



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: 1257-2	R\$ 351.330,92	96,66734%	800	0,0152%	R\$ 2.310.961.339,30	Art 7º , IV "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: 3818-0	R\$ 12.112,32	3,33266%	800	0,00052%	R\$ 2.310.961.339,30	Art 7º , IV "a"	Baixo	Fundo de Investimento
Total	R\$ 363.443,24							

Enquadramentos

Resolução

% Carteira

Saldo do grupo

Situação

(RPPS) - FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a

100,0000%

R\$ 363.443,24

Não 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\$ 351.330,92	163460.7974	0,015203%	R\$ 2.310.961.339,30	96,6673%	Lim. Resol.: 40,00% Lim. Política: 40,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	Desenquadrado - política
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	R\$ 12.112,32	5635.3959	0,000524%	R\$ 2.310.961.339,30	3,3326%	Lim. Resol.: 40,00% Lim. Política: 40,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	Desenquadrado - limite

Por benchmark

Benchmark

% Carteira | Saldo do grupo

CDI

100,0000% | R\$ 363.443,24

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	96,667342%	R\$ 351.330,92
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	3,332658%	R\$ 12.112,32

Por administradores

Administrador

% Carteira |

Saldo do grupo

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

100,0000% |

R\$ 363.443,24

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	96,667342%	R\$ 351.330,92
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	3,332658%	R\$ 12.112,32

Retornos do mês

Fundo de 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\$ 44.947,40	R\$ 8.435,68	R\$ 41.349,23	R\$ 12.112,32	3,3327%	R\$ 78,47	0,3480%	0,1469%
13.077.415/0001-05 - BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 555.717,39	R\$ 570.290,03	R\$ 778.047,82	R\$ 351.330,92	96,6673%	R\$ 3.371,32	0,3480%	0,2994%

