

REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA DO INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE IBIRAÇU -
IPRESI

Relatório Trimestral de Rentabilidade e Riscos dos Investimentos de Outubro/2021 A Dezembro/2021

Aos 11 de abril de 2022, reuniu-se o Conselho do Regime Próprio de Previdência Social, os seguintes conselheiros:

Sabrela Gomes Botom Rombaridi

Janaina Sarcinelli Tenaset

Therese Rompinelli

Helena Nova Mendes Piel

Celivana Fioratti

Priscia Romi Pignatone

Buanna Mattiuzzi Bedoni

O Presidente do RPPS: _____

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

1. RENTABILIDADE VERSUS META ATUARIAL

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

2. GERENCIAMENTO DE RISCO

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

2.1. VaR - Valor em risco dos investimentos

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

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

2.2. Índice Sharpe

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

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

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

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

3. ENQUADRAMENTO

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

4. ANÁLISE DOS INVESTIMENTOS

4.1. Outubro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IMA-B TP	2.965.933,68	0,00	0,00	0,00	2.889.347,15	-76.586,53	-2,58%	1,70%	-152,30%
BB IRF-M1 TP	4.245.499,57	0,00	0,00	0,00	4.223.476,36	-22.023,21	-0,52%	1,70%	-30,59%
BB FLUXO	602.256,23	0,00	0,00	0,00	604.655,76	2.399,53	0,40%	1,70%	23,50%
BB FLUXO	98,63	0,00	0,00	0,00	99,03	0,40	0,41%	1,70%	23,92%
BANESTES IMA-B	428.679,35	0,00	0,00	0,00	415.272,35	-13.407,00	-3,13%	1,70%	-184,46%
BANESTES IMA-B	984.491,05	0,00	0,00	0,00	953.700,97	-30.790,08	-3,13%	1,70%	-184,46%
BANESTES INSTITUCIONAL	412.251,49	0,00	0,00	0,00	402.247,98	-10.003,51	-2,43%	1,70%	-143,12%
BANESTES INSTITUCIONAL	1.241.623,07	0,00	0,00	0,00	1.211.494,38	-30.128,69	-2,43%	1,70%	-143,12%
BANESTES LIQUIDEZ	1.012.943,12	0,00	0,00	0,00	1.018.169,16	5.226,04	0,52%	1,70%	30,43%
BANESTES LIQUIDEZ	229.705,56	0,00	0,00	0,00	230.890,68	1.185,12	0,52%	1,70%	30,43%
BANESTES IRF-M 1	850.114,80	0,00	0,00	0,00	851.321,63	1.206,83	0,14%	1,70%	8,37%
BANESTES IRF-M 1	2.263.839,81	0,00	0,00	0,00	2.267.053,57	3.213,76	0,14%	1,70%	8,37%
BANESTES BTG PACTUAL	181.300,25	0,00	0,00	0,00	157.730,50	-23.569,75	-13,00%	1,70%	-766,75%
BANESTES AUTOMATICO	88.496,24	871.362,99	426.975,75	0,00	533.926,46	1.042,98	0,20%	1,70%	11,54%
BANESTES AUTOMATICO	164,17	0,00	0,00	0,00	164,66	0,49	0,30%	1,70%	17,60%
CAIXA DISPONIBILIDADES	10.010,70	0,00	9.834,04	0,00	190,20	13,54	0,14%	1,70%	7,98%
CAIXA IRF-M1 TP	1.055.915,61	0,00	0,00	0,00	1.050.259,41	-5.656,20	-0,54%	1,70%	-31,59%
CAIXA NOVO IMA-B-LP	1.753.961,48	0,00	0,00	0,00	1.709.174,29	-44.787,19	-2,55%	1,70%	-150,60%
CAIXA REF DI	694.153,35	0,00	0,00	0,00	697.643,80	3.490,45	0,50%	1,70%	29,66%
CAIXA IRF-M 1+	2.867.973,33	0,00	0,00	0,00	2.767.788,31	-100.185,02	-3,49%	1,70%	-206,03%
Carteira	21.889.411,49	871.362,99	436.809,79	0,00	21.984.606,65	-339.358,04	-1,52%	1,70%	-89,66%

