

REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA DO INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA

Relatório Trimestral de Rentabilidade e Riscos dos Investimentos de Abril/2023 A Junho/2023

Aos 25 de julho de 2023, reuniu-se o Conselho do Regime Próprio de Previdência Social, os seguintes conselheiros:

MARIA DE FÁTIMA DUTRA ROMANO

JOSÉ BARBOSA BARROS

MARCELO ALVES DE FREITAS

ROBSON JESUS DA SILVA

GENY MARIA DAS GRAÇAS

LILIAN APARECIDA DE SOUZA

STHEFANE FRANCO ROSA

CÉSAR ALVES DA SILVA



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

A Presidente do RPPS: MARIA DE FÁTIMA DUTRA ROMANO

Para em conjunto do cumprimento previsto no item V do Artigo 1º da Portaria MPS 519/2011 que em consonância com a Resolução CMN 4.963 de 25 de novembro de 2021, deliberam sobre a rentabilidade e riscos dos investimentos nos meses em questão:

1. RENTABILIDADE VERSUS META ATUARIAL

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

2. GERENCIAMENTO DE RISCO

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

2.1. VaR - Valor em risco dos investimentos

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

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



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

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: Indalá -
Bertioga /SP -CEP: 11250-000.

4.1. Abril

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IMA-B	4.314.972,73	0,00	0,00	0,00	4.401.790,35	86.817,62	2,01%	0,99%	202,54%
BB IRF-M	1.608.996,95	0,00	0,00	0,00	1.626.299,22	17.302,27	1,08%	0,99%	108,25%
BB IPCA	1.825.819,35	0,00	0,00	0,00	1.843.178,48	17.359,13	0,95%	0,99%	95,71%
BB IMA-B 5+	3.810.673,16	0,00	0,00	0,00	3.924.967,12	114.293,96	3,00%	0,99%	301,92%
BB RETORNO TOTAL	3.701.274,56	0,00	0,00	0,00	3.748.298,95	47.024,39	1,27%	0,99%	127,89%
BB AÇÕES BOLSA	2.286.134,63	0,00	0,00	0,00	2.313.114,35	26.979,72	1,18%	0,99%	118,80%
BB AÇÕES AGRO	562.306,74	0,00	0,00	0,00	559.659,55	-2.647,19	-0,47%	0,99%	-47,39%
BB TECNOLOGIA	444.952,33	0,00	0,00	0,00	436.845,66	-8.106,67	-1,82%	0,99%	-183,40%
BB ENERGIA	416.091,63	15.447,23	0,00	0,00	457.466,75	25.927,89	6,01%	0,99%	604,81%
BB SMALL CAPS	452.155,49	0,00	0,00	0,00	460.609,98	8.454,49	1,87%	0,99%	188,22%
BB RETORNO AÇÕES	328.757,48	0,00	0,00	0,00	330.987,71	2.230,23	0,68%	0,99%	68,29%
BB CONSUMO	215.964,74	0,00	0,00	0,00	216.616,60	651,86	0,30%	0,99%	30,38%
BB SETOR FINANCEIRO	608.693,94	0,00	0,00	0,00	655.374,44	46.680,50	7,67%	0,99%	771,99%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	369.196,89	0,00	0,00	0,00	393.317,20	24.120,31	6,53%	0,99%	657,66%
CAIXA IRF-M	1.281.625,53	0,00	0,00	0,00	1.295.459,25	13.833,72	1,08%	0,99%	108,66%
CAIXA IRF-M1 TP	1.241.273,26	1.290.000,00	2.450.000,00	0,00	86.331,62	5.058,36	0,41%	0,99%	41,02%
CAIXA IMA-B 5+	3.455.420,81	0,00	0,00	0,00	3.558.197,13	102.776,32	2,97%	0,99%	299,41%
SICREDI IRF-M LP	1.679.775,86	0,00	4.895,60	0,00	1.697.694,41	22.814,15	1,36%	0,99%	136,72%
BI - MASSA FALIDA	207.497,38	0,00	0,00	0,00	207.667,74	170,36	0,08%	0,99%	8,26%
Carteira	28.811.583,46	1.305.447,23	2.454.895,60	0,00	28.213.876,51	551.741,42	1,91%	0,99%	192,77%



