



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE SOURE

Visão Geral da carteira

Fundo	Saldo	Participação	Num. Cotistas	% sobre o PL	Patrimonio	Resolução	Grau Risco	Tipo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Banco: BANCO DO BRASIL Agência: 1151-7 Conta: 9138-3	R\$ 1.165.294,22	80,22104%	1140	0,01691%	R\$ 6.892.529.188,23	Art 7º, I, "b"	Baixo	Fundo de Investimento
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC FI Banco: 001 Agência: 1151-7 Conta: 9138-3	R\$ 287.310,10	19,77896%	173983	0,00024%	R\$ 118.944.663.125,89	Art 7º, IV "a"	Baixo	Fundo de Investimento
Total	R\$ 1.452.604,32							

Enquadramentos

Resolução

% Carteira | Saldo do grupo |

Situação

(RPPS) - FI 100% títulos TN – 7º, I, b

80,221035% | R\$ 1.165.294,22 |

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\$ 1.165.294,22	421176.1774	0,016907%	R\$ 6.892.529.188,23	80,2210%	Lim. Resol.: 100,00% Lim. Política: 100,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	Enquadrado

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

19,778965% | R\$ 287.310,10 |

Enquadrado

Fundo	Saldo	Saldo Cotas	% PL	P. Líq.	% Carteira	Limites	Situação
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI CNPJ: 04.288.966/0001-27	R\$ 287.310,10	76452.772	0,000242%	R\$ 118.944.663.125,89	19,7789%	Lim. Resol.: 40,00% Lim. Política: 40,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	Enquadrado

Por benchmark

Benchmark

% Carteira | Saldo do grupo

IRF-M 1

80,221035% | R\$ 1.165.294,22

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35	80,221035%	R\$ 1.165.294,22

CDI

19,778965% | R\$ 287.310,10

Fundo	% saldo	Saldo
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI CNPJ: 04.288.966/0001-27	19,778965%	R\$ 287.310,10

Por administradores

Administrador

% Carteira

Saldo do grupo

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

100,0000%

R\$ 1.452.604,32

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35	80,221035%	R\$ 1.165.294,22
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI CNPJ: 04.288.966/0001-27	19,778965%	R\$ 287.310,10

Retornos do mês

Fundo de Renda Fixa

Fundo	Saldo anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Participação	Retorno R\$	Retorno %	Efetivo %
11.328.882/0001-35 - BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 1.340.414,04	R\$ 0,00	R\$ 180.000,00	R\$ 1.165.294,22	80,2210%	R\$ 4.880,18	0,3663%	0,3640%
04.288,966/0001-27 - BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI	R\$ 77.564,18	R\$ 232.223,66	R\$ 22.693,81	R\$ 287.310,10	19,7790%	R\$ 216,07	0,2807%	0,0697%