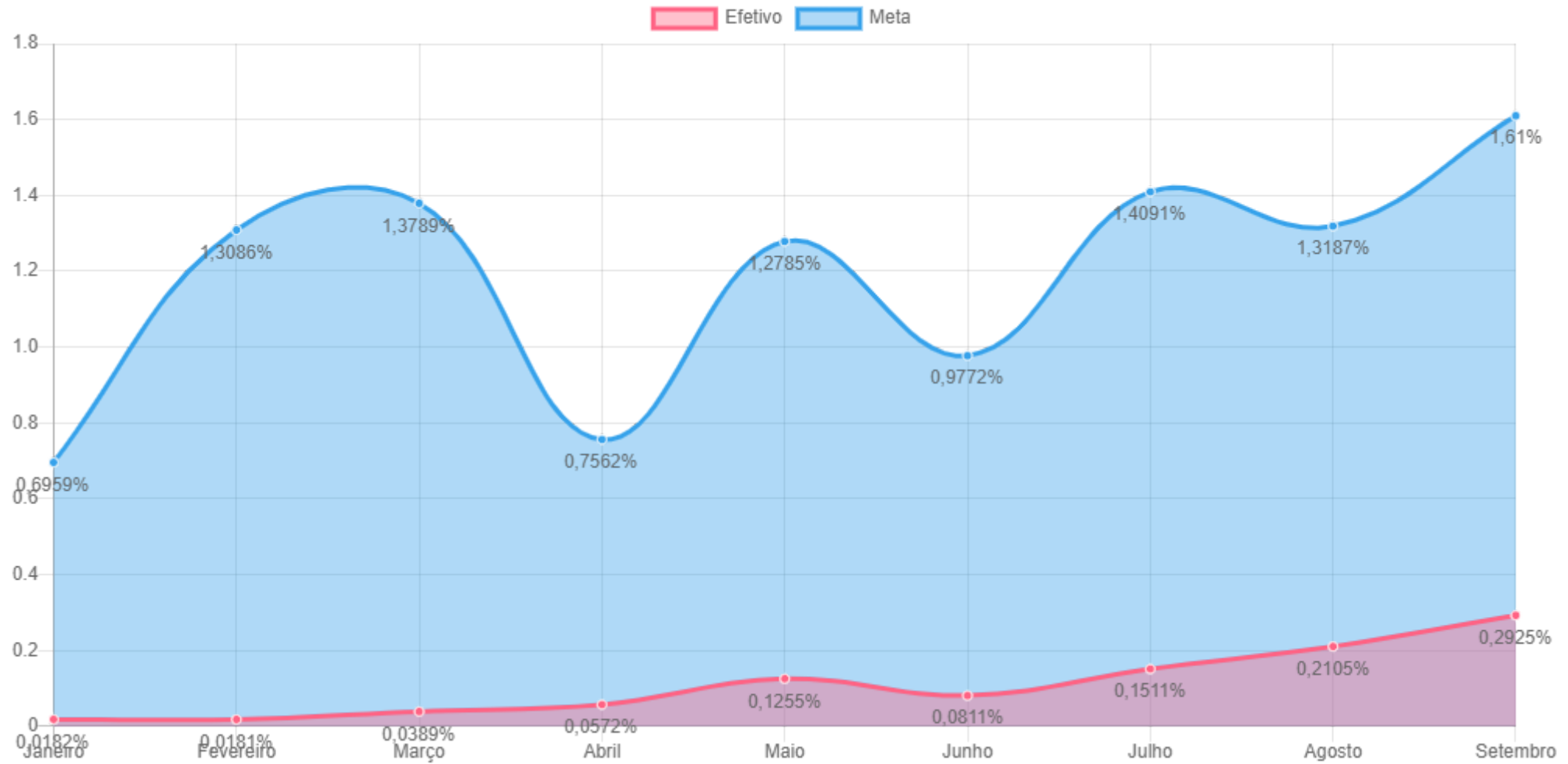
Tipo	Saldo anterior	Total aplicações	Total resgates	Saldo atual	Total retorno	Total retorno %	Total retorno efetivo
Fundo de Renda Fixa	R\$ 600.664,79	R\$ 578.725,71	R\$ 819.397,05	R\$ 363.443,24	R\$ 3.449,79	0,3480%	0,2925%
Totais	R\$ 600.664,79	R\$ 578.725,71	R\$ 819.397,05	R\$ 363.443,24	R\$ 3.449,79	0,3480%	0,2925%

Retornos acumulados

Mês	Saldo anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
JANEIRO	R\$ 662.913,60	R\$ 579.024,66	R\$ 675.457,40	R\$ 566.706,40	R\$ 225,54	0,0182%	0,6959%	2,6096%
FEVEREIRO	R\$ 566.706,40	R\$ 1.216.284,83	R\$ 1.714.614,56	R\$ 68.698,74	R\$ 322,07	0,0181%	1,3086%	1,3804%
