



**DI BLASI**  
Consultoria Financeira

**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DO MUNICÍPIO DE  
CAPANEMA PA**  
Agosto 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          | 72,19%       | 993         | 0.03     | Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"  | R\$ 906.879,45 | B     | Fundo de Investimento | 1,00%     |
| 13.077.415/0001-05 | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM C  | 0          | 3,81%        | 993         | 0.00     | Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"  | R\$ 47.892,98  | B     | Fundo de Investimento | 1,00%     |
| 11.328.882/0001-35 | BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI | 0          | 22,50%       | 1,130       | 0.00     | Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b" | R\$ 282.699,51 | B     | Fundo de Investimento | 0,20%     |
| 13.077.418/0001-49 | BB PREV RF REFERENCIADO DI LONC   | 0          | 1,49%        | 1,115       | 0.00     | Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"  | R\$ 18.772,44  | B     | Fundo de Investimento | 0,20%     |

R\$ 1.256.244,38

## Retorno do mês

| Nome Fundo                       | Saldo Inicial     | Aplicações          | Resgates            | Saldo Final         | Rentabilidade   | Efetivo        | Bench.  |
|----------------------------------|-------------------|---------------------|---------------------|---------------------|-----------------|----------------|---------|
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI   | R\$ 671,42        | R\$ 2.323.310,71    | R\$ 1.418.842,57    | R\$ 906.879,45      | R\$ 1.739,89    | 0,0748%        | CDI     |
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI   | R\$ 40.960,81     | R\$ 105.299,84      | R\$ 98.799,31       | R\$ 47.892,98       | R\$ 431,64      | 0,2951%        | CDI     |
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F | R\$ 583.242,13    | R\$ 195.000,00      | R\$ 500.000,00      | R\$ 282.699,51      | R\$ 4.457,38    | 0,5727%        | IRF-M 1 |
| BB PREV RF REFERENCIADO DI L'    | R\$ 18.558,08     | R\$ 0               | R\$ 0               | R\$ 18.772,44       | R\$ 214,36      | 1,1550%        | CDI     |
| <b>Total</b>                     | <b>643,432.44</b> | <b>2,623,610.55</b> | <b>2,017,641.88</b> | <b>1,256,244.38</b> | <b>6,843.27</b> | <b>0,2095%</b> |         |

## Enquadramentos

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

 % Carteira: : **22,50%**

 Saldo do grupo: **R\$ 282.699,51**

| Fundo                             | Saldo          | N. Cotas  | % PL     | P. Liq.          | % Carteira | Limites  | Situação   |
|-----------------------------------|----------------|-----------|----------|------------------|------------|--|------------|
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI | R\$ 282.699,51 | 83,125.05 | 0,00417% | 6,785,029,538.03 | 22,50%     | Lim. Res.: 100,00%<br>Lim. Pol.: 100,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 0,00% | Enquadrado |

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

 % Carteira: : **77,50%**

 Saldo do grupo: **R\$ 973.544,87**

| Fundo   | Saldo          | N. Cotas   | % PL     | P. Liq.           | % Carteira | Limites  | Situação                 |
|---|----------------|------------|----------|-------------------|------------|--|--------------------------|
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI                      | R\$ 906.879,45 | 345,200.88 | 0,02551% | 3,554,344,878.79  | 72,19%     | Lim. Res.: 60,00%<br>Lim. Pol.: 60,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 0,03% | Desenquadrado - politica |
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI                      | R\$ 47.892,98  | 18,230.32  | 0,00135% | 3,554,344,878.79  | 3,81%      | Lim. Res.: 60,00%<br>Lim. Pol.: 60,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 0,00% | Desenquadrado - limite   |
| BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI | R\$ 18.772,44  | 6,363.02   | 0,00013% | 14,734,335,445.36 | 1,49%      | Lim. Res.: 60,00%<br>Lim. Pol.: 60,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 0,00% | Desenquadrado - limite   |

## Enquadramento por Benchmark

**CDI**

 % Carteira: **77,50%**

 Saldo do grupo: **R\$ 973.544,87**

| Nome fundo  | Saldo          | Saldo cotas | %PL  | % Carteira | Limites   | Situação                |
|---|----------------|-------------|------|------------|---|-------------------------|
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI                      | R\$ 906.879,45 | 345,200.88  | 0.03 | 72.19      | Lim. Res.: 60,00%<br>Lim. Pol.: 60,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 15,00% | Desenquadrado - polític |
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI                      | R\$ 47.892,98  | 18,230.32   | 0.00 | 3.81       | Lim. Res.: 60,00%<br>Lim. Pol.: 60,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 15,00% | Desenquadrado - limite  |
| BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI | R\$ 18.772,44  | 6,363.02    | 0.00 | 1.49       | Lim. Res.: 60,00%<br>Lim. Pol.: 60,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 15,00% | Desenquadrado - limite  |

