

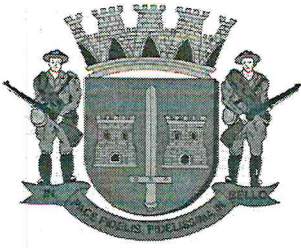
**BURIPREV - Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Buri - CNPJ: 02.922.449.0001/32**

Rua São Roque, 47 - Centro - Buri/SP - CEP: 18.290-000 - Fone: (15) 3546-3250
E-mail: ipasb@ipasb.sp.gov.br

Ata número 04/2022 da reunião ordinária do COMIN - Comitê de Investimentos do BURIPREV – Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Buri.

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS DE MARÇO DE 2022.

Aos quinze dias do mês de abril do ano de dois mil e vinte e dois, às quinze horas e trinta minutos, na sede do BURIPREV, sito a Rua São Roque, 47 nesta cidade de Buri, estado de São Paulo, reuniu-se o COMIN, Comitê de investimento do BURIPREV, conforme convocação do Presidente, Sr. Nilton Batista Vieira Filho, feita no último dia oito de abril 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 do COMIN abriu a presente reunião agradecendo a presença de todos, passou imediatamente a ordem do dia expondo aos presentes o relatório dos investimentos e desinvestimentos do BURIPREV e o resumo referente ao mês de março de dois mil e vinte e dois, conforme abaixo demonstrados:



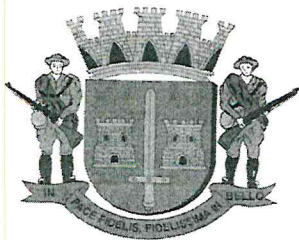
BURIPREV - Instituto de Previdência dos Servidores Públicos

do Município de Buri - CNPJ: 02.922.449.0001/32

Rua São Roque, 47 - Centro - Buri/SP - CEP: 18.290-000 - Fone: (15) 3546-3250

E-mail: ipasb@ipasb.sp.gov.br

Após a análise dos relatórios apresentados com relação ao gerenciamento de risco, VaR, risco de crédito, índice Sharpe, lâminas dos fundos, resumos e boletins, ficou verificado que a atual composição da carteira de investimentos do BURIPREV está de acordo com as normas legais vigentes. Em seguida o Sr. Presidente iniciou a presente reunião deliberando detalhadamente sobre a atual composição da carteira de investimentos conforme relatórios anexos, ficou constatado que todos os fundos se encontram devidamente enquadrados na resolução CMN 4604/2007, BC 4963/21, Portaria MPS 519/2011 e de acordo com a Política Anual de Investimentos (PAI). Após este momento, verificamos que os rendimentos da atual carteira de investimentos em média neste mês em questão, obtiveram rendimento positivo de 1,30% (um vírgula trinta por cento), sendo que a meta atuarial para o período foi de 2,03% (dois vírgula três por cento), onde se atingiu 63,68% (sessenta e três vírgula sessenta e oito por cento) dela. Nesse primeiro trimestre obtivemos a rentabilidade de 2,64% (dois vírgula sessenta e quatro por cento), sendo que a meta para este período foi de 4,47% (quatro vírgula quarenta e sete por cento), sendo assim atingimos apenas 59,15% (cinquenta e nove vírgula quinze por cento) dessa meta. Em seguida foram apresentadas as APRs do mês de março de dois mil e vinte e dois, que já são objetos de apreciação antecipada da parte deste Comitê, sendo que ficou também constatada a devida regularidade de tais peças. Também foi analisado os fundos BB RF IPCA - NTN-B com vencimento em 05/2023 que está pagando IPCA+6,43%aa e também o - BB RF Vértice XXI - NTN-B com vencimento em 08/2024 pagando IPCA+5,97%aa, os quais pareceram para este comitê, boas oportunidades para alocação de recursos do instituto. Logo, ficou decidido que esses fundos seriam apresentados como sugestão e pauta de discussão para próxima reunião deliberativa do instituto. Após este momento o Sr. presidente deixou espaço em aberto para demais questionamentos e, não havendo nada mais a ser tratado, novamente agradeceu a presença de todos, encerrando a reunião ordinária às dezessete horas, que para constar, eu, Nilton Batista Vieira Filho, membro do COMIN, redigi a presente ata que vai assinada por mim e pelos demais participantes.

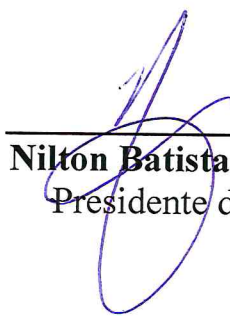


**BURIPREV - Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Buri - CNPJ: 02.922.449.0001/32**

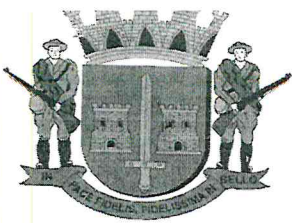
Rua São Roque, 47 - Centro - Buri/SP - CEP: 18.290-000 - Fone: (15) 3546-3250

E-mail: ipasb@ipasb.sp.gov.br

1. Mário Ferreira..... *Mário Ferreira*
2. Yuri Garcia Cordeiro de Lima..... *Yuri Garcia Cordeiro de Lima*



Nilton Batista Vieira Filho
Presidente do COMIN




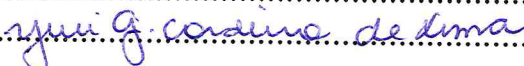
**BURIPREV - Instituto de Previdência dos Servidores Públicos
do Município de Buri - CNPJ: 02.922.449.0001/32**

Rua São Roque, 47 - Centro - Buri/SP - CEP: 18.290-000 - Fone: (15) 3546-3250

E-mail: ipasb@ipasb.sp.gov.br


CONVOCAÇÃO PARA REUNIÃO

Eu, Nilton Batista Vieira Filho, presidente do COMIN (Comitê de Investimentos) do BURIPREV, (Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Buri), no uso de suas atribuições legais, vem respeitosamente através dessa, convocar o (a) senhor (a), abaixo mencionados, a comparecer, na sede deste Instituto, sito à Rua São Roque, 47, centro, no dia **15/04/2022, (SEXTA-FEIRA) às 15:30 h.**, a fim de deliberar sobre assuntos referentes aos investimentos e desinvestimentos deste órgão.

