

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

**Ata número 02/2022 da reunião ordinária da Diretoria executiva, Comitê de investimentos e Conselhos de Administração e Fiscal do BURIPREV – Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Buri.**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL DE RENTABILIDADE E RISCOS DOS INVESTIMENTOS DE  
JANEIRO A MARÇO DE 2022**

Aos doze dias do mês de maio do ano de dois mil e vinte e dois, às quinze horas e trinta minutos, na Sala de Reuniões do Buriprev – Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Buri, sito a Rua São Roque, 47 - centro, nesta cidade de Buri, Estado de São Paulo, reuniu-se a Diretoria Executiva, o Comitê de Investimentos e os Conselhos de Administração e Fiscal do BURIPREV, conforme convocação do Diretor Presidente, senhor Marco Antônio Lima, feita no último dia 05 de maio de dois mil e vinte e dois, e em lista que foi devidamente assinada por todos os membros que foram localizados, e que segue anexo fazendo parte integrante desta ata. A presente reunião está sendo realizada com certo atraso devido às muitas dificuldades de reunir todos os membros, uma vez que nosso município se encontra num momento bastante turbulento, sendo gravemente assolado devido às complicações da pandemia do COVID 19. O Sr. Presidente abriu a presente reunião agradecendo a presença de todos, principalmente a nova integrante do Conselho de Administração Sra. Maria Aparecida Vieira dos Santos, e o Sr. Paulo André Rocha Machado, novo integrante do Comitê de Investimento. Passando para a ordem do dia, expondo aos presentes as APRs realizadas no ano de dois mil e vinte e dois, que já são alvo de pré-aprovação pelo órgão máximo da estrutura do BURIPREV através da PAI (Política Anual de Investimentos), deste mesmo ano e ainda pelo Comitê de investimentos que são comunicados previamente das necessidades de alocações, sendo que nas reuniões ordinárias mensais deliberam de forma mais aprofundada sobre as mesmas e ainda nas reuniões trimestrais, onde são expostas e aprovadas as devidas alocações; expôs também os balanços contábeis e as demonstrações financeiras do exercício de 2022, para apreciação. E sendo minuciosamente examinadas tais peças pelo colegiado deste órgão, ficou observada e constatada a devida regularidade em tais documentos e assim por unanimidade foram aprovadas tais peças apresentadas. Após este momento, o presidente tratou a respeito das dificuldades que temos encontrado em superar nossa meta atuarial num cenário tão negativo que o mundo tem vivido devido à crise que vem causando a atual pandemia; e ponderou que devemos manter as nossas atenções direcionadas tanto pra os dados macroeconômicos quanto para os

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

*[Handwritten signatures and initials in blue ink, including names like 'Lima', 'Rocha', and 'Vieira']*

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


noticiários envoltos aos conflitos entre Rússia e Ucrânia, ainda sem um claro cenário para futuros desfechos, além das tratativas americanas quanto as questões envolvendo os níveis globais do petróleo que, por sua vez, podem refletir significativamente na inflação e no desenvolvimento econômico interno e mundial. Após este momento foi tratado a respeito da aplicação que erroneamente o Banco Bradesco fez em um fundo não solicitado pelo Instituto e que assim que foi percebido o erro, imediatamente foi solicitado o estorno e a correção e assim ocorreu. Em seguida foi novamente exposto pelo sr. presidente a preocupação em superar nossa meta atuarial e solicitamos aos membros do COMIN presentes a análise e sugestões de fundos para que sejam realizados aportes. Em seguida o senhor presidente, 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 janeiro, fevereiro e março de 2022, como abaixo demonstrados:

*Paulo*

*Paulo*

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

noticiários envoltos aos conflitos entre Rússia e Ucrânia, ainda sem um claro cenário para futuros desfechos, além das tratativas americanas quanto as questões envolvendo os níveis globais do petróleo que, por sua vez, podem refletir significativamente na inflação e no desenvolvimento econômico interno e mundial. Após este momento foi tratado a respeito da aplicação que erroneamente o Banco Bradesco fez em um fundo não solicitado pelo Instituto e que assim que foi percebido o erro, imediatamente foi solicitado o estorno e a correção e assim ocorreu. Em seguida foi novamente exposto pelo sr. presidente a preocupação em superar nossa meta atuarial e solicitamos aos membros do COMIN presentes a análise e sugestões de fundos para que sejam realizados aportes e, por unanimidade ficou aprovada a proposição. Em seguida o senhor presidente, 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 janeiro, fevereiro e março de 2022, como abaixo demonstrados:



### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Janeiro/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1 TP	7.448.887,21	0,61%	0,95%	64,43%
BB IMA-B 5+	984.165,11	-1,63%	0,95%	-171,43%
BB RETORNO TOTAL	5.197.914,08	0,19%	0,95%	20,09%
BRADESCO PREMIUM	1.051.024,99	0,78%	0,95%	81,68%
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.464.205,95	0,62%	0,95%	64,94%
CAIXA IRF-M1 TP	9.433.406,40	0,61%	0,95%	64,13%
CAIXA REF DI	8.836.295,56	0,76%	0,95%	79,56%
CAIXA IDKA IPCA 2A	10.591.582,48	0,02%	0,95%	1,98%
SANTANDER ATIVO	3.117.986,33	0,32%	0,95%	34,20%
SICREDI IRF-M LP	2.077.965,42	-0,20%	0,95%	-21,47%
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.108.549,06	0,52%	0,95%	55,01%
NTN-B - 2024	1.784.276,37	1,18%	0,95%	124,67%
NTN-B - 2024	2.088.813,69	1,18%	0,95%	124,67%
CAIXA AÇÕES MULT.	318.308,48	5,72%	0,95%	602,47%
CAIXA BDR NÍVEL I	59.596,99	-9,75%	0,95%	-1026,32%
SICREDI LIQUIDEZ	941.904,55	0,76%	0,95%	80,25%
SICREDI SCHRODERS	328.340,24	11,24%	0,95%	1183,12%
TOTAL / MÉDIA	63.833.222,91	0,53%	0,95%	55,36%

### 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1 TP	11,67%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	1,54%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	8,14%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO PREMIUM	1,65%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO IRF-M 1 TP	13,26%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	14,78%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA REF DI	13,84%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IDKA IPCA 2A	16,59%	100%	Art. 7º, I, b
SANTANDER ATIVO	4,88%	20%	Art. 7º, III, a
SICREDI IRF-M LP	3,26%	20%	Art. 7º, III, a
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,74%	20%	Art. 7º, III, a
NTN-B - 2024	2,80%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,27%	100%	Art. 7º, I, a
CAIXA AÇÕES MULT.	0,50%	20%	Art. 8º, I
CAIXA BDR NÍVEL I	0,09%	10%	Art. 9º-A, III
SICREDI LIQUIDEZ	1,48%	20%	Art. 7º, III, a
SICREDI SCHRODERS	0,51%	20%	Art. 8º, I

### 3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,53%	0,95%	55,36%
Fevereiro			
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,53%	0,95%	55,36%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,53%, enquanto que a meta acumulada no período é de 0,95%, sendo assim o RPPS atingiu 55,36% 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	7.448.887,21	182.338,00	0,29%
BB IMA-B 5+	984.165,11	67.446,22	0,11%
BB RETORNO TOTAL	5.197.914,08	70.863,18	0,11%
BRADESCO PREMIUM	1.051.024,99	43.152,54	0,07%
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.464.205,95	208.597,99	0,33%
CAIXA IRF-M1 TP	9.433.406,40	235.006,94	0,37%
CAIXA REF DI	8.836.295,56	341.130,63	0,53%
CAIXA IDKA IPCA 2A	10.591.582,48	382.243,80	0,60%
SANTANDER ATIVO	3.117.986,33	13.356.509,16	20,92%
SICREDI IRF-M LP	2.077.965,42	52.056,49	0,08%
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.108.549,06	41.081,93	0,06%
NTN-B - 2024	1.784.276,37	0,00	0,00%
NTN-B - 2024	2.088.813,69	0,00	0,00%
CAIXA AÇÕES MULT.	318.308,48	40.562,44	0,06%
CAIXA BDR NÍVEL I	59.596,99	7.155,19	0,01%
SICREDI LIQUIDEZ	941.904,55	0,00	0,00%
SICREDI SCHRODERS	328.340,24	34.382,34	0,05%
Carteira	63.833.222,91	12.021.719,08	18,83%

##### 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	-
BB IMA-B 5+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BRADESCO PREMIUM	0,08
BRADESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA REF DI	0,02
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
SANTANDER ATIVO	-
SICREDI IRF-M LP	-
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	-
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
CAIXA AÇÕES MULT.	-
CAIXA BDR NÍVEL I	-
SICREDI LIQUIDEZ	0,06
SICREDI SCHRODERS	-

### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Fevereiro/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1 TP	7.704.624,80	0,73%	1,42%	51,26%
BB IMA-B 5+	983.959,62	-0,02%	1,42%	-1,47%
BB RETORNO TOTAL	5.232.686,48	0,67%	1,42%	47,06%
BRADESCO PREMIUM	1.059.732,12	0,83%	1,42%	58,28%
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.527.590,93	0,75%	1,42%	52,68%
CAIXA IRF-M1 TP	9.501.779,37	0,72%	1,42%	50,99%
CAIXA REF DI	9.313.057,01	0,79%	1,42%	55,35%
CAIXA IDKA IPCA 2A	10.712.988,58	1,15%	1,42%	80,64%
SANTANDER ATIVO	3.140.407,86	0,72%	1,42%	50,59%
SICREDI IRF-M LP	2.093.567,56	0,75%	1,42%	52,82%
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.118.842,27	0,93%	1,42%	65,32%
NTN-B - 2024	1.750.424,84	0,99%	1,42%	69,52%
NTN-B - 2024	2.049.184,44	0,99%	1,42%	69,53%
CAIXA AÇÕES MULT.	314.080,28	-1,33%	1,42%	-93,44%
CAIXA BDR NÍVEL I	55.355,57	-7,12%	1,42%	-500,65%
SICREDI LIQUIDEZ	949.348,76	0,79%	1,42%	55,60%
SICREDI SCHRODERS	333.243,76	1,49%	1,42%	105,06%
TOTAL / MÉDIA	64.840.874,25	0,80%	1,42%	56,26%