**IRF-M 1**

 % Carteira: **22,50%**

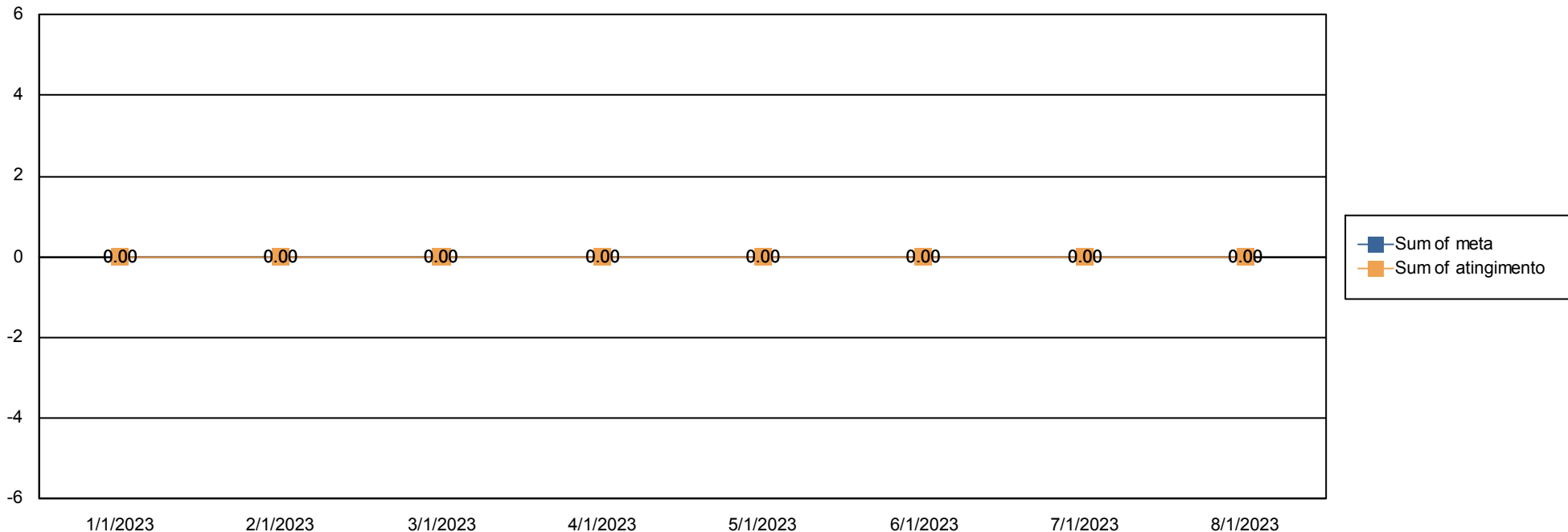
 Saldo do grupo: **R\$ 282.699,51**

| Nome fundo                        | Saldo          | Saldo cotas | %PL  | % Carteira | Limites  | Situação   |
|-----------------------------------|----------------|-------------|------|------------|--|------------|
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI | R\$ 282.699,51 | 83,125.05   | 0.00 | 22.50      | Lim. Res.: 100,00%<br>Lim. Pol.: 100,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 100,00% | Enquadrado |