4.1.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IMA-B	4.401.790,35	0,35%	98.604,69
BB IRF-M	1.626.299,22	0,09%	24.716,27
BB IPCA	1.843.178,48	0,03%	8.023,47
BB IMA-B 5+	3.924.967,12	0,49%	137.997,93
BB RETORNO TOTAL	3.748.298,95	0,15%	42.201,66
BB AÇÕES BOLSA	2.313.114,35	0,59%	167.409,88
BB AÇÕES AGRO	559.659,55	0,15%	41.957,10
BB TECNOLOGIA	436.845,66	0,12%	34.498,05
BB ENERGIA	457.466,75	0,14%	38.327,90
BB SMALL CAPS	460.609,98	0,20%	55.734,24
BB RETORNO AÇÕES	330.987,71	0,11%	30.548,83
BB CONSUMO	216.616,60	0,10%	29.029,09
BB SETOR FINANCEIRO	655.374,44	0,29%	81.917,27
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	393.317,20	0,21%	58.714,26
CAIXA IRF-M	1.295.459,25	0,07%	19.558,86
CAIXA IRF-M1 TP	86.331,62	0,00%	188,63
CAIXA IMA-B 5+	3.558.197,13	0,44%	125.416,85
SICREDI IRF-M LP	1.697.694,41	0,09%	24.572,34
BI - MASSA FALIDA	207.667,74	0,00%	0,00
Carteira	28.213.876,51	2,58%	728.786,87

4.1.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IMA-B	0,01
BB IRF-M	0,01
BB IPCA	0,00
BB IMA-B 5+	0,02
BB RETORNO TOTAL	0,01
BB AÇÕES BOLSA	-
BB AÇÕES AGRO	-
BB TECNOLOGIA	-
BB ENERGIA	-
BB SMALL CAPS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB CONSUMO	-
BB SETOR FINANCEIRO	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	-
CAIXA IRF-M	0,01
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B 5+	0,02
SICREDI IRF-M LP	0,01
BI - MASSA FALIDA	-



4.1.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IMA-B	4.401.790,35	15,60%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,72%
BB IRF-M	1.626.299,22	5,76%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,04%
BB IPCA	1.843.178,48	6,53%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,04%
BB IMA-B 5+	3.924.967,12	13,91%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,52%
BB RETORNO TOTAL	3.748.298,95	13,29%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,06%
BB AÇÕES BOLSA	2.313.114,35	8,20%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,18%
BB AÇÕES AGRO	559.659,55	1,98%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,18%
BB TECNOLOGIA	436.845,66	1,55%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,11%
BB ENERGIA	457.466,75	1,62%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,18%
BB SMALL CAPS	460.609,98	1,63%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,17%
BB RETORNO AÇÕES	330.987,71	1,17%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,04%
BB CONSUMO	216.616,60	0,77%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,21%
BB SETOR FINANCEIRO	655.374,44	2,32%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,42%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	393.317,20	1,39%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,30%
CAIXA IRF-M	1.295.459,25	4,59%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,09%
CAIXA IRF-M1 TP	86.331,62	0,31%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,00%
CAIXA IMA-B 5+	3.558.197,13	12,61%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,36%
SICREDI IRF-M LP	1.697.694,41	6,02%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,52%
BI - MASSA FALIDA	207.667,74	0,74%	0%	Outros Ativos Não Enquadrados na Resolução CMN	-



4.2. Maio

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IMA-B	4.401.790,35	400.000,00	0,00	0,00	4.921.070,57	119.280,22	2,48%	0,61%	405,93%
BB IRF-M	1.626.299,22	500.000,00	0,00	0,00	2.166.567,70	40.268,48	1,89%	0,61%	309,47%
BB IPCA	1.843.178,48	0,00	1.854.924,42	0,00	0,00	11.745,94	0,64%	0,61%	104,14%
BB IMA-B 5+	3.924.967,12	400.000,00	0,00	0,00	4.491.470,65	166.503,53	3,85%	0,61%	629,10%
BB RETORNO TOTAL	3.748.298,95	400.000,00	0,00	0,00	4.221.841,33	73.542,38	1,77%	0,61%	289,70%
BB AÇÕES BOLSA	2.313.114,35	0,00	0,00	0,00	2.343.967,23	30.852,88	1,33%	0,61%	217,96%
BB AÇÕES AGRO	559.659,55	100.000,00	0,00	0,00	675.259,97	15.600,42	2,36%	0,61%	386,45%
BB TECNOLOGIA	436.845,66	0,00	0,00	0,00	491.729,41	54.883,75	12,56%	0,61%	2053,04%
BB ENERGIA	457.466,75	0,00	0,00	0,00	471.585,41	14.118,66	3,09%	0,61%	504,33%
BB SMALL CAPS	460.609,98	0,00	0,00	0,00	528.636,87	68.026,89	14,77%	0,61%	2413,40%
BB RETORNO AÇÕES	330.987,71	0,00	0,00	0,00	337.558,23	6.570,52	1,99%	0,61%	324,39%
BB CONSUMO	216.616,60	0,00	0,00	0,00	243.626,44	27.009,84	12,47%	0,61%	2037,57%
BB SETOR FINANCEIRO	655.374,44	15.447,23	0,00	0,00	706.587,04	35.765,37	5,33%	0,61%	871,24%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	393.317,20	0,00	0,00	0,00	458.156,54	64.839,34	16,49%	0,61%	2693,87%
CAIXA IRF-M	1.295.459,25	0,00	0,00	0,00	1.323.897,59	28.438,34	2,20%	0,61%	358,73%
CAIXA IRF-M1 TP	86.331,62	1.400.000,00	0,00	0,00	1.496.086,82	9.755,20	0,66%	0,61%	107,25%
CAIXA IMA-B 5+	3.558.197,13	0,00	0,00	0,00	3.699.984,74	141.787,61	3,98%	0,61%	651,16%
SICREDI IRF-M LP	1.691.942,61	0,00	0,00	0,00	1.729.678,25	37.735,64	2,23%	0,61%	364,46%
BI - MASSA FALIDA	207.667,74	0,00	0,00	0,00	208.113,60	445,86	0,21%	0,61%	35,08%
Carteira	28.208.124,71	3.215.447,23	1.854.924,42	0,00	30.515.818,39	947.170,87	3,20%	0,61%	523,45%