MARÇO	R\$ 68.698,74	R\$ 1.713.301,42	R\$ 1.110.752,61	R\$ 671.939,94	R\$ 692,39	0,0389%	1,3789%	2,8178%
ABRIL	R\$ 671.939,94	R\$ 672.184,79	R\$ 1.051.467,91	R\$ 293.425,74	R\$ 768,92	0,0572%	0,7562%	7,5649%
MAIO	R\$ 293.425,74	R\$ 1.204.256,35	R\$ 940.430,44	R\$ 559.131,04	R\$ 1.879,39	0,1255%	1,2785%	9,8151%
JUNHO	R\$ 559.131,04	R\$ 1.658.027,30	R\$ 1.330.920,26	R\$ 888.035,90	R\$ 1.797,82	0,0811%	0,9772%	8,2979%
JULHO	R\$ 888.035,90	R\$ 506.960,95	R\$ 967.603,64	R\$ 429.501,29	R\$ 2.108,08	0,1511%	1,4091%	10,7244%
AGOSTO	R\$ 429.501,29	R\$ 1.025.438,65	R\$ 857.338,00	R\$ 600.664,79	R\$ 3.062,85	0,2105%	1,3187%	15,9637%
SETEMBRO	R\$ 600.664,79	R\$ 578.725,71	R\$ 819.397,05	R\$ 363.443,24	R\$ 3.449,79	0,2925%	1,6100%	18,1681%

