

**BURIPREV – Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do
Município de Buri** - CNPJ: 02.922.449.0001/32

Ata número 04/2022 da reunião ordinária da Diretoria Executiva e dos Conselhos de Administração e Fiscal do BURIPREV – Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Buri.

**RELATÓRIO TRIMESTRAL DE RENTABILIDADE E RISCO DOS
INVESTIMENTOS DE JULHO A SETEMBRO DE 2022.**

Aos vinte e cinco dias do mês de novembro do ano de dois mil e vinte e dois às dez horas, na sede do BURIPREV, sito a Rua São Roque, 47 nesta cidade de Buri, estado de São Paulo, reuniu-se a Diretoria executiva, os Conselhos de Administração e Fiscal e o Comitê de investimentos do BURIPREV, conforme convocação do Presidente, Sr. Marco Antonio Lima, realizada no último dia dezoito de novembro de dois mil e vinte e dois, em lista que foi devidamente assinada por todos, e que segue fazendo parte integrante desta ata. O Sr. Presidente abriu a presente reunião agradecendo a presença de todos, passou imediatamente a ordem do dia expondo aos presentes para em conjunto do cumprimento previsto na Portaria MPS 519/2011 em consonância com a Resolução CMN 3922/2010, de 25 de dezembro de 2010, deliberam um pouco mais detalhadamente sobre a rentabilidade e riscos dos investimentos nos meses de julho, agosto e setembro de dois mil e vinte e dois, como abaixo demonstrados:

Several handwritten signatures in blue ink are present in the lower right quadrant of the page. There are approximately six distinct signatures of varying styles and sizes.

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Setembro/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1 TP	9.471.126,29	1,08%	0,12%	931,33%
BB IMA-B 5+	1.048.705,77	2,36%	0,12%	2028,00%
BB RETORNO TOTAL	6.128.221,58	1,25%	0,12%	1079,54%
BRASESCO PREMIUM	1.140.455,78	1,12%	0,12%	959,33%
BRASESCO IRF-M 1 TP	9.361.428,94	1,10%	0,12%	943,56%
CAIXA IRF-M1 TP	10.162.689,46	1,09%	0,12%	935,94%
CAIXA REF DI	10.643.994,05	1,08%	0,12%	931,72%
CAIXA IDKA IPCA 2A	12.160.023,40	0,51%	0,12%	438,82%
SANTANDER ATIVO	3.330.043,27	1,07%	0,12%	922,26%
SICREDI LIQUIDEZ	3.236.248,50	1,08%	0,12%	926,11%
SICREDI IRF-M 1	357.643,71	1,12%	0,12%	964,49%
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.195.453,30	1,53%	0,12%	1318,28%
NTN-B - 2024	1.818.461,15	0,13%	0,12%	111,53%
NTN-B - 2024	2.128.833,07	0,13%	0,12%	111,53%
CAIXA AÇÕES MULT.	308.776,01	-0,69%	0,12%	-596,57%
CAIXA BDR NÍVEL I	45.583,96	-7,72%	0,12%	-6641,80%
TOTAL / MÉDIA	72.537.688,24	0,96%	0,12%	828,29%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1 TP	13,06%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	1,45%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	8,45%	20%	Art. 7º, III, a
BRASESCO PREMIUM	1,57%	20%	Art. 7º, III, a
BRASESCO IRF-M 1 TP	12,91%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	14,01%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA REF DI	14,67%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IDKA IPCA 2A	16,76%	100%	Art. 7º, I, b
SANTANDER ATIVO	4,59%	20%	Art. 7º, III, a
SICREDI LIQUIDEZ	4,46%	20%	Art. 7º, III, a
SICREDI IRF-M 1	0,49%	20%	Art. 7º, III, a
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,65%	20%	Art. 7º, III, a
NTN-B - 2024	2,51%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	2,93%	100%	Art. 7º, I, a
CAIXA AÇÕES MULT.	0,43%	20%	Art. 8º, I
CAIXA BDR NÍVEL I	0,06%	10%	Art. 9º-A, III

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,53%	0,95%	55,36%
Fevereiro	0,80%	1,42%	56,26%
Março	1,30%	2,03%	63,68%
Abril	0,84%	1,47%	57,10%
Mai	0,97%	0,88%	109,95%
Junho	0,69%	1,08%	63,87%
Julho	0,69%	-0,28%	-
Agosto	0,75%	0,05%	1626,91%
Setembro	0,96%	0,12%	828,29%
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	7,77%	7,97%	97,47%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 7,77%, enquanto que a meta acumulada no período é de 7,97%, sendo assim o RPPS atingiu 97,47% da meta atuarial.

