

Mês/Ano

01/2023



Filtrar

Data do último saldo: 31/01/2023

Versão para impressão



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DO MUNICÍPIO DE CAPANEMA PA

Visão Geral da carteira

| Fundo | Saldo | Participação | Num. Cotistas | % sobre o PL | Patrimonio | Resolução | Grau Risco | Tipo |
|--|-----------------------|--------------|---------------|--------------|-----------------------|---|------------|-----------------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO Banco: BANCO DO BRASIL Agência: 1735-3 Conta: 3818-0 | R\$ 13.056,40 | 2,12846% | 907 | 0,00034% | R\$ 3.853.684.843,62 | Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a" | Baixo | Fundo de Investimento |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO Banco: BANCO DO BRASIL Agência: 1735-3 Conta: 1257-2 | R\$ 35.246,45 | 5,74588% | 907 | 0,00091% | R\$ 3.853.684.843,62 | Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a" | Baixo | Fundo de Investimento |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Banco: 001 Agência: 1735-3 Conta: 1257-2 | R\$ 547.672,07 | 89,2816% | 1116 | 0,00834% | R\$ 6.562.900.517,46 | Res. 4.963/2021 - Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b" | Baixo | Fundo de Investimento |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI Banco: 001 Agência: 1735-3 Conta: 1257-2 | R\$ 17.446,06 | 2,84406% | 1070 | 0,00013% | R\$ 12.971.898.325,20 | Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a" | Baixo | Fundo de Investimento |
| Total | R\$ 613.420,98 | | | | | | | |

Enquadramentos

Resolução

% Carteira

Saldo do grupo

Situação

(RPPS) - Res. 4.963/2021 - Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º

89,280541%

R\$ 547.672,07

Enquadrado

| Fundo | Saldo | Saldo Cotas | % PL | P. Líq. | % Carteira | Limites | Situação |
|---|----------------|---------------|-----------|----------------------|------------|---|------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35 | R\$ 547.672,07 | 173410.232884 | 0,008345% | R\$ 6.562.900.517,46 | 89,2805% | Lim. Resol.: 100,00% Lim. Política: 100,00% Lim. CNPJ: 100,00% Lim. PL.: 100,0000% | Enquadrado |

(RPPS) - Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º

10,719459%

R\$ 65.756,19

Enquadrado

| Fundo | Saldo | Saldo Cotas | % PL | P. Líq. | % Carteira | Limites | Situação |
|--|---------------|--------------|-----------|-----------------------|------------|---|------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05 | R\$ 35.246,45 | 14361.233069 | 0,000915% | R\$ 3.853.684.843,62 | 5,7458% | Lim. Resol.: 60,00% Lim. Política: 60,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000% | Enquadrado |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05 | R\$ 13.063,68 | 5322.820182 | 0,000339% | R\$ 3.853.684.843,62 | 2,1296% | Lim. Resol.: 60,00% Lim. Política: 60,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000% | Enquadrado |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 13.077.418/0001-49 | R\$ 17.446,06 | 6363.021849 | 0,000134% | R\$ 12.971.898.325,20 | 2,8440% | Lim. Resol.: 60,00% Lim. Política: 60,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000% | Enquadrado |

Por benchmark

Benchmark

% Carteira | Saldo do grupo

IRF-M 1

89,280541% | R\$ 547.672,07

| Fundo | % saldo | Saldo |
|--|------------|----------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35 | 89,280541% | R\$ 547.672,07 |

CDI

10,719459% | R\$ 65.756,19

| Fundo | % saldo | Saldo |
|---|-----------|---------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05 | 5,745815% | R\$ 35.246,45 |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05 | 2,129618% | R\$ 13.063,68 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 13.077.418/0001-49 | 2,844026% | R\$ 17.446,06 |

Por administradores

Administrador

% Carteira

Saldo do grupo

30.822.936/0001-69 - BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A

100,0000%

R\$ 613.428,26

| Fundo | % saldo | Saldo |
|---|------------|----------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05 | 5,745815% | R\$ 35.246,45 |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05 | 2,129618% | R\$ 13.063,68 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35 | 89,280541% | R\$ 547.672,07 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 13.077.418/0001-49 | 2,844026% | R\$ 17.446,06 |