	Total aplicações	Total Resgates	Total retorno R\$	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
Total	R\$ 9.154.204,66	R\$ 9.467.981,87	R\$ 14.306,85	0,9970%	11,2554%	8,8583%

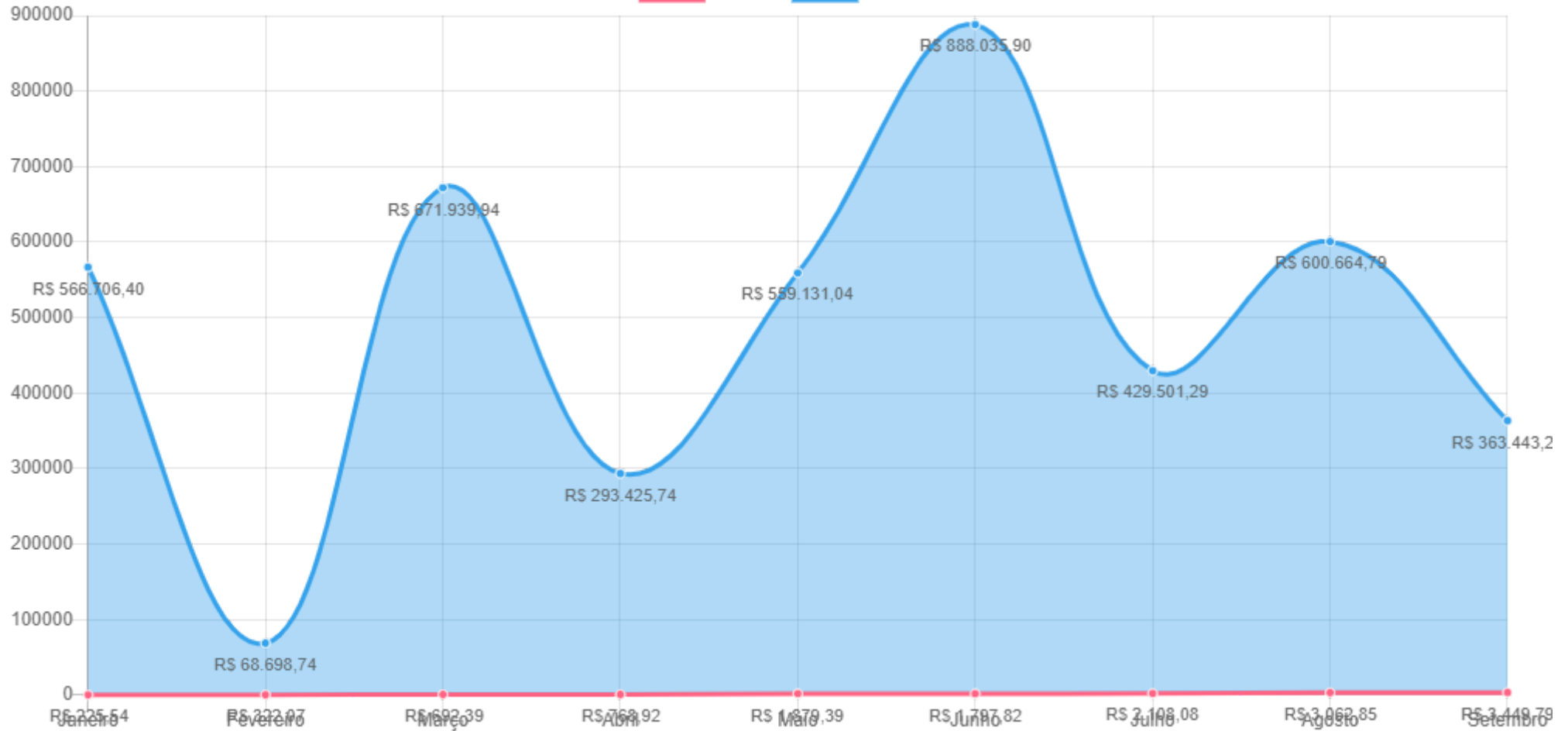
Gráfico - retorno acumulado no ano



	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maior	Junho	Julho	Agosto	Setembro
Efetivo	0,018%	0,018%	0,039%	0,057%	0,125%	0,081%	0,151%	0,211%	0,293%
Meta	0,696%	1,309%	1,379%	0,756%	1,279%	0,977%	1,409%	1,319%	1,610%

Grafico - Evolução do patrimônio

Retorno Saldo



Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio	Junho	Julho	Agosto	Setembro
R\$ 566.706,40	R\$ 68.698,74	R\$ 671.939,94	R\$ 293.425,74	R\$ 559.131,04	R\$ 888.035,90	R\$ 429.501,29	R\$ 600.664,79	R\$ 363.443,24
R\$ 225,54	R\$ 322,07	R\$ 692,39	R\$ 768,92	R\$ 1.879,39	R\$ 1.797,82	R\$ 2.108,08	R\$ 3.062,85	R\$ 3.449,79