4. GERENCIAMENTO DE RISCO

4.1 RISCO DE CRÉDITO

Caso o RPPS detenha fundos com Crédito Privado, a análise do crédito será feita a parte através da análise de avaliação de risco cedida por empresas com sede no país e fornecidas pelo RPPS para a Kansai

4.2 RISCO DE MERCADO

4.2.1 VaR - VALUE AT RISK

O VaR representa o valor monetário das perdas no valor presente a que uma carteira está sujeita, a um determinado nível de confiança e dentro de um horizonte de tempo.

Fundo	Aplicação	VaR	VaR %
BB IRF-M1 TP	9.471.126,29	15.925,86	0,02%
BB IMA-B 5+	1.048.705,77	41.735,86	0,06%
BB RETORNO TOTAL	6.128.221,58	55.295,64	0,08%
BRASESCO PREMIUM	1.140.455,78	151,49	0,00%
BRASESCO IRF-M 1 TP	9.361.428,94	15.539,81	0,02%
CAIXA IRF-M1 TP	10.162.689,46	16.900,43	0,02%
CAIXA REF DI	10.643.994,05	3.257,49	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A	12.160.023,40	167.635,08	0,23%
SANTANDER ATIVO	3.330.043,27	20.394,59	0,03%
SICREDI LIQUIDEZ	3.236.248,50	374,74	0,00%
SICREDI IRF-M 1	357.643,71	563,08	0,00%
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.195.453,30	14.178,18	0,02%
NTN-B - 2024	1.818.461,15	0,00	0,00%
NTN-B - 2024	2.128.833,07	0,00	0,00%
CAIXA AÇÕES MULT.	308.776,01	26.616,93	0,04%
CAIXA BDR NÍVEL I	45.583,96	4.972,02	0,01%
Carteira	72.537.688,24	320.400,46	0,44%

4.2.2 ÍNDICE SHARPE

O Índice Sharpe é um indicador de performance que ajusta o retorno ao risco, ou seja, ele avalia se um determinado fundo de investimento apresenta uma rentabilidade ponderada ao risco que o investidor está exposto.

Fundo	Sharpe
BB IRF-M1 TP	0,00
BB IMA-B 5+	0,01
BB RETORNO TOTAL	0,00
BRASESCO PREMIUM	0,12
BRASESCO IRF-M 1 TP	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	0,00
CAIXA REF DI	0,02
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
SANTANDER ATIVO	-
SICREDI LIQUIDEZ	0,02
SICREDI IRF-M 1	0,01
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	0,00
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
CAIXA AÇÕES MULT.	-
CAIXA BDR NÍVEL I	-

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	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M1 TP	8.495.008,18	426.700,00	0,00	0,00	9.011.181,07	89.472,89	1,00%	-0,28%	-
BB IMA-B 5+	1.018.989,84	0,00	0,00	0,00	1.000.084,27	-18.905,57	-1,86%	-0,28%	-
BB RETORNO TOTAL	5.807.317,50	0,00	0,00	0,00	5.844.415,34	37.097,84	0,64%	-0,28%	-
BRADESCO PREMIUM	1.102.520,86	0,00	0,00	0,00	1.114.399,75	11.878,89	1,08%	-0,28%	-
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.940.853,22	0,00	0,00	0,00	9.033.320,49	92.467,27	1,03%	-0,28%	-
CAIXA IRF-M1 TP	9.831.635,47	0,00	0,00	0,00	9.933.064,99	101.429,52	1,03%	-0,28%	-
CAIXA REF DI	9.678.210,79	0,00	0,00	0,00	9.775.659,92	97.449,13	1,01%	-0,28%	-
CAIXA IDKA IPCA 2A	12.147.012,47	0,00	0,00	0,00	12.111.487,50	-35.524,97	-0,29%	-0,28%	-
SANTANDER ATIVO	3.242.183,30	0,00	0,00	0,00	3.262.602,04	20.418,74	0,63%	-0,28%	-
SICREDI LIQUIDEZ	3.132.575,90	0,00	0,00	0,00	3.164.788,78	32.212,88	1,03%	-0,28%	-
SICREDI IRF-M 1	345.636,20	0,00	0,00	0,00	349.343,34	3.707,14	1,07%	-0,28%	-
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.160.961,71	0,00	0,00	0,00	1.170.273,44	9.311,73	0,80%	-0,28%	-
NTN-B - 2024	1.861.627,95	0,00	0,00	0,00	1.870.364,85	8.736,90	0,47%	-0,28%	-
NTN-B - 2024	2.179.367,52	0,00	0,00	0,00	2.189.595,62	10.228,10	0,47%	-0,28%	-
CAIXA AÇÕES MULT.	276.757,47	0,00	0,00	0,00	290.892,47	14.135,00	5,11%	-0,28%	-
CAIXA BDR NIVEL I	47.656,22	0,00	0,00	0,00	51.410,12	3.753,90	7,88%	-0,28%	-
Carteira	69.268.314,60	426.700,00	0,00	0,00	70.172.883,99	477.869,39	0,69%	-0,28%	-



