



DI BLASI
Consultoria Financeira

**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
CAPANEMA PA**
Janeiro 2024

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	13,07%	1,035	0.00	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 72.761,37	B	Fundo de Investimento	1,00%
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM C	0	19,68%	1,035	0.00	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 109.503,84	B	Fundo de Investimento	1,00%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	0	0,17%	1,127	0.00	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 918,92	B	Fundo de Investimento	0,20%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONC	0	67,08%	1,171	0.00	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 373.311,72	B	Fundo de Investimento	0,20%
49.964.484/0001-88	BB PREV RF TIT. PUB VÉRTICE 2024 F	0	0,00%	385	0.00	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 0,00	B		0,10%

R\$ 556.495,85

Retorno do mês

Nome Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI	R\$ 421.496,37	R\$ 793.327,37	R\$ 1.143.841,12	R\$ 72.906,81	R\$ 1.924,19	0,1583%	CDI
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI	R\$ 87.357,61	R\$ 111.135,91	R\$ 89.642,83	R\$ 109.511,30	R\$ 660,61	0,3328%	CDI
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F	R\$ 911,05	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 918,92	R\$ 7,87	0,8638%	IRF-M 1
BB PREV RF REFERENCIADO DI L	R\$ 170.436,85	R\$ 200.000,00	R\$ 0	R\$ 373.311,72	R\$ 2.874,87	0,7760%	CDI
Total	680,201.88	1,104,463.28	1,233,483.95	556,648.75	5,467.54	0,3064%	

Enquadramentos

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

 % Carteira: : **0,17%**

 Saldo do grupo: **R\$ 918,92**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 918,92	258.24	0,00001%	7,961,364,534.06	0,17%	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: : **99,83%**

 Saldo do grupo: **R\$ 555.729,83**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 72.906,81	26,580.26	0,00174%	4,198,417,498.27	13,10%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Desenquadrado - limite
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 109.511,30	39,925.47	0,00261%	4,198,417,498.27	19,67%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Desenquadrado - limite
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 373.311,72	120,703.27	0,00228%	16,400,080,186.89	67,06%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Desenquadrado - politica

Enquadramento por Benchmark

CDI

 % Carteira: **99,83%**

 Saldo do grupo: **R\$ 555.729,83**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 72.906,81	26,580.26	0.00	13.10	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Desenquadrado - limite
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 109.511,30	39,925.47	0.00	19.67	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Desenquadrado - limite
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 373.311,72	120,703.27	0.00	67.06	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Desenquadrado - política

IRF-M 1

 % Carteira: **0,17%**

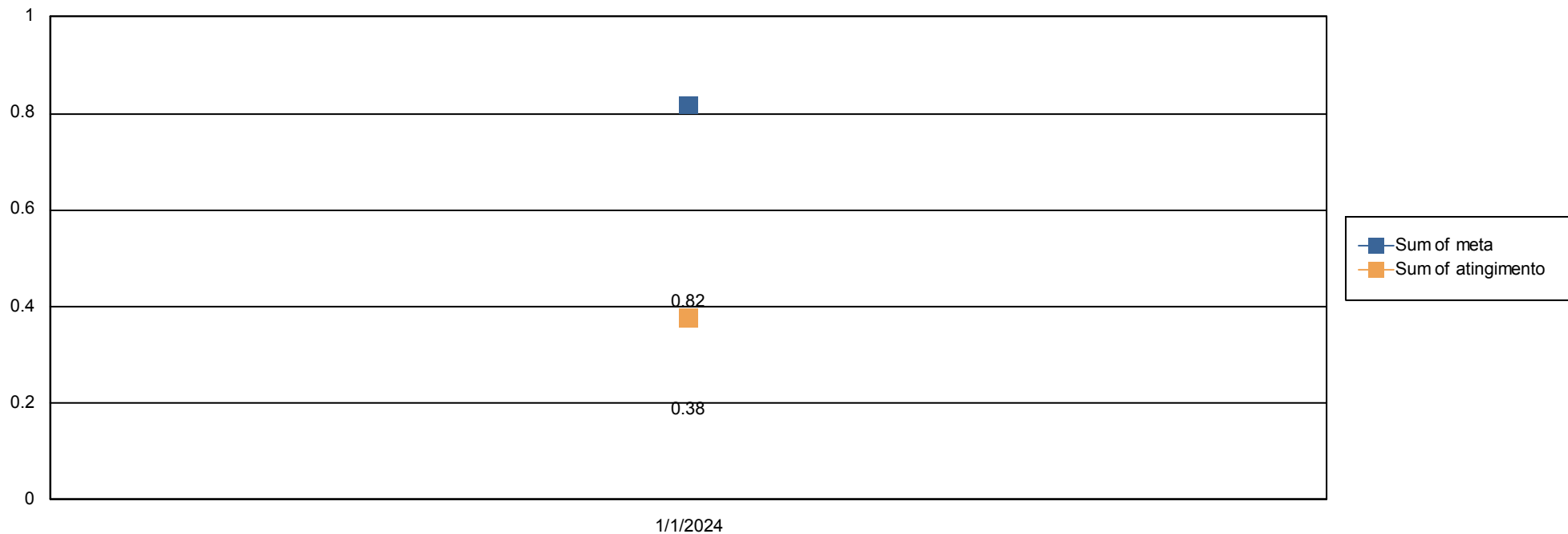
 Saldo do grupo: **R\$ 918,92**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 918,92	258.24	0.00	0.17	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

