



DI BLASI
Consultoria Financeira

**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
CAPANEMA PA**
Setembro 2023

Visão geral da carteira

CNPJ	Nome	P. Resgate	Participação	N. Cotistas	Perc. PL	Legislação	Saldo	Risco	Tipo	Taxa Adm.
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM C	0	25,25%	995	0.00	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 72.322,06	B	Fundo de Investimento	1,00%
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM C	0	12,29%	995	0.00	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 35.195,92	B	Fundo de Investimento	1,00%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	0	55,82%	1,145	0.00	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 159.860,95	B	Fundo de Investimento	0,20%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONC	0	6,64%	1,131	0.00	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 19.013,55	B	Fundo de Investimento	0,20%

R\$ 286.392,48

Retorno do mês

Nome Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI	R\$ 906.879,45	R\$ 330.329,18	R\$ 1.165.859,13	R\$ 72.322,06	R\$ 972,56	0,0786%	CDI
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI	R\$ 47.892,98	R\$ 17.662,41	R\$ 30.747,92	R\$ 35.195,92	R\$ 388,45	0,5925%	CDI
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F	R\$ 282.699,51	R\$ 0	R\$ 125.000,00	R\$ 159.860,95	R\$ 2.161,44	0,7645%	IRF-M 1
BB PREV RF REFERENCIADO DI L'	R\$ 18.772,44	R\$ 120.000,00	R\$ 120.000,00	R\$ 19.013,55	R\$ 241,11	0,1737%	CDI
Total	1,256,244.38	467,991.59	1,441,607.05	286,392.48	3,763.56	0,2183%	

Enquadramentos

Res. 4.963/2021 - Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"

 % Carteira: : **55,82%**

 Saldo do grupo: **R\$ 159.860,95**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 159.860,95	46,584.38	0,00227%	7,028,296,292.55	55,82%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado

Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"

 % Carteira: : **44,18%**

 Saldo do grupo: **R\$ 126.531,53**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 72.322,06	27,284.68	0,00214%	3,380,807,738.12	25,25%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Desenquadrado - limite c
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 35.195,92	13,278.24	0,00104%	3,380,807,738.12	12,29%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 19.013,55	6,382.84	0,00012%	15,259,689,366.93	6,64%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado

Enquadramento por Benchmark

CDI

 % Carteira: **44,18%**

 Saldo do grupo: **R\$ 126.531,53**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 72.322,06	27,284.68	0.00	25.25	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Desenquadrado - limite c
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 35.195,92	13,278.24	0.00	12.29	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 19.013,55	6,382.84	0.00	6.64	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IRF-M 1

 % Carteira: **55,82%**

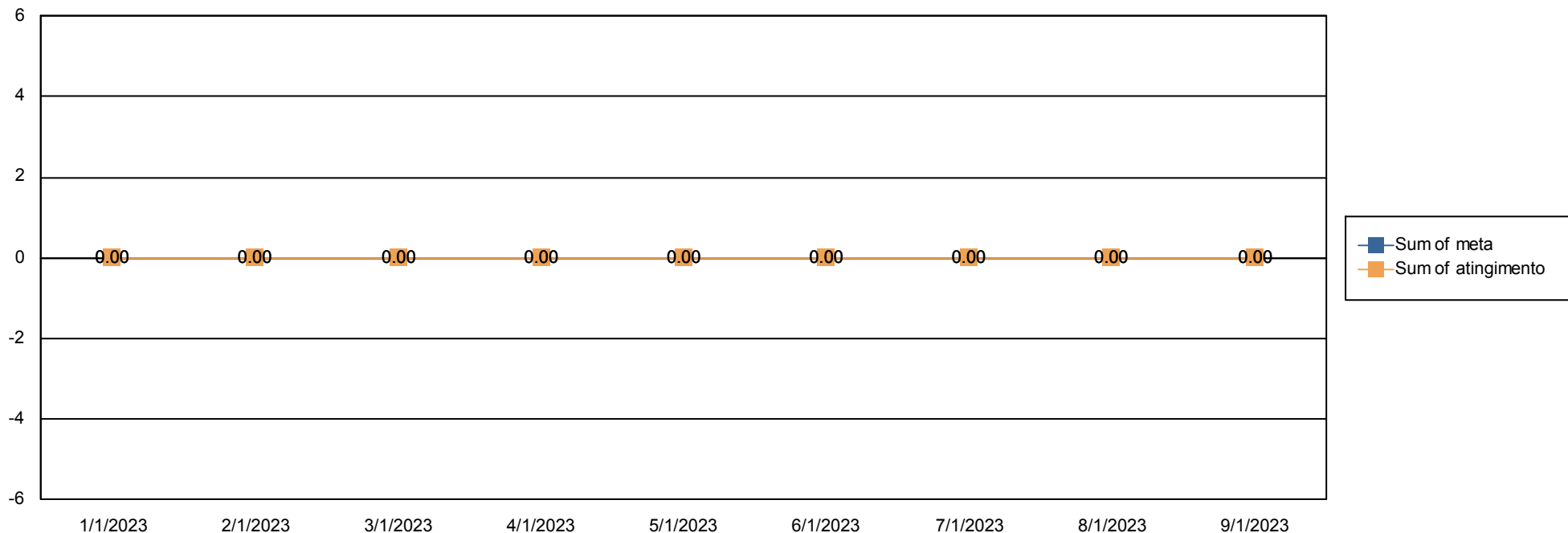
 Saldo do grupo: **R\$ 159.860,95**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 159.860,95	46,584.38	0.00	55.82	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