KANSASAI

CONSULTORES DE
VALORES MOBILIÁRIOS

4.1.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M1 TP	9.011.181,07	0,03%	20.720,78
BB IMA-B 5+	1.000.084,27	0,05%	37.325,79
BB RETORNO TOTAL	5.844.415,34	0,07%	47.053,29
BRADESCO PREMIUM	1.114.399,75	0,00%	296,13
BRADESCO IRF-M 1 TP	9.033.320,49	0,03%	20.571,48
CAIXA IRF-M1 TP	9.933.064,99	0,03%	22.493,41
CAIXA REF DI	9.775.659,92	0,01%	3.981,95
CAIXA IDKA IPCA 2A	12.111.487,50	0,24%	167.906,01
SANTANDER ATIVO	3.262.602,04	0,02%	14.118,03
SICREDI LIQUIDEZ	3.164.788,78	0,00%	1.043,90
SICREDI IRF-M 1	349.343,34	0,00%	728,59
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.170.273,44	0,00%	3.137,94
NTN-B - 2024	1.870.364,85	0,00%	0,00
NTN-B - 2024	2.189.595,62	0,00%	0,00
CAIXA AÇÕES MULT.	290.892,47	0,04%	25.366,77
CAIXA BDR NIVEL I	51.410,12	0,01%	5.975,54
Carteira	70.172.883,99	0,44%	308.307,64

4.1.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M1 TP	0,00
BB IMA-B 5+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BRADESCO PREMIUM	0,09
BRADESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA REF DI	-
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
SANTANDER ATIVO	-
SICREDI LIQUIDEZ	-
SICREDI IRF-M 1	0,00
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	-
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
CAIXA AÇÕES MULT.	-
CAIXA BDR NIVEL I	-

4.1.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IRF-M1 TP	9.011.181,07	12,84%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,18%
BB IMA-B 5+	1.000.084,27	1,43%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,13%
BB RETORNO TOTAL	5.844.415,34	8,33%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,18%
BRADESCO PREMIUM	1.114.399,75	1,59%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,02%
BRADESCO IRF-M 1 TP	9.033.320,49	12,87%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	1,65%
CAIXA IRF-M1 TP	9.933.064,99	14,16%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,20%
CAIXA REF DI	9.775.659,92	13,93%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,08%
CAIXA IDKA IPCA 2A	12.111.487,50	17,26%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,12%
SANTANDER ATIVO	3.262.602,04	4,65%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,92%
SICREDI LIQUIDEZ	3.164.788,78	4,51%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,34%
SICREDI IRF-M 1	349.343,34	0,50%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,10%
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.170.273,44	1,67%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,05%
NTN-B - 2024	1.870.364,85	2,67%	100%	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, a	-
NTN-B - 2024	2.189.595,62	3,12%	100%	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, a	-
CAIXA AÇÕES MULT.	290.892,47	0,41%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,04%
CAIXA BDR NÍVEL I	51.410,12	0,07%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III	0,00%

4.2. Agosto

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M1 TP	9.011.181,07	0,00	0,00	0,00	9.119.700,02	108.518,95	1,20%	0,05%	2621,07%
BB IMA-B 5+	1.000.084,27	0,00	0,00	0,00	1.024.555,32	24.471,05	2,45%	0,05%	5325,63%
BB RETORNO TOTAL	5.844.415,34	140.000,00	0,00	0,00	6.052.280,04	67.864,70	1,13%	0,05%	2468,18%
BRADESCO PREMIUM	1.114.399,75	0,00	0,00	0,00	1.127.879,44	13.479,69	1,21%	0,05%	2632,66%
BRADESCO IRF-M 1 TP	9.033.320,49	116.460,89	0,00	0,00	9.259.874,69	110.093,31	1,20%	0,05%	2618,82%
CAIXA IRF-M1 TP	9.933.064,99	0,00	0,00	0,00	10.053.324,15	120.259,16	1,21%	0,05%	2635,06%
CAIXA REF DI	9.775.659,92	315.949,24	0,00	0,00	10.208.068,34	116.459,18	1,15%	0,05%	2511,70%
CAIXA IDKA IPCA 2A	12.111.487,50	0,00	0,00	0,00	12.098.316,14	-13.171,36	-0,11%	0,05%	-236,69%
SANTANDER ATIVO	3.262.602,04	0,00	0,00	0,00	3.294.725,46	32.123,42	0,98%	0,05%	2142,95%
SICREDI LIQUIDEZ	3.164.788,78	0,00	0,00	0,00	3.201.783,84	36.995,06	1,17%	0,05%	2544,22%
SICREDI IRF-M 1	349.343,34	0,00	0,00	0,00	353.678,83	4.335,49	1,24%	0,05%	2701,10%
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.170.273,44	0,00	0,00	0,00	1.177.412,37	7.138,93	0,61%	0,05%	1327,70%
NTN-B - 2024	1.870.364,85	0,00	0,00	0,00	1.816.106,86	-54.257,99	-2,90%	0,05%	-6313,83%
NTN-B - 2024	2.189.595,62	0,00	0,00	0,00	2.126.076,96	-63.518,66	-2,90%	0,05%	-6313,83%
CAIXA AÇÕES MULT.	290.892,47	0,00	0,00	0,00	310.932,01	20.039,54	6,89%	0,05%	14993,76%
CAIXA BDR NÍVEL I	51.410,12	0,00	0,00	0,00	49.397,35	-2.012,77	-3,92%	0,05%	-8521,20%
Carteira	70.172.883,99	572.410,13	0,00	0,00	71.274.111,82	528.817,70	0,75%	0,05%	1626,91%