1. Mário Ferreira.....
2. Yuri Garcia Cordeiro de Lima.....

Sem mais no momento, grato pela atenção:

Buri (SP), 08 de abril de 2022.



Nilton Batista Vieira Filho
Presidente do COMIN

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			
Maio			
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	-

REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA DO INSTITUTO DE PREVIDENCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BURI

Relatório Trimestral de Rentabilidade e Riscos dos Investimentos de Janeiro/2022 A Março/2022

Aos _____ de _____ de 2022, reuniu-se o Conselho do Regime Próprio de Previdência Social, os seguintes conselheiros:



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

O Presidente do RPPS: _____

Para em conjunto do cumprimento previsto no item V do Artigo 1º da Portaria MPS 519/2011 que em consonância com a Resolução CMN 3.922 de 25 de novembro de 2010, deliberam sobre a rentabilidade e riscos dos investimentos nos meses em questão:

1. RENTABILIDADE VERSUS META ATUARIAL

Comparativo da rentabilidade de cada fundo de investimento com a meta atuarial.

2. GERENCIAMENTO DE RISCO

Em atendimento a legislação em vigor o gerenciamento de risco é feita através de análises de risco de mercado. Para essa análise será utilizado os conceitos de VaR e Índice Sharpe.

2.1. VaR - Valor em risco dos investimentos

Considerando que os fatos do passado que interferiram na oscilação (volatilidade) das cotas se repitam no futuro, adicionamos como medida de perda esperada para o próximo período (um dia) o cálculo do VaR - Value at Risk.

O VaR é uma medida de risco absoluto bastante interessante, pois ilustra a perda “máxima” a ser incorrida em um dia com certa probabilidade, por outro lado deve ser sempre bem compreendido para que não seja exigido dele uma segurança, uma previsão de perda máxima efetiva, que ele não pode propiciar.



2.2. Índice Sharpe

O Índice Sharpe é o mais utilizado na análise de fundos de investimento. Ele avalia se um determinado fundo de investimento apresenta uma rentabilidade ponderada ao risco que o investidor está exposto, ou seja, quanto maior o retorno e menor o risco do investimento, melhor será o Índice Sharpe.

O Sharpe é calculado a partir de resultados obtidos pelo fundo num determinado período. Sendo assim ele mostra o passado do fundo. Mas ele é um bom indicativo de volatilidade futura.

O cálculo do Índice Sharpe é feito dividindo a média aritmética dos retornos excedentes oferecidos pelo fundo em certa periodicidade pelo desvio padrão desses retornos. O retorno excedente é a parcela do rendimento oferecido pelo fundo que ficou acima ou abaixo da rentabilidade de um indexador adotado que no caso de fundos de renda fixa seria o CDI e para fundos de renda variável o Ibovespa.

Quando a rentabilidade do fundo é menor que o indexador adotado o valor do Índice Sharpe será negativo e, portanto desconsiderado.

3. ENQUADRAMENTO

Verificar se a carteira de investimento do RPPS está de acordo com sua Política de Investimento e com os limites previstos da Resolução CMN 3922/10.

4. ANÁLISE DOS INVESTIMENTOS



www.kansaiasset.com.br -
claudenir@kansaiasset.com.br
Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.1518
Endereço: Luiz Alonso Perez, Nº 339 - Bairro: Indaiá -
Bertioga /SP -CEP: 11250-000.

4.1. 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%
ITAÚ 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 SCHRODERS	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%



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
ITAÚ 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 NÍVEL I	59.596,99	0,01%	7.155,19
SICREDI LIQUIDEZ	941.904,55	0,00%	0,00
SICREDI SCHRODERS	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	-
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	-
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
CAIXA AÇÕES MULT.	-
CAIXA BDR NÍVEL I	-
SICREDI LIQUIDEZ	0,06
SICREDI SCHRODERS	-



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%
BRADESCO PREMIUM	1.051.024,99	1,65%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,03%
BRADESCO 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%
ITAÚ 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 SCHRODERS	328.340,24	0,51%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,08%



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%
ITAÚ 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 NÍVEL 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 SCHRODERS	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%



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
ITAÚ 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 SCHRODERS	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	-
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	0,00
NTN-B - 2024	-
NTN-B - 2024	-
CAIXA AÇÕES MULT.	-
CAIXA BDR NÍVEL I	-
SICREDI LIQUIDEZ	0,02
SICREDI SCHRODERS	-



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 IPCA 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%
ITAÚ 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 SCHRODERS	333.243,76	0,00	335.681,40	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%
ITAÚ 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%



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
ITAÚ 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 NÍVEL 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
ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	0,02
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	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	Yeld	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.kansalasset.com.br -
claudenir@kansalasset.com.br
 Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.1518
 Endereço: Luiz Alonso Perez, Nº 339 - Bairro: Indaiá -
 Bertiooga /SP -CEP: 11250-000.