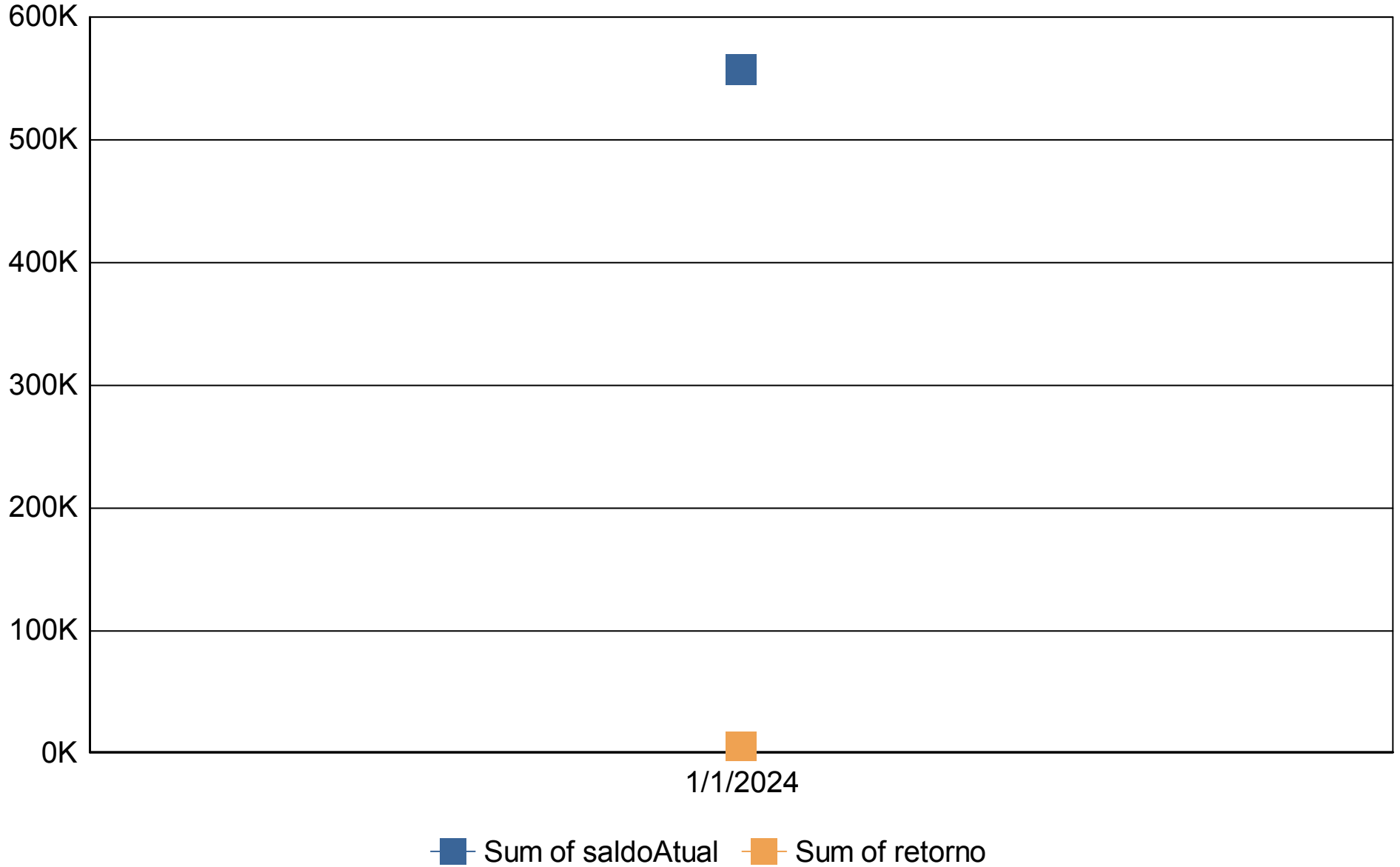
Retorno acumulado no ano

Período	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Retorno %	Meta	Atingimento
Janeiro	R\$ 680.201,88	R\$ 1.104.463,28	R\$ 1.233.483,95	R\$ 556.648,75	R\$ 5.467,54	0,3064%	0,8163	37,5306%
Total		1,104,463.28	1,233,483.95		5,467.54	0,3064%	0,8163%	37,5306%