4.2.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M1 TP	9.119.700,02	0,02%	17.126,20
BB IMA-B 5+	1.024.555,32	0,06%	39.973,18
BB RETORNO TOTAL	6.052.280,04	0,07%	49.675,23
BRADESCO PREMIUM	1.127.879,44	0,00%	222,60
BRADESCO IRF-M 1 TP	9.259.874,69	0,02%	17.222,46
CAIXA IRF-M1 TP	10.053.324,15	0,03%	18.661,66
CAIXA REF DI	10.208.068,34	0,01%	3.880,14
CAIXA IDKA IPCA 2A	12.098.316,14	0,23%	162.178,94
SANTANDER ATIVO	3.294.725,46	0,02%	15.443,52
SICREDI LIQUIDEZ	3.201.783,84	0,00%	942,35
SICREDI IRF-M 1	353.678,83	0,00%	630,53
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.177.412,37	0,01%	8.666,52
NTN-B - 2024	1.816.106,86	0,00%	0,00
NTN-B - 2024	2.126.076,96	0,00%	0,00
CAIXA AÇÕES MULT.	310.932,01	0,04%	26.246,43
CAIXA BDR NÍVEL I	49.397,35	0,01%	5.667,89
Carteira	71.274.111,82	0,42%	300.058,84

4.2.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M1 TP	0,00
BB IMA-B 5+	0,00
BB RETORNO TOTAL	-
BRADESCO PREMIUM	0,00
BRADESCO IRF-M 1 TP	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	0,00
CAIXA REF DI	-
CAIXA IDKA IPCA 2A	0,01
SANTANDER ATIVO	0,00
SICREDI LIQUIDEZ	-
SICREDI IRF-M 1	0,00
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	0,01
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
CAIXA AÇÕES MULT.	-
CAIXA BDR NÍVEL I	-

4.2.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IRF-M1 TP	9.119.700,02	12,80%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,16%
BB IMA-B 5+	1.024.555,32	1,44%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,13%
BB RETORNO TOTAL	6.052.280,04	8,49%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,20%
BRADESCO PREMIUM	1.127.879,44	1,58%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,02%
BRADESCO IRF-M 1 TP	9.259.874,69	12,99%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	1,87%
CAIXA IRF-M1 TP	10.053.324,15	14,11%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,20%
CAIXA REF DI	10.208.068,34	14,32%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,07%
CAIXA IDKA IPCA 2A	12.098.316,14	16,97%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,12%
SANTANDER ATIVO	3.294.725,46	4,62%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,93%
SICREDI LIQUIDEZ	3.201.783,84	4,49%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,31%
SICREDI IRF-M 1	353.678,83	0,50%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,09%
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.177.412,37	1,65%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,05%
NTN-B - 2024	1.816.106,86	2,55%	100%	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, a	-
NTN-B - 2024	2.126.076,96	2,98%	100%	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, a	-
CAIXA AÇÕES MULT.	310.932,01	0,44%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,05%
CAIXA BDR NÍVEL I	49.397,35	0,07%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III	0,00%