Retornos do mês

RENDA FIXA

| Fundo | Saldo anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Participação | Retorno R\$ | Retorno % | Efetivo % |
|--|------------------|----------------|------------------|----------------|--------------|--------------|-----------|-----------|
| 13.077.415/0001-05 - BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI | R\$ 20.207,81 | R\$ 32.462,65 | R\$ 39.870,21 | R\$ 13.063,68 | 2,1296% | R\$ 263,43 | 1,0342% | 0,5001% |
| 13.077.415/0001-05 - BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI | R\$ 1.101.655,63 | R\$ 150.430,33 | R\$ 1.226.340,80 | R\$ 35.246,45 | 5,7458% | R\$ 9.501,29 | 1,0342% | 0,7588% |
| 11.328.882/0001-35 - BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI | R\$ 541.943,89 | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 | R\$ 547.672,07 | 89,2805% | R\$ 5.728,18 | 1,0570% | 1,0570% |
| 13.077.418/0001-49 - BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI | R\$ 17.252,18 | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 | R\$ 17.446,06 | 2,8440% | R\$ 193,88 | 1,1238% | 1,1238% |

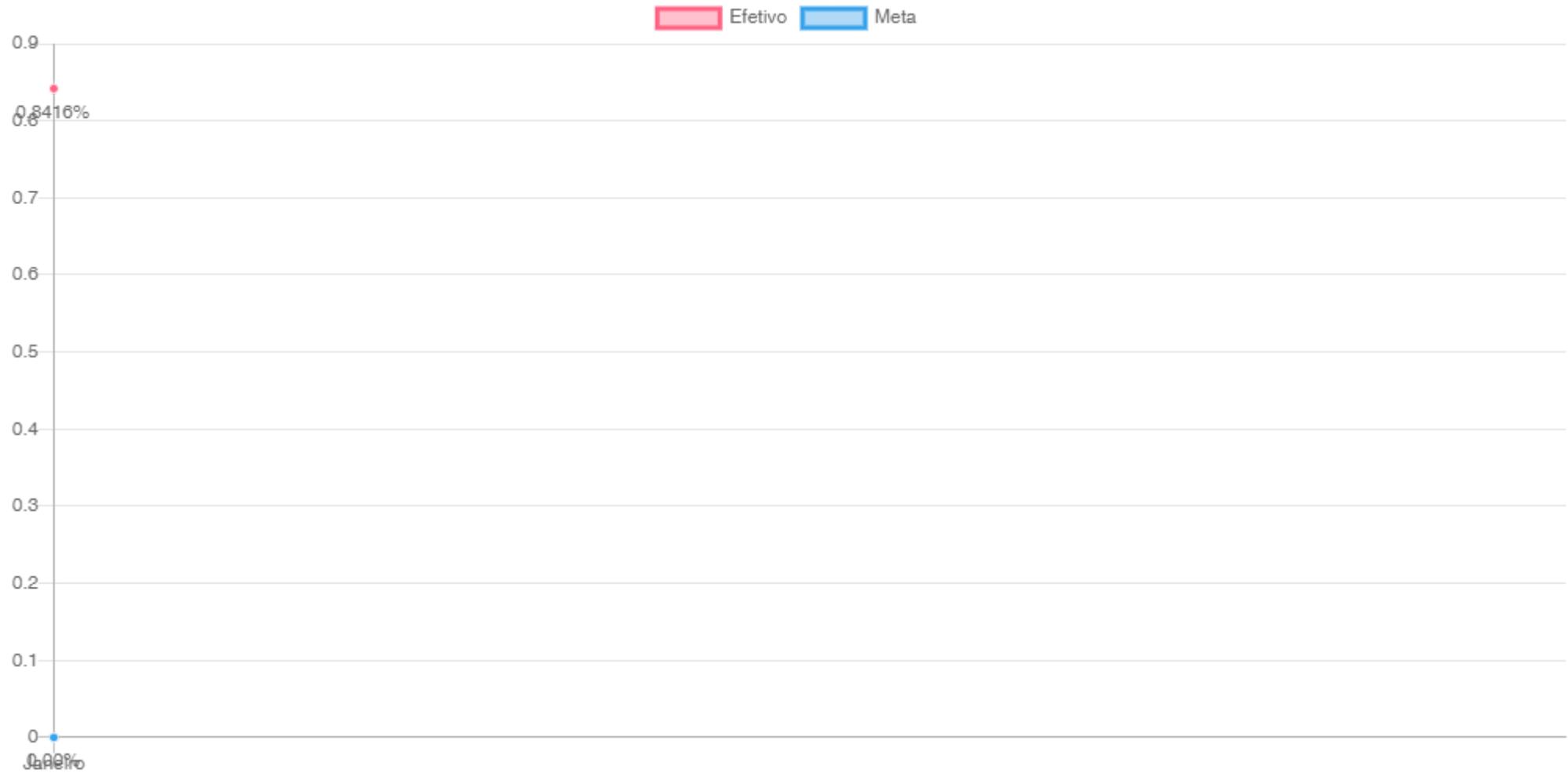
| Tipo | Saldo anterior | Total aplicações | Total resgates | Saldo atual | Total retorno | Total retorno % | Total retorno efetivo |
|------------|------------------|------------------|------------------|----------------|---------------|-----------------|-----------------------|
| RENDA FIXA | R\$ 1.681.059,51 | R\$ 182.892,98 | R\$ 1.266.211,01 | R\$ 613.428,26 | R\$ 15.686,78 | 1,0571% | 0,8416% |
| Totais | R\$ 1.681.059,51 | R\$ 182.892,98 | R\$ 1.266.211,01 | R\$ 613.428,26 | R\$ 15.686,78 | 1,0571% | 0,8416% |

