



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\$ 1.235.970,12 | 87,69812% | 1154 | 0,01833% | R\$ 6.744.375.720,34 | 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\$ 173.376,08 | 12,30188% | 173464 | 0,00016% | R\$ 107.913.441.203,10 | Art 7º, IV "a" | Baixo | Fundo de Investimento |
| Total | R\$ 1.409.346,20 | | | | | | | |

Enquadramentos

Resolução

% Carteira | Saldo do grupo |

Situação

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

87,69812% | R\$ 1.235.970,12 |

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\$ 1.235.970,12 | 449856.7929 | 0,018326% | R\$ 6.744.375.720,34 | 87,6981% | 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

12,30188% | R\$ 173.376,08 |

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\$ 173.376,08 | 46384.544 | 0,000161% | R\$ 107.913.441.203,10 | 12,3018% | 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

87,69812% | R\$ 1.235.970,12

| Fundo | % saldo | Saldo |
|--|-----------|------------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35 | 87,69812% | R\$ 1.235.970,12 |

CDI

12,30188% | R\$ 173.376,08

| Fundo | % saldo | Saldo |
|--|-----------|----------------|
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI CNPJ: 04.288.966/0001-27 | 12,30188% | R\$ 173.376,08 |

Por administradores

Administrador

% Carteira | Saldo do grupo

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

100,0000% | R\$ 1.409.346,20

| Fundo | % saldo | Saldo |
|--|-----------|------------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35 | 87,69812% | R\$ 1.235.970,12 |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI CNPJ: 04.288.966/0001-27 | 12,30188% | R\$ 173.376,08 |

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\$ 1.183.862,65 | R\$ 150.000,00 | R\$ 100.000,00 | R\$ 1.235.970,12 | 87,6981% | R\$ 2.107,47 | 0,1643% | 0,1579% |
| 04.288.966/0001-27 - BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI | R\$ 183.345,35 | R\$ 199.349,67 | R\$ 209.466,69 | R\$ 173.376,08 | 12,3019% | R\$ 147,75 | 0,1951% | 0,0386% |

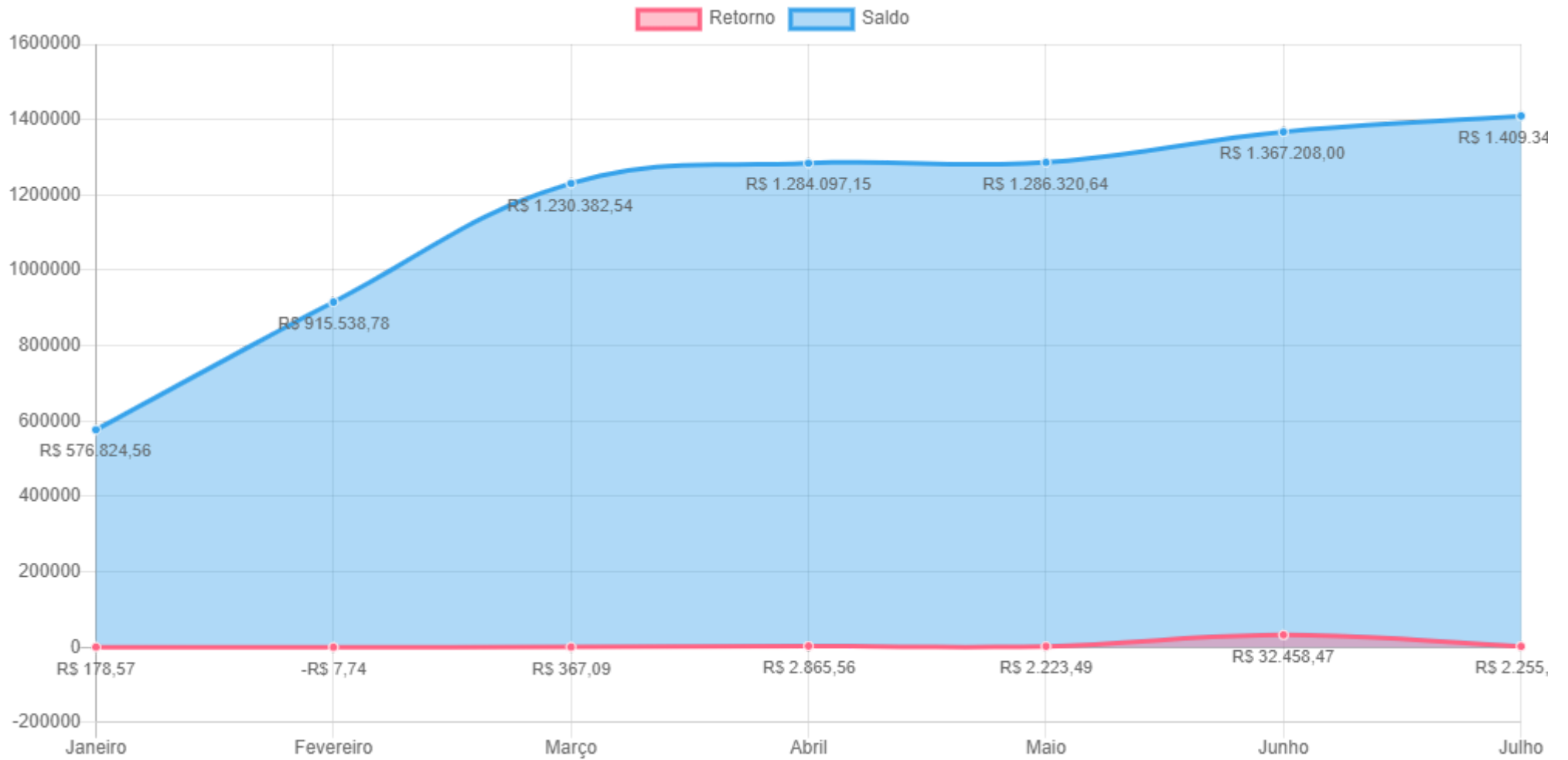
| Tipo | Saldo anterior | Total aplicações | Total resgates | Saldo atual | Total retorno | Total retorno % | Total retorno efetivo |
|---------------------|------------------|------------------|----------------|------------------|---------------|-----------------|-----------------------|
| Fundo de Renda Fixa | R\$ 1.367.208,00 | R\$ 349.349,67 | R\$ 309.466,69 | R\$ 1.409.346,20 | R\$ 2.255,22 | 0,1681% | 0,1314% |
| Totais | R\$ 1.367.208,00 | R\$ 349.349,67 | R\$ 309.466,69 | R\$ 1.409.346,20 | R\$ 2.255,22 | 0,1681% | 0,1314% |