Grafico - Retorno mensal

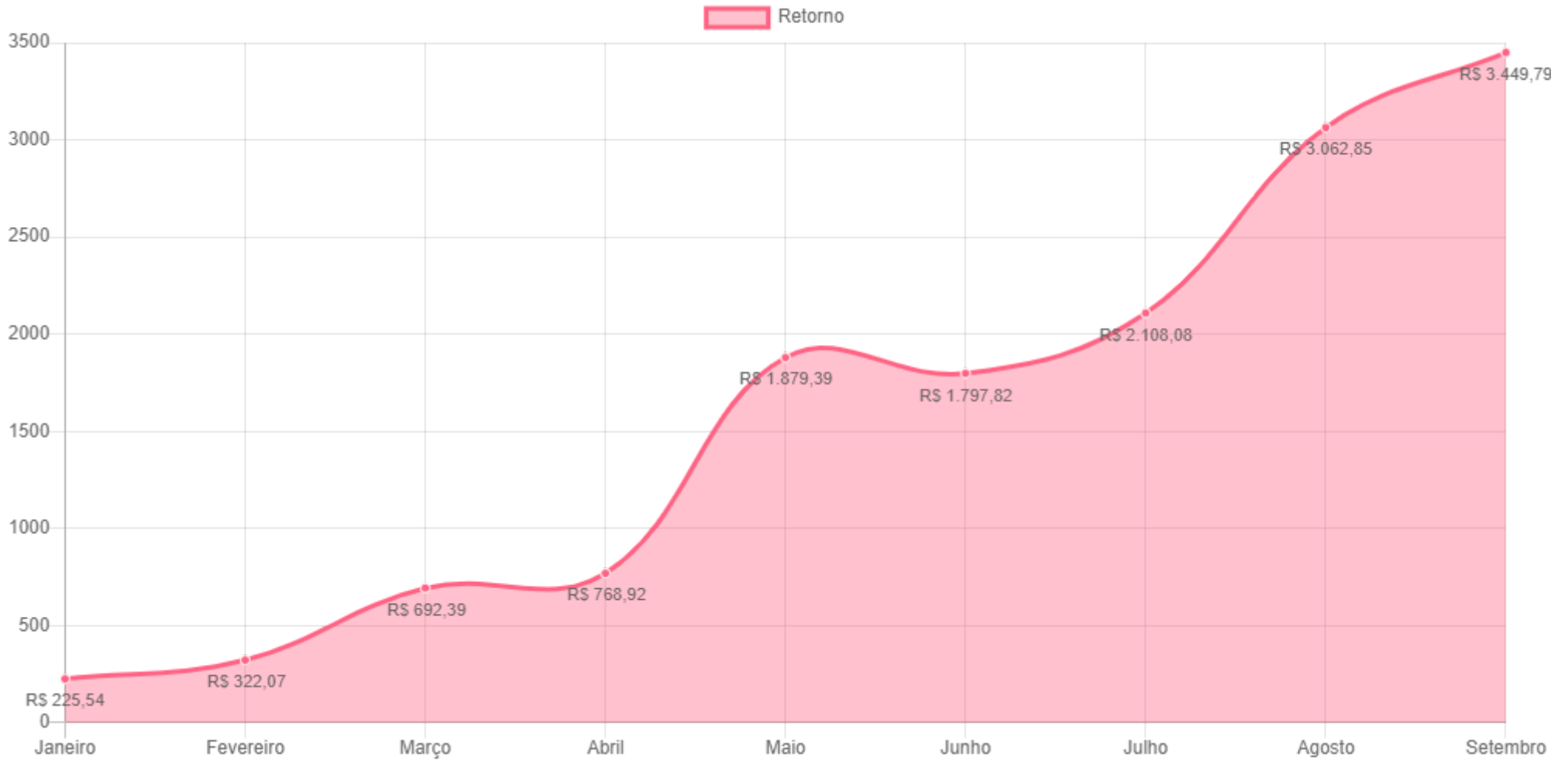