4.1.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IMA-B TP	2.889.347,15	0,36%	80.027,93
BB IRF-M1 TP	4.223.476,36	0,08%	16.603,89
BB FLUXO	604.655,76	0,00%	164,94
BB FLUXO	99,03	0,00%	0,03
BANESTES IMA-B	415.272,35	0,07%	15.090,52
BANESTES IMA-B	953.700,97	0,16%	34.656,41
BANESTES INSTITUCIONAL	402.247,98	0,06%	13.216,75
BANESTES INSTITUCIONAL	1.211.494,38	0,18%	39.806,33
BANESTES LIQUIDEZ	1.018.169,16	0,00%	1.040,19
BANESTES LIQUIDEZ	230.890,68	0,00%	235,88
BANESTES IRF-M 1	851.321,63	0,01%	2.903,44
BANESTES IRF-M 1	2.267.053,57	0,04%	7.731,81
BANESTES BTG PACTUAL	157.730,50	0,08%	17.380,44
BANESTES AUTOMATICO	533.926,46	0,00%	113,84
BANESTES AUTOMATICO	164,66	0,00%	0,04
CAIXA DISPONIBILIDADES	190,20	0,00%	0,04
CAIXA IRF-M1 TP	1.050.259,41	0,02%	4.104,82
CAIXA NOVO IMA-B LP	1.709.174,29	0,21%	47.226,53
CAIXA REF DI	697.643,80	0,00%	570,88
CAIXA IRF-M 1+	2.767.788,31	0,31%	69.247,05
Carteira	21.984.606,65	1,42%	311.834,84

4.1.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IMA-B TP	-
BB IRF-M1 TP	-
BB FLUXO	-
BB FLUXO	-
BANESTES IMA-B	-
BANESTES IMA-B	-
BANESTES INSTITUCIONAL	-
BANESTES INSTITUCIONAL	-
BANESTES LIQUIDEZ	0,01
BANESTES LIQUIDEZ	0,01
BANESTES IRF-M 1	-
BANESTES IRF-M 1	-
BANESTES BTG PACTUAL	-
BANESTES AUTOMATICO	-
BANESTES AUTOMATICO	-
CAIXA DISPONIBILIDADES	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA REF DI	0,00
CAIXA IRF-M 1+	-

4.1.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IMA-B TP	2.889.347,15	13,14%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,04%
BB IRF-M1 TP	4.223.476,36	19,21%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,06%
BB FLUXO	604.655,76	2,75%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,02%
BB FLUXO	99,03	0,00%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BANESTES IMA-B	415.272,35	1,89%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,19%
BANESTES IMA-B	953.700,97	4,34%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,43%
BANESTES INSTITUCIONAL	402.247,98	1,83%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,18%
BANESTES INSTITUCIONAL	1.211.494,38	5,51%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,56%
BANESTES LIQUIDEZ	1.018.169,16	4,63%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,04%
BANESTES LIQUIDEZ	230.890,68	1,05%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
BANESTES IRF-M 1	851.321,63	3,87%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,32%
BANESTES IRF-M 1	2.267.053,57	10,31%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,86%
BANESTES BTG PACTUAL	157.730,50	0,72%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,09%
BANESTES AUTOMATICO	533.926,46	2,43%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,06%
BANESTES AUTOMATICO	164,66	0,00%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
CAIXA DISPONIBILIDADES	190,20	0,00%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	1.050.259,41	4,78%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%
CAIXA NOVO IMA-B LP	1.709.174,29	7,77%	20%	FI Renda Fixa "Referenciado" - Art. 7º, III, a	0,07%
CAIXA REF DI	697.643,80	3,17%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
CAIXA IRF-M 1+	2.767.788,31	12,59%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,20%