### 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1 TP	11,88%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	1,52%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	8,07%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO PREMIUM	1,63%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO IRF-M 1 TP	13,15%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	14,65%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA REF DI	14,36%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IDKA IPCA 2A	16,52%	100%	Art. 7º, I, b
SANTANDER ATIVO	4,84%	20%	Art. 7º, III, a
SICREDI IRF-M LP	3,23%	20%	Art. 7º, III, a
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,73%	20%	Art. 7º, III, a
NTN-B - 2024	2,70%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,16%	100%	Art. 7º, I, a
CAIXA AÇÕES MULT.	0,48%	20%	Art. 8º, I
CAIXA BDR NÍVEL I	0,09%	10%	Art. 9º-A, III
SICREDI LIQUIDEZ	1,46%	20%	Art. 7º, III, a
SICREDI SCHRODERS	0,51%	20%	Art. 8º, I

### 3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,53%	0,95%	55,36%
Fevereiro	0,80%	1,42%	56,26%
Março			
Abril			
Maió			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	1,33%	2,38%	55,76%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,33%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,38%, sendo assim o RPPS atingiu 55,76% 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	7.704.624,80	35.513,28	0,05%
BB IMA-B 5+	983.959,62	43.728,58	0,07%
BB RETORNO TOTAL	5.232.686,48	53.503,78	0,08%
BRADESCO PREMIUM	1.059.732,12	515,01	0,00%
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.527.590,93	39.360,55	0,06%
CAIXA IRF-M1 TP	9.501.779,37	43.656,60	0,07%
CAIXA REF DI	9.313.057,01	6.603,82	0,01%
CAIXA IDKA IPCA 2A	10.712.988,58	148.476,88	0,23%
SANTANDER ATIVO	3.140.407,86	25.493,23	0,04%
SICREDI IRF-M LP	2.093.567,56	44.817,33	0,07%
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.118.842,27	7.874,31	0,01%
NTN-B - 2024	1.750.424,84	0,00	0,00%
NTN-B - 2024	2.049.184,44	0,00	0,00%
CAIXA AÇÕES MULT.	314.080,28	32.572,93	0,05%
CAIXA BDR NÍVEL I	55.355,57	5.621,06	0,01%
SICREDI LIQUIDEZ	949.348,76	422,09	0,00%
SICREDI SCHRODERS	333.243,76	30.827,04	0,05%
Carteira	64.840.874,25	426.945,63	0,66%

##### 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	-
BB IMA-B 5+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BRADESCO PREMIUM	0,03
BRADESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA REF DI	0,02
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
SANTANDER ATIVO	-
SICREDI IRF-M LP	-
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	0,00
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
CAIXA AÇÕES MULT.	-
CAIXA BDR NÍVEL I	-
SICREDI LIQUIDEZ	0,02
SICREDI SCHRODERS	-

### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Março/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IRF-M1 TP	8.078.145,75	0,84%	2,03%	41,08%
BB IMA-B 5+	1.018.616,43	3,52%	2,03%	173,16%
BB RETORNO TOTAL	5.303.903,22	1,36%	2,03%	66,91%
BRADESCO PREMIUM	1.069.692,54	0,94%	2,03%	46,21%
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.602.086,74	0,87%	2,03%	42,95%
BRADESCO IMA-B TP	115.726,28	3,55%	2,03%	174,52%
CAIXA IRF-M1 TP	9.584.044,24	0,87%	2,03%	42,57%
CAIXA REF DI	9.399.440,90	0,93%	2,03%	45,60%
CAIXA IDKA IPCA 2A	10.994.361,60	2,63%	2,03%	129,13%
SANTANDER ATIVO	3.168.568,37	0,90%	2,03%	44,09%
SICREDI IRF-M LP	0,00	-0,66%	2,03%	-32,28%
SICREDI LIQUIDEZ	3.045.864,56	0,55%	2,03%	27,09%
SICREDI SCHRODERS	0,00	0,73%	2,03%	35,96%
SICREDI IRF-M 1	336.922,78	0,37%	2,03%	18,18%
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.131.857,25	1,16%	2,03%	57,19%
NTN-B - 2024	1.783.823,82	1,91%	2,03%	93,81%
NTN-B - 2024	2.088.283,91	1,91%	2,03%	93,81%
CAIXA AÇÕES MULT.	330.124,77	5,11%	2,03%	251,15%
CAIXA BDR NÍVEL I	53.079,47	-4,11%	2,03%	-202,15%
TOTAL / MÉDIA	66.104.542,63	1,30%	2,03%	63,68%