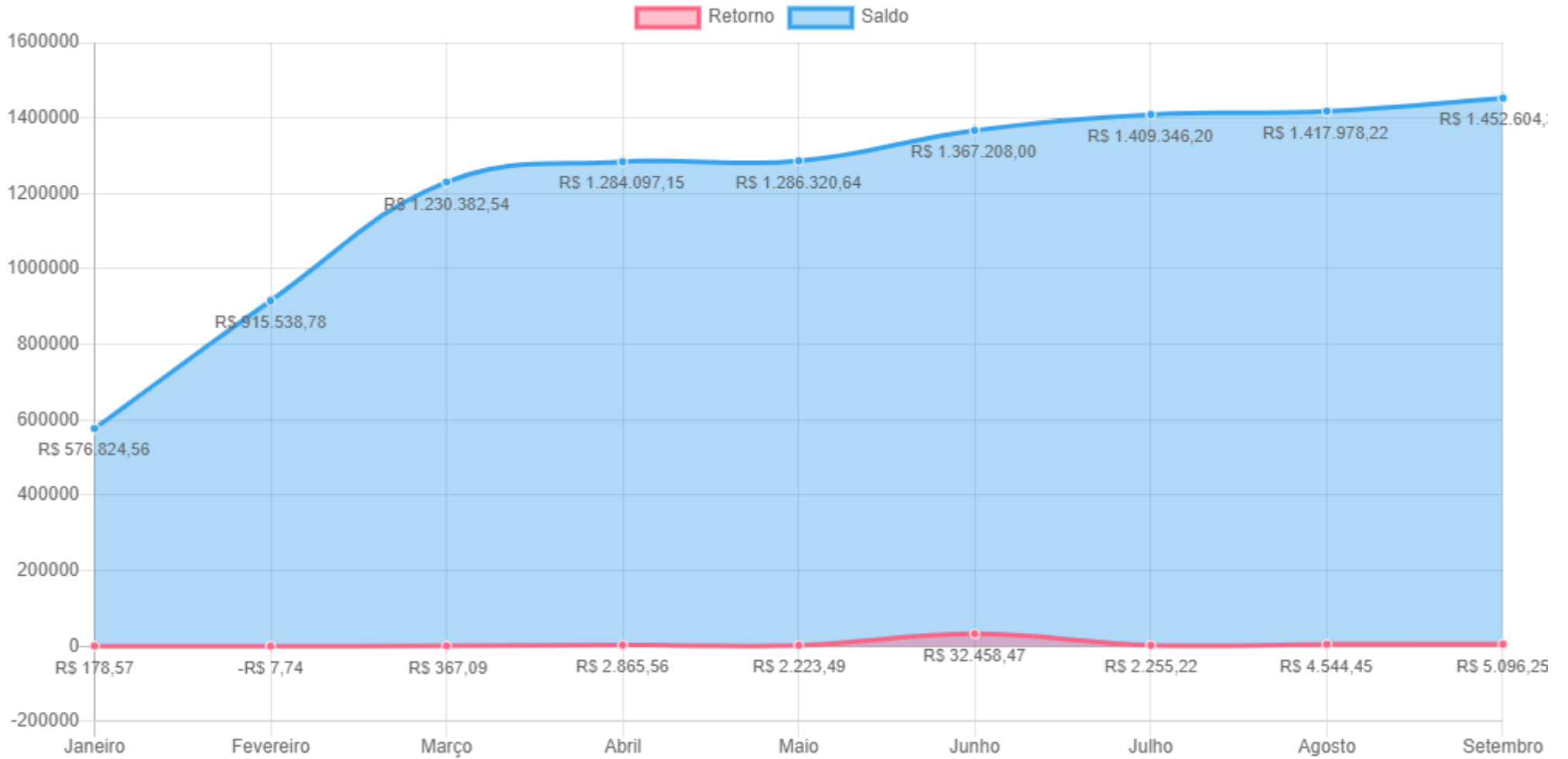
Tipo	Saldo anterior	Total aplicações	Total resgates	Saldo atual	Total retorno	Total retorno %	Total retorno efetivo
Fundo de Renda Fixa	R\$ 1.417.978,22	R\$ 232.223,66	R\$ 202.693,81	R\$ 1.452.604,32	R\$ 5.096,25	0,3494%	0,3088%
Totais	R\$ 1.417.978,22	R\$ 232.223,66	R\$ 202.693,81	R\$ 1.452.604,32	R\$ 5.096,25	0,3494%	0,3088%

