



DI BLASI
Consultoria Financeira

**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
CAPANEMA PA**
Abril 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 | 35,18% | 1,035 | 0.01 | Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a" | R\$ 517.236,75 | B | Fundo de Investimento | 1,00% |
| 13.077.415/0001-05 | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM C | 0 | 6,05% | 1,035 | 0.00 | Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a" | R\$ 88.894,85 | B | Fundo de Investimento | 1,00% |
| 11.328.882/0001-35 | BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI | 0 | 0,06% | 1,127 | 0.00 | Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b" | R\$ 938,42 | B | Fundo de Investimento | 0,20% |
| 13.077.418/0001-49 | BB PREV RF REFERENCIADO DI LONC | 0 | 58,71% | 1,171 | 0.01 | Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a" | R\$ 863.112,27 | 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\$ 1.470.182,29

Retorno do mês

| Nome Fundo | Saldo Inicial | Aplicações | Resgates | Saldo Final | Rentabilidade | Efetivo | Bench. |
|----------------------------------|------------------|------------------|------------------|----------------|---------------|---------|---------|
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI | R\$ 157.199,05 | R\$ 1.683.298,31 | R\$ 1.325.499,65 | R\$ 517.236,75 | R\$ 2.239,04 | 0,1216% | CDI |
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI | R\$ 42.950,67 | R\$ 84.050,15 | R\$ 38.330,56 | R\$ 88.927,00 | R\$ 256,74 | 0,2021% | CDI |
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F | R\$ 933,17 | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 938,42 | R\$ 5,25 | 0,5625% | IRF-M 1 |
| BB PREV RF REFERENCIADO DI L' | R\$ 1.055.067,61 | R\$ 0 | R\$ 200.000,00 | R\$ 863.112,27 | R\$ 8.044,66 | 0,7624% | CDI |
| Total | 1,256,150.50 | 1,767,348.46 | 1,563,830.21 | 1,470,214.44 | 10,545.69 | 0,3488% | |

Enquadramentos

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

 % Carteira: : **0,06%**

 Saldo do grupo: **R\$ 938,42**

| Fundo | Saldo | N. Cotas | % PL | P. Liq. | % Carteira | Limites | Situação |
|-----------------------------------|------------|----------|----------|------------------|------------|--|------------|
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI | R\$ 938,42 | 258.24 | 0,00001% | 8,334,507,355.54 | 0,06% | 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: : **99,94%**

 Saldo do grupo: **R\$ 1.469.276,02**

| Fundo | Saldo | N. Cotas | % PL | P. Liq. | % Carteira | Limites | Situação |
|---|----------------|------------|----------|-------------------|------------|--|------------------------|
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI | R\$ 517.236,75 | 184,336.19 | 0,01246% | 4,150,521,759.60 | 35,18% | Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,01% | Desenquadrado - limite |
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI | R\$ 88.927,00 | 31,692.38 | 0,00214% | 4,150,521,759.60 | 6,05% | 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\$ 863.112,27 | 272,101.29 | 0,00514% | 16,797,040,223.44 | 58,71% | Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,01% | Desenquadrado - limite |

Enquadramento por Benchmark

CDI

 % Carteira: **99,94%**

 Saldo do grupo: **R\$ 1.469.276,02**

| Nome fundo | Saldo | Saldo cotas | %PL | % Carteira | Limites | Situação |
|---|----------------|-------------|------|------------|---|------------------------|
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI | R\$ 517.236,75 | 184,336.19 | 0.01 | 35.18 | 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\$ 88.927,00 | 31,692.38 | 0.00 | 6.05 | 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\$ 863.112,27 | 272,101.29 | 0.01 | 58.71 | Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00% | Desenquadrado - limite |