Meta x Atingimento

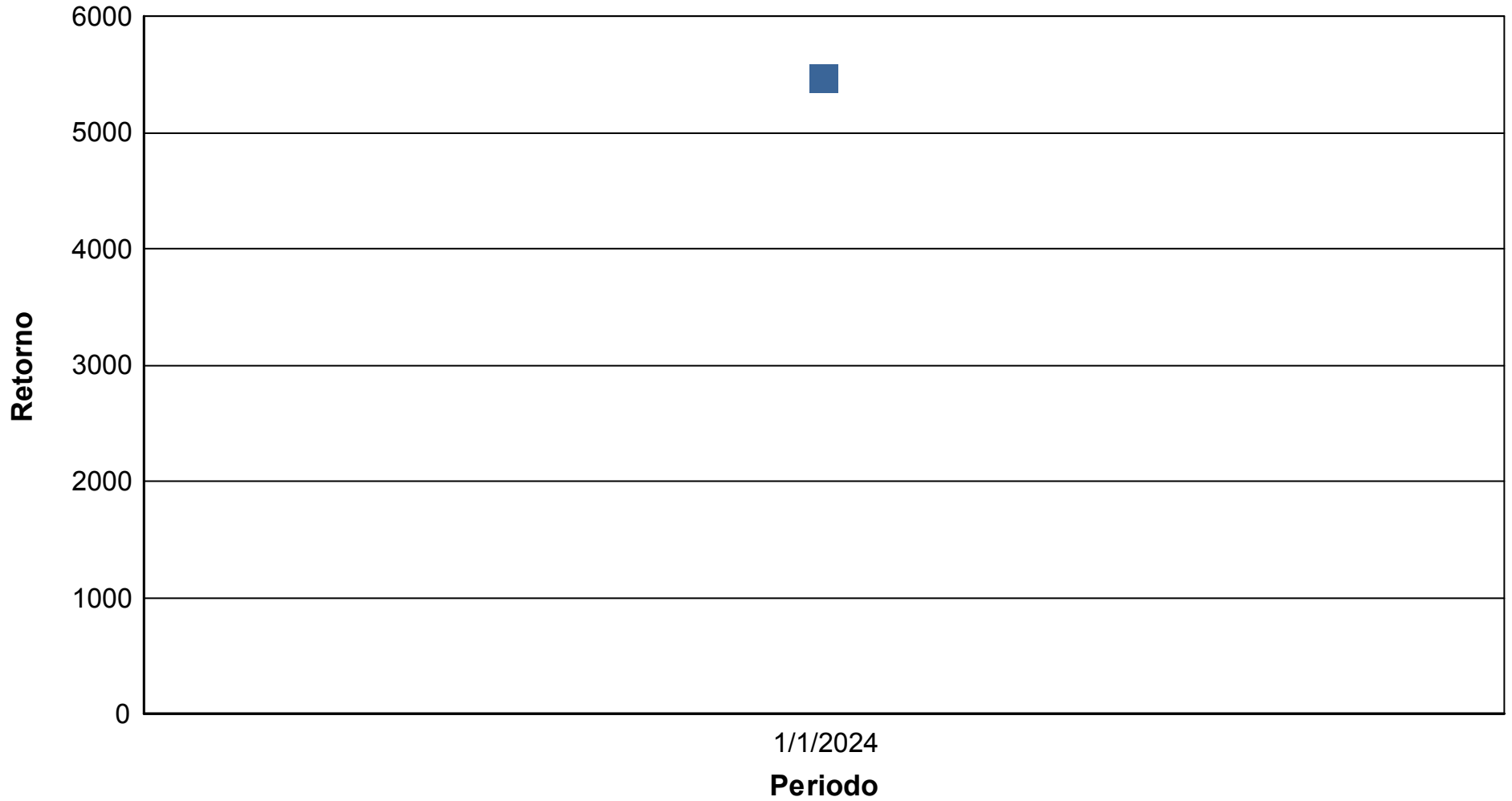


Evolução do patrimônio