Retornos acumulados

Mês	Saldo anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
JANEIRO	R\$ 576.672,53	R\$ 6.747,07	R\$ 6.773,61	R\$ 576.824,56	R\$ 178,57	0,0306%	0,0000%	0,0000%
FEVEREIRO	R\$ 576.824,56	R\$ 695.742,98	R\$ 357.021,02	R\$ 915.538,78	-R\$ 7,74	-0,0006%	0,0000%	0,0000%
MARÇO	R\$ 915.538,78	R\$ 621.862,56	R\$ 307.385,89	R\$ 1.230.382,54	R\$ 367,09	0,0239%	0,0000%	0,0000%
ABRIL	R\$ 1.230.382,54	R\$ 641.738,54	R\$ 590.889,49	R\$ 1.284.097,15	R\$ 2.865,56	0,1531%	0,0000%	0,0000%
MAIO	R\$ 1.284.097,15	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.286.320,64	R\$ 2.223,49	0,1732%	0,0000%	0,0000%
JUNHO	R\$ 1.286.320,64	R\$ 141.353,79	R\$ 92.924,90	R\$ 1.367.208,00	R\$ 32.458,47	2,2735%	0,0000%	0,0000%
JULHO	R\$ 1.367.208,00	R\$ 349.349,67	R\$ 309.466,69	R\$ 1.409.346,20	R\$ 2.255,22	0,1314%	0,0000%	0,0000%
AGOSTO	R\$ 1.409.346,20	R\$ 184.548,41	R\$ 180.460,84	R\$ 1.417.978,22	R\$ 4.544,45	0,2851%	0,0000%	0,0000%
SETEMBRO	R\$ 1.417.978,22	R\$ 232.223,66	R\$ 202.693,81	R\$ 1.452.604,32	R\$ 5.096,25	0,3088%	0,0000%	0,0000%

	Total aplicações	Total Resgates	Total retorno R\$	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
Total	R\$ 2.873.566,68	R\$ 2.047.616,25	R\$ 49.981,36	3,4091%	0,0000%	∞%

Grafico - Evolução do patrimônio



Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maió	Junho	Julho	Agosto	Setembro
R\$ 576.824,56	R\$ 915.538,78	R\$ 1.230.382,54	R\$ 1.284.097,15	R\$ 1.286.320,64	R\$ 1.367.208,00	R\$ 1.409.346,20	R\$ 1.417.978,22	R\$ 1.452.604,32
R\$ 178,57	-R\$ 7,74	R\$ 367,09	R\$ 2.865,56	R\$ 2.223,49	R\$ 32.458,47	R\$ 2.255,22	R\$ 4.544,45	R\$ 5.096,25