IRF-M 1

 % Carteira: **0,06%**

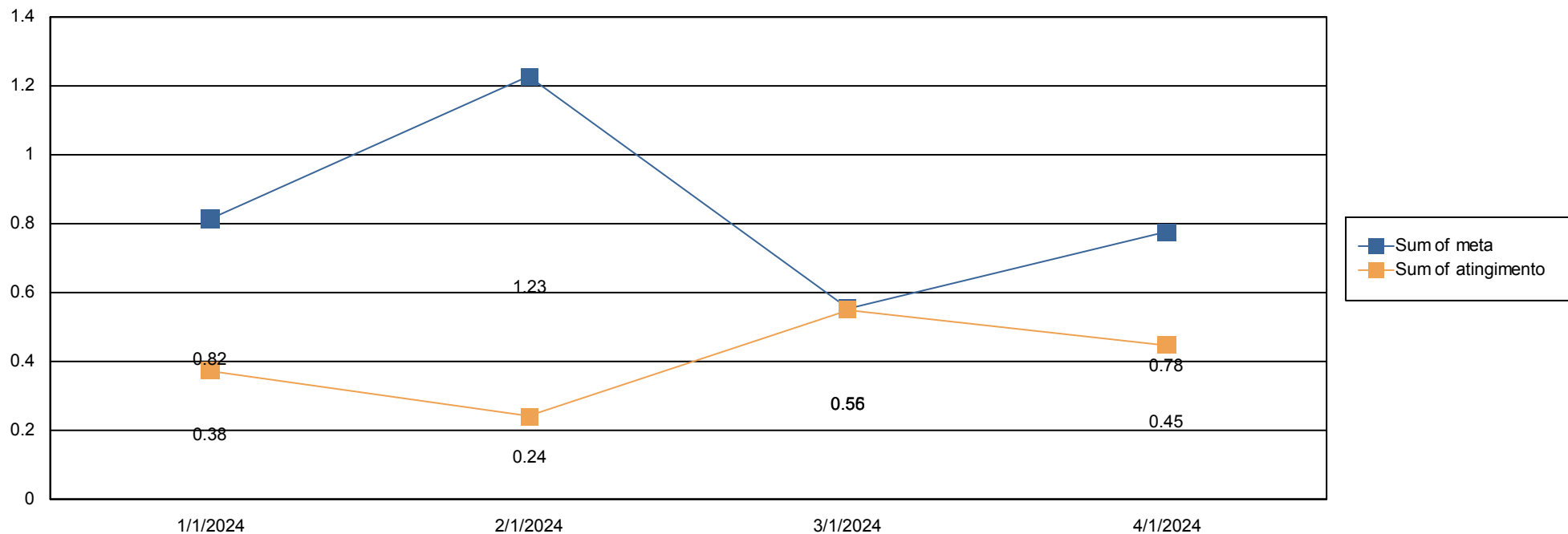
 Saldo do grupo: **R\$ 938,42**

| Nome fundo | Saldo | Saldo cotas | %PL | % Carteira | Limites | Situação |
|-----------------------------------|------------|-------------|------|------------|--|------------|
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI | R\$ 938,42 | 258.24 | 0.00 | 0.06 | Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00% | Enquadrado |