Retornos acumulados

| Mês | Saldo anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno R\$ | Efetivo % | 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% |

| | Total aplicações | Total Resgates | Total retorno R\$ | Efetivo % | Meta % | Atingimento % |
|-------|------------------|------------------|-------------------|-----------|---------|---------------|
| Total | R\$ 182.892,98 | R\$ 1.266.211,01 | R\$ 15.686,78 | 0,8416% | 0,0000% | ∞% |

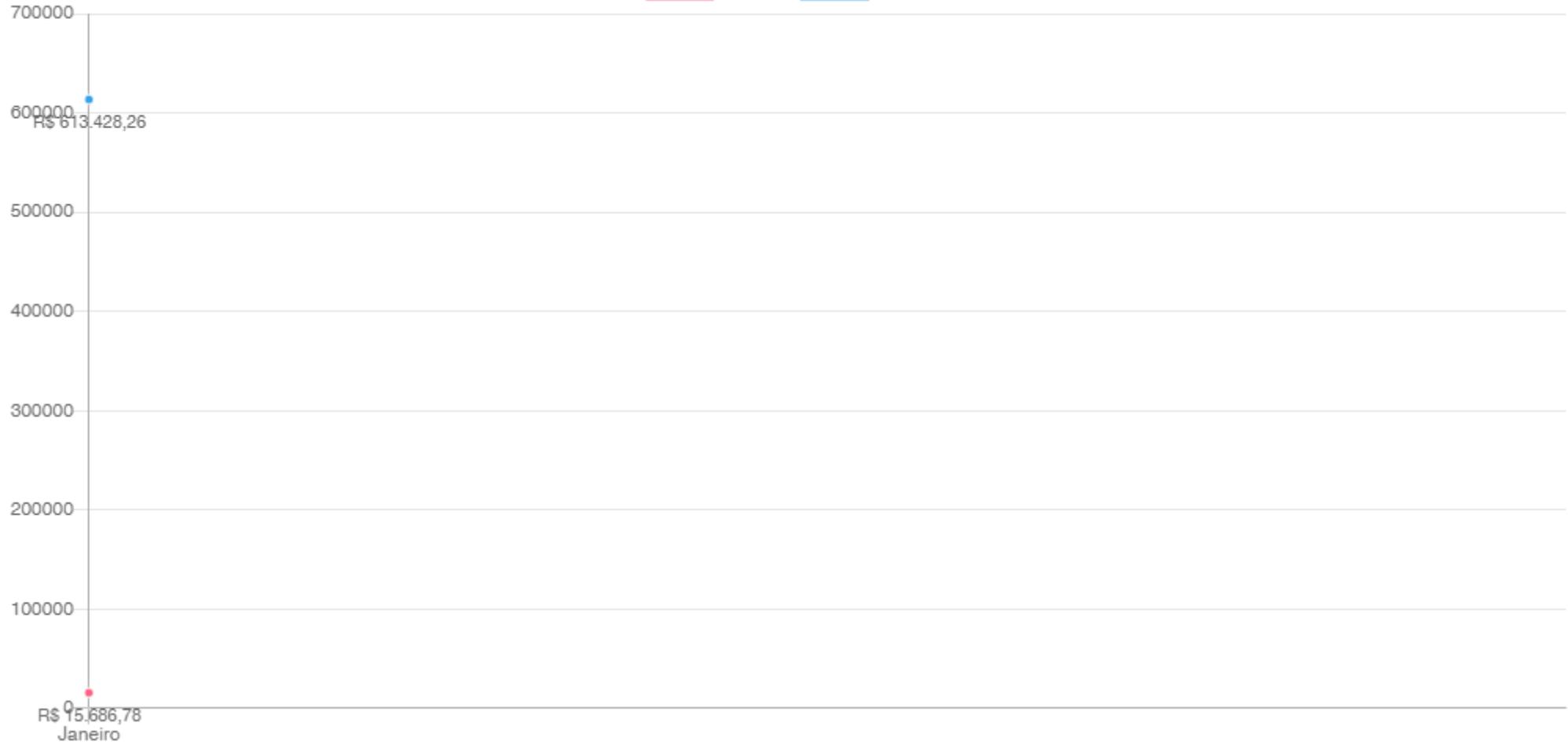
Gráfico - retorno acumulado no ano



| | Janeiro |
|---------|---------|
