



DI BLASI
Consultoria Financeira

**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
CAPANEMA PA**
Dezembro 2021

Visão geral da carteira

CNPJ	Nome	P. Resgate	Participação	N. Cotistas	% PL.	Legislação	Saldo	Risco	Tipo	Taxa Adm.
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM C	0	45,23%	812	0,02%	Art 7º , IV "a"	R\$ 739.963,61	B	Fundo de Investim	0,20%
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM C	0	2,43%	812	0,00%	Art 7º , IV "a"	R\$ 39.743,64	B	Fundo de Investim	0,20%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	0	45,99%	1,129	0,01%	Art 7º, I, "b"	R\$ 752.425,70	B	Fundo de Investim	0,20%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONC	0	6,36%	862	0,00%	Art 7º , IV "a"	R\$ 103.984,03	B		0,20%

R\$ 1.636.116,98

Retorno do mês

Nome Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI	R\$ 227.961,05	R\$ 2.451.262,23	R\$ 1.941.560,23	R\$ 739.963,61	R\$ 2.300,56	0,0858%	CDI
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI	R\$ 493,13	R\$ 88.519,01	R\$ 49.465,03	R\$ 39.743,64	R\$ 196,53	0,2207%	CDI
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F	R\$ 347.715,31	R\$ 500.000,00	R\$ 100.000,00	R\$ 752.425,70	R\$ 4.710,39	0,5556%	IRF-M 1
BB PREV RF REFERENCIADO DI LI	R\$ 101.438,77	R\$ 600.000,00	R\$ 600.000,00	R\$ 103.984,03	R\$ 2.545,26	0,3628%	CDI
Total	677,608.26	3,639,781.24	2,691,025.26	1,636,116.98	9,752.74	0,2259%	

Enquadramentos

FI 100% títulos TN – 7º, I, b

 % Carteira: : **45,99%**

 Saldo do grupo: **R\$ 752.425,70**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 752.425,70	269,001.88	0,01%	3,104,156.65	45,99%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,01%	Desenquadrado - limite c

FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a

 % Carteira: : **54,01%**

 Saldo do grupo: **R\$ 883.691,28**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 739.963,61	338,917.78	0,02%	3,023,342.66	45,23%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,02%	Desenquadrado - politica
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 39.743,64	18,203.36	0,00%	3,023,342.66	2,43%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Desenquadrado - limite
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 103.984,03	43,179.15	0,00%	3,695,128.79	6,36%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Desenquadrado - limite

Enquadramento por Benchmark

CDI

 % Carteira: **54,01%**

 Saldo do grupo: **R\$ 883.691,28**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 739.963,61	338,917.78	0.02	45.23	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Desenquadrado - política
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 39.743,64	18,203.36	0.00	2.43	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Desenquadrado - limite
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 103.984,03	43,179.15	0.00	6.36	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Desenquadrado - limite