### 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IRF-M1 TP	12,22%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	1,54%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	8,02%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO PREMIUM	1,62%	20%	Art. 7º, III, a
BRADESCO IRF-M 1 TP	13,01%	100%	Art. 7º, I, b
BRADESCO IMA-B TP	0,18%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	14,50%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA REF DI	14,22%	20%	Art. 7º, III, a
CAIXA IDKA IPCA 2A	16,63%	100%	Art. 7º, I, b
SANTANDER ATIVO	4,79%	20%	Art. 7º, III, a
SICREDI IRF-M LP	0,00%	20%	Art. 7º, III, a
SICREDI LIQUIDEZ	4,61%	20%	Art. 7º, III, a
SICREDI SCHRODERS	0,00%	20%	Art. 8º, I
SICREDI IRF-M 1	0,51%	20%	Art. 7º, III, a
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1,71%	20%	Art. 7º, III, a
NTN-B - 2024	2,70%	100%	Art. 7º, I, a
NTN-B - 2024	3,16%	100%	Art. 7º, I, a
CAIXA AÇÕES MULT.	0,50%	20%	Art. 8º, I
CAIXA BDR NÍVEL I	0,08%	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			
Mai			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,64%	4,47%	59,15%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,64%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,47%, sendo assim o RPPS atingiu 59,15% 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	8.078.145,75	24.683,02	0,04%
BB IMA-B 5+	1.018.616,43	34.962,00	0,05%
BB RETORNO TOTAL	5.303.903,22	40.710,62	0,06%
BRADESCO PREMIUM	1.069.692,54	437,91	0,00%
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.602.086,74	26.136,68	0,04%
BRADESCO IMA-B TP	115.726,28	2.481,60	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	9.584.044,24	29.139,03	0,04%
CAIXA REF DI	9.399.440,90	5.319,11	0,01%
CAIXA IDKA IPCA 2A	10.994.361,60	132.949,86	0,20%
SANTANDER ATIVO	3.168.568,37	17.309,51	0,03%
SICREDI IRF-M LP	0,00	0,00	0,00%
SICREDI LIQUIDEZ	3.045.864,56	1.193,77	0,00%
SICREDI SCHRODERS	0,00	0,00	0,00%
SICREDI IRF-M 1	336.922,78	860,78	0,00%
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.131.857,25	4.188,38	0,01%
NTN-B - 2024	1.783.823,82	0,00	0,00%
NTN-B - 2024	2.088.283,91	0,00	0,00%
CAIXA AÇÕES MULT.	330.124,77	32.962,69	0,05%
CAIXA BDR NÍVEL I	53.079,47	5.771,97	0,01%
Carteira	66.104.542,63	292.645,94	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	-
BB IMA-B 5+	0,01
BB RETORNO TOTAL	0,01
BRADESCO PREMIUM	0,01
BRADESCO IRF-M 1 TP	-
BRADESCO IMA-B TP	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA REF DI	0,00
CAIXA IDKA IPCA 2A	0,02
SANTANDER ATIVO	0,00
SICREDI IRF-M LP	0,00
SICREDI LIQUIDEZ	-
SICREDI SCHRODERS	-
SICREDI IRF-M 1	0,00
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	0,02
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.



www.kansainvest.com.br  
dab@kansai.com.br  
Tel: (11) 3313 3530 / (11) 29710 1518  
Endereço: Luiz Adorno Perez, N. 339 - Bairro: Indaiá  
Bertoga / SP - CEP: 11750-000.

## 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.kansasast.com.br  
daudenh@kansasast.com.br  
Tel: (13) 3333.3530 / (13) 99710.1518  
Endereço: Luiz Alonso Perez, N° 339 - Bairro: Indaia -  
Bertogsa /Sp - CEP: 11.250-000.