4.2. Novembro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IMA-B TP	2.889.347,15	0,00	0,00	0,00	2.988.750,79	99.403,64	3,44%	1,39%	246,76%
BB IRF-M1 TP	4.223.476,36	0,00	0,00	0,00	4.256.116,81	32.640,45	0,77%	1,39%	55,43%
BB FLUXO	604.655,76	0,00	0,00	0,00	607.711,75	3.055,99	0,51%	1,39%	36,25%
BB FLUXO	99,03	0,00	0,00	0,00	99,53	0,50	0,50%	1,39%	36,21%
BANESTES IMA-B	415.272,35	0,00	0,00	0,00	428.719,43	13.447,08	3,24%	1,39%	232,26%
BANESTES IMA-B	953.700,97	0,00	0,00	0,00	984.583,10	30.882,13	3,24%	1,39%	232,26%
BANESTES INSTITUCIONAL	402.247,98	0,00	0,00	0,00	414.990,41	12.742,43	3,17%	1,39%	227,21%
BANESTES INSTITUCIONAL	1.211.494,38	0,00	0,00	0,00	1.249.872,18	38.377,80	3,17%	1,39%	227,21%
BANESTES LIQUIDEZ	1.018.169,16	0,00	0,00	0,00	1.024.997,06	6.827,90	0,67%	1,39%	48,10%
BANESTES LIQUIDEZ	230.890,68	0,00	0,00	0,00	232.439,05	1.548,37	0,67%	1,39%	48,10%
BANESTES IRF-M 1	851.321,63	0,00	0,00	0,00	856.303,06	4.981,43	0,59%	1,39%	41,97%
BANESTES IRF-M 1	2.267.053,57	340.000,00	0,00	0,00	2.621.163,67	14.110,10	0,54%	1,39%	38,82%
BANESTES BTG PACTUAL	157.730,50	0,00	0,00	0,00	147.230,05	-10.500,45	-6,66%	1,39%	-477,49%
BANESTES AUTOMATICO	533.926,46	288.004,76	751.937,50	0,00	71.965,12	1.971,40	0,37%	1,39%	26,48%
BANESTES AUTOMATICO	164,66	0,00	0,00	0,00	165,31	0,65	0,39%	1,39%	28,31%
CAIXA DISPONIBILIDADES	190,20	20.000,00	9.933,97	0,00	10.304,82	48,59	0,47%	1,39%	33,98%
CAIXA IRF-M1 TP	1.050.259,41	0,00	0,00	0,00	1.058.452,14	8.192,73	0,78%	1,39%	55,95%
CAIXA NOVO IMA-B LP	1.709.174,29	0,00	0,00	0,00	1.767.326,64	58.152,35	3,40%	1,39%	244,04%
CAIXA REF DI	697.643,80	0,00	0,00	0,00	701.985,60	4.341,80	0,62%	1,39%	44,64%
CAIXA IRF-M 1 +	2.767.788,31	0,00	0,00	0,00	2.828.437,57	60.649,26	2,19%	1,39%	157,17%
Carteira	21.984.606,65	648.004,76	761.871,47	0,00	22.251.614,09	380.874,15	1,73%	1,39%	124,26%