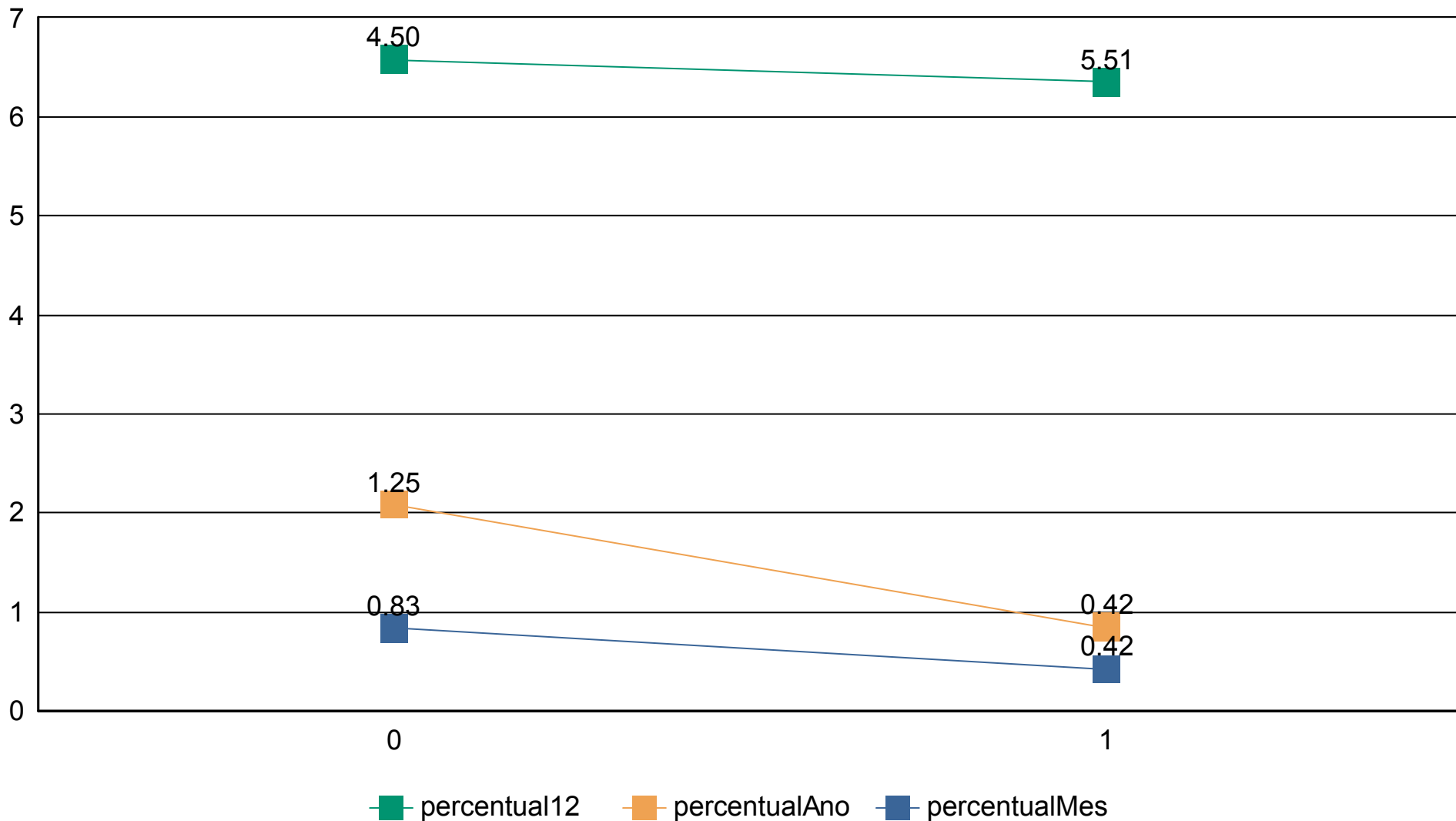




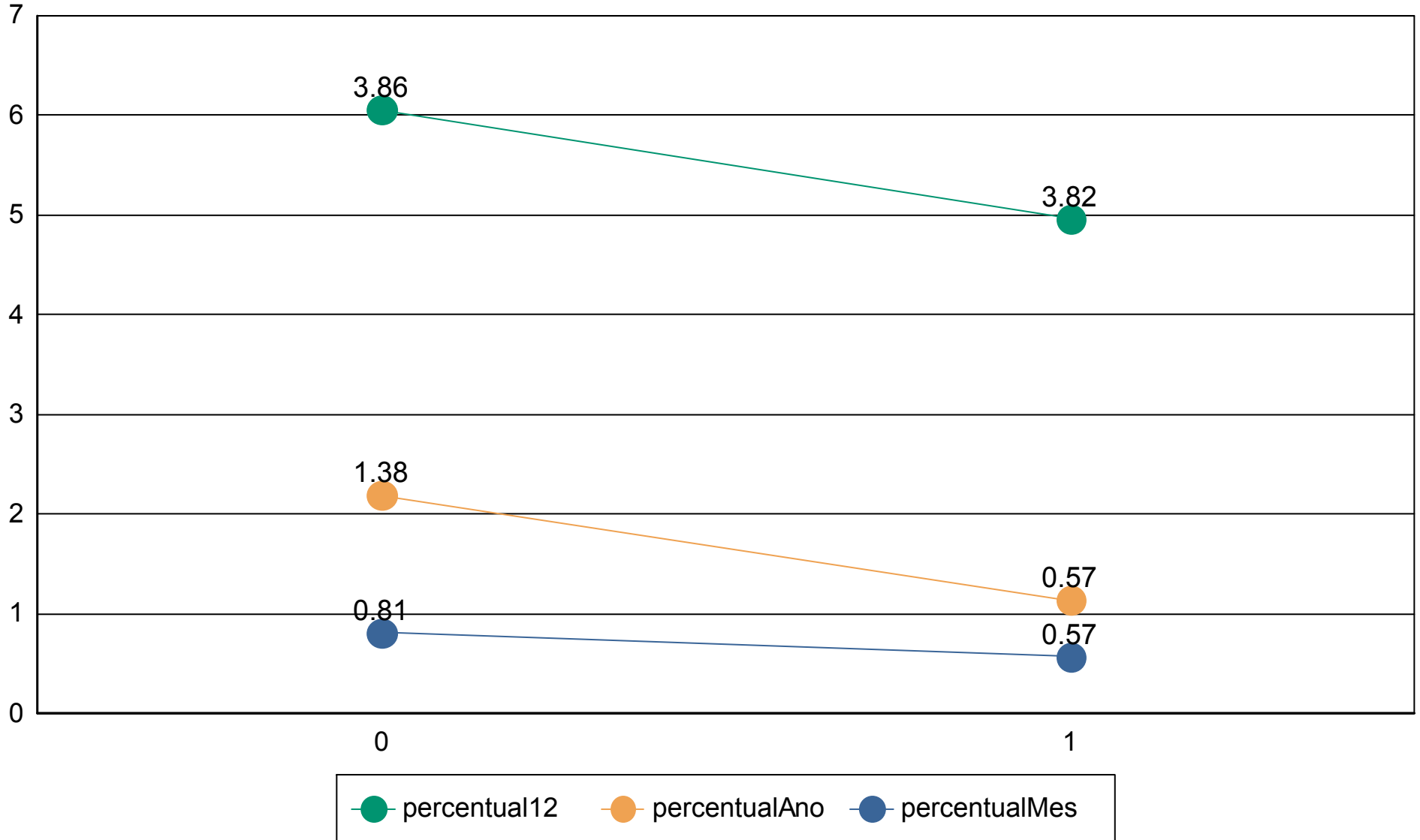
Retorno Mensal



Índices Econômicos - IPCA

