



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\$ 214.882,01	15,36893%	833	0,00676%	R\$ 3.180.026.553,36	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: 3818-0	R\$ 27.239,19	1,94822%	833	0,00086%	R\$ 3.180.026.553,36	Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	Baixo	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PUBLICOS FIC FI Banco: 001 Agência: 1735-3 Conta: 1257-2	R\$ 678.205,19	48,50702%	1084	0,01328%	R\$ 5.107.140.425,93	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\$ 477.832,33	34,17583%	958	0,00479%	R\$ 9.967.340.356,95	Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	Baixo	Fundo de Investimento
Total	R\$ 1.398.158,72							

Enquadramentos

Resolução

% Carteira | Saldo do grupo |

Situação

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

48,507024% | R\$ 678.205,19 |

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\$ 678.205,19	233368.5856	0,01328%	R\$ 5.107.140.425,93	48,5070%	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, III, "a"

51,492976% | R\$ 719.953,53 |

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\$ 214.882,01	94724.5952	0,006757%	R\$ 3.180.026.553,36	15,3689%	Lim. Resol.: 60,00% Lim. Política: 60,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 20,0000%	Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	R\$ 27.239,19	12007.6204	0,000857%	R\$ 3.180.026.553,36	1,9482%	Lim. Resol.: 60,00% Lim. Política: 60,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 20,0000%	Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 13.077.418/0001-49	R\$ 477.832,33	189927.0351	0,004794%	R\$ 9.967.340.356,95	34,1758%	Lim. Resol.: 60,00% Lim. Política: 60,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 20,0000%	Desenquadrado - limite de CNPJ

Por benchmark

Benchmark

% Carteira | Saldo do grupo

CDI

51,492976% | R\$ 719.953,53

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	15,368928%	R\$ 214.882,01
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	1,948219%	R\$ 27.239,19
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 13.077.418/0001-49	34,175829%	R\$ 477.832,33

IRF-M 1

48,507024% | R\$ 678.205,19

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35	48,507024%	R\$ 678.205,19

Por administradores

Administrador

% Carteira | Saldo do grupo

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

100,0000% | R\$ 1.398.158,72

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	15,368928%	R\$ 214.882,01
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	1,948219%	R\$ 27.239,19
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35	48,507024%	R\$ 678.205,19
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 13.077.418/0001-49	34,175829%	R\$ 477.832,33

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\$ 26.982,29	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 27.239,19	1,9482%	R\$ 256,90	0,9521%	0,9521%
13.077.415/0001-05 - BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 20.737,12	R\$ 1.281.141,51	R\$ 1.093.833,75	R\$ 214.882,01	15,3689%	R\$ 6.837,13	0,9521%	0,5251%
11.328.882/0001-35 - BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 991.716,29	R\$ 0,00	R\$ 320.000,00	R\$ 678.205,19	48,5070%	R\$ 6.488,90	0,9216%	0,6543%
13.077.418/0001-49 - BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 472.791,53	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 477.832,33	34,1758%	R\$ 5.040,80	1,0662%	1,0661%