IRF-M 1

 % Carteira: **45,99%**

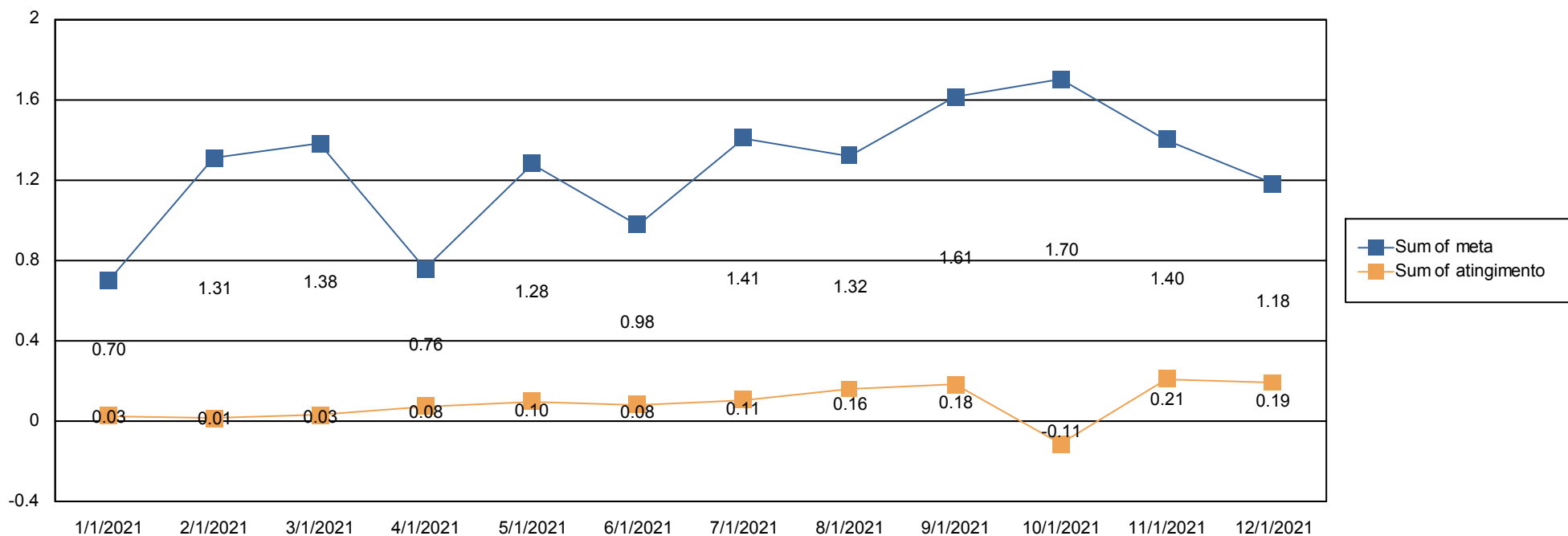
 Saldo do grupo: **R\$ 752.425,70**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 752.425,70	269,001.88	0.01	45.99	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Desenquadrado - limite