| Efetivo | 0,842% |
| Meta | 0,000% |

Grafico - Evolução do patrimônio

Retorno Saldo



| | Janeiro |
|--|----------------|
| | R\$ 613.428,26 |
| | R\$ 15.686,78 |

Grafico - Retorno mensal

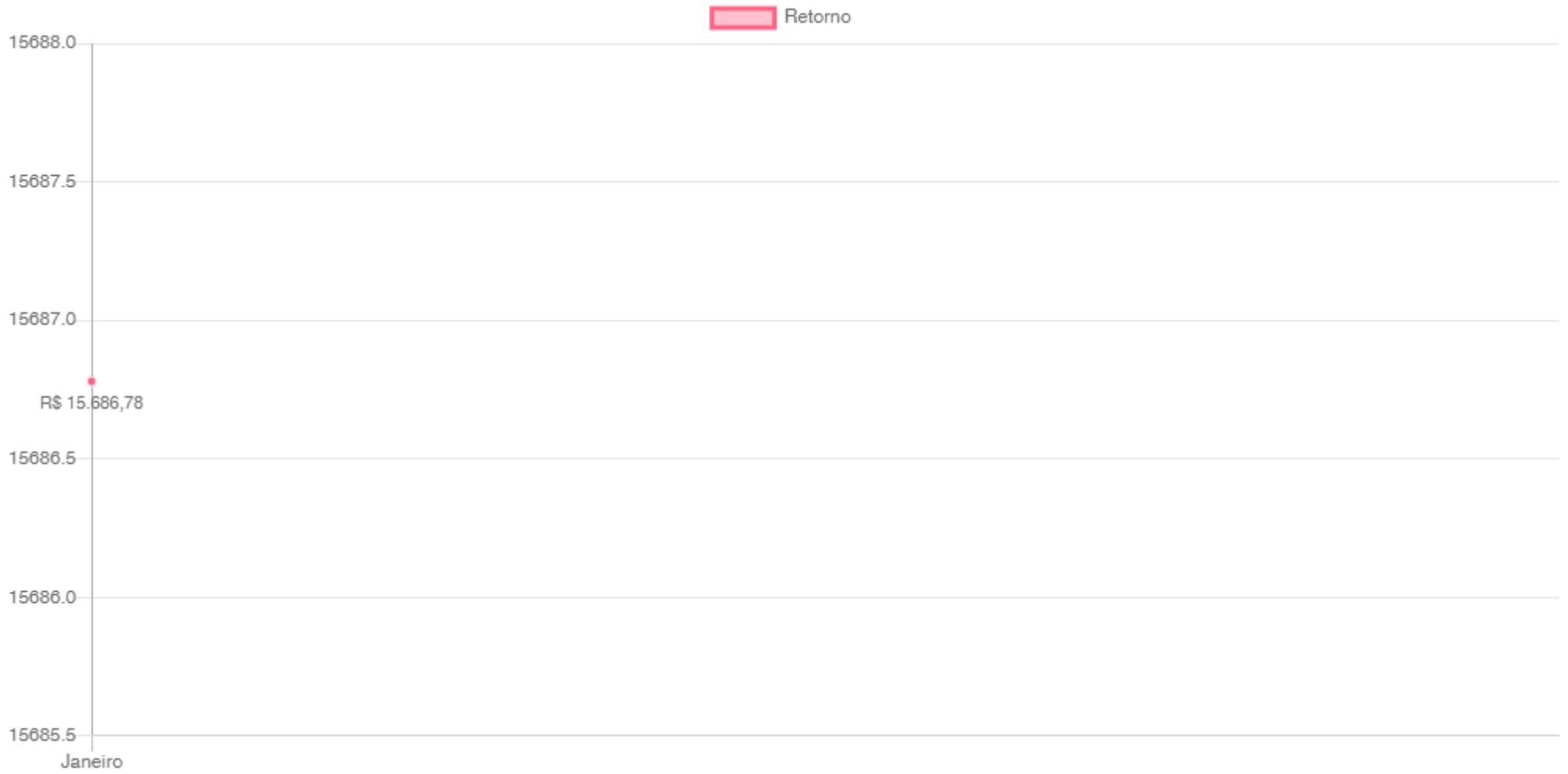
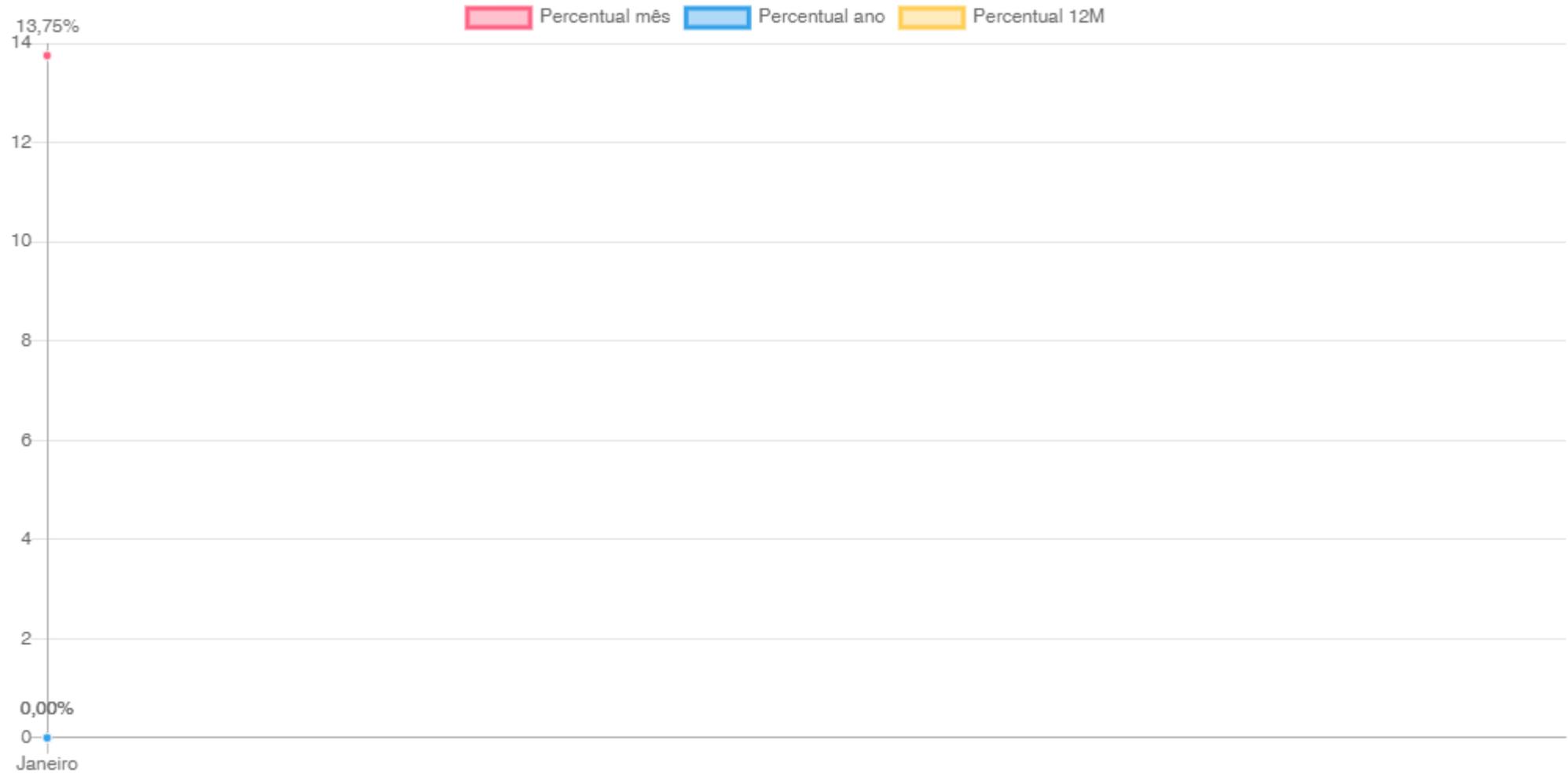