4.2.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IMA-B	4.921.070,57	0,32%	96.540,16
BB IRF-M	2.166.567,70	0,09%	28.619,69
BB IPCA		0,00%	0,00
BB IMA-B 5+	4.491.470,65	0,46%	140.214,06
BB RETORNO TOTAL	4.221.841,33	0,14%	41.333,05
BB AÇÕES BOLSA	2.343.967,23	0,51%	156.743,82
BB AÇÕES AGRO	675.259,97	0,16%	47.692,69
BB TECNOLOGIA	491.729,41	0,13%	41.087,76
BB ENERGIA	471.585,41	0,12%	35.787,16
BB SMALL CAPS	528.636,87	0,20%	61.022,85
BB RETORNO AÇÕES	337.558,23	0,10%	29.635,12
BB CONSUMO	243.626,44	0,10%	29.908,72
BB SETOR FINANCEIRO	706.587,04	0,26%	80.199,39
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	458.156,54	0,20%	61.071,78
CAIXA IRF-M	1.323.897,59	0,06%	17.486,93
CAIXA IRF-M1 TP	1.496.086,82	0,01%	3.143,94
CAIXA IMA-B 5+	3.699.984,74	0,38%	115.103,92
SICREDI IRF-M LP	1.729.678,25	0,07%	21.955,38
BI - MASSA FALIDA	208.113,60	0,00%	0,00
Carteira	30.515.818,39	2,33%	711.037,01

4.2.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IMA-B	0,02
BB IRF-M	0,02
BB IPCA	0,01
BB IMA-B 5+	0,02
BB RETORNO TOTAL	0,02
BB AÇÕES BOLSA	-
BB AÇÕES AGRO	-
BB TECNOLOGIA	-
BB ENERGIA	-
BB SMALL CAPS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB CONSUMO	-
BB SETOR FINANCEIRO	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	-
CAIXA IRF-M	0,02
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B 5+	0,02
SICREDI IRF-M LP	0,02
BI - MASSA FALIDA	-



4.2.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IMA-B	4.921.070,57	16,13%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,74%
BB IRF-M	2.166.567,70	7,10%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%
BB IPCA	0,00	0,00%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	-
BB IMA-B 5+	4.491.470,65	14,72%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,52%
BB RETORNO TOTAL	4.221.841,33	13,83%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,07%
BB AÇÕES BOLSA	2.343.967,23	7,68%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,19%
BB AÇÕES AGRO	675.259,97	2,21%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,21%
BB TECNOLOGIA	491.729,41	1,61%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,11%
BB ENERGIA	471.585,41	1,55%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,19%
BB SMALL CAPS	528.636,87	1,73%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,17%
BB RETORNO AÇÕES	337.558,23	1,11%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,04%
BB CONSUMO	243.626,44	0,80%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,21%
BB SETOR FINANCEIRO	706.587,04	2,32%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,43%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	458.156,54	1,50%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,30%
CAIXA IRF-M	1.323.897,59	4,34%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,11%
CAIXA IRF-M1 TP	1.496.086,82	4,90%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,02%
CAIXA IMA-B 5+	3.699.984,74	12,12%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,33%
SICREDI IRF-M LP	1.729.678,25	5,67%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,48%
BI - MASSA FALIDA	208.113,60	0,68%	0%	Outros Ativos Não Enquadrados na Resolução CMN	-