4.2.1. VaR

Nome do Fundo	Saldo no Mês	VaR (%) de 1 mês	VaR (R\$) de 1 mês
BB IMA-B TP	2.988.750,79	0,63%	140.301,46
BB IRF-M1 TP	4.256.116,81	0,15%	33.575,01
BB FLUXO	607.711,75	0,01%	2.499,11
BB FLUXO	99,53	0,00%	0,41
BANESTES IMA-B	428.719,43	0,10%	22.763,33
BANESTES IMA-B	984.583,10	0,23%	52.277,51
BANESTES INSTITUCIONAL	414.990,41	0,09%	19.830,60
BANESTES INSTITUCIONAL	1.249.872,18	0,27%	59.726,00
BANESTES LIQUIDEZ	1.024.997,06	0,03%	5.584,75
BANESTES LIQUIDEZ	232.439,05	0,01%	1.266,46
BANESTES IRF-M 1	856.303,06	0,02%	4.993,19
BANESTES IRF-M 1	2.621.163,67	0,07%	15.284,27
BANESTES BTG PACTUAL	147.230,05	0,10%	21.185,18
BANESTES AUTOMATICO	71.965,12	0,00%	230,47
BANESTES AUTOMATICO	165,31	0,00%	0,53
CAIXA DISPONIBILIDADES	10.304,82	0,00%	39,91
CAIXA IRF-M1 TP	1.058.452,14	0,04%	8.393,10
CAIXA NOVO IMA-B LP	1.767.326,64	0,37%	82.682,28
CAIXA REF DI	701.985,60	0,02%	3.633,35
CAIXA IRF-M 1+	2.828.437,57	0,43%	95.838,86
Carteira	22.251.614,09	2,33%	518.021,18

4.2.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IMA-B TP	0,01
BB IRF-M1 TP	0,01
BB FLUXO	-
BB FLUXO	-
BANESTES IMA-B	0,01
BANESTES IMA-B	0,01
BANESTES INSTITUCIONAL	0,01
BANESTES INSTITUCIONAL	0,01
BANESTES LIQUIDEZ	0,02
BANESTES LIQUIDEZ	0,02
BANESTES IRF-M 1	-
BANESTES IRF-M 1	-
BANESTES BTG PACTUAL	-
BANESTES AUTOMATICO	-
BANESTES AUTOMATICO	-
CAIXA DISPONIBILIDADES	-
CAIXA IRF-M1 TP	0,01
CAIXA NOVO IMA-B LP	0,01
CAIXA REF DI	0,01
CAIXA IRF-M 1+	0,01

4.2.3. Enquadramento

Nome do Futuro	Saldo Mes Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IMA-B TP	2.988.750,79	13,43%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,04%
BB IRF-M1 TP	4.256.116,81	19,13%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,06%
BB FLUXO	607.711,75	2,73%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,02%
BB FLUXO	99,53	0,00%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BANESTES IMA-B	428.719,43	1,93%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,21%
BANESTES IMA-B	984.583,10	4,42%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,48%
BANESTES INSTITUCIONAL	414.990,41	1,86%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,19%
BANESTES INSTITUCIONAL	1.249.872,18	5,62%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,56%
BANESTES LIQUIDEZ	1.024.997,06	4,61%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,04%
BANESTES LIQUIDEZ	232.439,05	1,04%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
BANESTES IRF-M 1	856.303,06	3,85%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,30%
BANESTES IRF-M 1	2.621.163,67	11,78%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,93%
BANESTES BTG PACTUAL	147.230,05	0,66%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,09%
BANESTES AUTOMATICO	71.965,12	0,32%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
BANESTES AUTOMATICO	165,31	0,00%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
CAIXA DISPONIBILIDADES	10.304,82	0,05%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	1.058.452,14	4,76%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%
CAIXA NOVO IMA-B LP	1.767.326,64	7,94%	20%	FI Renda Fixa "Referenciado" - Art. 7º, III, a	0,07%
CAIXA REF DI	701.985,60	3,15%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
CAIXA IRF-M 1+	2.828.437,57	12,71%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,23%