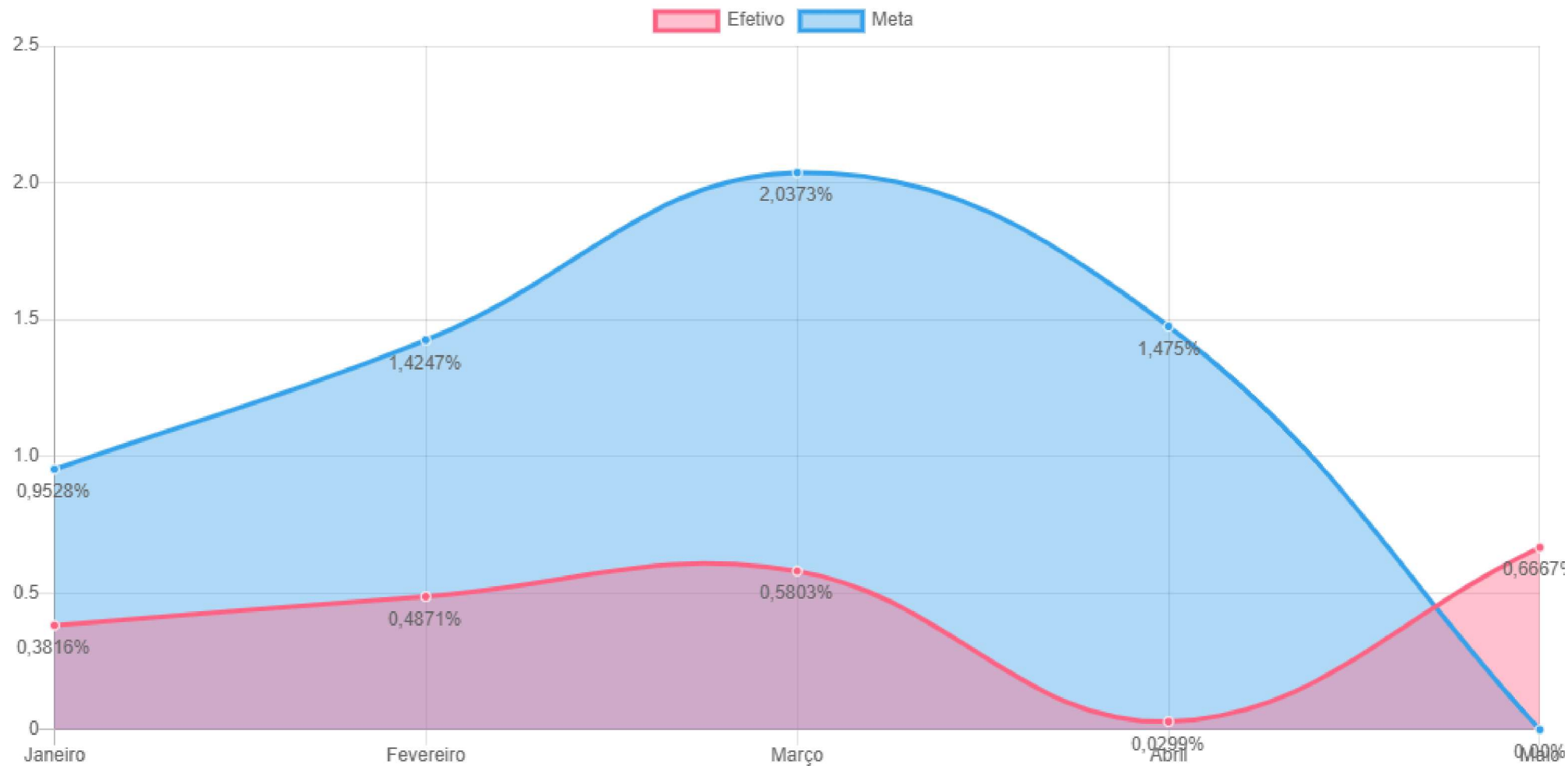
Tipo	Saldo anterior	Total aplicações	Total resgates	Saldo atual	Total retorno	Total retorno %	Total retorno efetivo
RENDA FIXA	R\$ 1.512.227,23	R\$ 1.281.141,51	R\$ 1.413.833,75	R\$ 1.398.158,72	R\$ 18.623,73	0,9763%	0,6667%
Totais	R\$ 1.512.227,23	R\$ 1.281.141,51	R\$ 1.413.833,75	R\$ 1.398.158,72	R\$ 18.623,73	0,9763%	0,6667%

Retornos acumulados

Mês	Saldo anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
JANEIRO	R\$ 1.636.116,98	R\$ 1.672.181,05	R\$ 1.972.009,26	R\$ 1.348.913,24	R\$ 12.624,47	0,3816%	0,9528%	40,0504%
FEVEREIRO	R\$ 1.348.913,24	R\$ 1.776.036,03	R\$ 1.049.895,00	R\$ 2.090.275,55	R\$ 15.221,28	0,4871%	1,4247%	34,1889%
MARÇO	R\$ 2.090.275,55	R\$ 1.157.385,66	R\$ 1.803.334,99	R\$ 1.463.172,64	R\$ 18.846,42	0,5803%	2,0373%	28,4841%
ABRIL	R\$ 1.463.172,64	R\$ 2.336.533,76	R\$ 2.288.614,09	R\$ 1.512.227,23	R\$ 1.134,92	0,0299%	1,4750%	2,0250%
MAIO	R\$ 1.512.227,23	R\$ 1.281.141,51	R\$ 1.413.833,75	R\$ 1.398.158,72	R\$ 18.623,73	0,6667%	0,0000%	0,0000%

	Total aplicações	Total Resgates	Total retorno R\$	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
Total	R\$ 8.223.278,01	R\$ 8.527.687,09	R\$ 66.450,82	2,1628%	6,0181%	35,9386%