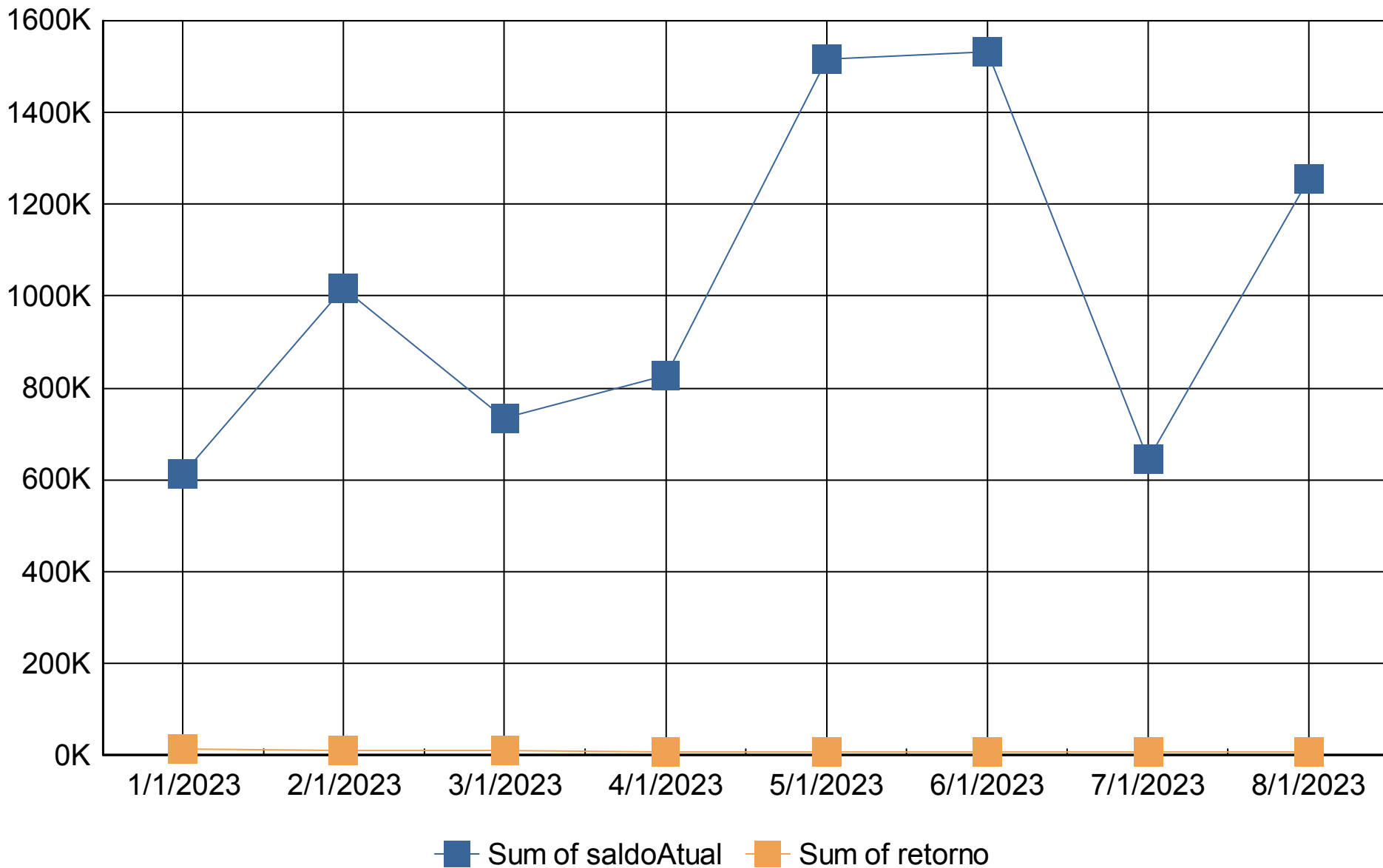
### Retorno acumulado no ano

| 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%     |
| <b>Total</b> |                  | 8,180,541.75     | 8,682,448.04     |                  | 77,091.16     | 4,1274%   | 0,0000% | 0,0000%     |