#### 4.1. Janeiro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M1 TP	7.662.007,33	0,00	260.000,00	0,00	7.448.887,21	46.879,88	0,61%	0,95%	64,43%
BB IMA-B 5+	1.000.452,06	0,00	0,00	0,00	984.165,11	-16.286,95	-1,63%	0,95%	-171,43%
BB RETORNO TOTAL	5.188.015,84	0,00	0,00	0,00	5.197.914,08	9.898,24	0,19%	0,95%	20,09%
BRADESCO PREMIUM	1.042.935,81	0,00	0,00	0,00	1.051.024,99	8.089,18	0,78%	0,95%	81,68%
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.412.328,85	0,00	0,00	0,00	8.464.205,95	51.877,10	0,62%	0,95%	64,94%
CAIXA IRF-M1 TP	9.376.304,94	0,00	0,00	0,00	9.433.406,40	57.101,46	0,61%	0,95%	64,13%
CAIXA REF DI	8.265.499,25	504.541,23	0,00	0,00	8.836.295,56	66.255,08	0,76%	0,95%	79,56%
CAIXA IDKA IPCA 2A	10.589.590,29	0,00	0,00	0,00	10.591.582,48	1.992,19	0,02%	0,95%	1,98%
SANTANDER ATIVO	3.107.894,22	0,00	0,00	0,00	3.117.986,33	10.092,11	0,32%	0,95%	34,20%
SICREDI IRF-M LP	2.082.210,84	0,00	0,00	0,00	2.077.965,42	-4.245,42	-0,20%	0,95%	-21,47%
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.102.788,48	0,00	0,00	0,00	1.108.549,06	5.760,58	0,52%	0,95%	55,01%
NTN-B - 2024	1.763.399,21	0,00	0,00	0,00	1.784.276,37	20.877,16	1,18%	0,95%	124,67%
NTN-B - 2024	2.064.373,25	0,00	0,00	0,00	2.088.813,69	24.440,44	1,18%	0,95%	124,67%
CAIXA AÇÕES MULT.	301.083,16	0,00	0,00	0,00	318.308,48	17.225,32	5,72%	0,95%	602,47%
CAIXA BDR NÍVEL I	66.032,54	0,00	0,00	0,00	59.596,99	-6.435,55	-9,75%	0,95%	-1026,32%
SICREDI LIQUIDEZ	934.781,31	0,00	0,00	0,00	941.904,55	7.123,24	0,76%	0,95%	80,25%
SICREDI SCHROEDERS	295.177,07	0,00	0,00	0,00	328.340,24	33.163,17	11,24%	0,95%	1183,12%
Carteira	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%



**KANSAL**

www.kansalasset.com.br  
 d.audencir@kansalasset.com.br  
 Tel: (13) 3333.3530 / (13) 99210.1538  
 Endereço: Luiz Alonzo Perez, N° 339 - Bairro: Indaial -  
 Bertolona /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-M1 TP	7.448.887,21	0,29%	182.338,00
BB IMA-B 5+	984.165,11	0,11%	67.446,22
BB RETORNO TOTAL	5.197.914,08	0,11%	70.863,18
BRADESCO PREMIUM	1.051.024,99	0,07%	43.152,54
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.464.205,95	0,33%	208.597,99
CAIXA IRF-M1 TP	9.433.406,40	0,37%	235.006,94
CAIXA REF DI	8.836.295,56	0,53%	341.130,63
CAIXA IDKA IPCA 2A	10.591.582,48	0,60%	382.243,80
SANTANDER ATIVO	3.117.986,33	20,92%	13.356.509,16
SICREDI IRF-M LP	2.077.965,42	0,08%	52.056,49
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.108.549,06	0,06%	41.081,93
NTN-B - 2024	1.784.276,37	0,00%	0,00
NTN-B - 2024	2.088.813,69	0,00%	0,00
CAIXA AÇÕES MULT.	318.308,48	0,06%	40.562,44
CAIXA BDR NIVEL I	59.596,99	0,01%	7.155,19
SICREDI LIQUIDEZ	941.904,55	0,00%	0,00
SICREDI SCHROEDERS	328.340,24	0,05%	34.382,34
Carteira	63.833.222,91	18,83%	12.021.719,08

#### 4.1.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M1 TP	-
BB IMA-B 5+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BRADESCO PREMIUM	0,08
BRADESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA REF DI	0,02
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
SANTANDER ATIVO	-
SICREDI IRF-M LP	-
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	-
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
CAIXA AÇÕES MULT.	-
CAIXA BDR NIVEL I	-
SICREDI LIQUIDEZ	0,06
SICREDI SCHROEDERS	-



www.kansasaset.com.br  
 dtaudente@kansasaset.com.br  
 Tel: (13) 3313-3530 / (13) 99710.1518  
 Endereço: Luiz Alonzo Perez, N° 339 - Bairro: Indaial -  
 Bertogge / SP - CEP: 11250-000.

#### 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	7.448.887,21	11,67%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,15%
BB IMA-B 5+	984.165,11	1,54%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,10%
BB RETORNO TOTAL	5.197.914,08	8,14%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,12%
BRDESCO PREMIUM	1.051.024,99	1,65%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,03%
BRDESCO IRF-M 1 TP	8.464.205,95	13,26%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	1,29%
CAIXA IRF-M1 TP	9.433.406,40	14,78%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,15%
CAIXA REF DI	8.836.295,56	13,84%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,09%
CAIXA IDKA IPCA 2A	10.591.582,48	16,59%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,10%
SANTANDER ATIVO	3.117.986,33	4,88%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,46%
SICREDI IRF-M LP	2.077.965,42	3,26%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,67%
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.108.549,06	1,74%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,04%
NTN-B - 2024	1.784.276,37	2,80%	100%	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, a	-
NTN-B - 2024	2.088.813,69	3,27%	100%	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, a	-
CAIXA AÇÕES MULT.	318.308,48	0,50%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,04%
CAIXA BDR NÍVEL I	59.596,99	0,09%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III	0,00%
SICREDI LIQUIDEZ	941.904,55	1,48%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,17%
SICREDI SCHROEDERS	328.340,24	0,51%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,08%



www.kansalasset.com.br  
 dclaudenir@kansalasset.com.br  
 Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.1518  
 Endereço: Luiz Alonso Perez, N. 339 - Bairro: Indaia -  
 Bertoga / SP - CEP. 11250-000.