4.3. Junho

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IMA-B	4.921.070,57	0,00	0,00	0,00	5.038.499,11	117.428,54	2,39%	0,30%	793,37%
BB IRF-M	2.166.567,70	0,00	0,00	0,00	2.211.907,99	45.340,29	2,09%	0,30%	695,78%
BB IMA-B 5+	4.491.470,65	0,00	0,00	0,00	4.639.994,99	148.524,34	3,31%	0,30%	1099,44%
BB RETORNO TOTAL	4.221.841,33	0,00	0,00	0,00	4.298.009,13	76.167,80	1,80%	0,30%	599,83%
BB AÇÕES BOLSA	2.343.967,23	0,00	0,00	0,00	2.465.570,73	121.603,50	5,19%	0,30%	1724,87%
BB AÇÕES AGRO	675.259,97	0,00	0,00	0,00	714.781,04	39.521,07	5,85%	0,30%	1945,90%
BB TECNOLOGIA	491.729,41	0,00	0,00	0,00	513.087,51	21.358,10	4,34%	0,30%	1444,10%
BB ENERGIA	471.585,41	0,00	0,00	0,00	515.153,57	43.568,16	9,24%	0,30%	3071,64%
BB SMALL CAPS	528.636,87	0,00	0,00	0,00	576.912,42	48.275,55	9,13%	0,30%	3036,21%
BB RETORNO AÇÕES	337.558,23	0,00	0,00	0,00	362.525,89	24.967,66	7,40%	0,30%	2459,18%
BB CONSUMO	243.626,44	15.447,23	0,00	0,00	282.646,11	23.572,44	9,10%	0,30%	3025,12%
BB SETOR FINANCEIRO	706.587,04	0,00	0,00	0,00	776.976,29	70.389,25	9,96%	0,30%	3312,09%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	458.156,54	0,00	0,00	0,00	501.313,31	43.156,77	9,42%	0,30%	3131,82%
CAIXA IRF-M	1.323.897,59	0,00	1.150.000,00	0,00	178.624,38	4.726,79	0,36%	0,30%	118,71%
CAIXA IRF-M1 TP	1.496.086,82	360.000,00	1.250.000,00	0,00	624.588,51	18.501,69	1,24%	0,30%	411,17%
CAIXA IMA-B 5+	3.699.984,74	840.000,00	0,00	0,00	4.679.603,10	139.618,36	3,08%	0,30%	1022,47%
SICREDI IRF-M LP	1.729.678,25	0,00	0,00	0,00	1.766.130,19	36.451,94	2,11%	0,30%	700,68%
BI - MASSA FALIDA	208.113,60	0,00	0,00	0,00	208.488,00	374,40	0,18%	0,30%	59,81%
Carteira	30.515.818,39	1.215.447,23	2.400.000,00	0,00	30.354.812,27	1.023.546,65	3,35%	0,30%	1115,18%



www.kansaiasset.com.br -
 claudenir@kansaiasset.com.br
 Tel: (13) 3313.3530 / (13) 99710.1518
 Endereço: Luiz Alonso Perez, Nº 339 - Bairro: Indaiá -
 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 IMA-B	5.038.499,11	0,31%	94.339,82
BB IRF-M	2.211.907,99	0,08%	25.741,09
BB IMA-B 5+	4.639.994,99	0,44%	134.283,95
BB RETORNO TOTAL	4.298.009,13	0,13%	39.118,54
BB AÇÕES BOLSA	2.465.570,73	0,52%	157.631,10
BB AÇÕES AGRO	714.781,04	0,18%	53.188,24
BB TECNOLOGIA	513.087,51	0,14%	42.667,70
BB ENERGIA	515.153,57	0,14%	41.295,42
BB SMALL CAPS	576.912,42	0,22%	66.873,45
BB RETORNO AÇÕES	362.525,89	0,10%	31.237,28
BB CONSUMO	282.646,11	0,12%	34.965,31
BB SETOR FINANCEIRO	776.976,29	0,27%	83.088,22
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	501.313,31	0,22%	66.774,14
CAIXA IRF-M	178.624,38	0,01%	2.081,00
CAIXA IRF-M1 TP	624.588,51	0,00%	1.215,29
CAIXA IMA-B 5+	4.679.603,10	0,44%	133.814,30
SICREDI IRF-M LP	1.766.130,19	0,07%	20.048,55
BI - MASSA FALIDA	208.488,00	0,00%	0,00
Carteira	30.354.812,27	2,40%	727.862,73