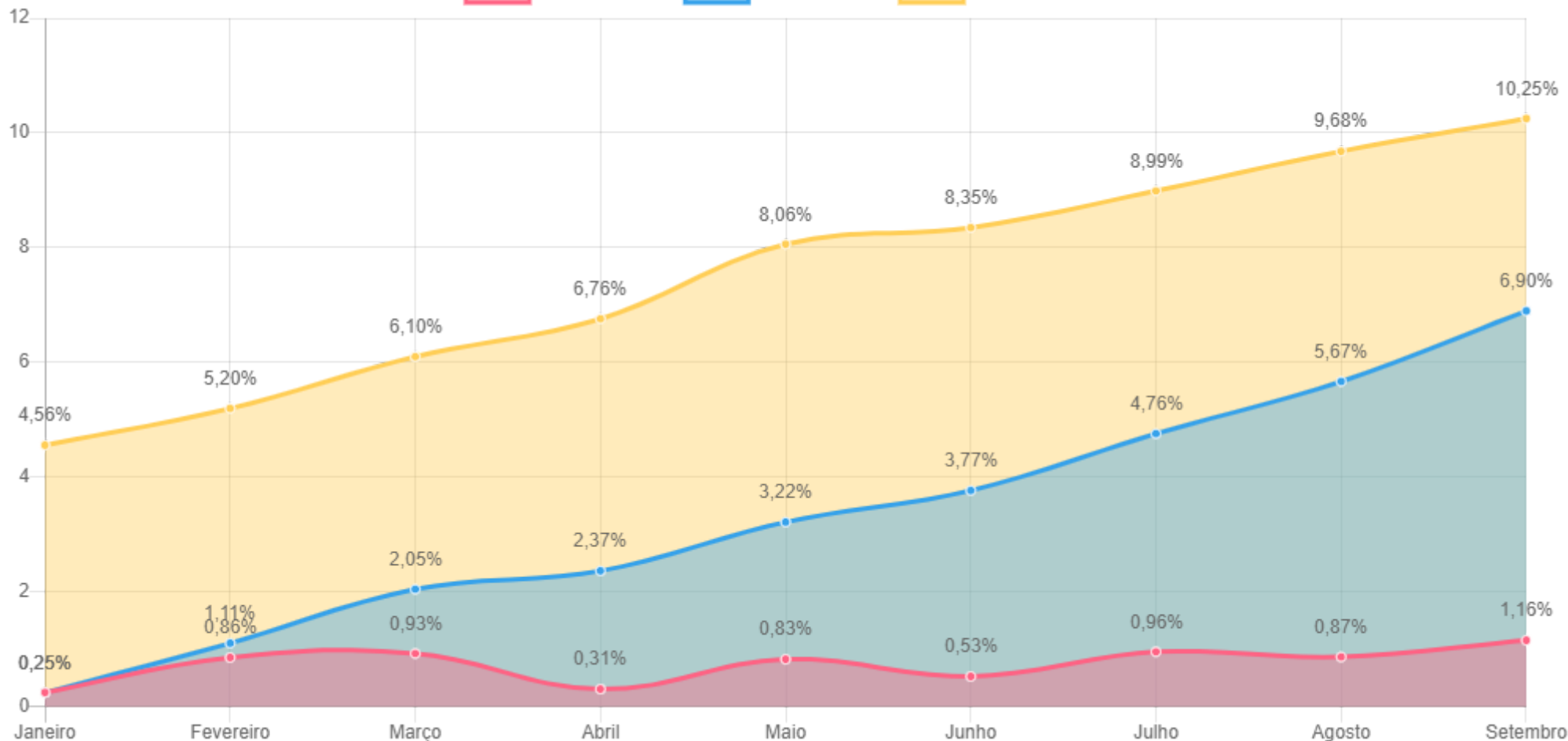