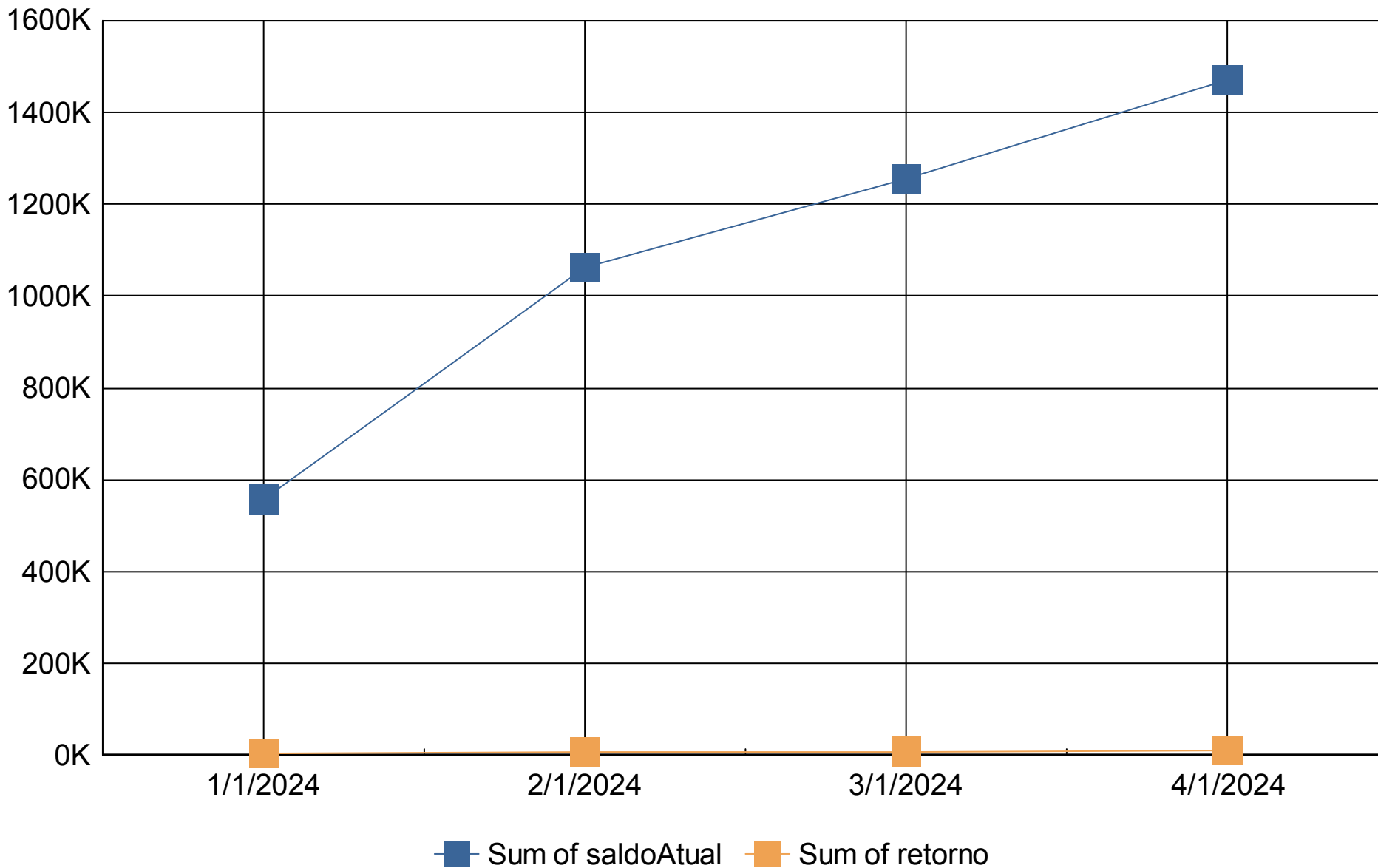
Retorno acumulado no ano

| 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% |
| Fevereiro | R\$ 556.648,75 | R\$ 1.963.825,63 | R\$ 1.465.928,34 | R\$ 1.062.006,41 | R\$ 7.460,37 | 0,2960% | 1,2279 | 24,1054% |
| Março | R\$ 1.062.006,41 | R\$ 1.868.972,99 | R\$ 1.683.809,76 | R\$ 1.256.150,50 | R\$ 8.980,86 | 0,3064% | 0,5552 | 55,1894% |
| Abril | R\$ 1.256.150,50 | R\$ 1.767.348,46 | R\$ 1.563.830,21 | R\$ 1.470.214,44 | R\$ 10.545,69 | 0,3488% | 0,7761 | 44,9415% |
| Total | | 6,704,610.36 | 5,947,052.26 | | 32,454.46 | 1,2635% | 3,4173% | 36,9737% |