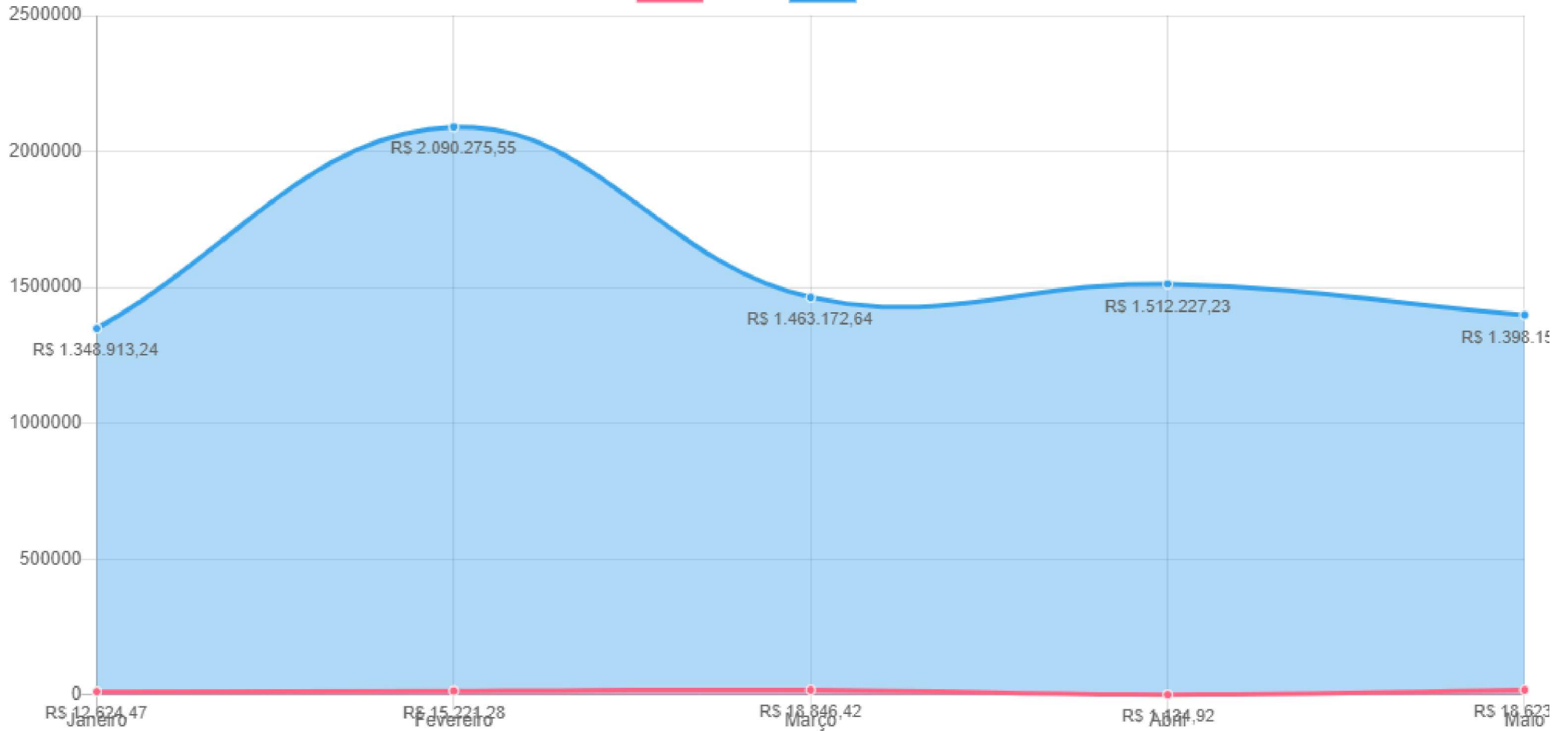
Gráfico - retorno acumulado no ano



	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio
Efetivo	0,382%	0,487%	0,580%	0,030%	0,667%
Meta	0,953%	1,425%	2,037%	1,475%	0,000%

Grafico - Evolução do patrimônio

Retorno Saldo



Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio
R\$ 1.348.913,24	R\$ 2.090.275,55	R\$ 1.463.172,64	R\$ 1.512.227,23	R\$ 1.398.158,72
R\$ 12.624,47	R\$ 15.221,28	R\$ 18.846,42	R\$ 1.134,92	R\$ 18.623,73