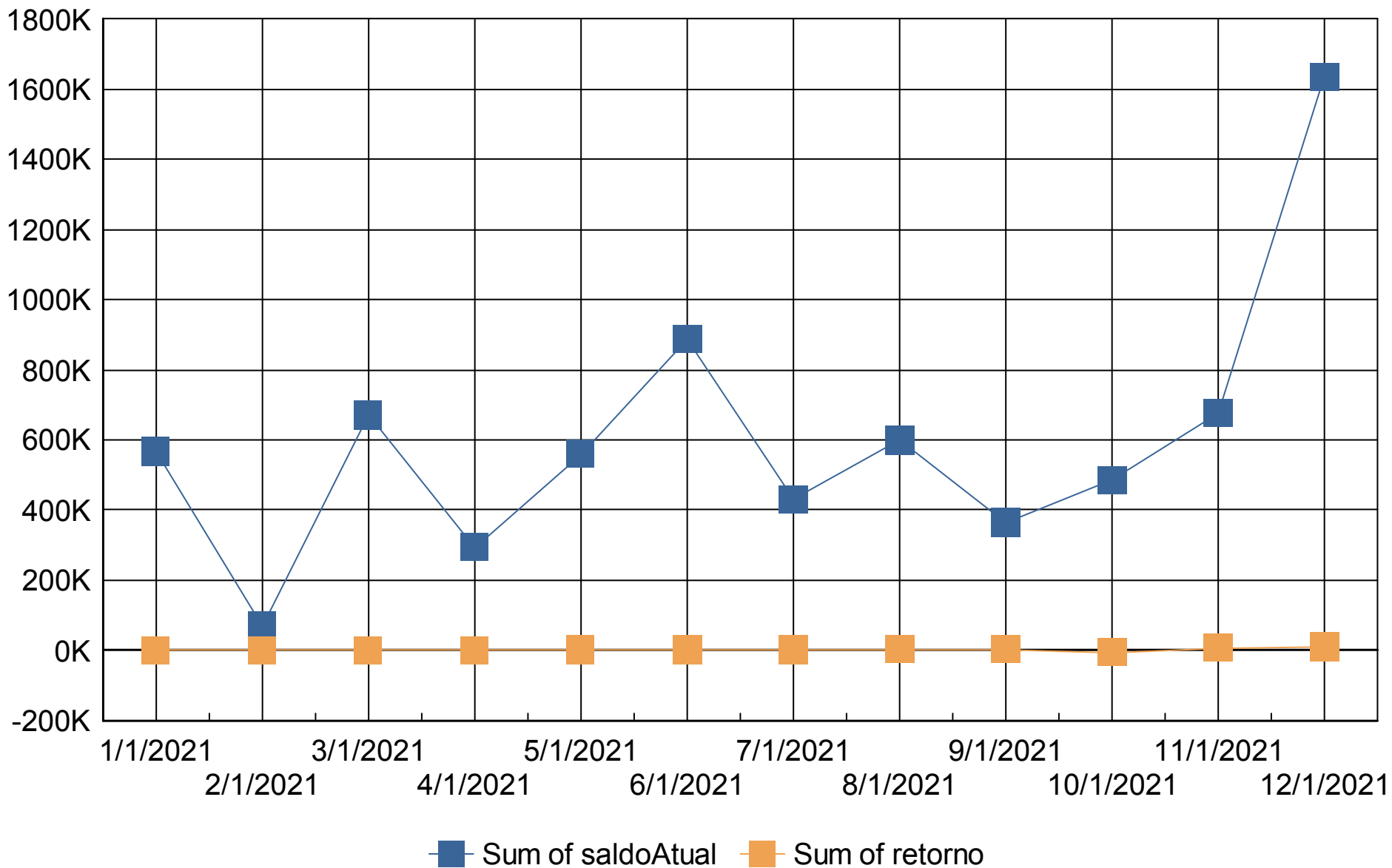
Retorno acumulado no ano

Período	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Retorno %	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%
Mai	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%
Outubro	R\$ 363.443,24	R\$ 2.228.341,28	R\$ 2.102.242,96	R\$ 484.574,96	-R\$ 4.966,60	-0,1916%	1,7004	-11,2696%
Novembro	R\$ 484.574,96	R\$ 1.868.125,20	R\$ 1.682.019,95	R\$ 677.608,26	R\$ 6.928,05	0,2945%	1,3990	21,0488%
Dezembro	R\$ 677.608,26	R\$ 3.639.781,24	R\$ 2.691.025,26	R\$ 1.636.116,98	R\$ 9.752,74	0,2259%	1,1780	19,1761%
Total		16,890,452.38	15,943,270.04		26,021.04	1,3287%	16,0816%	8,2623%