Gráfico - Índices econômicos

IPCA

■ Percentual mês ■ Percentual ano ■ Percentual 12M

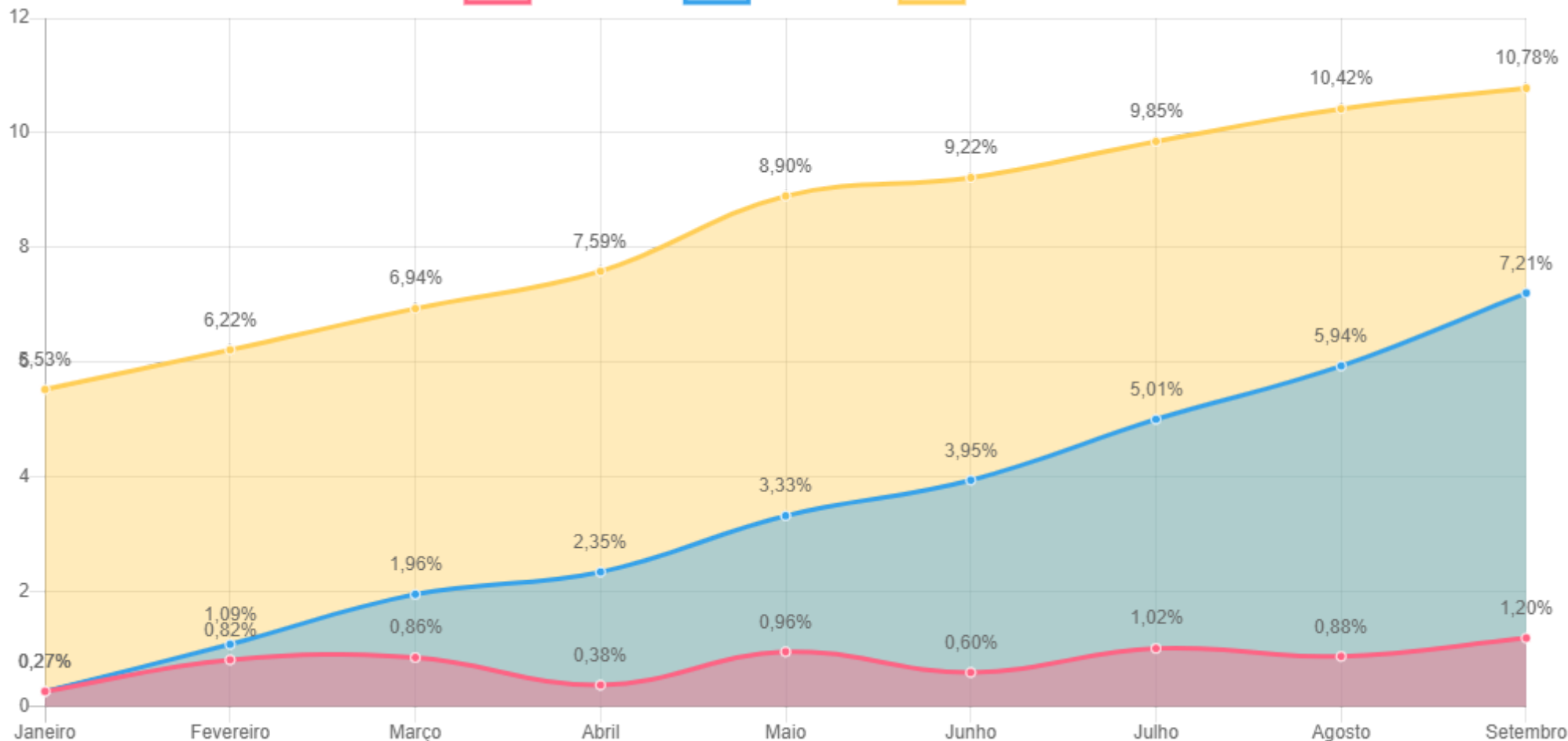


Mês	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maió	Junho	Julho	Agosto	Setembro
Percentual mês	0,25%	0,86%	0,93%	0,31%	0,83%	0,53%	0,96%	0,87%	1,16%
Percentual ano	0,25%	1,11%	2,05%	2,37%	3,22%	3,77%	4,76%	5,67%	6,90%
Percentual 12M	4,56%	5,20%	6,10%	6,76%	8,06%	8,35%	8,99%	9,68%	10,25%

Gráfico - Índices econômicos

INPC

■ Percentual mês ■ Percentual ano ■ Percentual 12M



Mês	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maió	Junho	Julho	Agosto	Setembro
Percentual mês	0,27%	0,82%	0,86%	0,38%	0,96%	0,60%	1,02%	0,88%	1,20%
Percentual ano	0,27%	1,09%	1,96%	2,35%	3,33%	3,95%	5,01%	5,94%	7,21%
Percentual 12M	5,53%	6,22%	6,94%	7,59%	8,90%	9,22%	9,85%	10,42%	10,78%

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	26,449484%	0,000097%	2,664112%	5,636426%	8,929215%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	26,449484%	0,000097%	2,664112%	5,636426%	8,929215%

	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 3M	VOL 6M	VOL 12M
Geral		26,449484%	0,000097%			