4.3. Setembro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M1 TP	9.119.700,02	250.000,00	0,00	0,00	9.470.126,29	100.426,27	1,07%	0,12%	922,15%
BB IMA-B 5+	1.024.555,32	0,00	0,00	0,00	1.048.705,77	24.150,45	2,36%	0,12%	2028,00%
BB RETORNO TOTAL	6.052.280,04	0,00	0,00	0,00	6.128.221,58	75.941,54	1,25%	0,12%	1079,54%
BRADESCO PREMIUM	1.127.879,44	0,00	0,00	0,00	1.140.455,78	12.576,34	1,12%	0,12%	959,33%
BRADESCO IRF-M 1 TP	9.259.874,69	0,00	0,00	0,00	9.361.428,94	101.554,25	1,10%	0,12%	943,56%
CAIXA IRF-M1 TP	10.053.324,15	0,00	0,00	0,00	10.162.689,46	109.365,31	1,09%	0,12%	935,94%
CAIXA REF DI	10.208.068,34	321.891,51	0,00	0,00	10.643.994,05	114.034,20	1,08%	0,12%	931,72%
CAIXA IDKA IPCA 2A	12.098.316,14	0,00	0,00	0,00	12.160.023,40	61.707,26	0,51%	0,12%	438,82%
SANTANDER ATIVO	3.294.725,46	0,00	0,00	0,00	3.330.043,27	35.317,81	1,07%	0,12%	922,26%
SICREDI LIQUIDEZ	3.201.783,84	0,00	0,00	0,00	3.236.248,50	34.464,66	1,08%	0,12%	926,11%
SICREDI IRF-M 1	353.678,83	0,00	0,00	0,00	357.643,71	3.964,88	1,12%	0,12%	964,49%
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.177.412,37	0,00	0,00	0,00	1.195.453,30	18.040,93	1,53%	0,12%	1318,28%
NTN-B - 2024	1.816.106,86	0,00	0,00	0,00	1.818.461,15	2.354,29	0,13%	0,12%	111,53%
NTN-B - 2024	2.126.076,96	0,00	0,00	0,00	2.128.833,07	2.756,11	0,13%	0,12%	111,53%
CAIXA AÇÕES MULT.	310.932,01	0,00	0,00	0,00	308.776,01	-2.156,00	-0,69%	0,12%	-596,57%
CAIXA BDR NÍVEL I	49.397,35	0,00	0,00	0,00	45.583,96	-3.813,39	-7,72%	0,12%	-6641,80%
Carteira	71.274.111,82	571.891,51	0,00	0,00	72.536.688,24	690.684,91	0,96%	0,12%	827,10%

4.3.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IRF-M1 TP	9.470.126,29	0,02%	15.924,18
BB IMA-B-5+	1.048.705,77	0,06%	41.735,86
BB RETORNO TOTAL	6.128.221,58	0,08%	55.295,64
BRADESCO PREMIUM	1.140.455,78	0,00%	151,49
BRADESCO IRF-M 1 TP	9.361.428,94	0,02%	15.539,81
CAIXA IRF-M1 TP	10.162.689,46	0,02%	16.900,43
CAIXA REF DI	10.643.994,05	0,00%	3.257,49
CAIXA IDKA IPCA 2A	12.160.023,40	0,23%	167.635,08
SANTANDER ATIVO	3.330.043,27	0,03%	20.394,59
SICREDI LIQUIDEZ	3.236.248,50	0,00%	374,74
SICREDI IRF-M 1	357.643,71	0,00%	563,08
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.195.453,30	0,02%	14.178,18
NTN-B - 2024	1.818.461,15	0,00%	0,00
NTN-B - 2024	2.128.833,07	0,00%	0,00
CAIXA AÇÕES MULT.	308.776,01	0,04%	26.616,93
CAIXA BDR NÍVEL I	45.583,96	0,01%	4.972,02
Carteira	72.536.688,24	0,44%	320.399,24

4.3.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M1 TP	0,00
BB IMA-B-5+	0,01
BB RETORNO TOTAL	0,00
BRADESCO PREMIUM	0,12
BRADESCO IRF-M 1 TP	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	0,00
CAIXA REF DI	0,02
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
SANTANDER ATIVO	-
SICREDI LIQUIDEZ	0,02
SICREDI IRF-M 1	0,01
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	0,00
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
CAIXA AÇÕES MULT.	-
CAIXA BDR NÍVEL I	-