Grafico - Retorno mensal

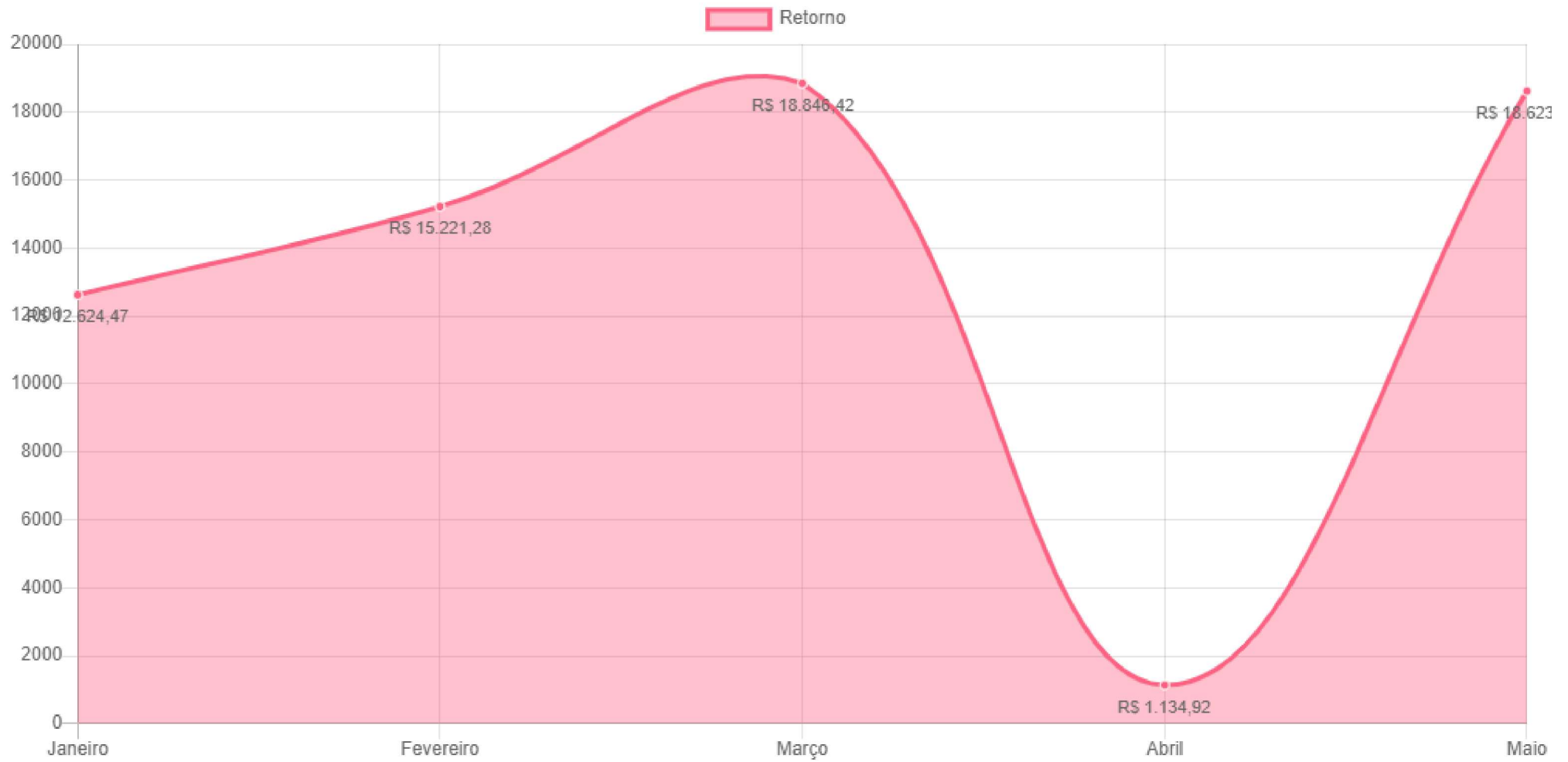