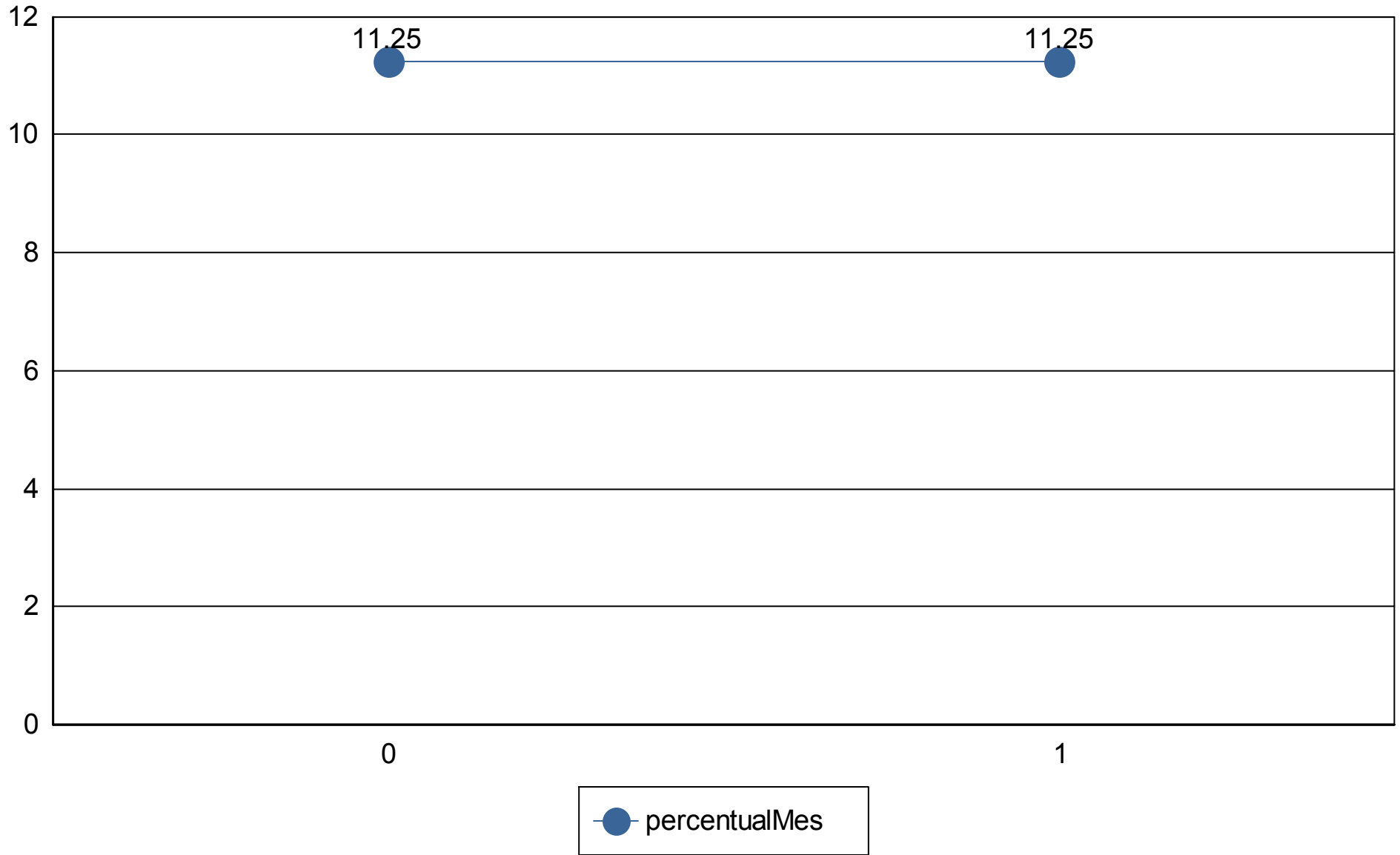


Índices Econômicos - INPC





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 emitentes 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