4.3.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IRF-M1 TP	9.470.126,29	13,06%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,16%
BB IMA-B 5+	1.048.705,77	1,45%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,13%
BB RETORNO TOTAL	6.128.221,58	8,45%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,20%
BRADESCO PREMIUM	1.140.455,78	1,57%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,02%
BRADESCO IRF-M 1 TP	9.361.428,94	12,91%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	1,74%
CAIXA IRF-M1 TP	10.162.689,46	14,01%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,19%
CAIXA REF DI	10.643.994,05	14,67%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,08%
CAIXA IDKA IPCA 2A	12.160.023,40	16,76%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,14%
SANTANDER ATIVO	3.330.043,27	4,59%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,96%
SICREDI LIQUIDEZ	3.236.248,50	4,46%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,28%
SICREDI IRF-M 1	357.643,71	0,49%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,10%
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.195.453,30	1,65%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,05%
NTN-B - 2024	1.818.461,15	2,51%	100%	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, a	-
NTN-B - 2024	2.128.833,07	2,93%	100%	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, a	-
CAIXA AÇÕES MULT.	308.776,01	0,43%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,05%
CAIXA BDR NÍVEL I	45.583,96	0,06%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III	0,00%

Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Janeiro	63.254.874,45	504.541,23	260.000,00	0,00	63.833.222,91	333.807,23	0,53%	0,95%	55,36%
Fevereiro	63.833.222,91	604.058,75	0,00	111.759,18	64.840.874,25	515.351,77	0,80%	1,42%	56,26%
Março	64.840.874,25	2.923.852,77	2.505.504,54	0,00	66.104.542,63	845.320,15	1,30%	2,03%	63,68%
Acumulado	63.254.874,45	4.032.452,75	2.765.504,54	111.759,18	66.104.542,63	1.694.479,15	2,64%	4,47%	59,15%

Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Abril	66.104.542,63	364.307,60	0,00	0,00	67.027.468,28	558.618,05	0,84%	1,47%	57,10%
Mai	67.027.468,28	623.565,07	116.667,60	0,00	68.187.285,67	652.919,92	0,97%	0,88%	109,95%
Junho	68.187.285,67	606.452,55	0,00	0,00	69.268.314,60	474.576,38	0,69%	1,08%	63,87%
Acumulado	66.104.542,63	1.594.325,22	116.667,60	0,00	69.268.314,60	1.686.114,35	2,52%	3,47%	72,56%

Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Julho	69.268.314,60	426.700,00	0,00	0,00	70.172.883,99	477.869,39	0,69%	-0,28%	-
Agosto	70.172.883,99	572.410,13	0,00	0,00	71.274.111,82	528.817,70	0,75%	0,05%	1626,91%
Setembro	71.274.111,82	571.891,51	0,00	0,00	72.536.688,24	690.684,91	0,96%	0,12%	827,10%
Acumulado	69.268.314,60	1.571.001,64	0,00	0,00	72.536.688,24	1.697.372,00	2,41%	-0,11%	-2124,98%



Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Janeiro	63.254.874,45	504.541,23	260.000,00	0,00	63.833.222,91	333.807,23	0,53%	0,95%	55,36%
Fevereiro	63.833.222,91	604.058,75	0,00	111.759,18	64.840.874,25	515.351,77	0,80%	1,42%	56,26%
Março	64.840.874,25	2.923.852,77	2.505.504,54	0,00	66.104.542,63	845.320,15	1,30%	2,03%	63,68%
Abril	66.104.542,63	364.307,60	0,00	0,00	67.027.468,28	558.618,05	0,84%	1,47%	57,10%
Maior	67.027.468,28	623.565,07	116.667,60	0,00	68.187.285,67	652.919,92	0,97%	0,88%	109,95%
Junho	68.187.285,67	606.452,55	0,00	0,00	69.268.314,60	474.576,38	0,69%	1,08%	63,87%
Julho	69.268.314,60	426.700,00	0,00	0,00	70.172.883,99	477.869,39	0,69%	-0,28%	-
Agosto	70.172.883,99	572.410,13	0,00	0,00	71.274.111,82	528.817,70	0,75%	0,05%	1626,91%
Setembro	71.274.111,82	571.891,51	0,00	0,00	72.536.688,24	690.684,91	0,96%	0,12%	827,10%
Acumulado	63.254.874,45	7.197.779,61	2.882.172,14	111.759,18	72.536.688,24	5.077.965,50	7,77%	7,97%	97,45%