Gráfico - Índices econômicos

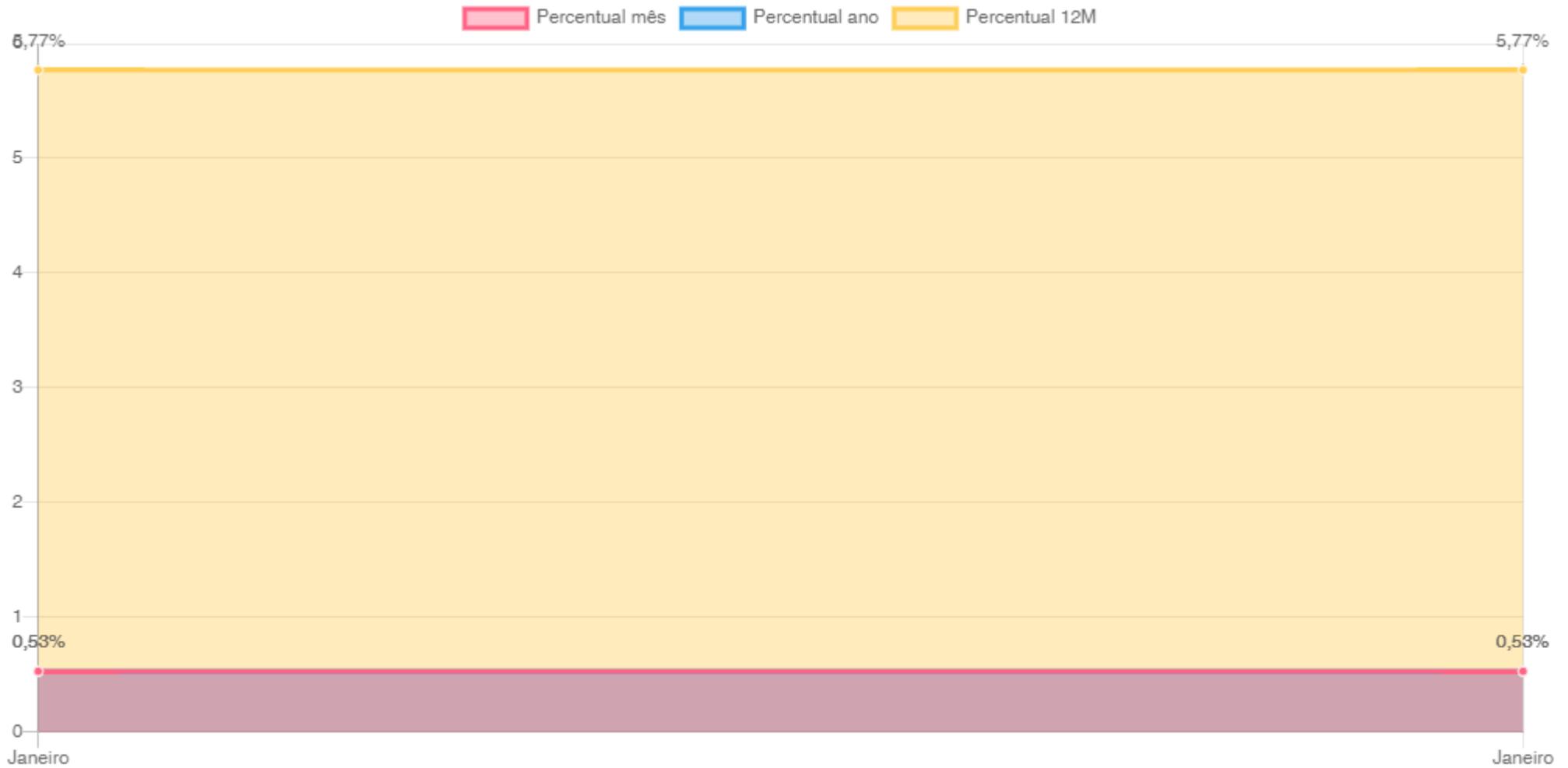
SELIC



| Mês | Janeiro |
|----------------|---------|
| Percentual mês | 13,75% |
| Percentual ano | 0,00% |
| Percentual 12M | 0,00% |