Grafico - Retorno mensal

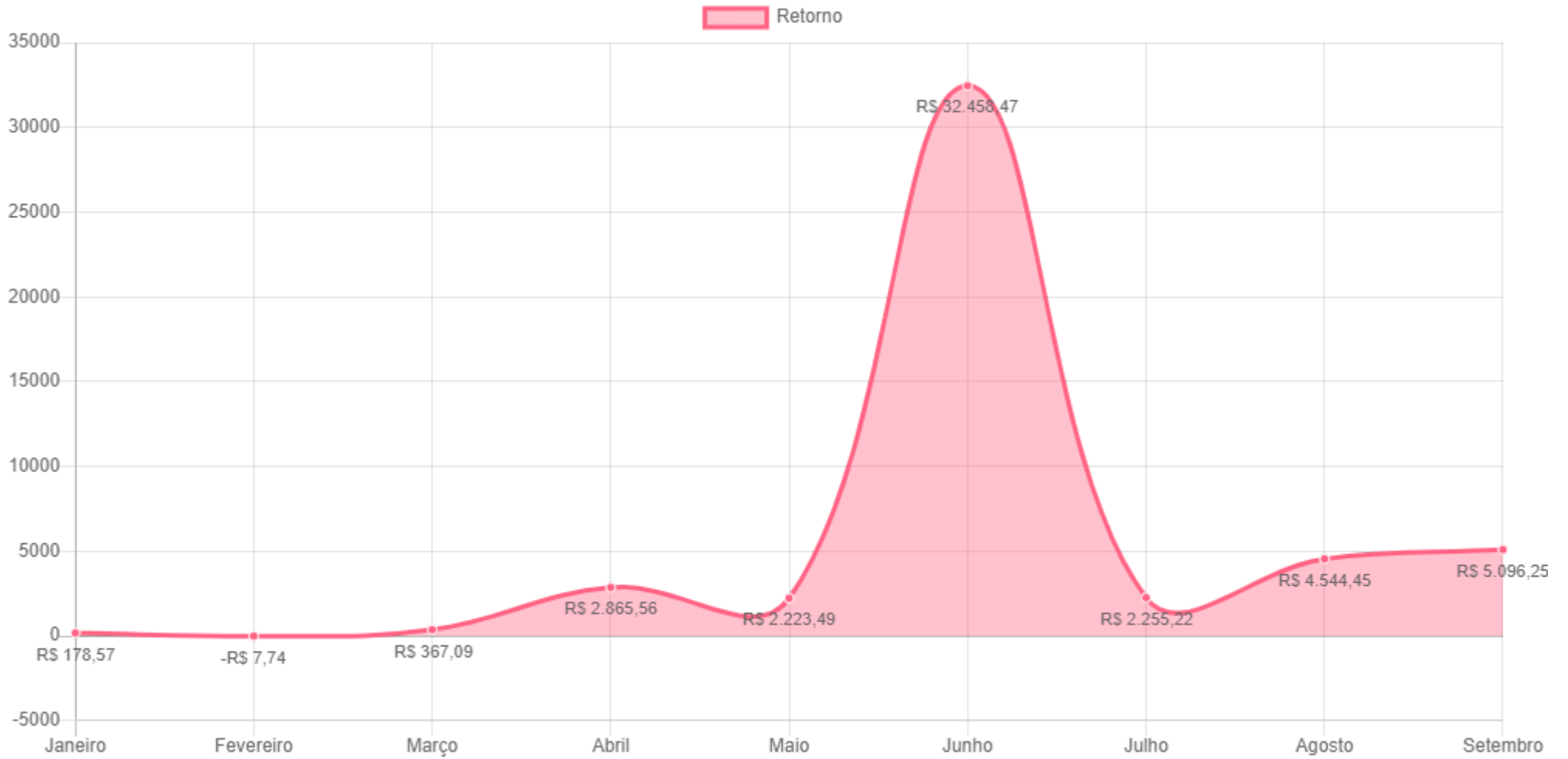