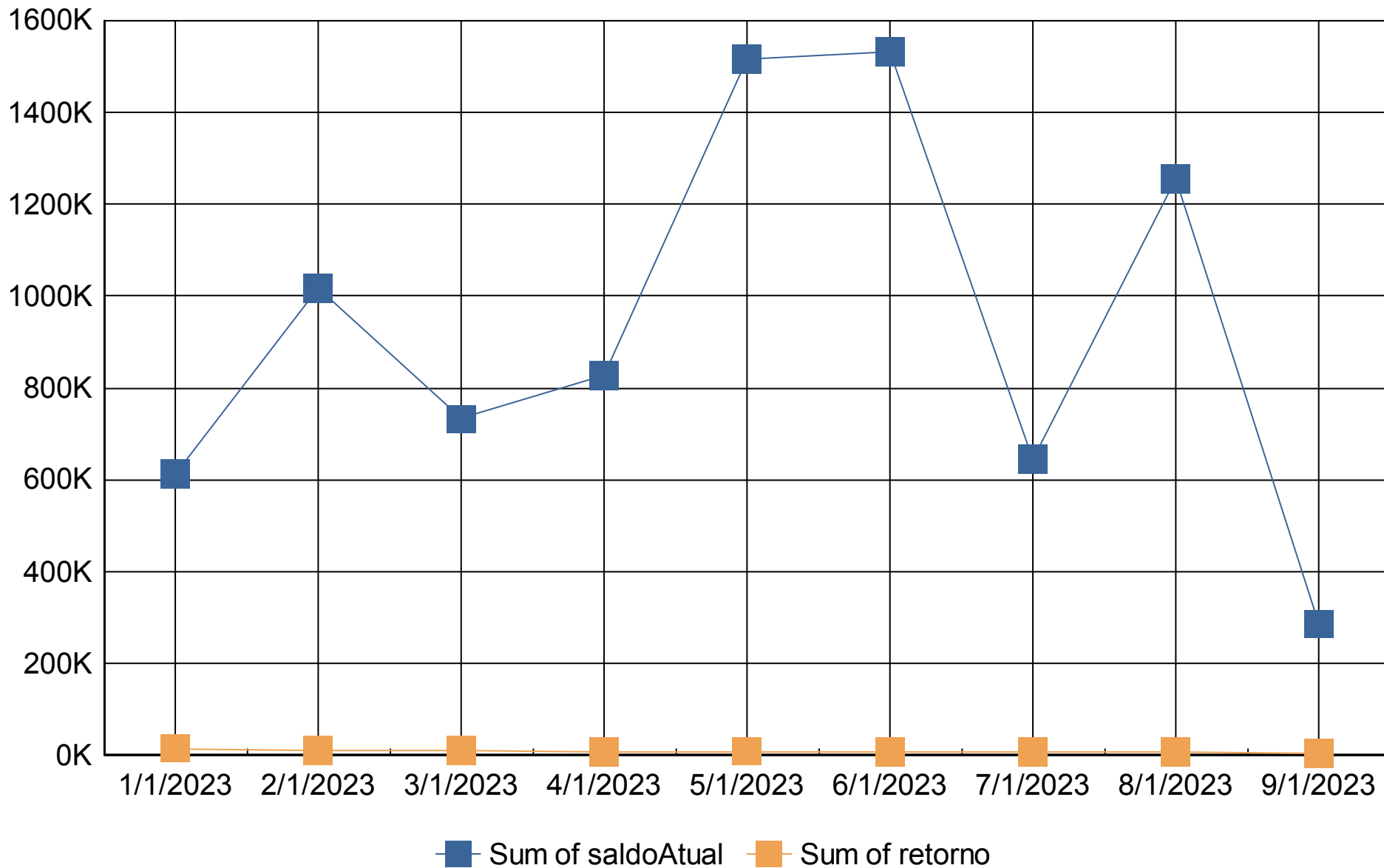
Retorno acumulado no ano

Período	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Retorno %	Meta	Atingimento
Janeiro	R\$ 1.681.059,51	R\$ 182.892,98	R\$ 1.266.211,01	R\$ 613.428,26	R\$ 15.686,78	0,8416%	0,0000	0,0000%
Fevereiro	R\$ 613.428,26	R\$ 794.347,48	R\$ 400.613,07	R\$ 1.017.921,91	R\$ 10.759,24	0,7643%	0,0000	0,0000%
Março	R\$ 1.017.921,91	R\$ 1.438.858,82	R\$ 1.733.759,95	R\$ 733.304,35	R\$ 10.283,57	0,4186%	0,0000	0,0000%
Abril	R\$ 733.304,35	R\$ 526.432,40	R\$ 440.415,98	R\$ 826.963,16	R\$ 7.642,39	0,6067%	0,0000	0,0000%
Mai	R\$ 826.963,16	R\$ 1.077.112,53	R\$ 397.415,94	R\$ 1.515.853,82	R\$ 9.194,07	0,4829%	0,0000	0,0000%
Junho	R\$ 1.515.853,82	R\$ 1.033.692,37	R\$ 1.026.902,52	R\$ 1.531.393,87	R\$ 8.750,20	0,3432%	0,0000	0,0000%
Julho	R\$ 1.531.393,87	R\$ 503.594,62	R\$ 1.399.487,69	R\$ 643.432,44	R\$ 7.931,64	0,3898%	0,0000	0,0000%
Agosto	R\$ 643.432,44	R\$ 2.623.610,55	R\$ 2.017.641,88	R\$ 1.256.244,38	R\$ 6.843,27	0,2095%	0,0000	0,0000%
Setembro	R\$ 1.256.244,38	R\$ 467.991,59	R\$ 1.441.607,05	R\$ 286.392,48	R\$ 3.763,56	0,2183%	0,0000	0,0000%
Total		8,648,533.34	10,124,055.09		80,854.72	4,3547%	0,0000%	0,0000%