4.3. Dezembro

Nome do Fundo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
BB IMA-B TP	2.988.750,79	0,00	0,00	0,00	2.994.829,45	6.078,66	0,20%	1,17%	17,34%
BB IRF-M1 TP	4.256.116,81	0,00	0,00	0,00	4.292.055,29	35.938,48	0,84%	1,17%	71,97%
BB FLUXO	607.711,75	0,00	0,00	0,00	611.778,98	4.067,23	0,67%	1,17%	57,04%
BB FLUXO	99,53	0,00	0,00	0,00	100,19	0,66	0,66%	1,17%	56,52%
BANESTES IMA-B	428.719,43	0,00	0,00	0,00	429.009,61	290,18	0,07%	1,17%	5,77%
BANESTES IMA-B	984.583,10	0,00	0,00	0,00	985.249,52	666,42	0,07%	1,17%	5,77%
BANESTES INSTITUCIONAL	414.990,41	0,00	0,00	0,00	416.754,46	1.764,05	0,43%	1,17%	36,23%
BANESTES INSTITUCIONAL	1.249.872,18	0,00	0,00	0,00	1.255.185,15	5.312,97	0,43%	1,17%	36,23%
BANESTES LIQUIDEZ	1.024.997,06	0,00	0,00	0,00	1.033.108,69	8.111,63	0,79%	1,17%	67,45%
BANESTES LIQUIDEZ	232.439,05	0,00	0,00	0,00	234.278,52	1.839,47	0,79%	1,17%	67,45%
BANESTES IRF-M 1	856.303,06	0,00	0,00	0,00	863.110,06	6.807,00	0,79%	1,17%	67,76%
BANESTES IRF-M 1	2.621.163,67	0,00	0,00	0,00	2.642.000,08	20.836,41	0,79%	1,17%	67,76%
BANESTES BTG PACTUAL	147.230,05	0,00	0,00	0,00	146.252,39	-977,66	-0,66%	1,17%	-56,60%
BANESTES AUTOMATICO	71.965,12	584.108,47	202.144,43	0,00	455.493,44	1.564,28	0,34%	1,17%	29,37%
BANESTES AUTOMATICO	165,31	0,00	0,00	0,00	166,18	0,87	0,53%	1,17%	44,86%
CAIXA DISPONIBILIDADES	10.304,82	25.000,00	9.740,76	0,00	25.753,96	189,90	0,74%	1,17%	63,32%
CAIXA IRF-M1 TP	1.058.452,14	0,00	0,00	0,00	1.067.433,64	8.981,50	0,85%	1,17%	72,33%
CAIXA NOVO IMA-B LP	1.767.326,64	0,00	0,00	0,00	1.771.235,78	3.909,14	0,22%	1,17%	18,85%
CAIXA REF DI	701.985,60	0,00	0,00	0,00	707.282,02	5.296,42	0,75%	1,17%	64,31%
CAIXA IRF-M 1 +	2.828.437,57	0,00	0,00	0,00	2.892.572,12	64.134,55	2,27%	1,17%	193,27%
Carteira	22.251.614,09	609.108,47	211.885,19	0,00	22.823.649,53	174.812,16	0,77%	1,17%	65,79%

4.3.1. Var

Nome do Fundo	Saldo no Mês	Var (%) de 1 mês	Var (R\$) de 1 mês
BB IMA-B TP	2.994.829,45	0,40%	92.241,38
BB IRF-M1 TP	4.292.055,29	0,08%	18.318,89
BB FLUXO	611.778,98	0,00%	263,30
BB FLUXO	100,19	0,00%	0,04
BANESTES IMA-B	429.009,61	0,07%	16.426,58
BANESTES IMA-B	985.249,52	0,17%	37.724,74
BANESTES INSTITUCIONAL	416.754,46	0,06%	13.937,09
BANESTES INSTITUCIONAL	1.255.185,15	0,18%	41.975,85
BANESTES LÍQUIDEZ	1.033.108,69	0,00%	984,49
BANESTES LÍQUIDEZ	234.278,52	0,00%	223,25
BANESTES IRF-M 1	863.110,06	0,01%	2.213,74
BANESTES IRF-M 1	2.642.000,08	0,03%	6.776,31
BANESTES BTG PACTUAL	146.252,39	0,09%	19.470,59
BANESTES AUTOMÁTICO	455.493,44	0,00%	163,77
BANESTES AUTOMÁTICO	166,18	0,00%	0,06
CAIXA DISPONIBILIDADES	25.753,96	0,00%	9,56
CAIXA IRF-M1 TP	1.067.433,64	0,02%	4.541,05
CAIXA NOVO IMA-B LP	1.771.235,78	0,24%	54.752,45
CAIXA REF DI	707.282,02	0,00%	578,58
CAIXA IRF-M 1+	2.892.572,12	0,34%	78.565,45
Carteira	22.823.649,53	1,51%	345.644,36