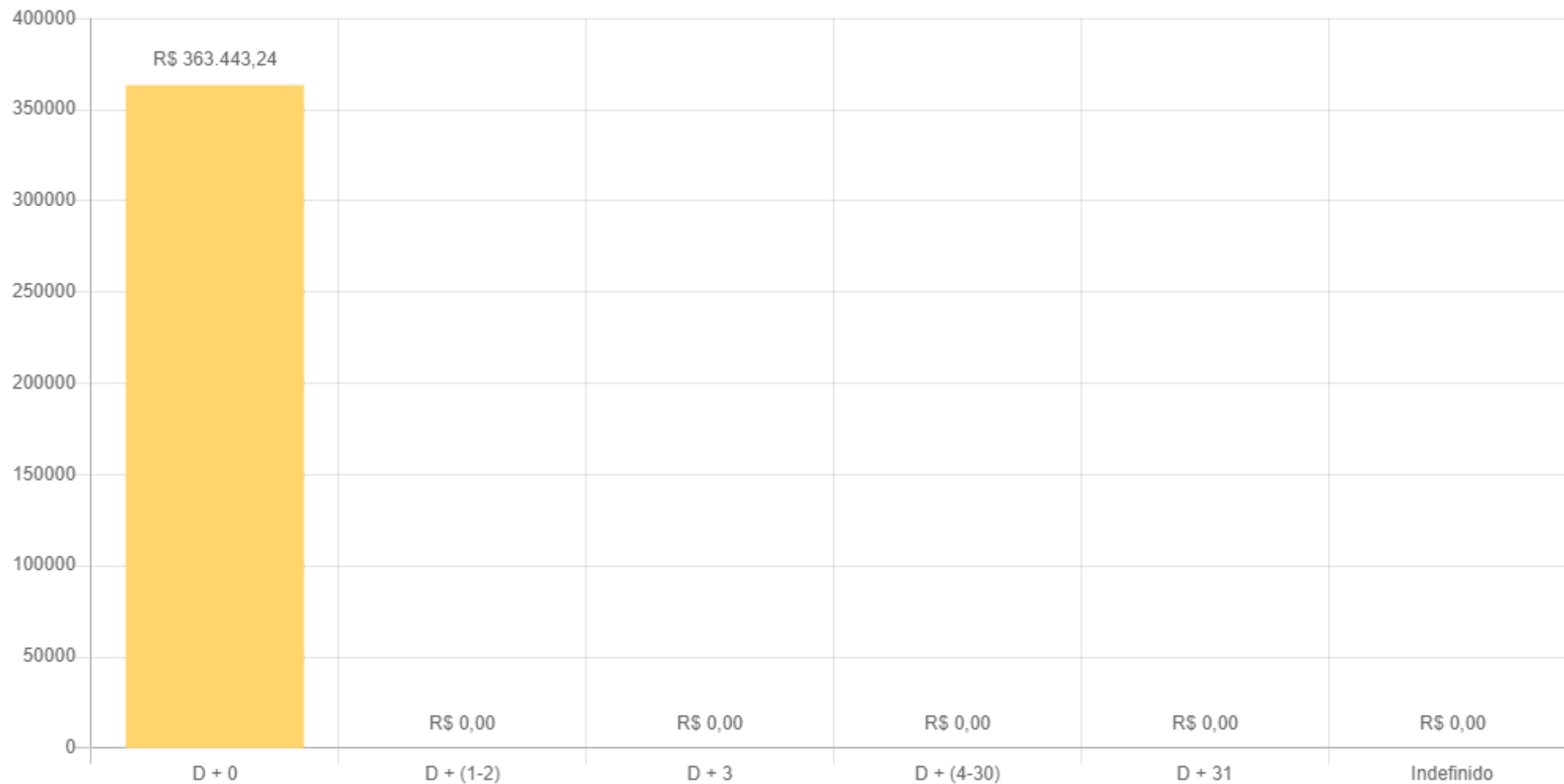
Provisão de risco - Mercado

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\$ 351.330,92	0,000097%	8,929215%	R\$ 0,34
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	R\$ 12.112,32	0,000097%	8,929215%	R\$ 0,01

Risco de mercado

Saldo Total	R\$ 363.443,24
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 0,35
% Provisão de perda	0,0001%
% Aceitavel perda	2,0%
Limite de utilização	0,0048%

Prazo Resgate	Quantidade Fundos	% carteira	Saldo
D + 0	2	100,0000%	R\$ 363.443,24



Risco crédito

Artigos	Limite	Limite Política	Saldo	% carteira
FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a	40,0000%	40,0000%	R\$ 363.443,24	100,0000%

Risco crédito	% carteira	Saldo
100% Títulos publicos	50,0000%	R\$ 181.721,62
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	50,0000%	R\$ 181.721,62
100% Títulos privados	0,0000%	R\$ 0,00
Aceitavel carteira Titulos Privados	30,00%	
Limite de Utilização	166,67%	