#### 4.2. Fevereiro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M1 TP	7.448.887,21	200.000,00	0,00	0,00	7.704.624,80	55.737,59	0,73%	1,42%	51,26%
BB IMA-B 5+	984.165,11	0,00	0,00	0,00	983.959,62	-205,49	-0,02%	1,42%	-1,47%
BB RETORNO TOTAL	5.197.914,08	0,00	0,00	0,00	5.232.686,48	34.772,40	0,67%	1,42%	47,06%
BRADESCO PREMIUM	1.051.024,99	0,00	0,00	0,00	1.059.732,12	8.707,13	0,83%	1,42%	58,28%
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.464.205,95	0,00	0,00	0,00	8.527.590,93	63.384,98	0,75%	1,42%	52,68%
CAIXA IRF-M1 TP	9.433.406,40	0,00	0,00	0,00	9.501.779,37	68.372,97	0,72%	1,42%	50,99%
CAIXA REF DI	8.836.295,56	404.058,75	0,00	0,00	9.313.057,01	72.702,70	0,79%	1,42%	55,35%
CAIXA IDKA IPCA 2A	10.591.582,48	0,00	0,00	0,00	10.712.988,58	121.406,10	1,15%	1,42%	80,64%
SANTANDER ATIVO	3.117.986,33	0,00	0,00	0,00	3.140.407,86	22.421,53	0,72%	1,42%	50,59%
SICREDI IRF-M LP	2.077.965,42	0,00	0,00	0,00	2.093.567,56	15.602,14	0,75%	1,42%	52,82%
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.108.549,06	0,00	0,00	0,00	1.118.842,27	10.293,21	0,93%	1,42%	65,32%
NTN-B - 2024	1.784.276,37	0,00	0,00	51.485,83	1.750.424,84	17.634,30	0,99%	1,42%	69,52%
NTN-B - 2024	2.088.813,69	0,00	0,00	60.273,35	2.049.184,44	20.644,10	0,99%	1,42%	69,53%
CAIXA AÇÕES MULT.	318.308,48	0,00	0,00	0,00	314.080,28	-4.228,20	-1,33%	1,42%	-93,44%
CAIXA BDR NIVEL I	59.596,99	0,00	0,00	0,00	55.355,57	-4.241,42	-7,12%	1,42%	-500,65%
SICREDI LIQUIDEZ	941.904,55	0,00	0,00	0,00	949.348,76	7.444,21	0,79%	1,42%	55,60%
SICREDI SCHROEDERS	328.340,24	0,00	0,00	0,00	333.243,76	4.903,52	1,49%	1,42%	105,06%
Carteira	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%



**KANSASAI**

www.kansasaset.com.br  
 claudenir@kansasaset.com.br  
 Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.1518  
 Endereço: Luiz Almino Perez, N° 339 - Bairro: Indaial -  
 Bertelga / 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-M1 TP	7.704.624,80	0,05%	35.513,28
BB IMA-B 5+	983.959,62	0,07%	43.728,58
BB RETORNO TOTAL	5.232.686,48	0,08%	53.503,78
BRADESCO PREMIUM	1.059.732,12	0,00%	515,01
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.527.590,93	0,06%	39.360,55
CAIXA IRF-M1 TP	9.501.779,37	0,07%	43.656,60
CAIXA REF DI	9.313.057,01	0,01%	6.603,82
CAIXA IDKA IPCA 2A	10.712.988,58	0,23%	148.476,88
SANTANDER ATIVO	3.140.407,86	0,04%	25.493,23
SICREDI IRF-M LP	2.093.567,56	0,07%	44.817,33
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.118.842,27	0,01%	7.874,31
NTN-B - 2024	1.750.424,84	0,00%	0,00
NTN-B - 2024	2.049.184,44	0,00%	0,00
CAIXA AÇÕES MULT.	314.080,28	0,05%	32.572,93
CAIXA BDR NÍVEL I	55.355,57	0,01%	5.621,06
SICREDI LIQUIDEZ	949.348,76	0,00%	422,09
SICREDI SCHROEDERS	333.243,76	0,05%	30.827,04
Carteira	64.840.874,25	0,66%	426.945,63

#### 4.2.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IRF-M1 TP	-
BB IMA-B 5+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BRADESCO PREMIUM	0,03
BRADESCO IRF-M 1 TP	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA REF DI	0,02
CAIXA IDKA IPCA 2A	-
SANTANDER ATIVO	-
SICREDI IRF-M LP	-
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	0,00
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
CAIXA AÇÕES MULT.	-
CAIXA BDR NÍVEL I	-
SICREDI LIQUIDEZ	0,02
SICREDI SCHROEDERS	-



**KANSASAI**

www.kansasaiasset.com.br  
 daudenir@kansasaiasset.com.br  
 Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.1518  
 Endereço: Luiz Alorno Perez, N° 339 - Bairro: Indaial -  
 Bertoglio / SP - CEP: 11250-000.