Meta x Atingimento

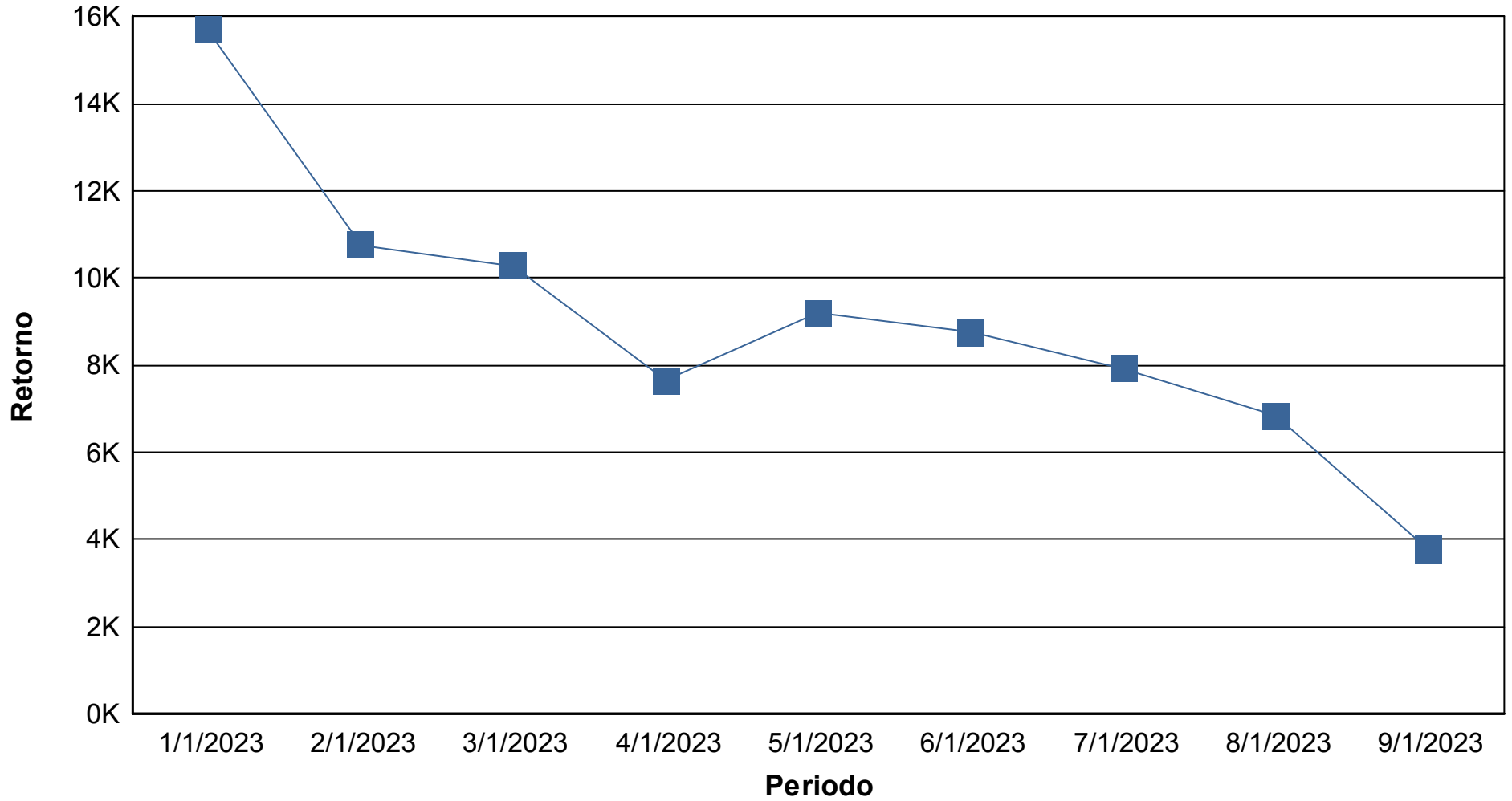


Evolução do patrimônio



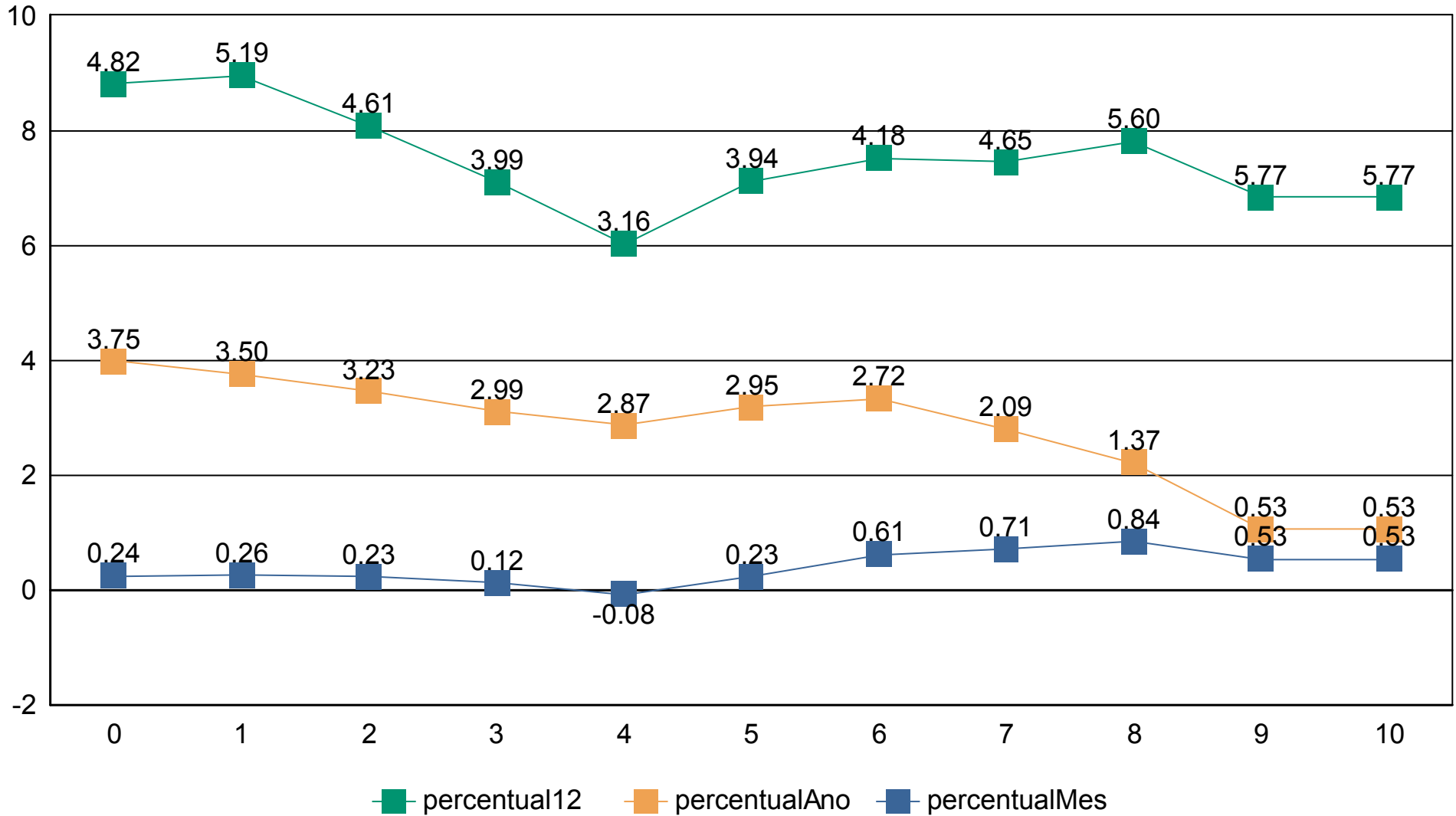


Retorno Mensal

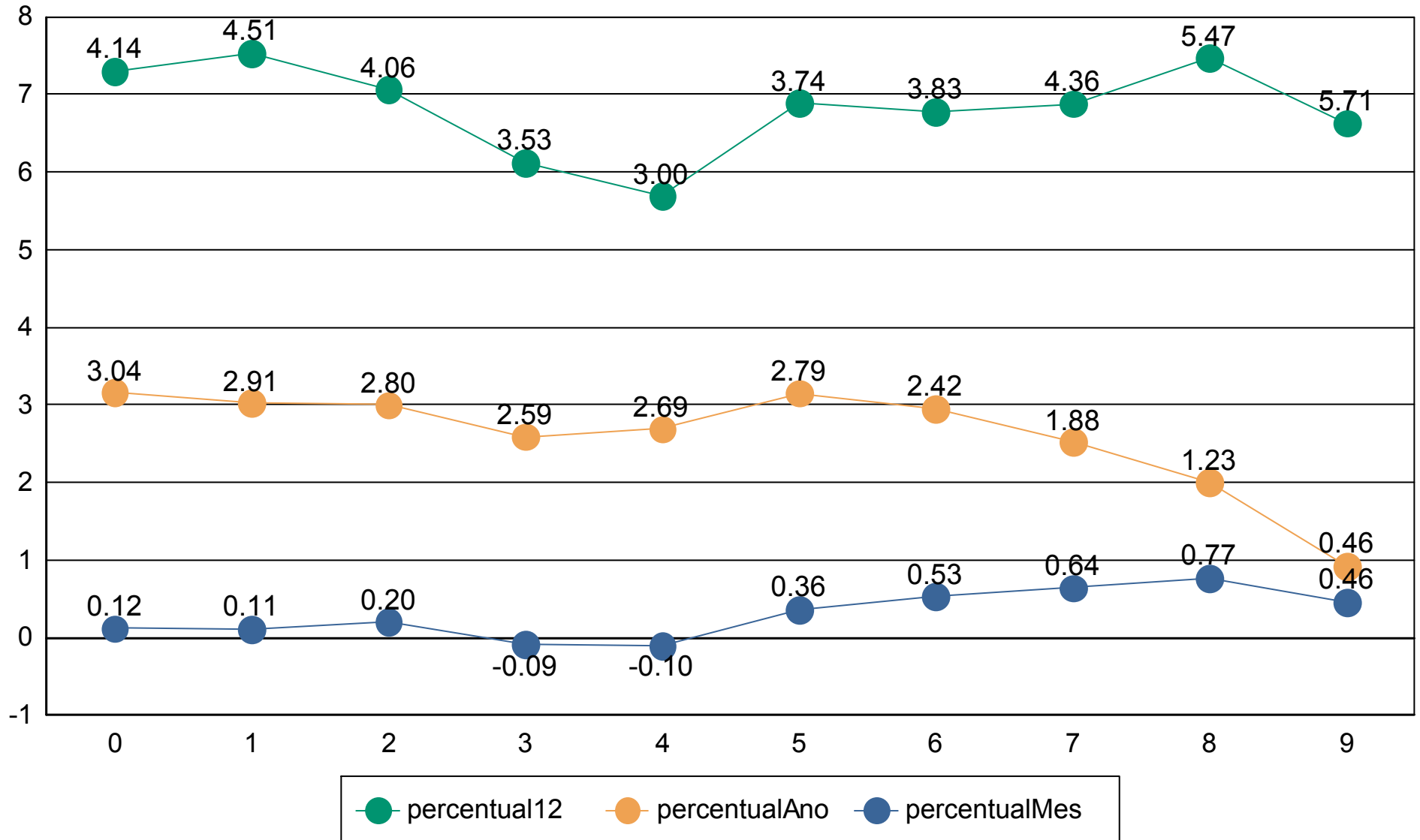




Índices Econômicos - IPCA

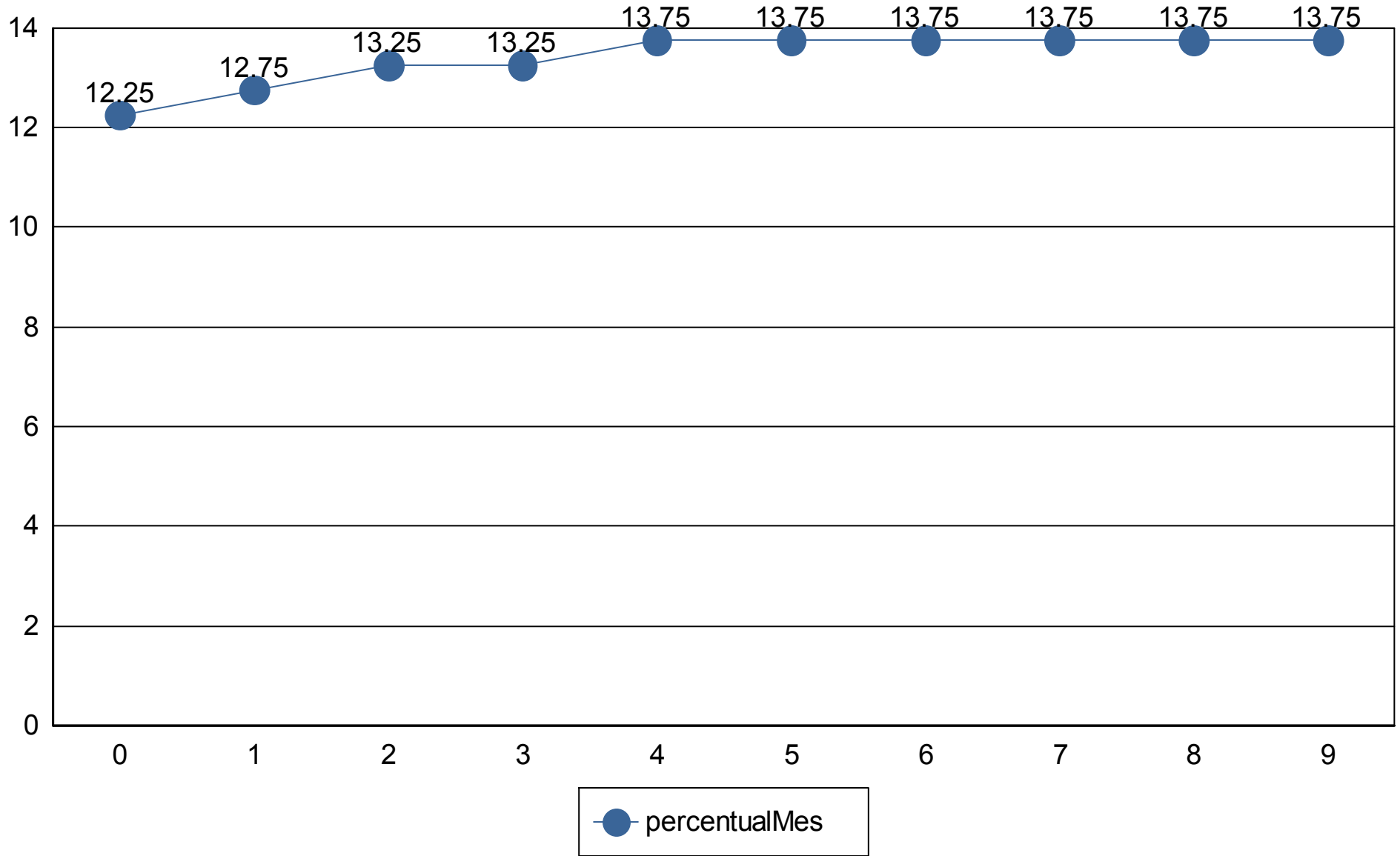


Índices Econômicos - INPC





Índices Econômicos - SELIC



Medidas de risco

GESTÃO DE RISCO - MERCADO: O valor dos ativos que compõem a carteira do fundo pode aumentar ou diminuir de acordo com flutuações de preços e cotações de mercado, mudanças no cenário político e econômico, alterações nas taxas de juros e, ainda, com os resultados das empresas emittentes de valores mobiliários (ações, debêntures, notas promissórias, entre outros).

Índice Sharpe: O índice de Sharpe é uma medida que permite a classificação do fundo em termos de desempenho global, sendo considerados melhores os fundos com maior índice. Vale lembrar ainda que o índice varia se o resultado for calculado com base em rentabilidades semanais, mensais ou anuais.

VaR - Value at Risk: Value-at-risk ou Valor sob Risco pode ser definido como perda máxima, num determinado período, sob condições normais de mercado, com determinado grau de confiança.

CNPJ	Nome fundo	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL3	VOL6	VOL12
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	CDI	26,05%	0,00%	8,77%	23,15%	56,83%
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	CDI	26,05%	0,00%	8,77%	23,15%	56,83%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	IRF-M 1	25,67%	0,00%	9,16%	25,21%	61,47%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI	CDI	25,99%	0,00%	9,65%	25,45%	61,62%
			103,75%	0,00%	36,36%	96,96%	236,75%