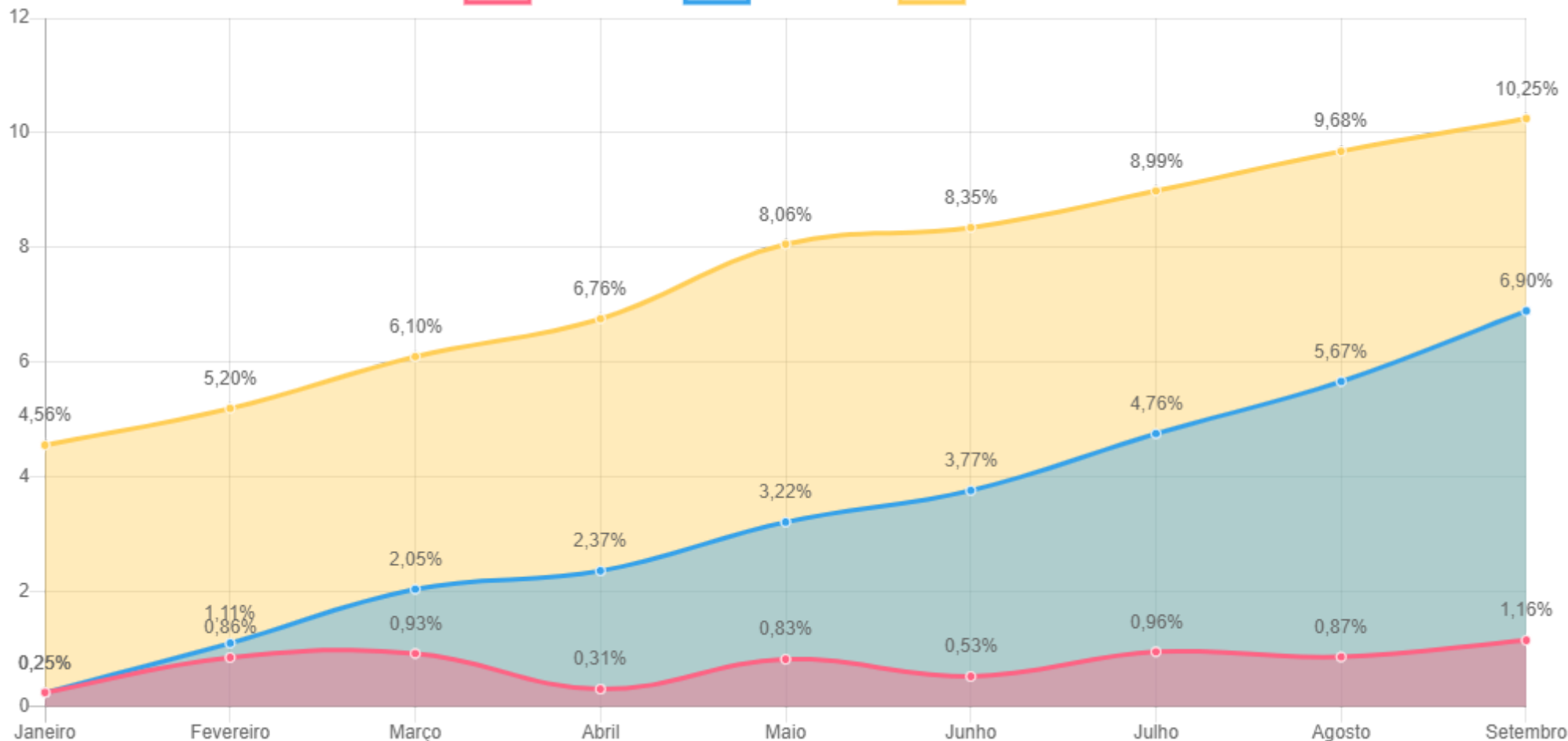