### Meta x Atingimento

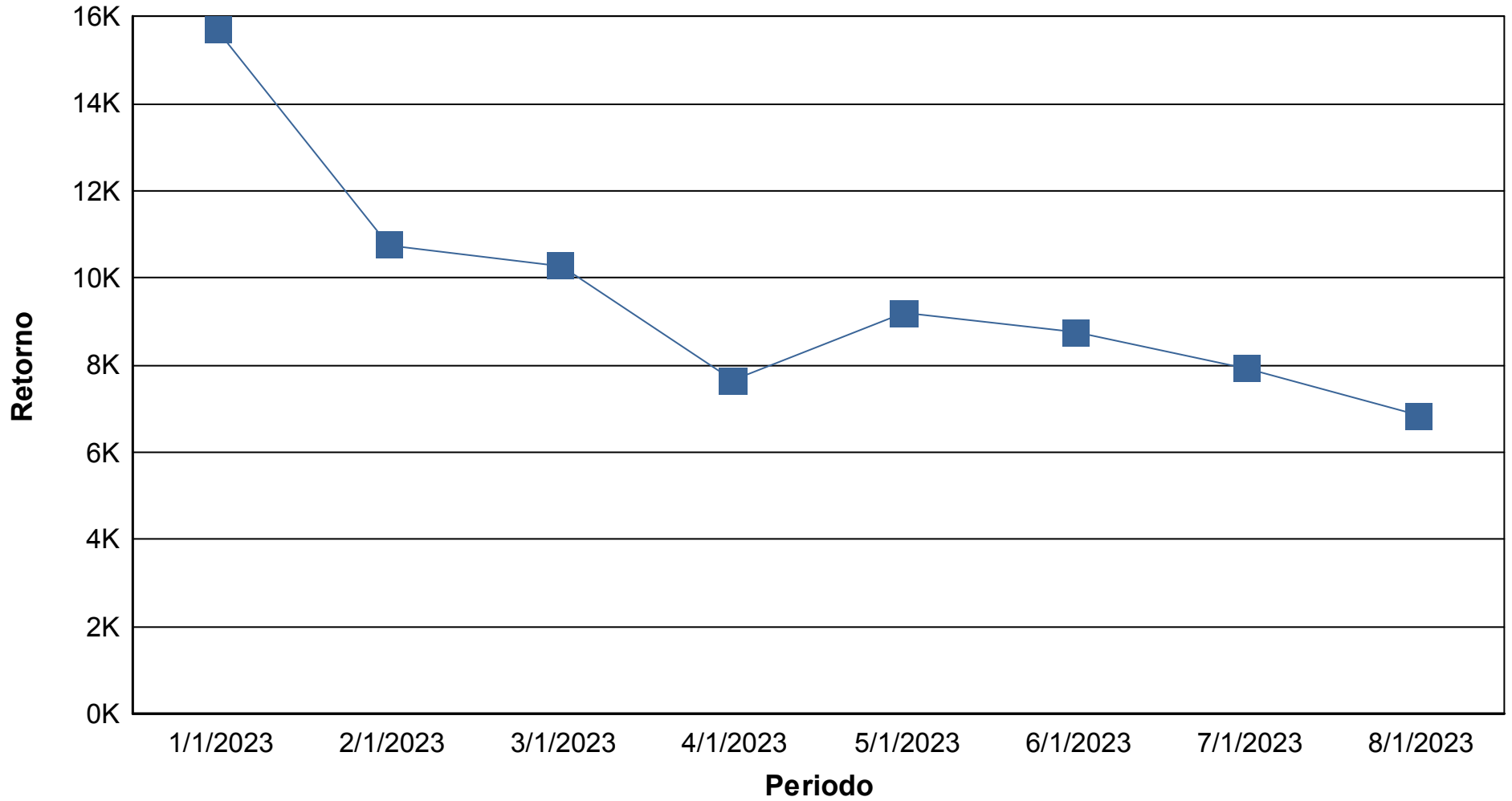


### Evolução do patrimônio

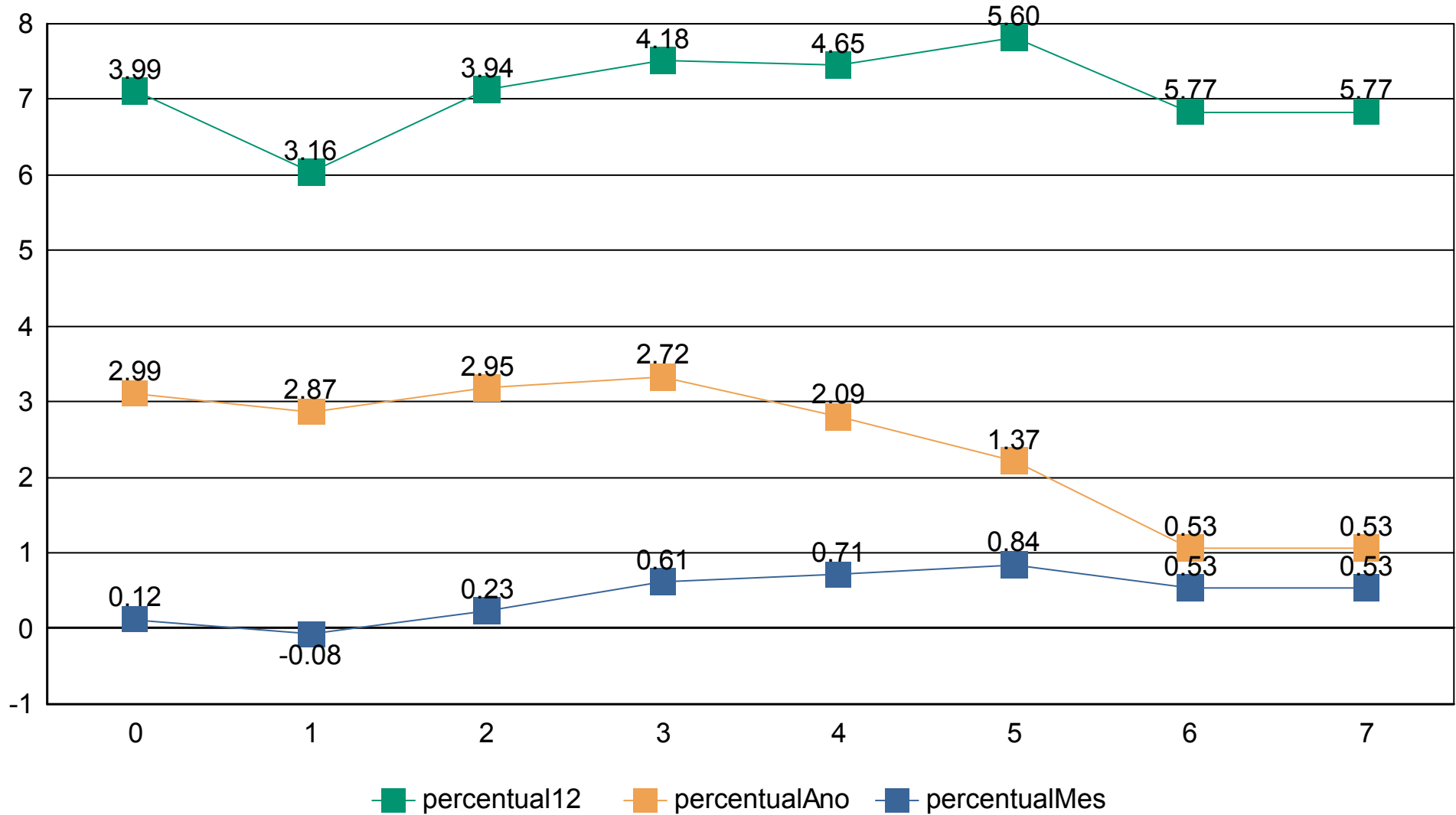




### Retorno Mensal

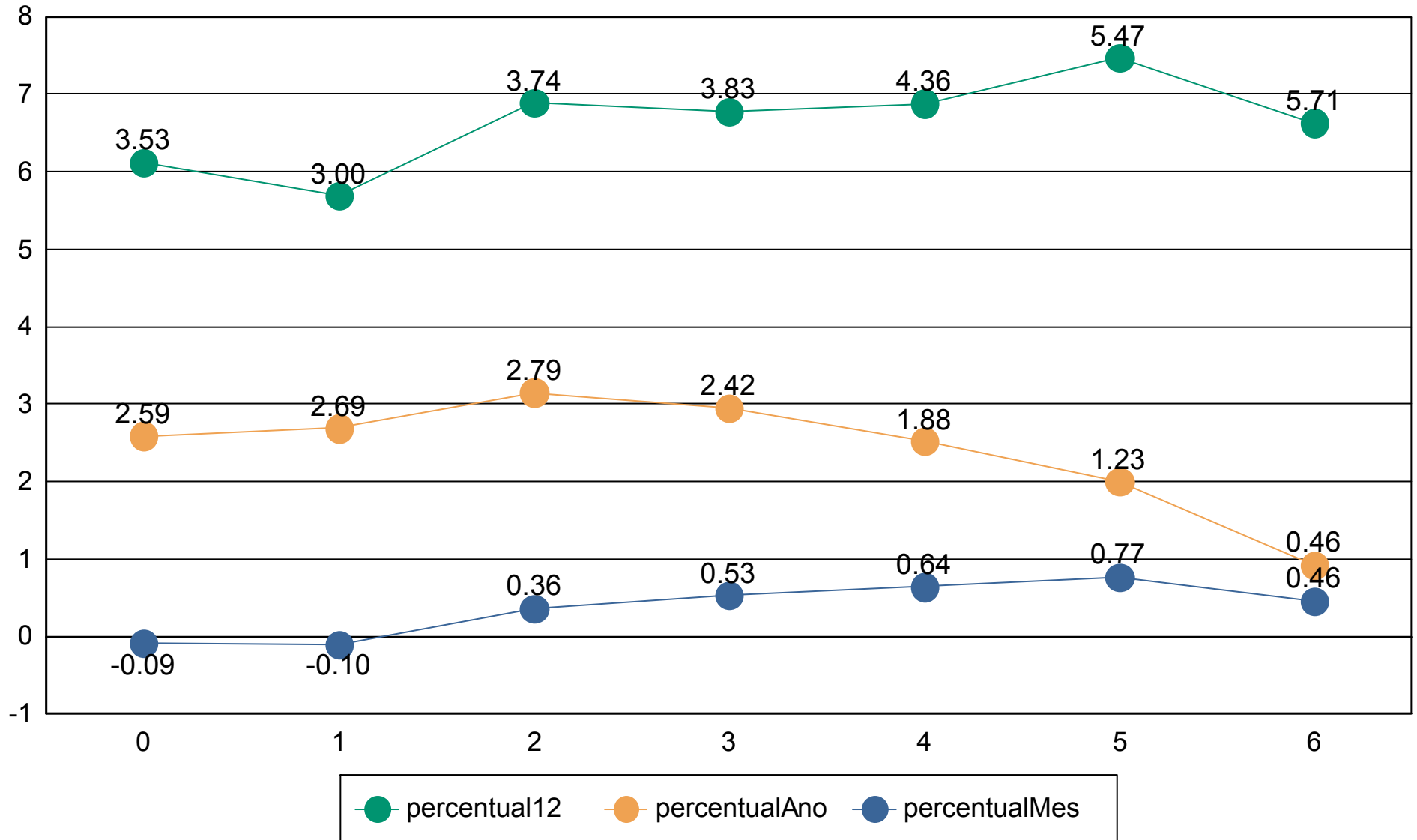


## Índices Econômicos - IPCA



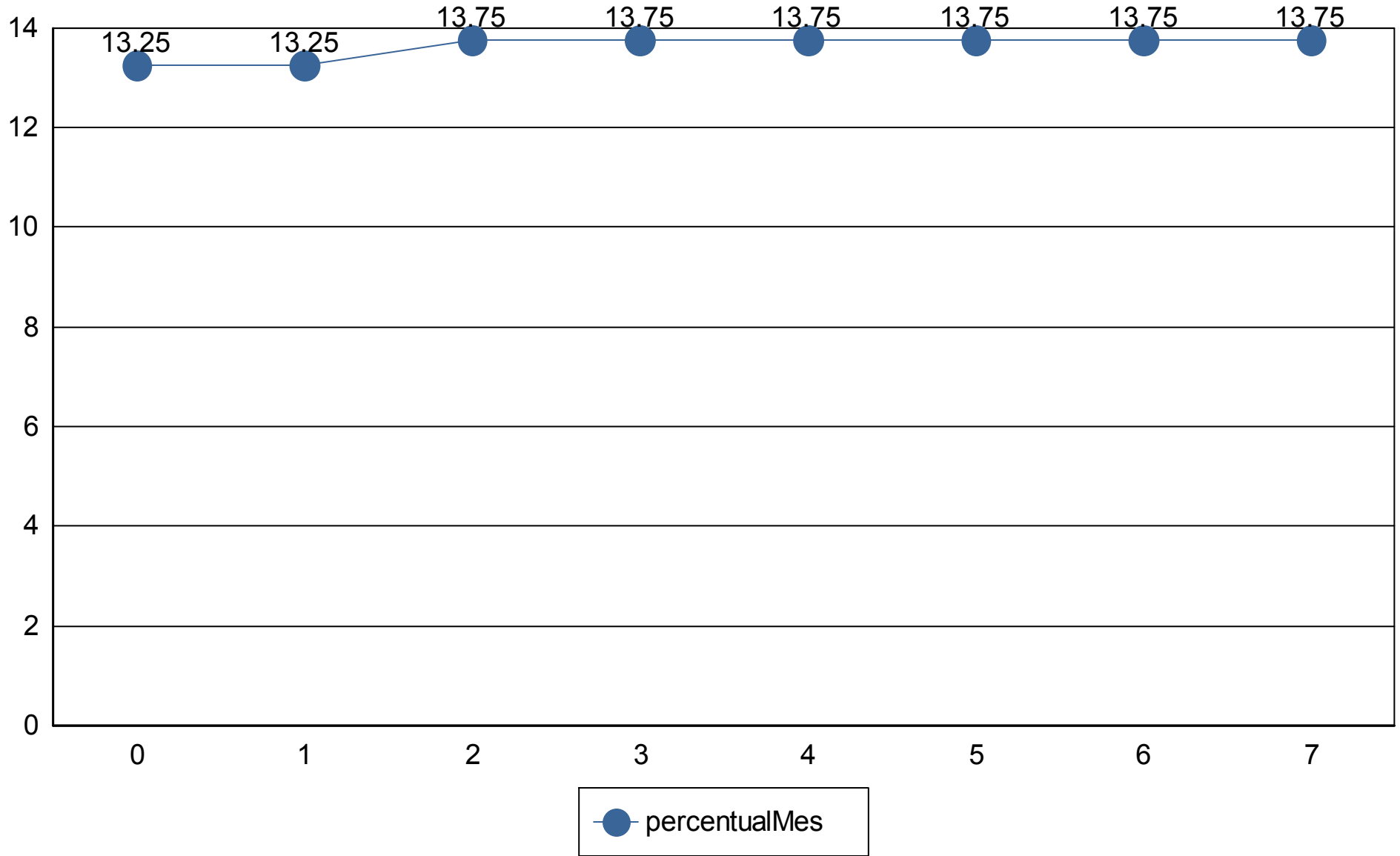


## Índices Econômicos - INPC





## 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       | 26,28%         | 0,00%        | 9,09%         | 22,51%        | 56,55%         |
| 13.077.415/0001-05 | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI       | CDI       | 26,28%         | 0,00%        | 9,09%         | 22,51%        | 56,55%         |
| 11.328.882/0001-35 | BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI                | IRF-M 1   | 26,09%         | 0,00%        | 9,78%         | 24,60%        | 61,09%         |
| 13.077.418/0001-49 | BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI | CDI       | 26,27%         | 0,00%        | 10,00%        | 24,73%        | 61,27%         |
|                    |  |           | <b>104,93%</b> | <b>0,00%</b> | <b>37,97%</b> | <b>94,35%</b> | <b>235,46%</b> |