#### 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	7.704.624,80	11,88%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,15%
BB IMA-B 5+	983.959,62	1,52%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,11%
BB RETORNO TOTAL	5.232.686,48	8,07%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,13%
BRADESCO PREMIUM	1.059.732,12	1,63%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,02%
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.527.590,93	13,15%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	1,30%
CAIXA IRF-M1 TP	9.501.779,37	14,65%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,16%
CAIXA REF DI	9.313.057,01	14,36%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,09%
CAIXA IDKA IPÇA 2A	10.712.988,58	16,52%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,10%
SANTANDER ATIVO	3.140.407,86	4,84%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,58%
SICREDI IRF-M LP	2.093.567,56	3,23%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,67%
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.118.842,27	1,73%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,05%
NTN-B - 2024	1.750.424,84	2,70%	100%	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, a	-
NTN-B - 2024	2.049.184,44	3,16%	100%	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, a	-
CAIXA AÇÕES MULT.	314.080,28	0,48%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,04%
CAIXA BDR NÍVEL I	55.355,57	0,09%	10%	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III	0,00%
SICREDI LIQUIDEZ	949.348,76	1,46%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,17%
SICREDI SCHROEDERS	333.243,76	0,51%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,09%



## 4.3. Março

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IRF-M1 TP	7.704.624,80	396.589,05	90.000,00	0,00	8.078.145,75	66.931,90	0,84%	2,03%	41,08%
BB IMA-B 5+	983.959,62	0,00	0,00	0,00	1.018.616,43	34.656,81	3,52%	2,03%	173,16%
BB RETORNO TOTAL	5.232.686,48	0,00	0,00	0,00	5.303.903,22	71.216,74	1,36%	2,03%	66,91%
BRADESCO PREMIUM	1.059.732,12	0,00	0,00	0,00	1.069.692,54	9.960,42	0,94%	2,03%	46,21%
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.527.590,93	0,00	0,00	0,00	8.602.086,74	74.495,81	0,87%	2,03%	42,95%
BRADESCO IMA-B TP	0,00	111.759,18	0,00	0,00	115.726,28	3.967,10	3,55%	2,03%	174,52%
CAIXA IRF-M1 TP	9.501.779,37	0,00	0,00	0,00	9.584.044,24	82.264,87	0,87%	2,03%	42,57%
CAIXA REF DI	9.313.057,01	0,00	0,00	0,00	9.399.440,90	86.383,89	0,93%	2,03%	45,60%
CAIXA IDKA IPCA 2A	10.712.988,58	0,00	0,00	0,00	10.994.361,60	281.373,02	2,63%	2,03%	129,13%
SANTANDER ATIVO	3.140.407,86	0,00	0,00	0,00	3.168.568,37	28.160,51	0,90%	2,03%	44,09%
SICREDI IRF-M LP	2.093.567,56	0,00	2.079.823,14	0,00	0,00	-13.744,42	-0,66%	2,03%	-32,28%
SICREDI LIQUIDEZ	949.348,76	2.079.823,14	0,00	0,00	3.045.864,56	16.692,66	0,55%	2,03%	27,09%
SICREDI SCHROEDERS	333.243,76	0,00	0,00	0,00	0,00	2.437,64	0,73%	2,03%	35,96%
SICREDI IRF-M 1	0,00	335.681,40	0,00	0,00	336.922,78	1.241,38	0,37%	2,03%	18,18%
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.118.842,27	0,00	0,00	0,00	1.131.857,25	13.014,98	1,16%	2,03%	57,19%
NTN-B - 2024	1.750.424,84	0,00	0,00	0,00	1.783.823,82	33.398,98	1,91%	2,03%	93,81%
NTN-B - 2024	2.049.184,44	0,00	0,00	0,00	2.088.283,91	39.099,47	1,91%	2,03%	93,81%
CAIXA AÇÕES MULT.	314.080,28	0,00	0,00	0,00	330.124,77	16.044,49	5,11%	2,03%	251,15%
CAIXA BDR NÍVEL I	55.355,57	0,00	0,00	0,00	53.079,47	-2.276,10	-4,11%	2,03%	-202,15%
Carteira	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%