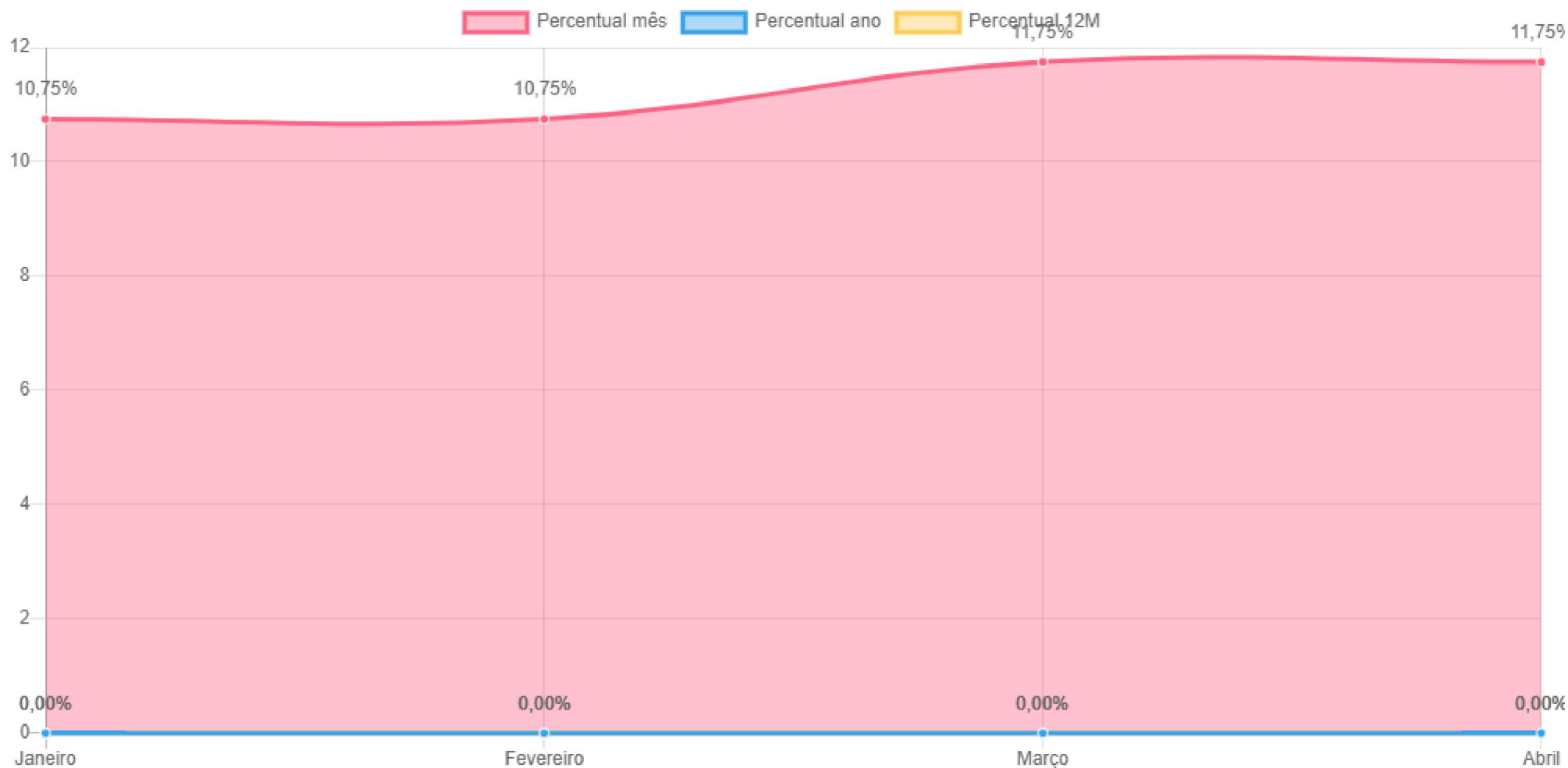