Provisão de risco - Mercado

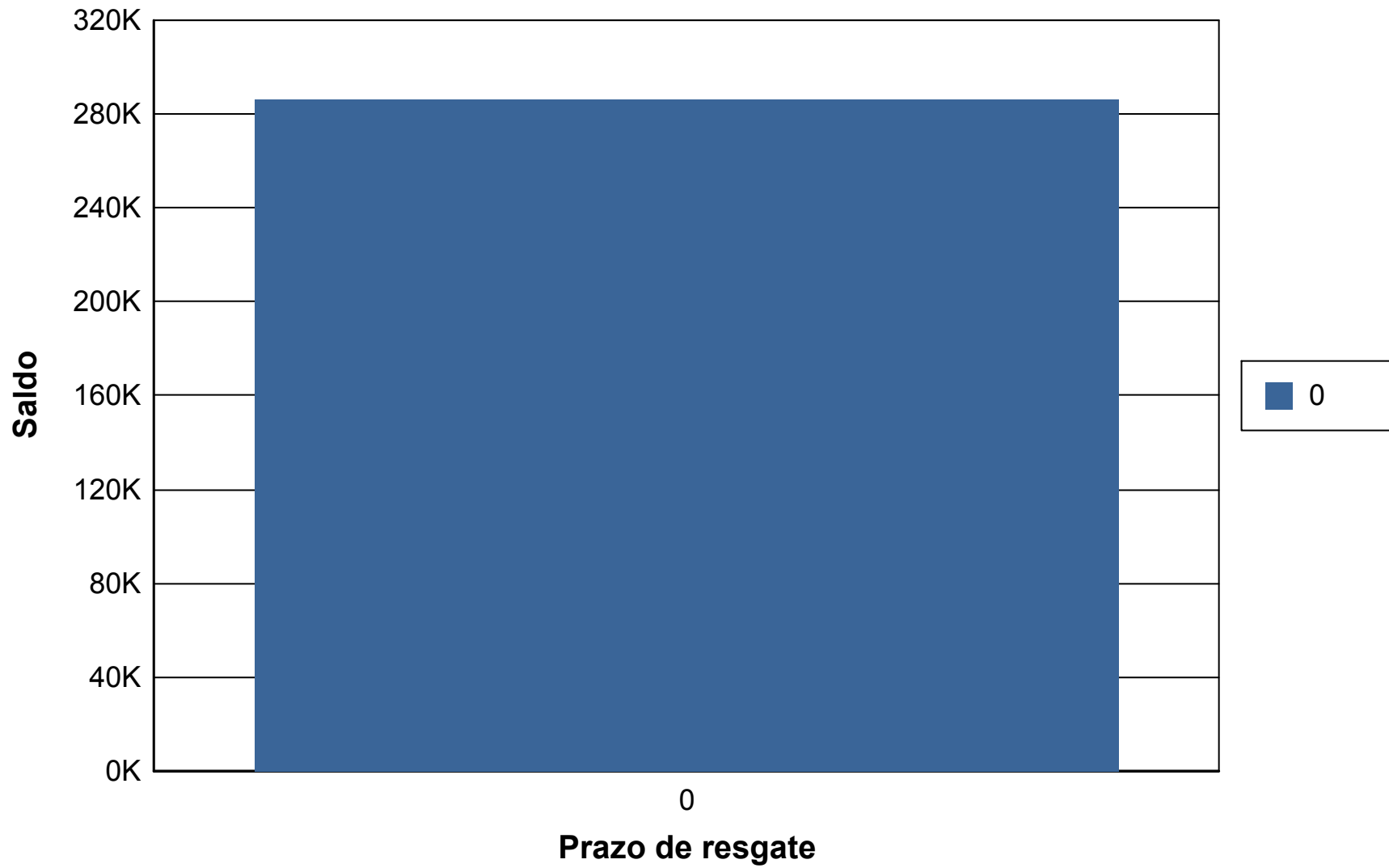
CNPJ	Nome do fundo	Benchmark	Saldo	VAR12	VOL12	VAR% BASE 1
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO C	CDI	R\$ 72.322,06	0,00%	56,83%	R\$ 0,04
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO C	CDI	R\$ 35.195,92	0,00%	56,83%	R\$ 0,02
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO	IRF-M 1	R\$ 159.860,95	0,00%	61,47%	R\$ 0,21

Saldo Total:	R\$ 267.378,93
Provisão para perda e Investimentos	R\$ 0,27
% Provisão de perda	0,00%
% Aceitável perda	2%
Limite de utilização	0,01%



Nome do Fundo	Saldo	% Part.	N. Cotistas	% PL	PL do Fundo	Legislação	Grau risco	Prazo Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE	R\$ 72.322,06	25,25%	995	0,00%	R\$ 3.380.807.738,12	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE	R\$ 35.195,92	12,29%	995	0,00%	R\$ 3.380.807.738,12	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULC	R\$ 159.860,95	55,82%	1,145	0,00%	R\$ 7.028.296.292,55	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIAD	R\$ 19.013,55	6,64%	1,131	0,00%	R\$ 15.259.689.366,93	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
0	R\$ 286.392,48	4	100,00%



Risco Crédito

Legislação	Limite	Limite Política	Saldo	% Carteira
Res. 4.963/2021 - Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	100,00%	100,00%	R\$ 159.860,95	55,82
Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	60,00%	60,00%	R\$ 126.531,53	44,18

	Saldo	% Carteira
100% títulos públicos	0.00	0.00
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	0.00	0.00
100% títulos privados	286,392.48	100.00