KANSAI

CONSULTORES DE
VALORES MOBILIÁRIOS

**BURIPREV – Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do
Município de Buri - CNPJ: 02.922.449.0001/32**

Após análise minuciosa das documentações apresentadas, tais como laminas, resumo das aplicações financeiras mensal, do relatório trimestral completo contendo todas as informações relevantes de todos os fundos que compõe a carteira de investimento do BURIPREV, ficou apurado que tais fundos se encontram de acordo com todas as legislações pertinentes em que se refere a aplicações financeiras dos RPPSs. Após esse momento foram também apresentadas as APRs dos investimentos e desinvestimentos do órgão referente a este mesmo trimestre, sendo que tais documentos já são previamente analisados e aprovados por seus responsáveis, sendo que ficou também constatada a devida regularidade de tais peças. Em seguida o Sr. Paulo André Rocha Machado, mencionou sobre um aporte no valor de R\$ 2.300,000,00 (Dois milhões e trezentos mil reais) que foi aplicado no Fundo BB Vértice 2024, com CNPJ: 44.345.590-0001/60, sendo que tais valores foram sacados do fundo Santander renda Fixa Ativa da instituição Santander, CNPJ: 26.507.132/0001-06, sendo que tal aporte foi aprovado na reunião trimestral anterior. Após, o Sr. Mário Ferreira, membro do Comitê de Investimentos, usou a palavra e discorreu que devido a vários aspectos econômicos que precisam ser levados em consideração, este instituto precisa diversificar um pouco mais sua carteira de investimentos, uma vez que quanto maior a diversificação se corre menos riscos de mercado, sendo que essa diversificação precisa ser feita também com relação a instituições financeiras, uma vez que essas instituições assim como seus fundos poderão apresentar risco de crédito e diversificando minimiza-se maiores perdas. Então após algumas explicações e ponderações, o Sr. Mário propôs que os fundos que estão custodiados nas instituições Santander e Itaú, respectivamente nos fundos Santander renda Fixa Ativa e Itaú Institucional Alocação Dinâmica Renda Fixa, sejam alocados em fundos cujo benchmark seja o IPCA acrescidos de juros semestrais, nessas mesmas instituições, pois ambas se tratam de instituições sólidas e de grande confiança no mercado brasileiro. Sugeriu também que seja retirado o valor de R\$ 3.000.000,00 (três milhões de reais) do fundo CAIXA IDKA, CNPJ: 14.386.926/0001-71, e tais valores sejam enviados ao fundo dessa mesma instituição FI BRASIL 2024 VI TP RF, CNPJ: 22.791.074/0001-26. Após a explanação e sugestão do Sr. Mário, sendo colocado em

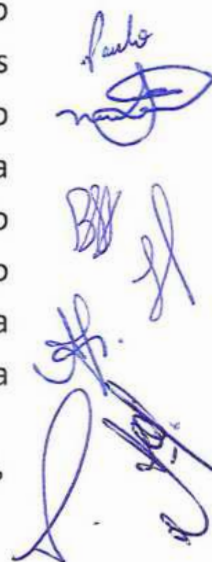
Rua São Roque, 47 - Centro - Buri/SP - CEP 18290-000 - Fone: (15) 3546-3250.



**BURIPREV – Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do
Município de Buri - CNPJ: 02.922.449.0001/32**



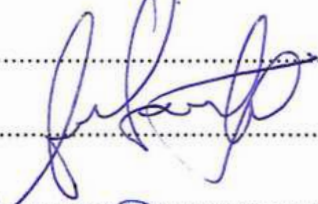
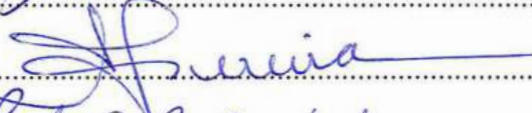
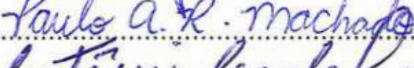
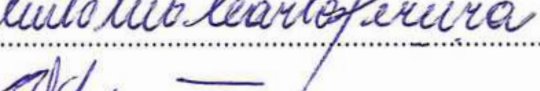
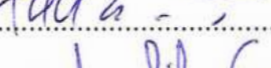
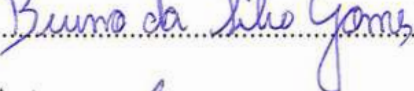
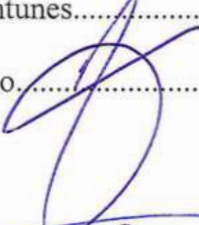
votação, tal sugestão foi aprovada por unanimidade pelos presentes. Logo após o presidente do instituto Sr. Marco comunicou que no último dia 04/07/2022, foi liberada a emissão do CRP (Certificado de Regularidade Previdenciária) pela Secretaria de Previdência Social (SPS), certidão esta que vinha sendo perseguida por este órgão a muitos anos e que agora pudemos ser contemplados com tal benefício que ajudará grandemente o ente em firmar convênios com a união e assim também sanar irregularidades que a muito tempo vinha sendo fruto de apontamentos pelo Tribunal de Contas do Estado de São Paulo. Em seguida tratou também sobre a certificação TOTUM, certificação essa em que todos os membros dos conselhos deste instituto deverão possuir a partir de abril de 2023 e, caso tais membros não venham conseguir a aprovação no exame de certificação, novamente este instituto deverá perder o CRP. Então para incentivar que tais membros consigam a aprovação junto a certificadora TOTUM, ficou tratado junto ao executivo municipal que será liberado uma gratificação em dinheiro a todos os membros que conseguirem a aprovação no exame. Após este momento, o Sr. presidente tratou também de um apontamento que foi registrado pelo TCESP, no sentido de que a empresa “Kansai” que é a responsável técnica pela análise profissional dos investimentos do BURIPREV, não possui mais o devido registro junto a CVM e assim não está apta em prestar tais serviços a este órgão de previdência, porém já entrou em contato com a empresa “Crédito e Mercado” que possui o devido registro, porém o senhor Mário fez uma ressalva de que tal empresa talvez não seja uma boa aquisição a este instituto neste momento, devido a um histórico recente que deu início a uma investigação da polícia federal junto a empresa “Plena investimentos”, denominada “Operação Miquéias”. Então assim o Sr. presidente deixou em aberto tal contratação. Em seguida foi verificado que durante este terceiro trimestre de dois mil e vinte e dois, os rendimentos do BURIPREV com relação à meta atuarial estipulada para o período, sendo que o retorno do trimestre foi de 2,41% (dois vírgula quarenta e um por cento) e a meta trimestral ficou em - 0,11% (negativo onze por cento); sendo que a rentabilidade média obtida no período fechou em 0,80% (zero vírgula oitenta por cento); sendo que assim a carteira de investimentos atual atingiu 97,47% (noventa e sete vírgula