Gráfico - Índices econômicos

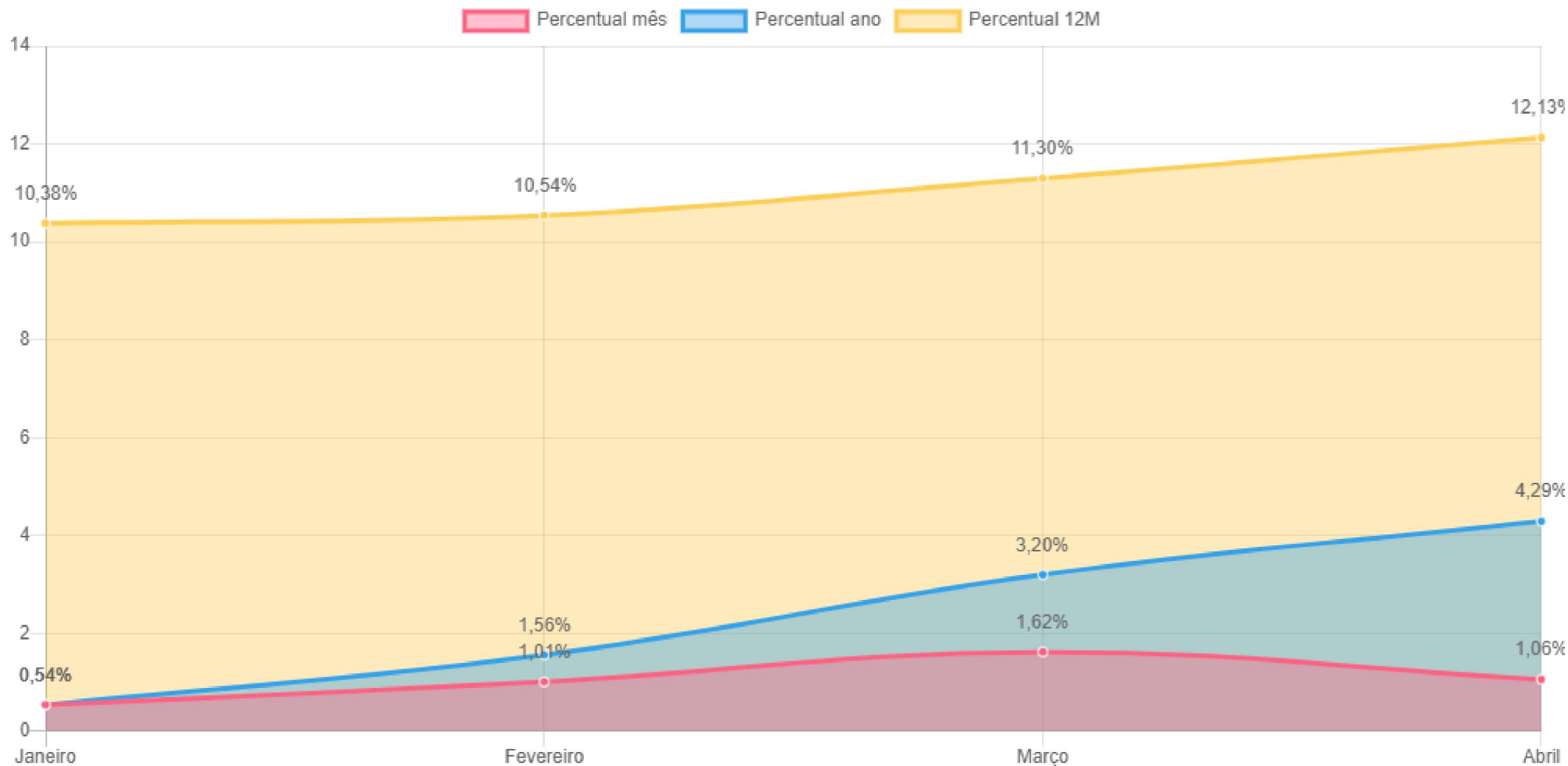
SELIC



Mês	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril
Percentual mês	10,75%	10,75%	11,75%	11,75%
Percentual ano	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Percentual 12M	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%