Gráfico - Índices econômicos

IPCA

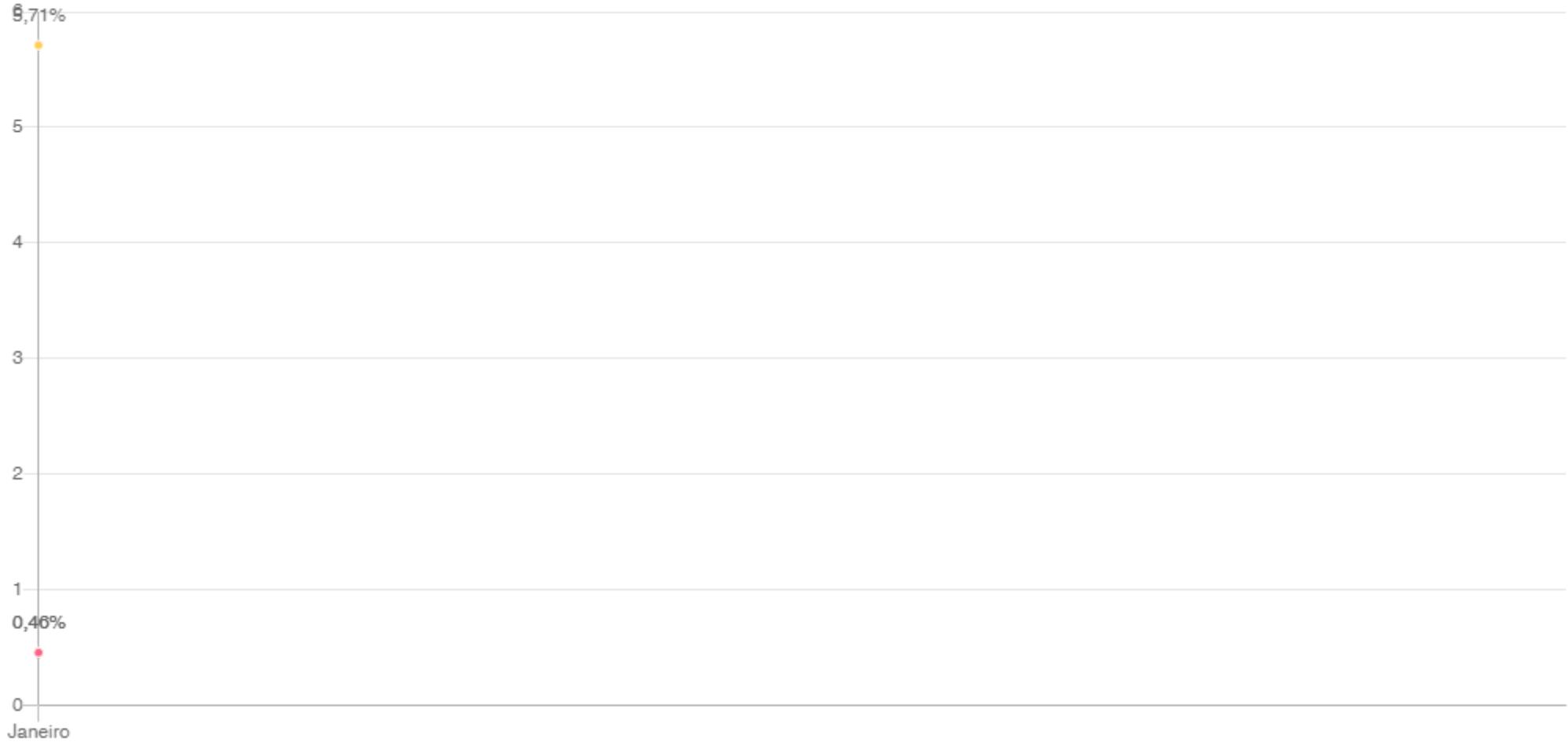


| Mês | Janeiro | Janeiro |
|----------------|---------|---------|
| Percentual mês | 0,53% | 0,53% |
| Percentual ano | 0,53% | 0,53% |
| Percentual 12M | 5,77% | 5,77% |

Gráfico - Índices econômicos

INPC

■ Percentual mês ■ Percentual ano ■ Percentual 12M



| Mês | Janeiro |
|----------------|---------|
| Percentual mês | 0,46% |
| Percentual ano | 0,46% |
| Percentual 12M | 5,71% |

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 emissoras 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.

| Nome | Benchmark | Sharpe | VAR 12M | VOL 3M | VOL 6M | VOL 12M |
|--|-----------|------------|-----------|-----------|------------|------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | CDI | 25,372682% | 0,000136% | 8,953076% | 22,494816% | 55,288132% |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | CDI | 25,372682% | 0,000136% | 8,953076% | 22,494816% | 55,288132% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | IRF-M 1 | 25,240137% | 0,000218% | 9,624415% | 23,654034% | 58,016149% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | CDI | 25,373974% | 0,000137% | 9,824307% | 24,766013% | 61,038678% |

| | Benchmark | Sharpe | VAR 12M | VOL 3M | VOL 6M | VOL 12M |
|-------|-----------|------------|-----------|--------|--------|---------|