Meta x Atingimento

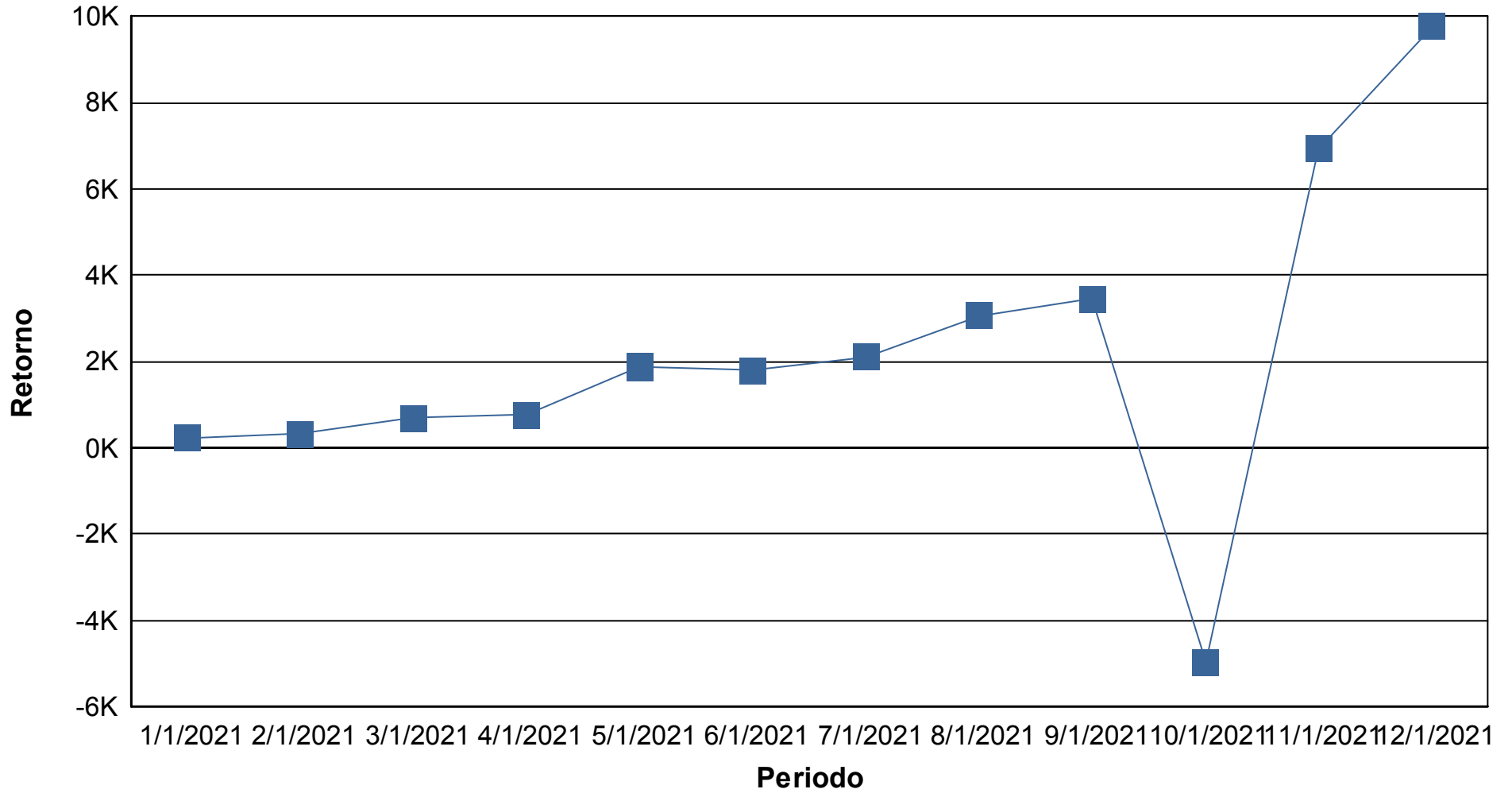


Evolução do patrimônio

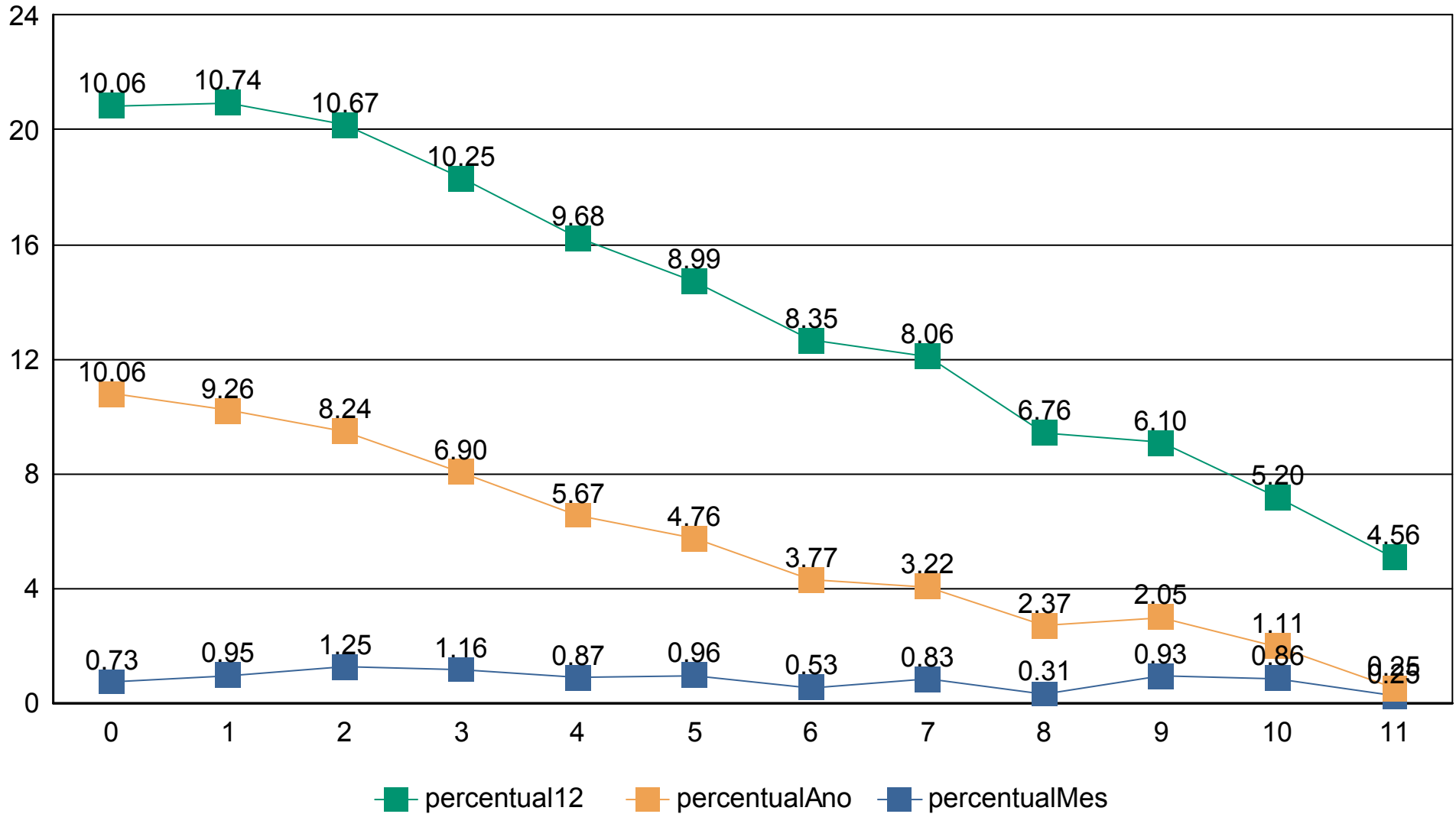




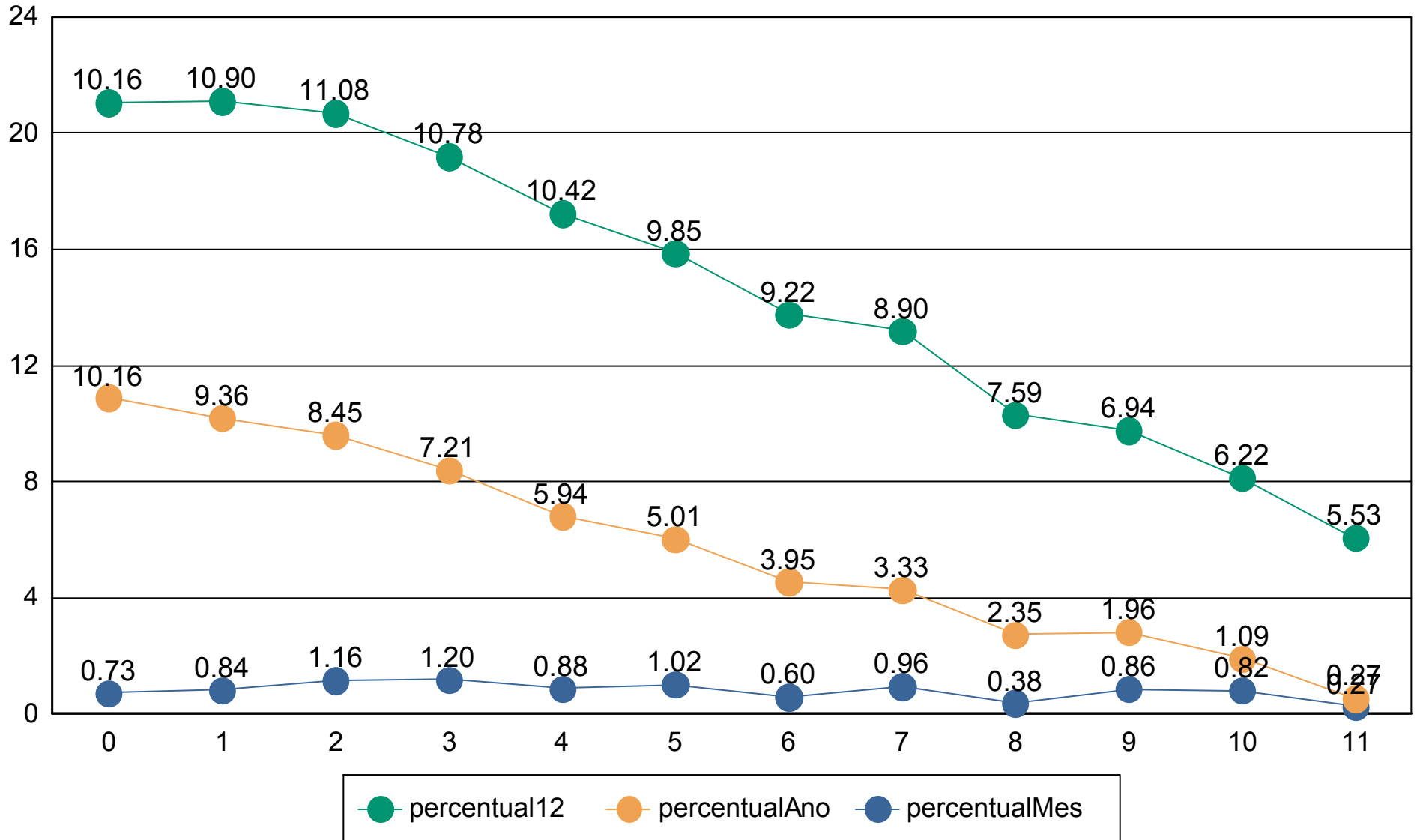