4.3.2. Índice Sharpe

Nome do Fundos	Índice Sharpe
BB IMA-B TP	-
BB IRF-M1 TP	0,00
BB FLUXO	-
BB FLUXO	-
BANESTES IMA-B	-
BANESTES IMA-B	-
BANESTES INSTITUCIONAL	-
BANESTES INSTITUCIONAL	-
BANESTES LÍQUIDEZ	0,01
BANESTES LÍQUIDEZ	0,01
BANESTES IRF-M 1	0,00
BANESTES IRF-M 1	0,00
BANESTES BTG PACTUAL	-
BANESTES AUTOMÁTICO	-
BANESTES AUTOMÁTICO	-
CAIXA DISPONIBILIDADES	-
CAIXA IRF-M1 TP	0,00
CAIXA NOVO IMA-B LP	-
CAIXA REF DI	-
CAIXA IRF-M 1+	0,01

4.3.3. Enquadramento

Nome do Fundo	Saldo Mês Atual	% do PL do RPPS	Limite Resolução	Enquadramento	% do PL do Fundo
BB IMA-B TP	2.994.829,45	13,12%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,04%
BB IRF-M1 TP	4.292.055,29	18,81%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,07%
BB FLUXO	611.778,98	2,68%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,02%
BB FLUXO	100,19	0,00%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
BANESTES IMA-B	429.009,61	1,88%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,21%
BANESTES IMA-B	985.249,52	4,32%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,49%
BANESTES INSTITUCIONAL	416.754,46	1,83%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,19%
BANESTES INSTITUCIONAL	1.255.185,15	5,50%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,56%
BANESTES LIQUIDEZ	1.033.108,69	4,53%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,04%
BANESTES LIQUIDEZ	234.278,52	1,03%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
BANESTES IRF-M 1	863.110,06	3,78%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,33%
BANESTES IRF-M 1	2.642.000,08	11,58%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	1,01%
BANESTES BTG PACTUAL	146.252,39	0,64%	20%	FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a	0,09%
BANESTES AUTOMATICO	455.493,44	2,00%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,05%
BANESTES AUTOMATICO	166,18	0,00%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
CAIXA DISPONIBILIDADES	25.753,96	0,11%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	1.067.433,64	4,68%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,02%
CAIXA NOVO IMA-B LP	1.771.235,78	7,76%	20%	FI Renda Fixa "Referenciado" - Art. 7º, III, a	0,07%
CAIXA REF DI	707.282,02	3,10%	20%	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	0,01%
CAIXA IRF-M 1+	2.892.572,12	12,67%	20%	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	0,24%

Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Janeiro	19.823.659,70	0,00	19.267,18	0,00	19.680.427,36	-123.965,16	-0,63%	0,69%	-90,48%
Fevereiro	19.680.427,36	20.000,00	9.790,54	0,00	19.533.340,89	-157.295,93	-0,80%	1,30%	-61,27%
Março	19.533.340,89	1.568.958,45	377.079,87	0,00	20.660.581,42	-64.638,05	-0,31%	1,37%	-22,70%
Acumulado	19.823.659,70	1.588.958,45	406.137,59	0,00	20.660.581,42	-345.899,14	-1,73%	3,41%	-50,70%

Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Abril	20.660.581,42	391.989,62	390.588,38	0,00	20.749.564,74	87.582,08	0,42%	0,75%	56,41%
Mai	20.749.564,74	745.115,37	381.597,66	0,00	21.233.836,48	120.754,03	0,57%	1,27%	44,90%
Junho	21.233.836,48	503.978,98	399.726,56	0,00	21.409.357,71	71.268,81	0,33%	0,97%	34,35%
Acumulado	20.660.581,42	1.641.083,97	1.171.912,60	0,00	21.409.357,71	279.604,92	1,34%	3,03%	44,13%

Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Julho	21.409.357,71	599.479,54	394.717,03	0,00	21.597.416,51	-16.703,71	-0,08%	1,40%	-5,50%
Agosto	21.597.416,51	4.779.936,35	4.644.688,12	0,00	21.655.336,48	-77.328,26	-0,36%	1,31%	-27,08%
Setembro	21.655.336,48	7.634.159,16	7.408.908,87	0,00	21.889.411,49	8.824,72	0,04%	1,61%	2,51%
Acumulado	21.409.357,71	13.013.575,05	12.448.314,02	0,00	21.889.411,49	-85.207,25	-0,39%	4,39%	-8,95%

Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Outubro	21.889.411,49	871.362,99	436.809,79	0,00	21.984.606,65	-339.358,04	-1,52%	1,70%	-89,66%
Novembro	21.984.606,65	648.004,76	761.871,47	0,00	22.251.614,09	380.874,15	1,73%	1,39%	124,26%
Dezembro	22.251.614,09	609.108,47	211.885,19	0,00	22.823.649,53	174.812,16	0,77%	1,17%	65,79%
Acumulado	21.889.411,49	2.128.476,22	1.410.566,45	0,00	22.823.649,53	216.328,27	0,96%	4,32%	22,19%

Mês	Saldo Mês Anterior	Aplicações	Resgate	Yield	Saldo Mês Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta	% da Meta
Janeiro/2021	19.823.659,70	0,00	19.267,18	0,00	19.680.427,36	-123.965,16	-0,63%	0,69%	-90,48%
Fevereiro/2021	19.680.427,36	20.000,00	9.790,54	0,00	19.533.340,89	-157.295,93	-0,80%	1,30%	-61,27%
Março/2021	19.533.340,89	1.568.958,45	377.079,87	0,00	20.660.581,42	-64.638,05	-0,31%	1,37%	-22,70%
Abril/2021	20.660.581,42	391.989,62	390.588,38	0,00	20.749.564,74	87.582,08	0,42%	0,75%	56,41%
Maió/2021	20.749.564,74	745.115,37	381.597,66	0,00	21.233.836,48	120.754,03	0,57%	1,27%	44,90%
Junho/2021	21.233.836,48	503.978,98	399.726,56	0,00	21.409.357,71	71.268,81	0,33%	0,97%	34,35%
Julho/2021	21.409.357,71	599.479,54	394.717,03	0,00	21.597.416,51	-16.703,71	-0,08%	1,40%	-5,50%
Agosto/2021	21.597.416,51	4.779.936,35	4.644.688,12	0,00	21.655.336,48	-77.328,26	-0,36%	1,31%	-27,08%
Setembro/2021	21.655.336,48	7.634.159,16	7.408.908,87	0,00	21.889.411,49	8.824,72	0,04%	1,61%	2,51%
Outubro/2021	21.889.411,49	871.362,99	436.809,79	0,00	21.984.606,65	-339.358,04	-1,52%	1,70%	-89,66%
Novembro/2021	21.984.606,65	648.004,76	761.871,47	0,00	22.251.614,09	380.874,15	1,73%	1,39%	124,26%
Dezembro/2021	22.251.614,09	609.108,47	211.885,19	0,00	22.823.649,53	174.812,16	0,77%	1,17%	65,79%
Acumulado	19.823.659,70	18.372.093,69	15.436.930,66	0,00	22.823.649,53	64.826,80	0,15%	16,02%	0,91%

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

~~Adriana~~ ~~Barbosa~~ Jaroffi

~~Adriana~~
~~Barbosa~~

~~Adriana~~
~~Barbosa~~

~~Adriana~~
~~Barbosa~~