Meta x Atingimento

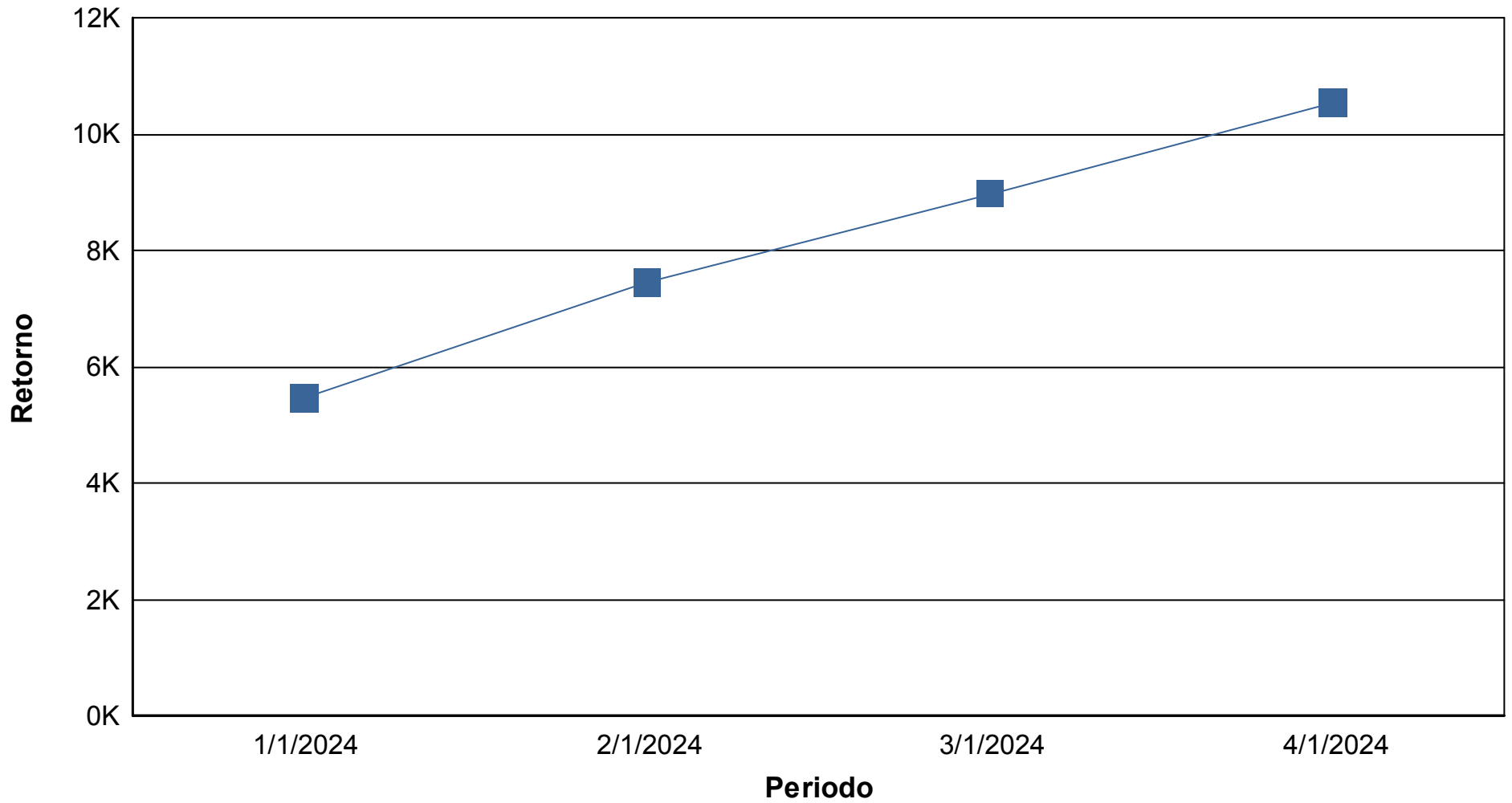


Evolução do patrimônio

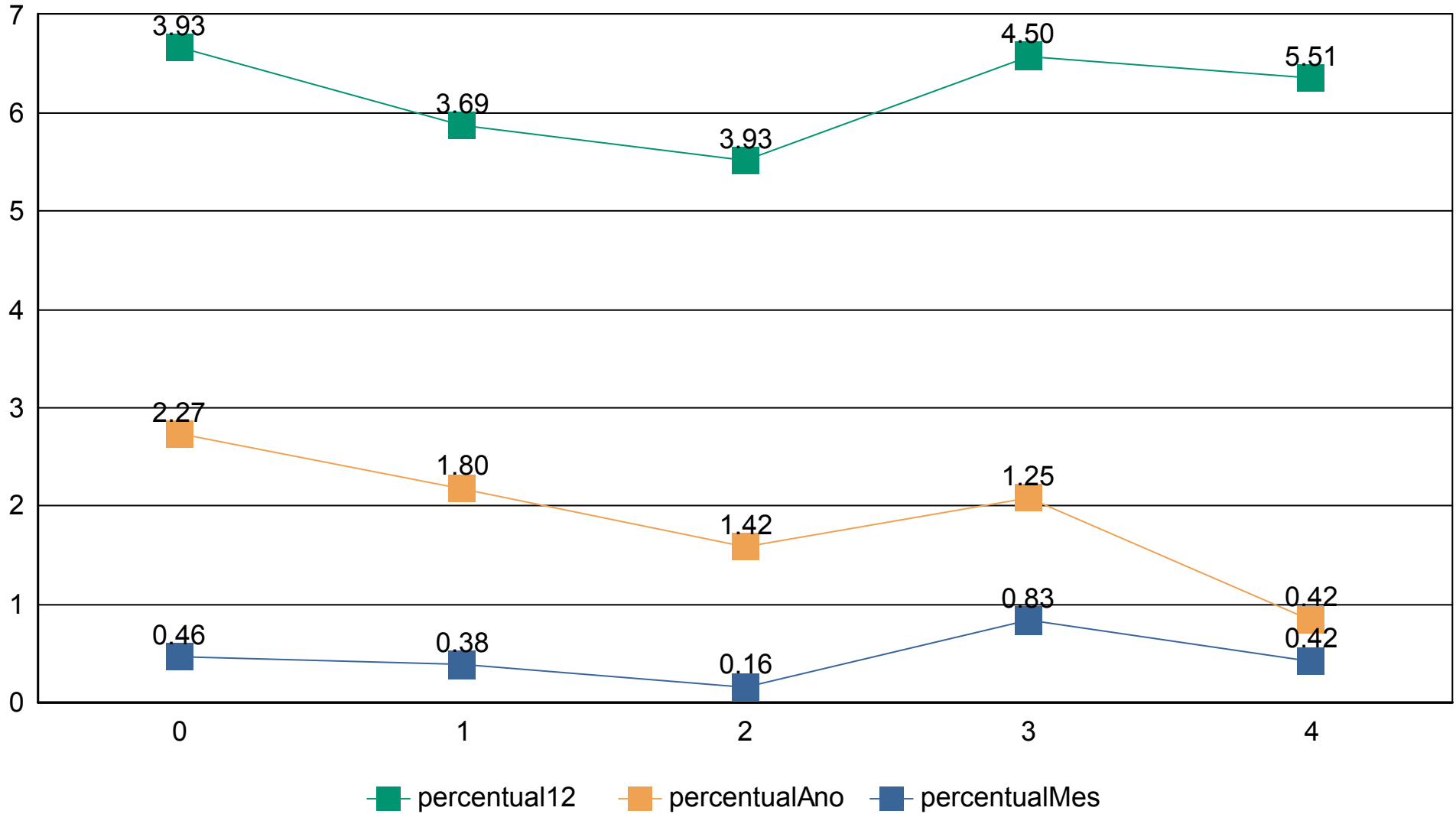




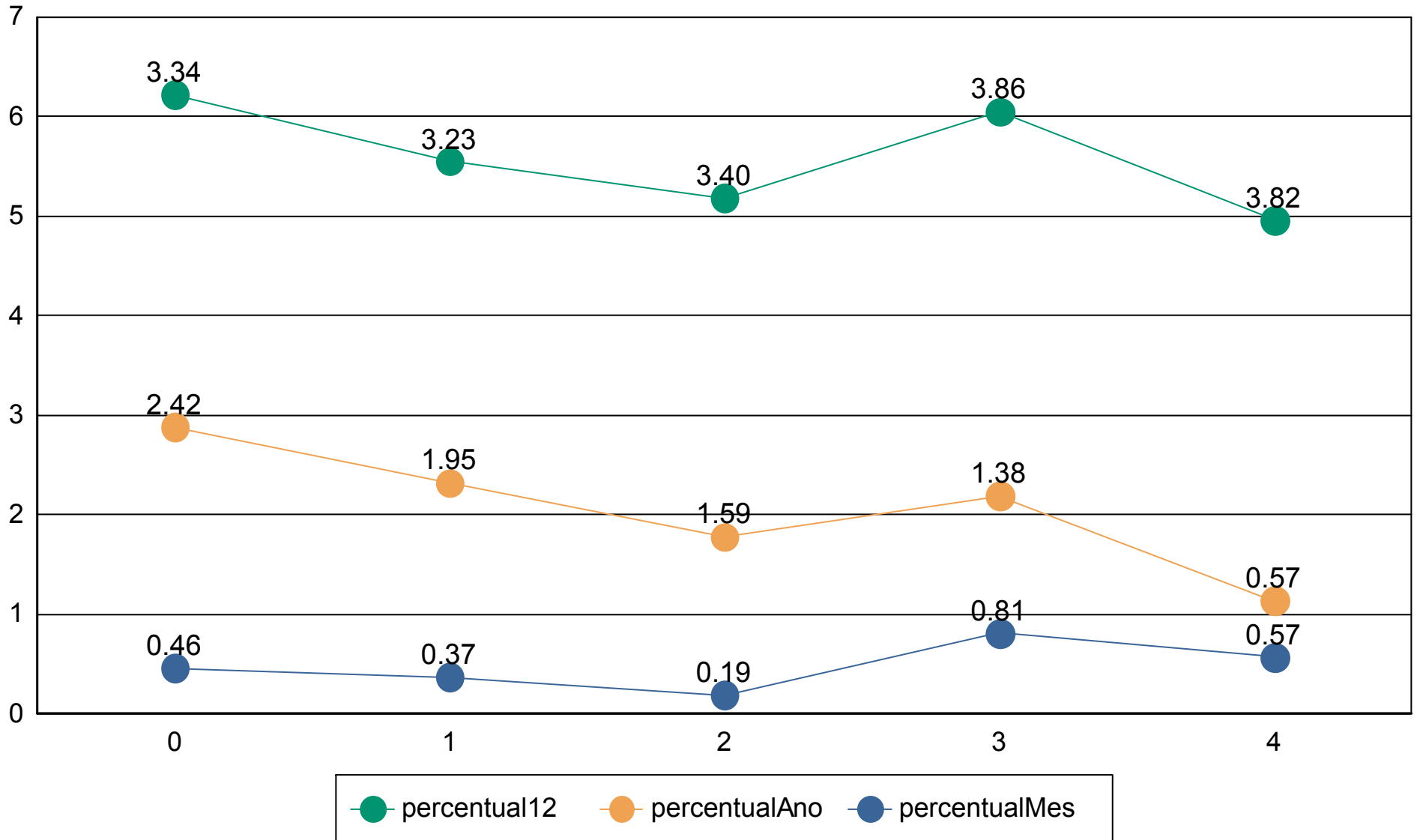
Retorno Mensal



Índices Econômicos - IPCA

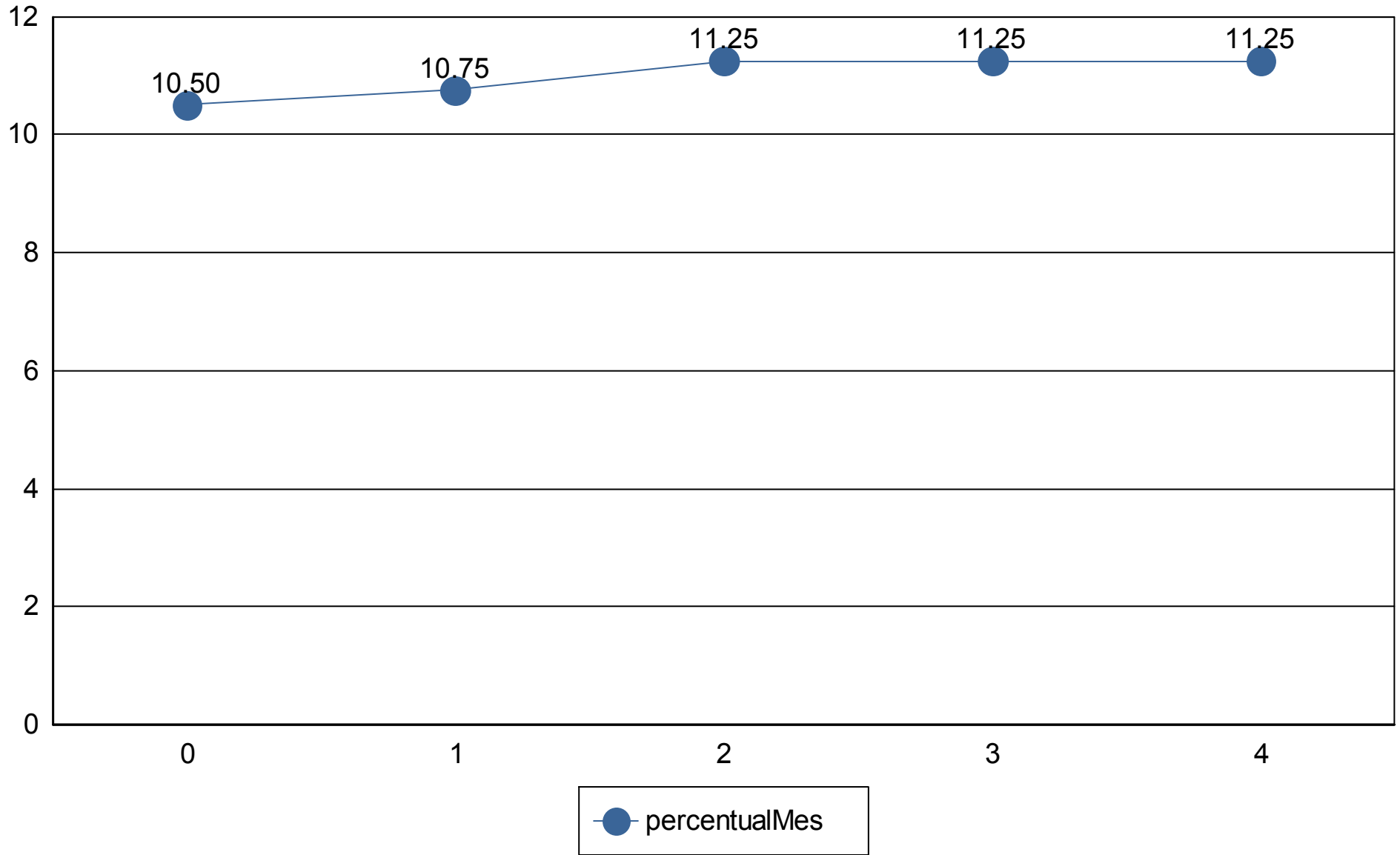


Índices Econômicos - INPC





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

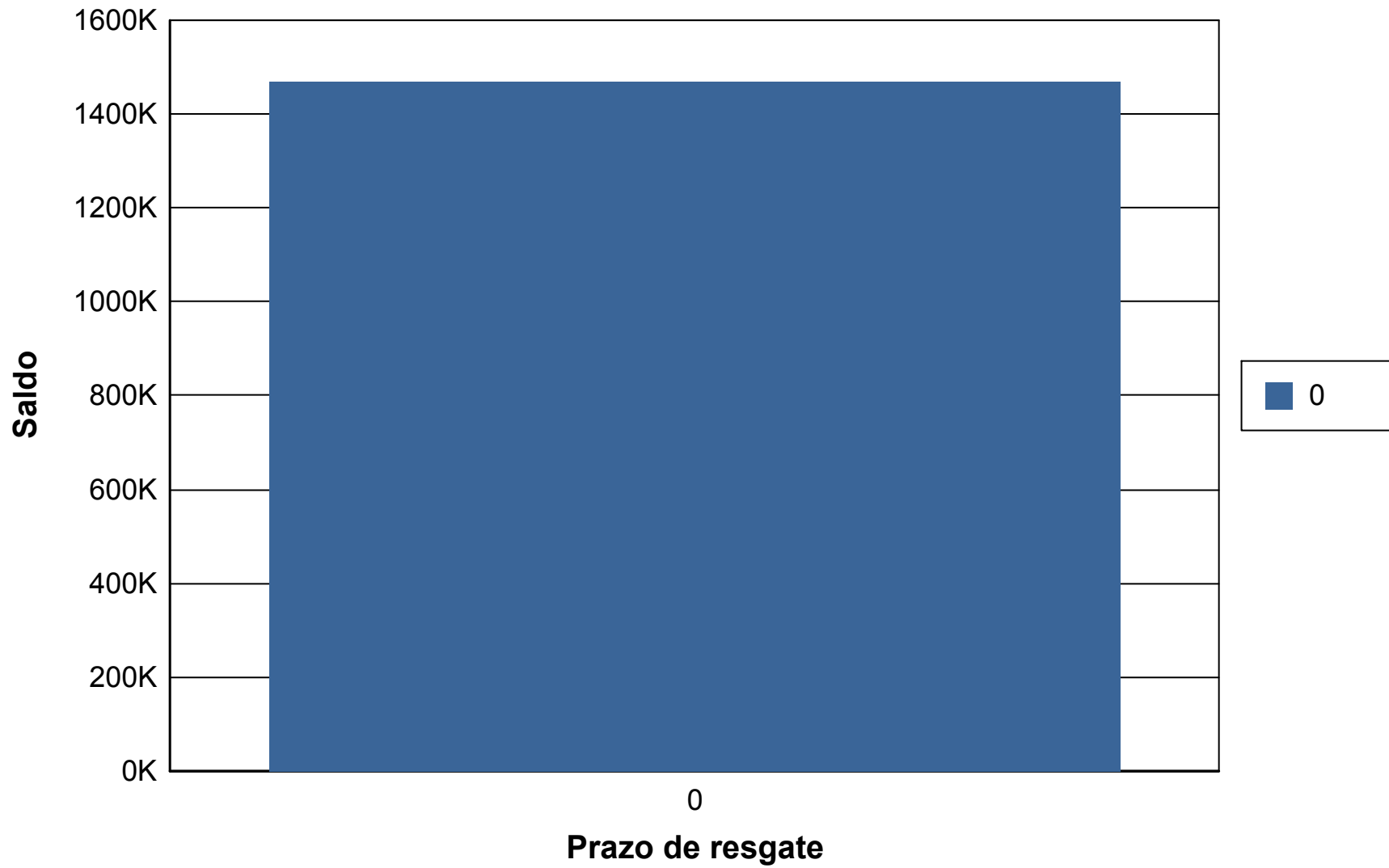