Retorno Mensal



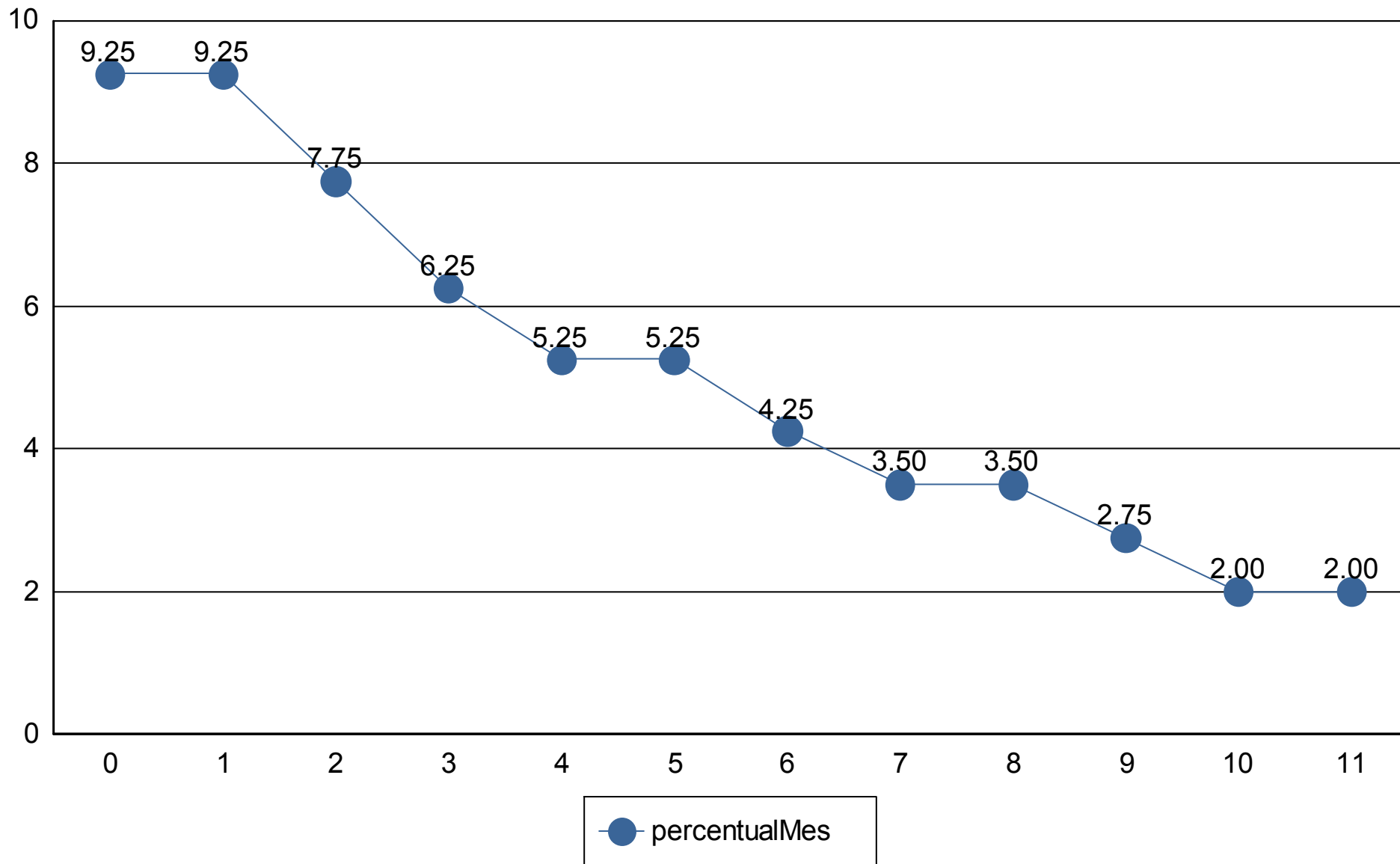
Índices Econômicos - IPCA



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
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	CDI	25,79%	0,00%	4,75%	9,47%	15,74%
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	CDI	25,79%	0,00%	4,75%	9,47%	15,74%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	IRF-M 1	27,06%	0,00%	6,46%	7,49%	12,16%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI	CDI	25,86%	0,00%	5,84%	12,08%	22,08%
			104,50%	0,00%	21,80%	38,50%	65,72%