Gráfico - Índices econômicos

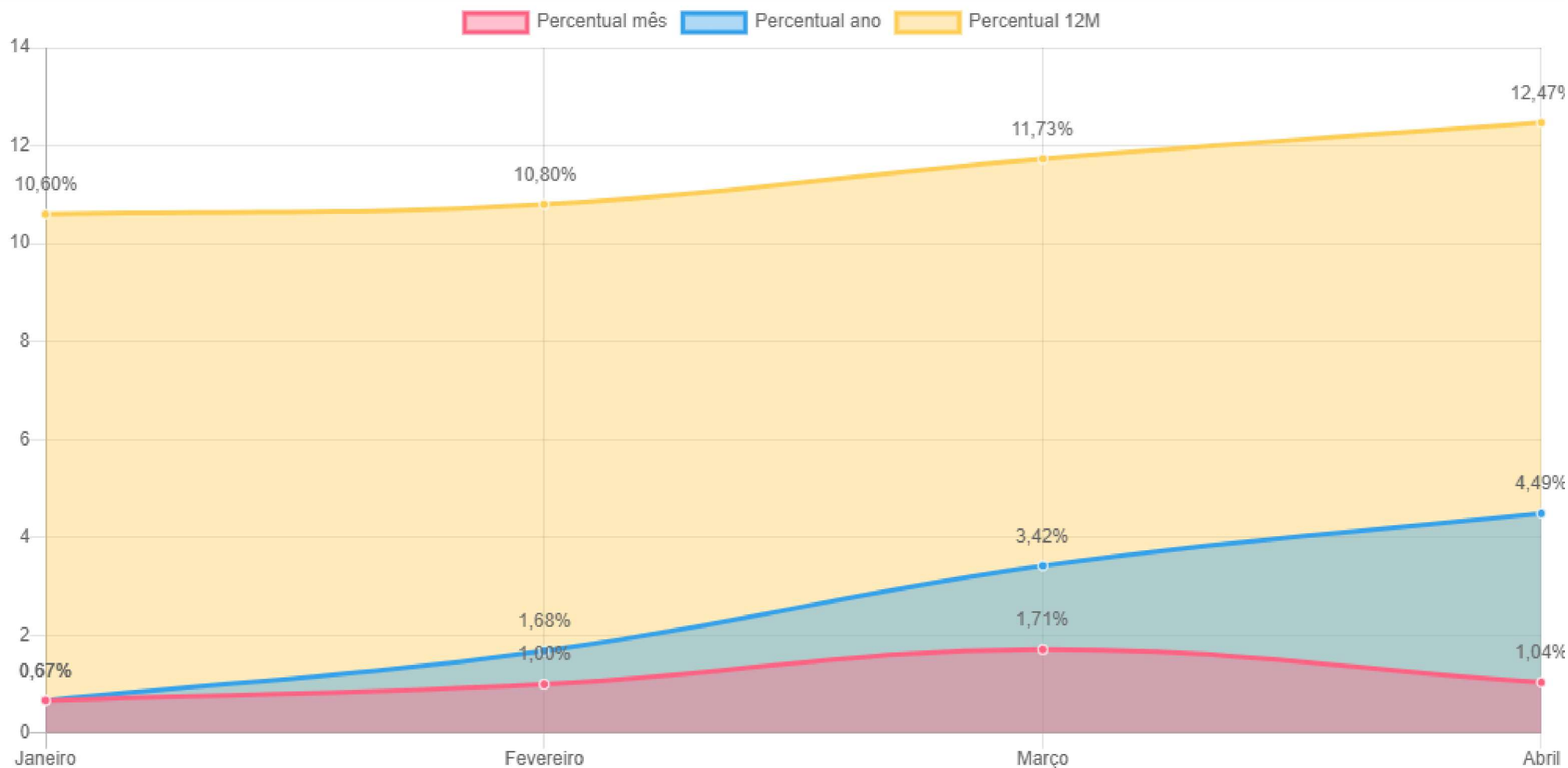
IPCA



Mês	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril
Percentual mês	0,54%	1,01%	1,62%	1,06%
Percentual ano	0,54%	1,56%	3,20%	4,29%
Percentual 12M	10,38%	10,54%	11,30%	12,13%

Gráfico - Índices econômicos

INPC



Mês	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril
Percentual mês	0,67%	1,00%	1,71%	1,04%
Percentual ano	0,67%	1,68%	3,42%	4,49%
Percentual 12M	10,60%	10,80%	11,73%	12,47%

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	25,063069%	0,000534%	6,876658%	16,642718%	32,922979%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	25,063069%	0,000534%	6,876658%	16,642718%	32,922979%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	24,349958%	0,001594%	6,605578%	16,679681%	31,005155%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	25,230468%	0,000519%	7,672351%	19,201083%	39,757767%

	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 3M	VOL 6M	VOL 12M
Geral		24,926641%	0,000795%			