Gráfico - Índices econômicos

IPCA

■ Percentual mês ■ Percentual ano ■ Percentual 12M

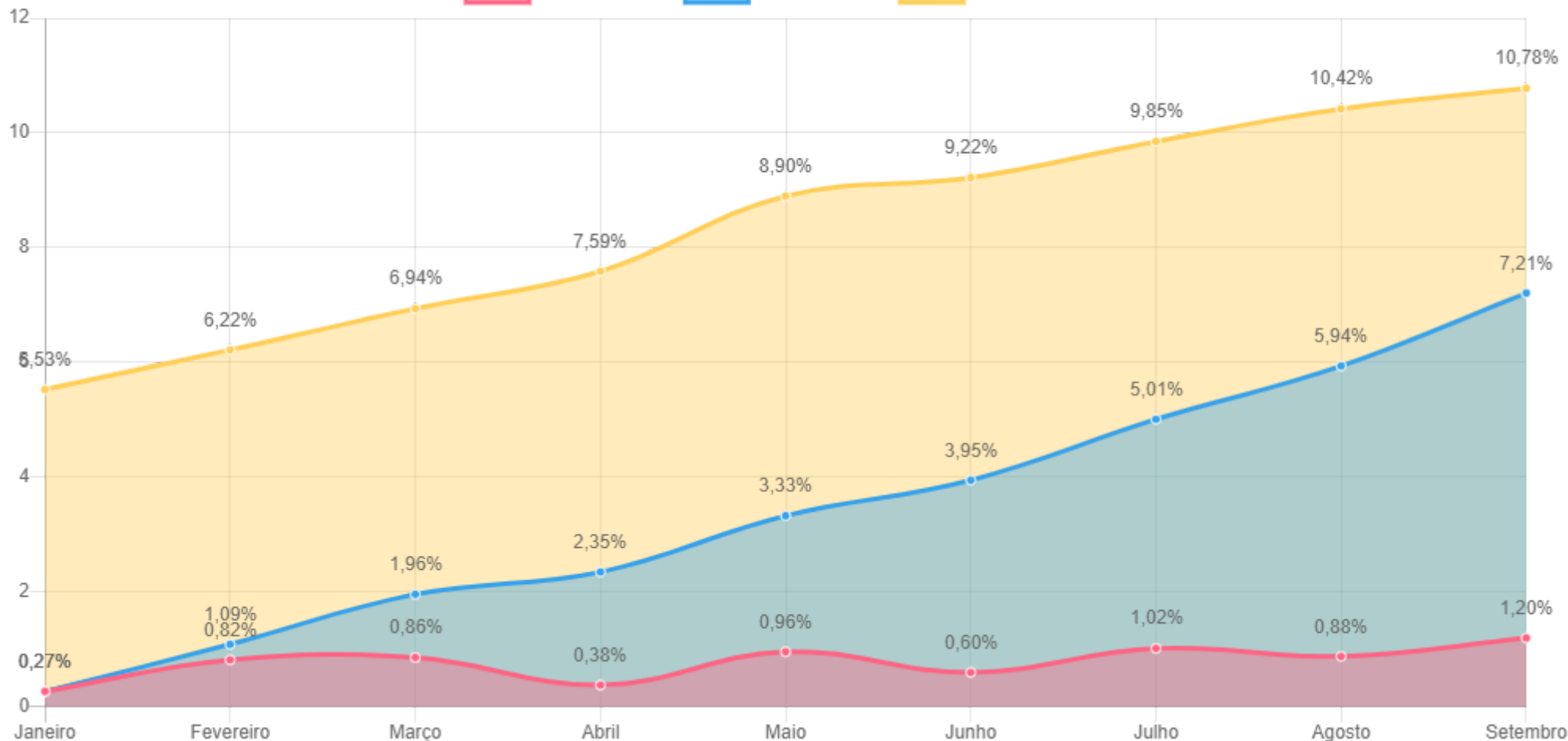


Mês	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maió	Junho	Julho	Agosto	Setembro
Percentual mês	0,25%	0,86%	0,93%	0,31%	0,83%	0,53%	0,96%	0,87%	1,16%
Percentual ano	0,25%	1,11%	2,05%	2,37%	3,22%	3,77%	4,76%	5,67%	6,90%
Percentual 12M	4,56%	5,20%	6,10%	6,76%	8,06%	8,35%	8,99%	9,68%	10,25%

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 emittentes 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 RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	29,564526%	0,000137%	2,894008%	5,225625%	9,173437%
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC FI	CDI	25,010239%	0,000097%	2,210651%	4,399625%	5,913071%

	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 3M	VOL 6M	VOL 12M
Geral		27,287382%	0,000117%			