www.kansalasset.com.br  
daudemir@kansalasset.com.br  
Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.1518  
Endereço: Luit Alonzo Peres, N° 319 - Bairro: Indaial -  
Bertoga / 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-M1 TP	8.078.145,75	0,04%	24.683,02
BB IMA-B 5+	1.018.616,43	0,05%	34.962,00
BB RETORNO TOTAL	5.303.903,22	0,06%	40.710,62
BRADESCO PREMIUM	1.069.692,54	0,00%	437,91
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.602.086,74	0,04%	26.136,68
BRADESCO IMA-B TP	115.726,28	0,00%	2.481,60
CAIXA IRF-M1 TP	9.584.044,24	0,04%	29.139,03
CAIXA REF DI	9.399.440,90	0,01%	5.319,11
CAIXA IDKA IPCA 2A	10.994.361,60	0,20%	132.949,86
SANTANDER ATIVO	3.168.568,37	0,03%	17.309,51
SICREDI IRF-M LP	0,00	0,00%	0,00
SICREDI LIQUIDEZ	3.045.864,56	0,00%	1.193,77
SICREDI SCHRODERS	0,00	0,00%	0,00
SICREDI IRF-M 1	336.922,78	0,00%	860,78
ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.131.857,25	0,01%	4.188,38
NTN-B - 2024	1.783.823,82	0,00%	0,00
NTN-B - 2024	2.088.283,91	0,00%	0,00
CAIXA AÇÕES MULT.	330.124,77	0,05%	32.962,69
CAIXA BDR NIVEL I	53.079,47	0,01%	5.771,97
Carteira	66.104.542,63	0,44%	292.645,94

#### 4.3.2. Índice Sharpe

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



www.kansalstat.com.br  
 daudenir@kansalstat.com.br  
 Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.3538  
 Endereço: Luiz Alonso Perez, Nº 339 - Bairro: Indaial -  
 Barroiga /SP - CEP: 11250-000.



### 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	8.078.145,75	12,22%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,16%
BB IMA-B 5+	1.018.616,43	1,54%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,11%
BB RETORNO TOTAL	5.303.903,22	8,02%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,13%
BRADESCO PREMIUM	1.069.692,54	1,62%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,02%
BRADESCO IRF-M 1 TP	8.602.086,74	13,01%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	1,31%
BRADESCO IMA-B TP	115.726,28	0,18%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
CAIXA IRF-M1 TP	9.584.044,24	14,50%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,17%
CAIXA REF DI	9.399.440,90	14,22%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,08%
CAIXA IDKA IPCA 2A	10.994.361,60	16,63%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,10%
SANTANDER ATIVO	3.168.568,37	4,79%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,65%
SICREDI IRF-M LP	0,00	0,00%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	-
SICREDI LIQUIDEZ	3.045.864,56	4,61%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,47%
SICREDI SCHRODERS	0,00	0,00%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	-
SICREDI IRF-M 1	336.922,78	0,51%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,10%
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.131.857,25	1,71%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,05%
NTN-B - 2024	1.783.823,82	2,70%	100%	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, a	-
NTN-B - 2024	2.088.283,91	3,16%	100%	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) - Art. 7º, I, a	-
CAIXA AÇÕES MULT.	330.124,77	0,50%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,04%
CAIXA BDR NÍVEL I	53.079,47	0,08%	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%



www.kansasaset.com.br  
 daudenir@kansasaset.com.br  
 Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.1518  
 Endereço: Luiz Aloisio Peres, N.º 339 - Bairro: Indaial -  
 Betim/SP - CEP: 11290-000.


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

E não havendo nada mais a ser tratado, o presidente franqueou a palavra a todos os presentes e não havendo demais assuntos e ou questionamentos, novamente agradeceu a presença de todos, encerrando a presente reunião ordinária e, que para constar, eu, Marco Antônio Lima, presidente do BURIPREV, redigi a presente ata que vai assinada por mim e pelos demais presentes.

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

Sem mais no momento, grato pela atenção:

Buri (SP), 12 de maio de 2022.

  
\_\_\_\_\_  
Marco Antônio Lima  
Presidente

## CONVOCAÇÃO PARA REUNIÃO



**BURIPREV**

Instituto de Previdência  
dos Servidores Públicos  
do Município de Buri

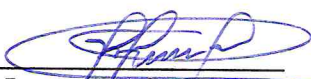
CNPJ 02.922.449/0001-32  
Rua São Roque, 47 - Buri - SP  
e-mail: ipasb@ipasb.sp.gov.br  
Telefone: (15) 3546-3250

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 **12/05/2022 (quinta feira) às 15:30 h**, onde na ocasião será discutido sobre os investimentos e desinvestimentos referentes ao 1º trimestre de 2022 e outros assuntos de suma importância com relação a este órgão de Previdência.

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

Sem mais no momento, grato pela atenção:

Buri (SP), 05 de maio de 2022.

  
**Marco Antônio Lima**  
Presidente