Provisão de risco - Mercado

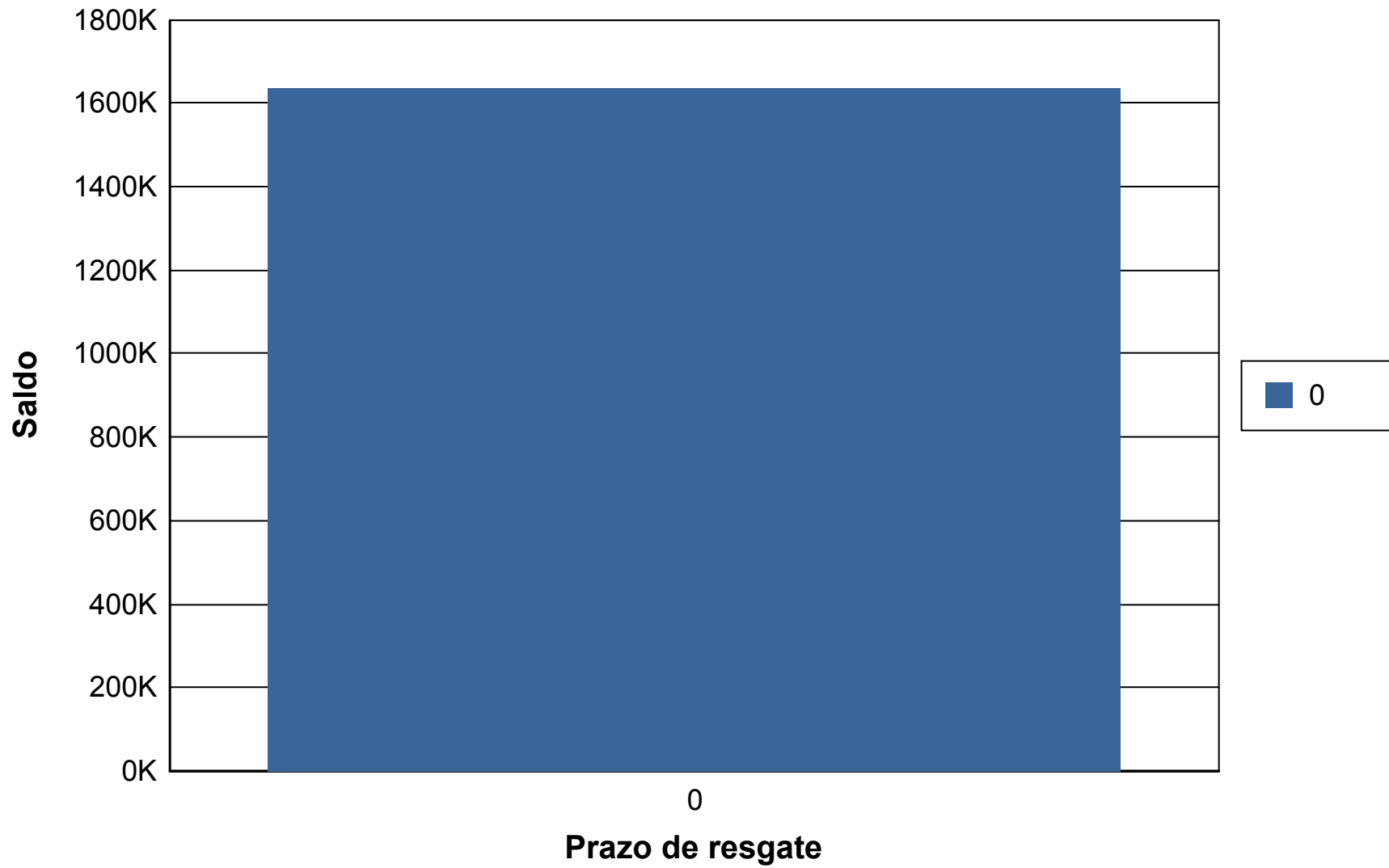
CNPJ	Nome do fundo	Benchmark	Saldo	VAR12	VOL12	VAR% BASE 1
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO C	CDI	R\$ 739.963,61	0,00%	15,74%	R\$ 2,38
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO C	CDI	R\$ 39.743,64	0,00%	15,74%	R\$ 0,13
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO	IRF-M 1	R\$ 752.425,70	0,00%	12,16%	R\$ 8,82

Saldo Total:	R\$ 1.532.132,95
Provisão para perda e Investimentos	R\$ 11,33
% Provisão de perda	0,00%
% Aceitável perda	2%
Limite de utilização	0,04%



Nome do Fundo	Saldo	% Part.	N. Cotistas	% PL	PL do Fundo	Legislação	Grau risco	Prazo Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE	R\$ 739.963,61	45,23%	812	0,02%	R\$ 3.357.805.259,34	Art 7º , IV "a"	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE	R\$ 39.743,64	2,43%	812	0,00%	R\$ 3.357.805.259,34	Art 7º , IV "a"	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULC	R\$ 752.425,70	45,99%	1,129	0,01%	R\$ 5.263.892.606,36	Art 7º, I, "b"	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIAD	R\$ 103.984,03	6,36%	862	0,00%	R\$ 7.314.536.112,78	Art 7º , IV "a"	Baixo	D+ 0

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
0	R\$ 1.636.116,98	4	100,00%



Risco Crédito

Legislação	Limite	Limite Política	Saldo	% Carteira
FI 100% títulos TN – 7º, I, b	100,00%	100,00%	R\$ 752.425,70	45,99
FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a	40,00%	40,00%	R\$ 883.691,28	54,01

	Saldo	% Carteira
100% títulos públicos	1,194,271.34	72.99
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	441,845.64	27.01
100% títulos privados	0.00	0.00

Distribuição dos saldos