## Provisão de risco - Mercado

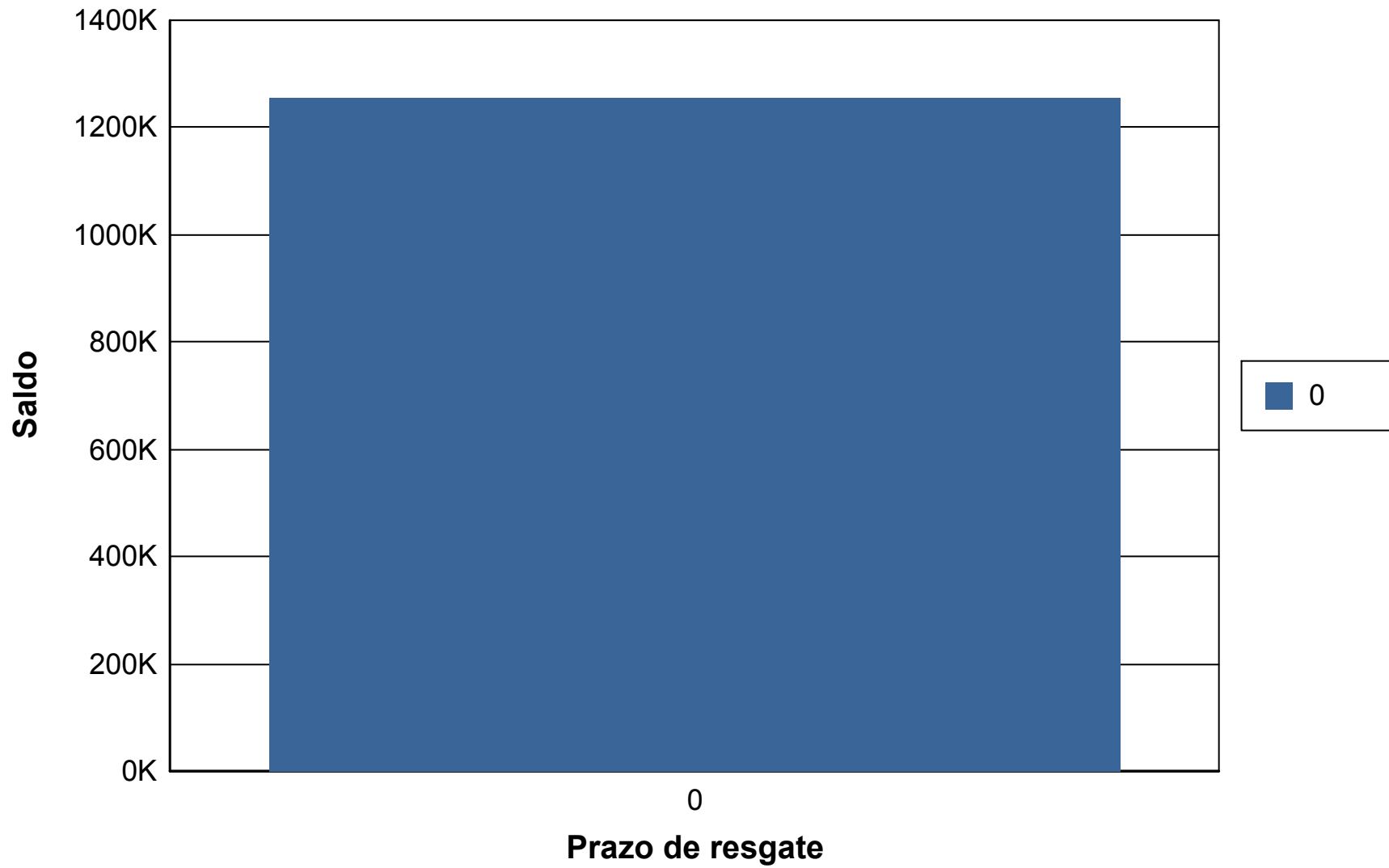
| CNPJ               | Nome do fundo                                       | Benchmark | Saldo          | VAR12 | VOL12  | VAR% BASE 1 |
|--------------------|---|-----------|----------------|-------|--------|-------------|
| 13.077.415/0001-05 | BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO C  | CDI       | R\$ 906.879,45 | 0,00% | 56,55% | R\$ 0,50    |
| 13.077.415/0001-05 | BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO C  | CDI       | R\$ 47.892,98  | 0,00% | 56,55% | R\$ 0,03    |
| 11.328.882/0001-35 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO | IRF-M 1   | R\$ 282.699,51 | 0,00% | 61,09% | R\$ 0,32    |

|                                     |                         |
|-------------------------------------|-------------------------|
| Saldo Total:                        | <b>R\$ 1.237.471,94</b> |
| Provisão para perda e Investimentos | <b>R\$ 0,85</b>         |
| % Provisão de perda                 | 0,00%                   |
| % Aceitavel perda                   | 2%                      |
| Limite de utilização                | 0,00%                   |



| Nome do Fundo                              | Saldo          | % Part. | N. Cotistas | % PL  | PL do Fundo           | Legislação    | Grau risco | Prazo Resgate |
|--|----------------|---------|-------------|-------|-----------------------|---------------|------------|---------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE  | R\$ 906.879,45 | 72,19%  | 993         | 0,03% | R\$ 3.610.705.496,97  | da Fixa (CVM) | Baixo      | D+ 0          |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE  | R\$ 47.892,98  | 3,81%   | 993         | 0,00% | R\$ 3.610.705.496,97  | da Fixa (CVM) | Baixo      | D+ 0          |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULC | R\$ 282.699,51 | 22,50%  | 1,130       | 0,00% | R\$ 6.791.320.048,28  | ixa 100% TP/E | Baixo      | D+ 0          |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIAD   | R\$ 18.772,44  | 1,49%   | 1,115       | 0,00% | R\$ 15.659.060.568,03 | da Fixa (CVM) | Baixo      | D+ 0          |

| Prazo Resgate | Saldo            | N. Fundo | % Carteira |
|---------------|------------------|----------|------------|
| 0             | R\$ 1.256.244,38 | 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\$ 282.699,51 | 22,50      |
| Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"  | 60,00%  | 60,00%          | R\$ 973.544,87 | 77,50      |

|   | Saldo               | % Carteira |
|---|---------------------|------------|
| 100% títulos públicos                       | 0.00                | 0.00       |
| 50% Títulos publicos e 50% Títulos privados | 0.00                | 0.00       |
| 100% títulos privados                       | <b>1,256,244.38</b> | 100.00     |