4.3.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IMA-B	0,01
BB IRF-M	0,02
BB IMA-B 5+	0,01
BB RETORNO TOTAL	0,01
BB AÇÕES BOLSA	-
BB AÇÕES AGRO	-
BB TECNOLOGIA	-
BB ENERGIA	-
BB SMALL CAPS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB CONSUMO	-
BB SETOR FINANCEIRO	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	-
CAIXA IRF-M	0,02
CAIXA IRF-M1 TP	0,01
CAIXA IMA-B 5+	0,01
SICREDI IRF-M LP	0,02
BI - MASSA FALIDA	#N/D



4.3.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IMA-B	5.038.499,11	16,60%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,67%
BB IRF-M	2.211.907,99	7,29%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,05%
BB IMA-B 5+	4.639.994,99	15,29%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,39%
BB RETORNO TOTAL	4.298.009,13	14,16%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,08%
BB AÇÕES BOLSA	2.465.570,73	8,12%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,20%
BB AÇÕES AGRO	714.781,04	2,35%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,21%
BB TECNOLOGIA	513.087,51	1,69%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,11%
BB ENERGIA	515.153,57	1,70%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,19%
BB SMALL CAPS	576.912,42	1,90%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,17%
BB RETORNO AÇÕES	362.525,89	1,19%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,04%
BB CONSUMO	282.646,11	0,93%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,23%
BB SETOR FINANCEIRO	776.976,29	2,56%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,44%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	501.313,31	1,65%	20%	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	0,28%
CAIXA IRF-M	178.624,38	0,59%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	624.588,51	2,06%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	4.679.603,10	15,42%	100%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, b	0,38%
SICREDI IRF-M LP	1.766.130,19	5,82%	20%	Renda fixa conforme CVM - Art. 7º, III, a	0,43%
BI - MASSA FALIDA	208.488,00	0,69%	0%	Outros Ativos Não Enquadrados na Resolução CMN	-



Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Janeiro	26.844.843,53	918.502,03	80.000,00	0,00	27.934.293,92	250.948,36	0,91%	0,92%	98,20%
Fevereiro	27.934.293,92	1.454.582,61	1.250.000,00	0,00	28.110.565,12	-28.311,41	-0,10%	1,22%	-8,22%
Março	28.110.565,12	1.315.447,23	1.191.350,00	0,00	28.811.583,46	576.921,11	2,04%	1,09%	186,81%
Acumulado	26.844.843,53	3.688.531,87	2.521.350,00	0,00	28.811.583,46	799.558,06	2,87%	3,26%	87,78%

Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Abril	28.811.583,46	1.305.447,23	2.454.895,60	0,00	28.208.124,71	545.989,62	1,90%	0,99%	190,76%
Mai	28.208.124,71	3.215.447,23	1.854.924,42	0,00	30.515.818,39	947.170,87	3,20%	0,61%	523,45%
Junho	30.515.818,39	1.215.447,23	2.400.000,00	0,00	30.354.812,27	1.023.546,65	3,35%	0,30%	1115,18%
Acumulado	28.811.583,46	5.736.341,69	6.709.820,02	0,00	30.354.812,27	2.516.707,14	8,69%	1,91%	454,19%



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

Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yeld	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Janeiro	26.844.843,53	918.502,03	80.000,00	0,00	27.934.293,92	250.948,36	0,91%	0,92%	98,20%
Fevereiro	27.934.293,92	1.454.582,61	1.250.000,00	0,00	28.110.565,12	-28.311,41	-0,10%	1,22%	-8,22%
Março	28.110.565,12	1.315.447,23	1.191.350,00	0,00	28.811.583,46	576.921,11	2,04%	1,09%	186,81%
Abril	28.811.583,46	1.305.447,23	2.454.895,60	0,00	28.208.124,71	545.989,62	1,90%	0,99%	190,76%
Mai	28.208.124,71	3.215.447,23	1.854.924,42	0,00	30.515.818,39	947.170,87	3,20%	0,61%	523,45%
Junho	30.515.818,39	1.215.447,23	2.400.000,00	0,00	30.354.812,27	1.023.546,65	3,35%	0,30%	1115,18%
Acumulado	26.844.843,53	9.424.873,56	9.231.170,02	0,00	30.354.812,27	3.316.265,20	11,81%	5,24%	225,28%



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

OBSERVAÇÕES:



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

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

MARIA DE FÁTIMA DUTRA ROMANO

JOSÉ BARBOSA BARROS

MARCELO ALVES DE FREITAS

ROBSON JESUS DA SILVA

GENY MARIA DAS GRAÇAS

LILIAN APARECIDA DE SOUZA

STHEFANE FRANCO ROSA

CÉSAR ALVES DA SILVA



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