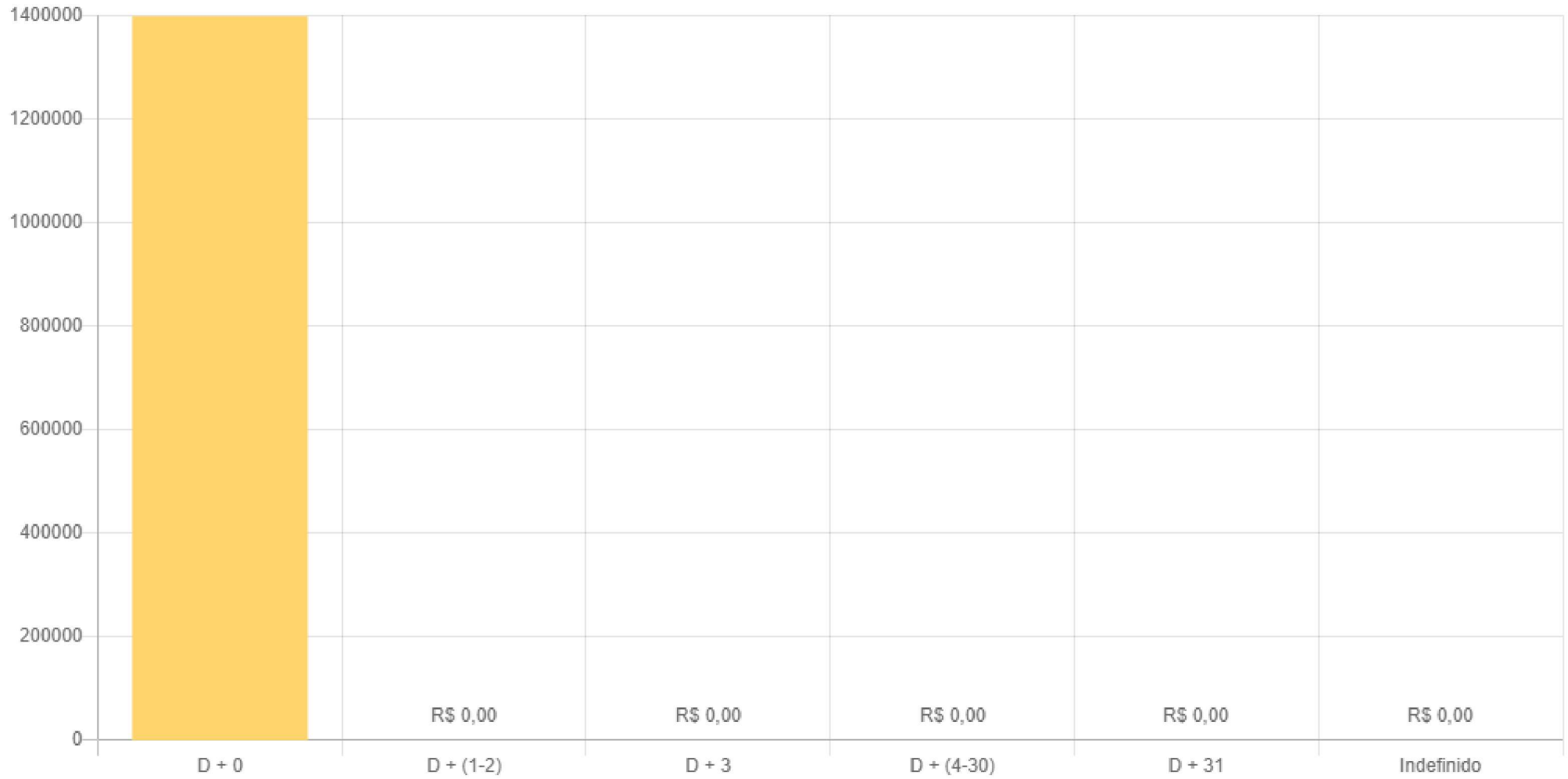
Provisão de risco - Mercado

Nome	CNPJ Fundo	Benchmark	Saldo	VAR 12M	VOL 12M	VAR% BASE 1 DIA CONFIANÇA 95% 252 DU* (R\$)
------	------------	-----------	-------	---------	---------	---

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\$ 214.882,01	0,534252%	32,922979%	R\$ 1,15
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	R\$ 27.239,19	0,534252%	32,922979%	R\$ 0,15
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M 1	R\$ 678.205,19	1,594051%	31,005155%	R\$ 10,81
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	13.077.418/0001-49	CDI	R\$ 477.832,33	0,518568%	39,757767%	R\$ 2,48

Risco de mercado	
Saldo Total	R\$ 1.398.158,72
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 14,58
% Provisão de perda	0,001%
% Aceitavel perda	2,0%
Limite de utilização	0,0521%

Prazo Resgate	Quantidade Fundos	% carteira	Saldo
D + 0	4	100,0000%	R\$ 1.398.158,72



Risco crédito

Risco crédito	% carteira	Saldo
Aceitavel carteira Titulos Privados	30,00%	
Limite de Utilização	85,82%	