| Geral | | 25,339868% | 0,000157% | | | |

Provisão de risco - Mercado

| Nome | CNPJ Fundo | Benchmark | Saldo | VAR 12M | VOL 12M | VAR% BASE 1 DIA CONFIANÇA 95% 252 DU* (R\$) |
|---|--------------------|-----------|----------------|-----------|------------|---|
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 | CDI | R\$ 13.056,40 | 0,136327% | 55,288132% | R\$ 0,02 |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.415/0001-05 | CDI | R\$ 35.246,45 | 0,136327% | 55,288132% | R\$ 0,05 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 11.328.882/0001-35 | IRF-M 1 | R\$ 547.672,07 | 0,218368% | 58,016149% | R\$ 1,20 |

| | | | | | | |
|--|------------------------|-----|---------------|-----------|------------|----------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | 13.077.418/0001- 49 | CDI | R\$ 17.446,06 | 0,137416% | 61,038678% | R\$ 0,02 |
|--|------------------------|-----|---------------|-----------|------------|----------|

| Risco de mercado | |
|--------------------------------------|----------------|
| Saldo Total | R\$ 613.420,98 |
| Provisão para perda e Investimentos: | R\$ 1,29 |
| % Provisão de perda | 0,0002% |
| % Aceitavel perda | 2,0% |
| Limite de utilização | 0,0105% |

| Prazo Resgate | Quantidade Fundos | % carteira | Saldo |
|---------------|-------------------|------------|----------------|
| D + 0 | 4 | 100,0000% | R\$ 613.420,98 |