Rua São Roque, 47 - Centro - Buri/SP - CEP 18290-000 - Fone: (15) 3546-3250.



**BURIPREV – Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do
Município de Buri - CNPJ: 02.922.449.0001/32**

quarenta e sete por cento) dessa meta. E não havendo nada mais a ser tratado, o presidente franqueou a palavra aos presentes e, não havendo demais assuntos, novamente agradeceu a presença de todos encerrando esta reunião ordinária e, que para constar, eu, Mário Ferreira, membro do Comitê de Investimentos deste instituto, redigi a presente ata que vai assinada por mim e pelos demais presentes.

1. Mário Ferreira.....
2. Lourdes Domingues.....
3. Maria Aparecida Vieira dos Santos.....
4. Taís Mara Costa Pires.....
5. Fernanda Almeida de Oliveira.....
6. Daiane Lopes fogaça Hamaué.....
7. Sueli Lopes Ferreira dos Santos.....
8. Tânia Aparecida Muniz.....
9. Aleonai Franco de Lima Pereira.....
10. Paulo André Rocha Machado.....
11. Antonio Carlos Pereira.....
12. Ronaldo Marcelino Teixeira.....
13. Bruno da Silva Gomes.....
14. Cláudio Silas Figueira Antunes.....
15. Nilton Batista Vieira Filho.....


Marco Antônio Lima
Presidente do BURIPREV


CONVOCAÇÃO PARA REUNIÃO

Eu, Marco Antônio Lima, Diretor Presidente do BURIPREV, (Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Buri), no uso de suas atribuições legais, vem respeitosamente através deste instrumento, convocar os (as) senhores (as), abaixo relacionados, (as), a comparecer na Sede do Buriprev, sito a Rua São Roque, 47 – centro, no dia 25/11/2022 (sexta feira) às 10 h, onde na ocasião será discutido sobre os investimentos e desinvestimentos referentes ao 3º trimestre de 2022 e outros assuntos de suma importância com relação a este órgão de Previdência.

- 1 – Sueli Lopes Ferreira dos Santos
- 2 – Maria Aparecida Vieira dos Santos.....
- 3 – Taís Mara da Costa Pires.....
- 4 – Fernanda Almeida Oliveira.....
- 5 – Daiane Lopes Fogaça Hamaue.....
- 6 – Tânia Aparecida Muniz.....
- 7 – Paulo André Rocha Machado.....
- 8 – Aleonai Franco de Lima Pereira.....
- 9 – Maria Eliete Uriazeniki Nogueira.....
- 10 – Antonio Carlos Pereira.....
- 11 – Bruno da Silva Gomes.....
- 12 – Cláudio Silas Figueira Antunes.....
- 13 – Ronaldo Marcelino Teixeira.....
- 14 – Lourdes Domingues.....
- 15 – Mário Ferreira.....
- 16 – Nilton Batista Vieira Filho.....

Sem mais no momento, grato pela atenção.

Buri (SP), 16 de novembro de 2022.


Marco Antônio Lima
Presidente

BURIPREV
Instituto de Previdência
dos Servidores Públicos
do Município de Buri

CNPJ 02.922.449/0001-32
Rua São Roque, 47 - Buri - SP
e-mail: ipasb@ipasb.sp.gov.br
Telefone: (15) 3546-3250