,40%	272,93%
CAIXA IMA-B	7.631.428,52	0,00	0,00	0,00	7.745.628,41	114.199,89	1,50%	0,40%	372,40%
CAIXA IRF-M1 TP	9.275.044,66	0,00	0,00	0,00	9.375.943,46	100.898,80	1,09%	0,40%	270,72%
CAIXA TP	1.111.257,43	0,00	0,00	0,00	1.123.403,00	12.145,57	1,09%	0,40%	271,99%
CAIXA IRF-M1 TP	8.375.009,97	0,00	0,00	0,00	8.466.117,68	91.107,71	1,09%	0,40%	270,72%
CAIXA IRF-M	2.565.585,25	0,00	0,00	0,00	2.600.613,76	35.028,51	1,37%	0,40%	339,77%
CAIXA REF DI	270.389,36	0,00	0,00	0,00	273.377,56	2.988,20	1,11%	0,40%	275,03%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.795.410,30	0,00	0,00	0,00	5.824.969,70	29.559,40	0,51%	0,40%	126,93%
CAIXA IRF-M 1+	195.997,33	0,00	0,00	0,00	199.010,30	3.012,97	1,54%	0,40%	382,56%
CAIXA IRF-M 1+	1.130.252,30	0,00	0,00	0,00	1.147.627,12	17.374,82	1,54%	0,40%	382,56%
CAIXA IMA-B 5	5.739.605,01	0,00	0,00	0,00	5.764.121,02	24.516,01	0,43%	0,40%	106,30%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.905.596,20	0,00	0,00	0,00	2.941.669,23	36.073,03	1,24%	0,40%	308,96%
Carteira	86.396.847,51	210.945,64	125.683,99	0,00	87.414.781,32	932.672,16	1,08%	0,40%	268,38%

4.3.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M	42.618,43	0,00%	648,69
BB IMA-B TP	39.697,14	0,00%	981,16
BB FLUXO	300.029,62	0,00%	35,64
BB PERFIL	535.192,37	0,00%	85,86
BB IRF-M	679.904,73	0,01%	10.348,78
BB IRF-M1 TP	7.156.580,78	0,01%	12.033,92
BB IMA-B 5+	190.355,04	0,01%	7.575,65
BB JUROS E MOEDAS	2.241.554,22	0,01%	6.078,56
BB IRF-M1 TP	3.190.949,06	0,01%	5.365,64
BB FLUXO	5.395.812,85	0,00%	641,04
BB PERFIL	9.318.390,74	0,00%	1.494,86
BB IRF-M 1+	190.101,79	0,01%	4.463,16
BB RETORNO TOTAL	8.742.126,32	0,09%	78.881,21
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.928.986,99	0,01%	6.522,05
CAIXA IMA-B	7.745.628,41	0,22%	194.519,61
CAIXA IRF-M1 TP	9.375.943,46	0,02%	15.592,09
CAIXA TP	1.123.403,00	0,00%	254,99
CAIXA IRF-M1 TP	8.466.117,68	0,02%	14.079,06
CAIXA IRF-M	2.600.613,76	0,05%	39.474,67
CAIXA REF DI	273.377,56	0,00%	83,66
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.824.969,70	0,09%	80.301,59
CAIXA IRF-M 1+	199.010,30	0,01%	4.648,07
CAIXA IRF-M 1+	1.147.627,12	0,03%	26.803,91
CAIXA IMA-B 5	5.764.121,02	0,08%	68.668,94
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.941.669,23	0,04%	32.341,99
Carteira	87.414.781,32	0,62%	544.376,68

4.3.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M	0,00
BB IMA-B TP	0,00
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,02
BB IRF-M	0,00
BB IRF-M1 TP	0,00
BB IMA-B 5+	0,01
BB JUROS E MOEDAS	-
BB IRF-M1 TP	0,00
BB FLUXO	-
BB PERFIL	0,02
BB IRF-M 1+	0,00
BB RETORNO TOTAL	0,00
BRADESCO IRF-M 1 TP	0,00
CAIXA IMA-B	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	0,00
CAIXA TP	0,02
CAIXA IRF-M1 TP	0,00
CAIXA IRF-M	0,00
CAIXA REF DI	0,02
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
CAIXA IRF-M 1+	0,00
CAIXA IRF-M 1+	0,00
CAIXA IMA-B 5	-
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	42.618,43	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB IMA-B TP	39.697,14	0,05%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
BB FLUXO	300.029,62	0,34%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
BB PERFIL	535.192,37	0,61%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,00%
BB IRF-M	679.904,73	0,78%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
BB IRF-M1 TP	7.156.580,78	8,19%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,12%
BB IMA-B 5+	190.355,04	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
BB JUROS E MOEDAS	2.241.554,22	2,56%	10%	Fundos Multimercados- Art. 10º, I, a	0,01%
BB IRF-M1 TP	3.190.949,06	3,65%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%
BB FLUXO	5.395.812,85	6,17%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,16%
BB PERFIL	9.318.390,74	10,66%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,08%
BB IRF-M 1+	190.101,79	0,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,14%
BB RETORNO TOTAL	8.742.126,32	10,00%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,28%
BRADESCO IRF-M 1 TP	3.928.986,99	4,49%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,73%
CAIXA IMA-B	7.745.628,41	8,86%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,20%
CAIXA IRF-M1 TP	9.375.943,46	10,73%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,17%
CAIXA TP	1.123.403,00	1,29%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	8.466.117,68	9,68%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,16%
CAIXA IRF-M	2.600.613,76	2,98%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,28%
CAIXA REF DI	273.377,56	0,31%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	5.824.969,70	6,66%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,07%
CAIXA IRF-M 1+	199.010,30	0,23%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,01%
CAIXA IRF-M 1+	1.147.627,12	1,31%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,07%
CAIXA IMA-B 5	5.764.121,02	6,59%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,06%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	2.941.669,23	3,37%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%

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%
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	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
Julho	84.108.148,10	7.978.130,46	7.373.502,32	0,00	85.266.471,87	553.695,63	0,65%	-0,28%	-232,69%
Agosto	85.266.471,87	1.081.009,51	873.310,23	0,00	86.396.847,51	922.676,36	1,08%	0,04%	2672,91%
Setembro	86.396.847,51	210.945,64	125.683,99	0,00	87.414.781,32	932.672,16	1,08%	0,40%	268,38%
Acumulado	84.108.148,10	9.270.085,61	8.372.496,54	0,00	87.414.781,32	2.409.044,15	2,84%	0,16%	1770,72%

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%
Maio	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%
Julho	84.108.148,10	7.978.130,46	7.373.502,32	0,00	85.266.471,87	553.695,63	0,65%	-0,28%	-232,69%
Agosto	85.266.471,87	1.081.009,51	873.310,23	0,00	86.396.847,51	922.676,36	1,08%	0,04%	2672,91%
Setembro	86.396.847,51	210.945,64	125.683,99	0,00	87.414.781,32	932.672,16	1,08%	0,40%	268,38%
Acumulado	80.447.671,70	13.966.245,72	11.423.406,05	0,00	87.414.781,32	4.424.269,95	5,39%	7,09%	75,96%

OBSERVAÇÕES:

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