| CNPJ | Nome do fundo | Benchmark | Saldo | VAR12 | VOL12 | VAR% BASE 1 |
|------|---------------|-----------|-------|-------|-------|-------------|
| | | | | | | |

| | |
|-------------------------------------|----|
| 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\$ 517.236,75 | 35,18% | 1,035 | 0,01% | R\$ 4.150.521.759,60 | da Fixa (CVM) | Baixo | D+ 0 |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE | R\$ 88.894,85 | 6,05% | 1,035 | 0,00% | R\$ 4.150.521.759,60 | da Fixa (CVM) | Baixo | D+ 0 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULC | R\$ 938,42 | 0,06% | 1,127 | 0,00% | R\$ 8.334.507.355,54 | ixa 100% TP/E | Baixo | D+ 0 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIAD | R\$ 863.112,27 | 58,71% | 1,171 | 0,01% | R\$ 16.797.040.223,44 | da Fixa (CVM) | Baixo | D+ 0 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBL | R\$ 0,00 | 0,00% | 385 | 0,00% | R\$ 2.887.006.869,37 | ixa 100% TP/E | Baixo | D+ 0 |

| Prazo Resgate | Saldo | N. Fundo | % Carteira |
|---------------|------------------|----------|------------|
| 0 | R\$ 1.470.182,29 | 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\$ 938,42 | 0,06 |
| Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a" | 60,00% | 60,00% | R\$ 1.469.243,87 | 99,94 |

| | Saldo | % Carteira |
|---|---------------------|------------|
| 100% títulos públicos | 0.00 | 0.00 |
| 50% Títulos publicos e 50% Títulos privados | 0.00 | 0.00 |
| 100% títulos privados | 1,470,182.29 | 100.00 |