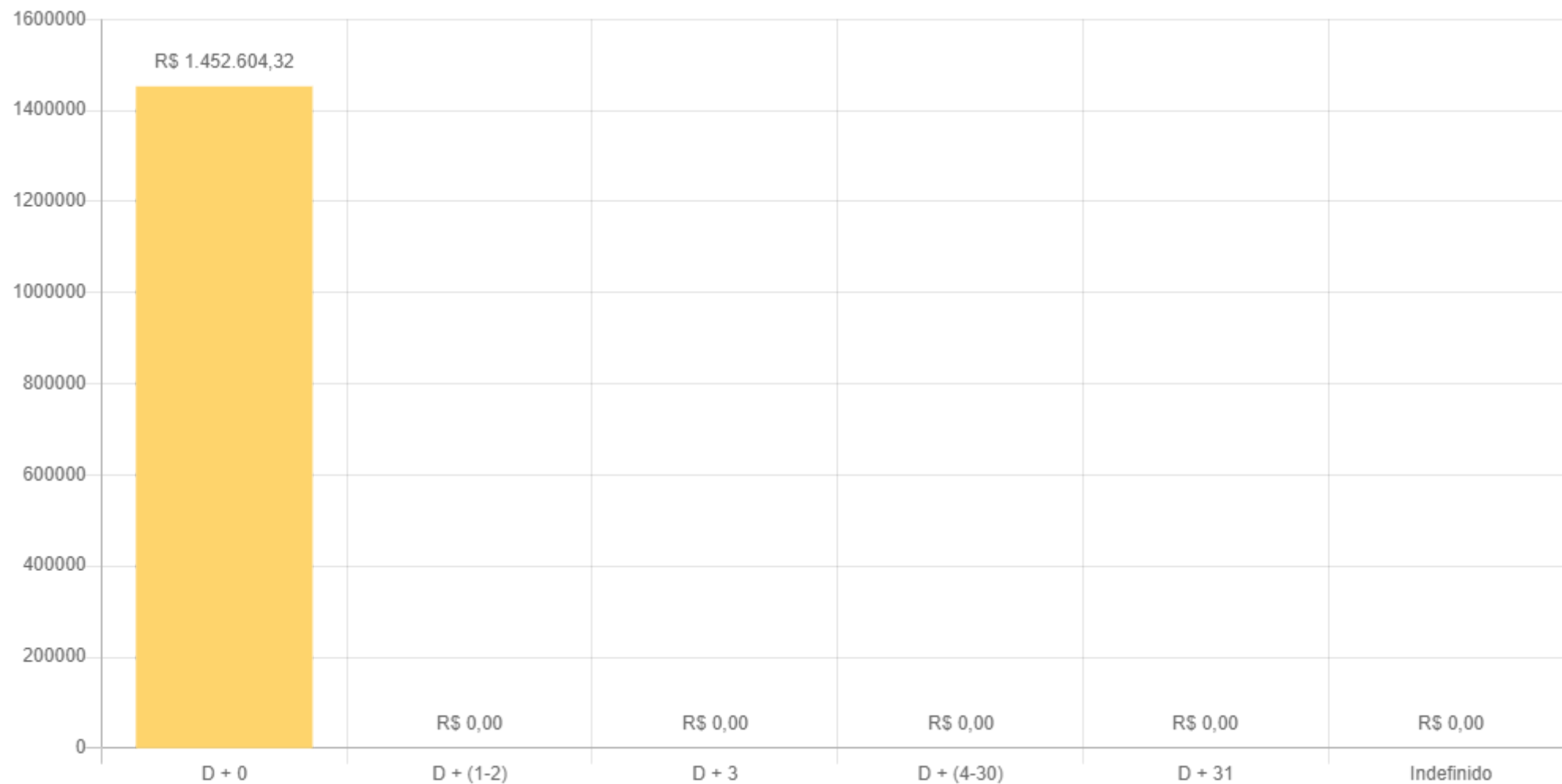
Provisão de risco - Mercado

Nome	CNPJ Fundo	Benchmark	Saldo	VAR 12M	VOL 12M	VAR% BASE 1 DIA CONFIANÇA 95% 252 DU* (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M 1	R\$ 1.165.294,22	0,000137%	9,173437%	R\$ 1,60
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC FI	04.288.966/0001-27	CDI	R\$ 287.310,10	0,000097%	5,913071%	R\$ 0,28

Risco de mercado

Saldo Total	R\$ 1.452.604,32
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 1,88
% Provisão de perda	0,0001%
% Aceitavel perda	2,0%
Limite de utilização	0,0065%

Prazo Resgate	Quantidade Fundos	% carteira	Saldo
D + 0	2	100,0000%	R\$ 1.452.604,32



Risco crédito

Artigos	Limite	Limite Política	Saldo	% carteira
FI 100% títulos TN – 7º, I, b	100,0000%	100,0000%	R\$ 1.165.294,22	80,2210%

Artigos	Limite	Limite Política	Saldo	% carteira
FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a	40,0000%	40,0000%	R\$ 287.310,10	19,7790%

Risco crédito	% carteira	Saldo
100% Títulos publicos	90,1105%	R\$ 1.308.949,27
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	9,8895%	R\$ 143.655,05
100% Títulos privados	0,0000%	R\$ 0,00
Aceitavel carteira Titulos Privados	30,00%	
Limite de Utilização	32,96%	