Provisão de risco - Mercado

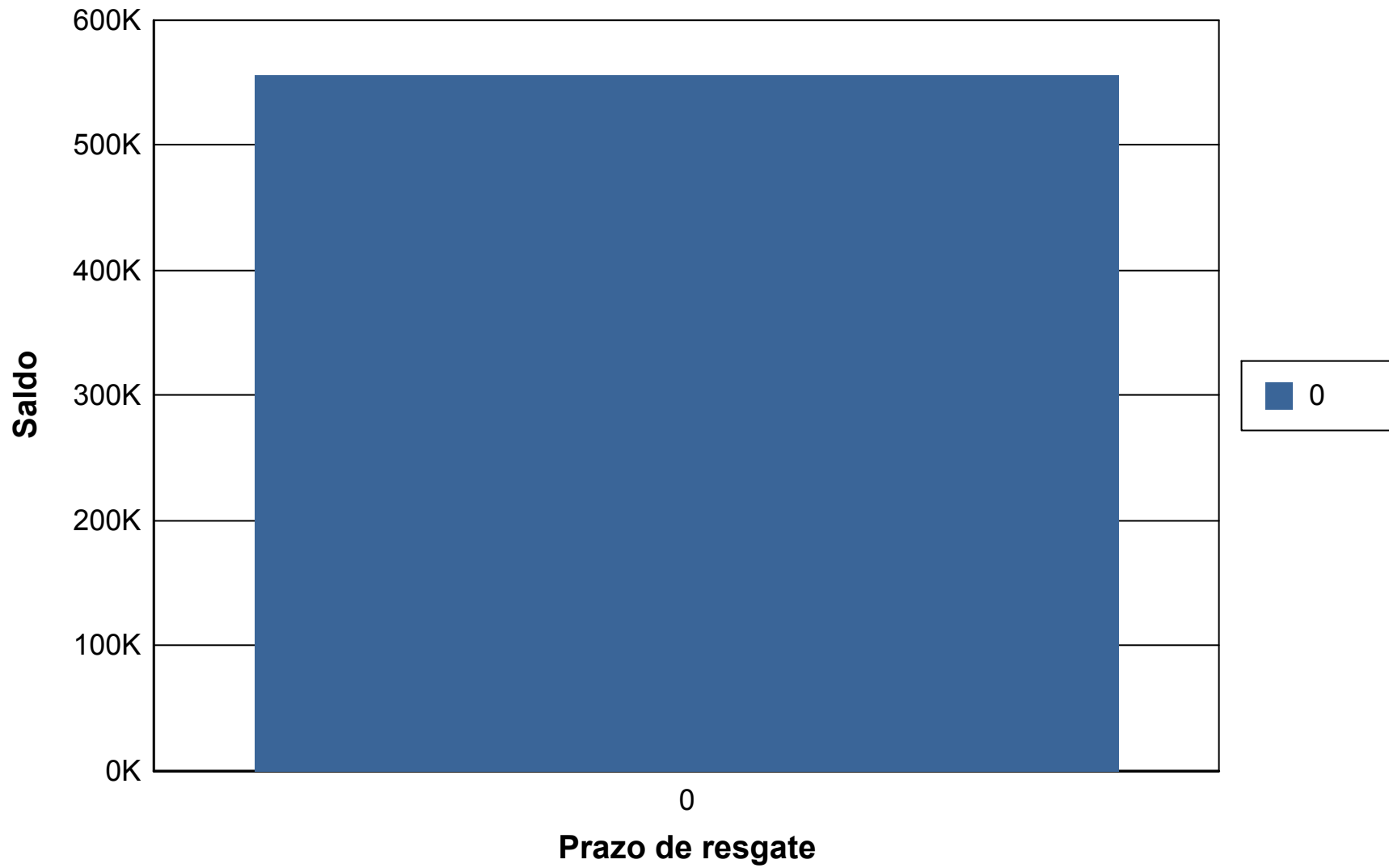
CNPJ	Nome do fundo	Benchmark	Saldo	VAR12	VOL12	VAR% BASE 1

Saldo Total:	
Provisão para perda e Investimentos	
% Provisão de perda	
% Aceitavel perda	2%
Limite de utilização	



Nome do Fundo	Saldo	% Part.	N. Cotistas	% PL	PL do Fundo	Legislação	Grau risco	Prazo Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE	R\$ 72.761,37	13,07%	1,035	0,00%	R\$ 4.198.417.498,27	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE	R\$ 109.503,84	19,68%	1,035	0,00%	R\$ 4.198.417.498,27	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULC	R\$ 918,92	0,17%	1,127	0,00%	R\$ 7.961.364.534,06	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIAD	R\$ 373.311,72	67,08%	1,171	0,00%	R\$ 16.400.080.186,89	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBL	R\$ 0,00	0,00%	385	0,00%	R\$ 2.636.302.220,38	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
0	R\$ 556.495,85	5	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\$ 918,92	0,17
Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	60,00%	60,00%	R\$ 555.576,93	99,83

	Saldo	% Carteira
100% títulos públicos	0.00	0.00
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	0.00	0.00
100% títulos privados	556,495.85	100.00