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% |

| | Total aplicações | Total Resgates | Total retorno R\$ | Efetivo % | Meta % | Atingimento % |
|-------|------------------|------------------|-------------------|-----------|---------|---------------|
| Total | R\$ 2.456.794,61 | R\$ 1.664.461,60 | R\$ 40.340,66 | 2,7976% | 0,0000% | ∞% |

Grafico - Evolução do patrimônio



| Janeiro | Fevereiro | Março | Abril | Maio | Junho | Julho |
|----------------|----------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 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\$ 178,57 | -R\$ 7,74 | R\$ 367,09 | R\$ 2.865,56 | R\$ 2.223,49 | R\$ 32.458,47 | R\$ 2.255,22 |

Grafico - Retorno mensal

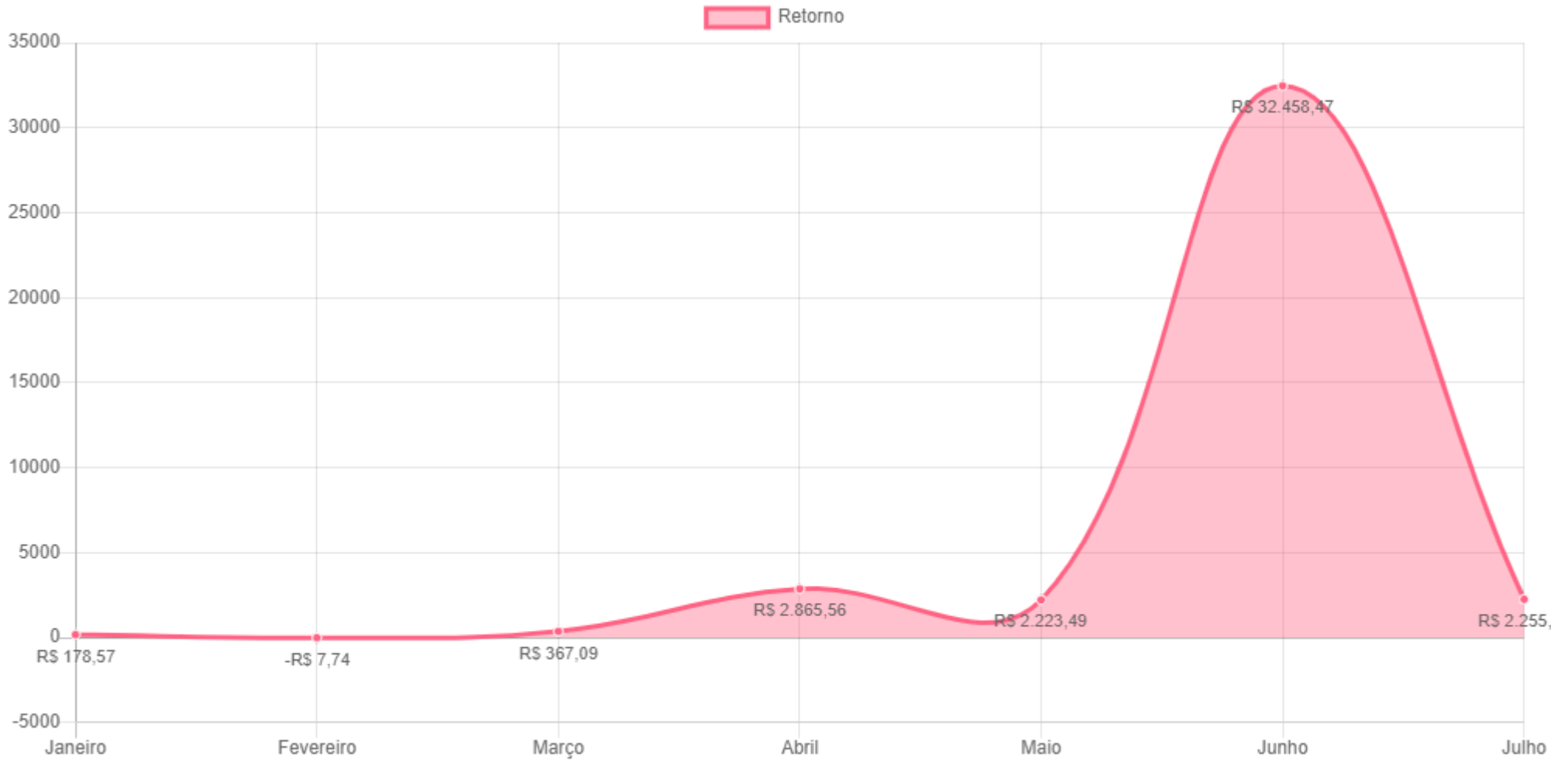
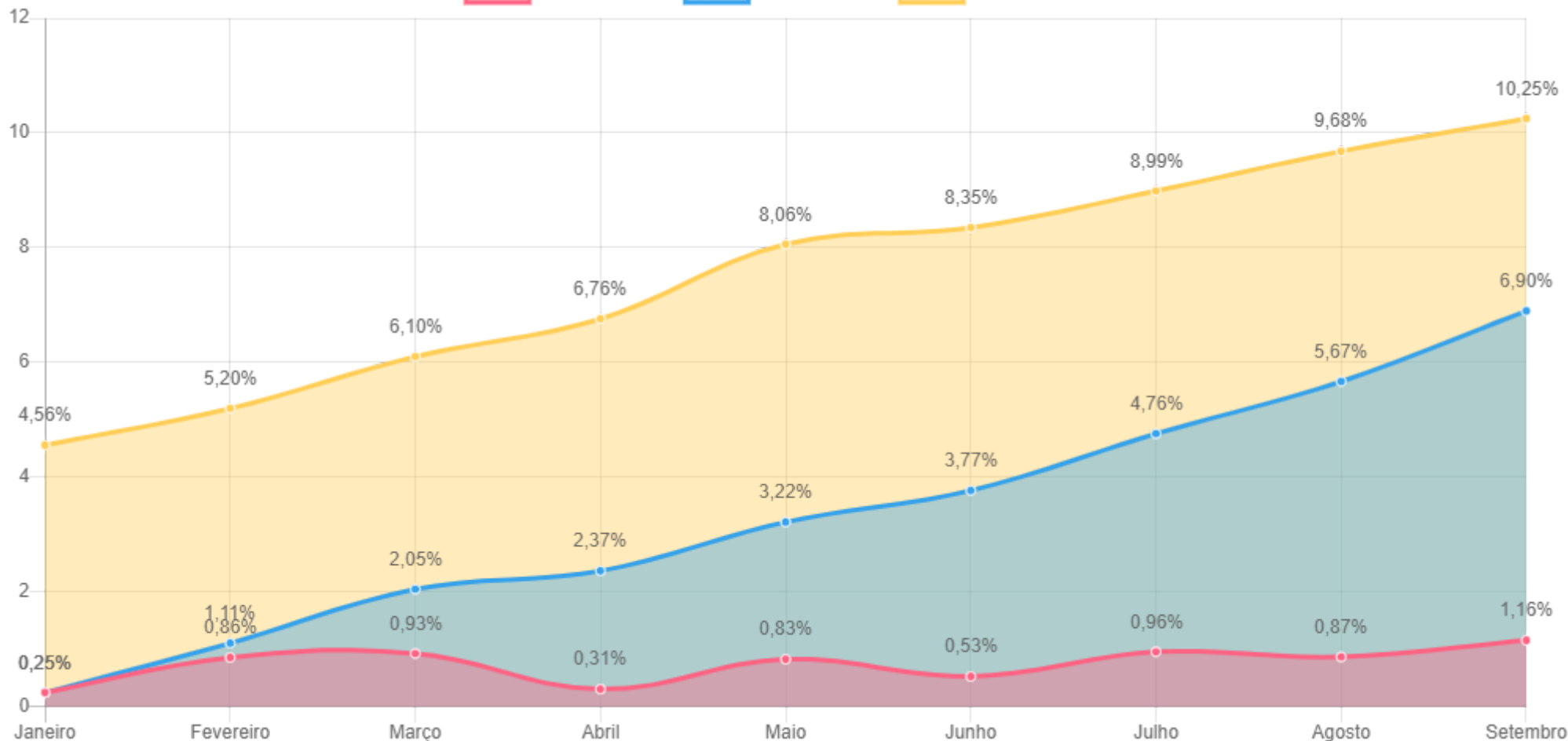


Gráfico - Índices econômicos

IPCA

■ Percentual mês ■ Percentual ano ■ Percentual 12M

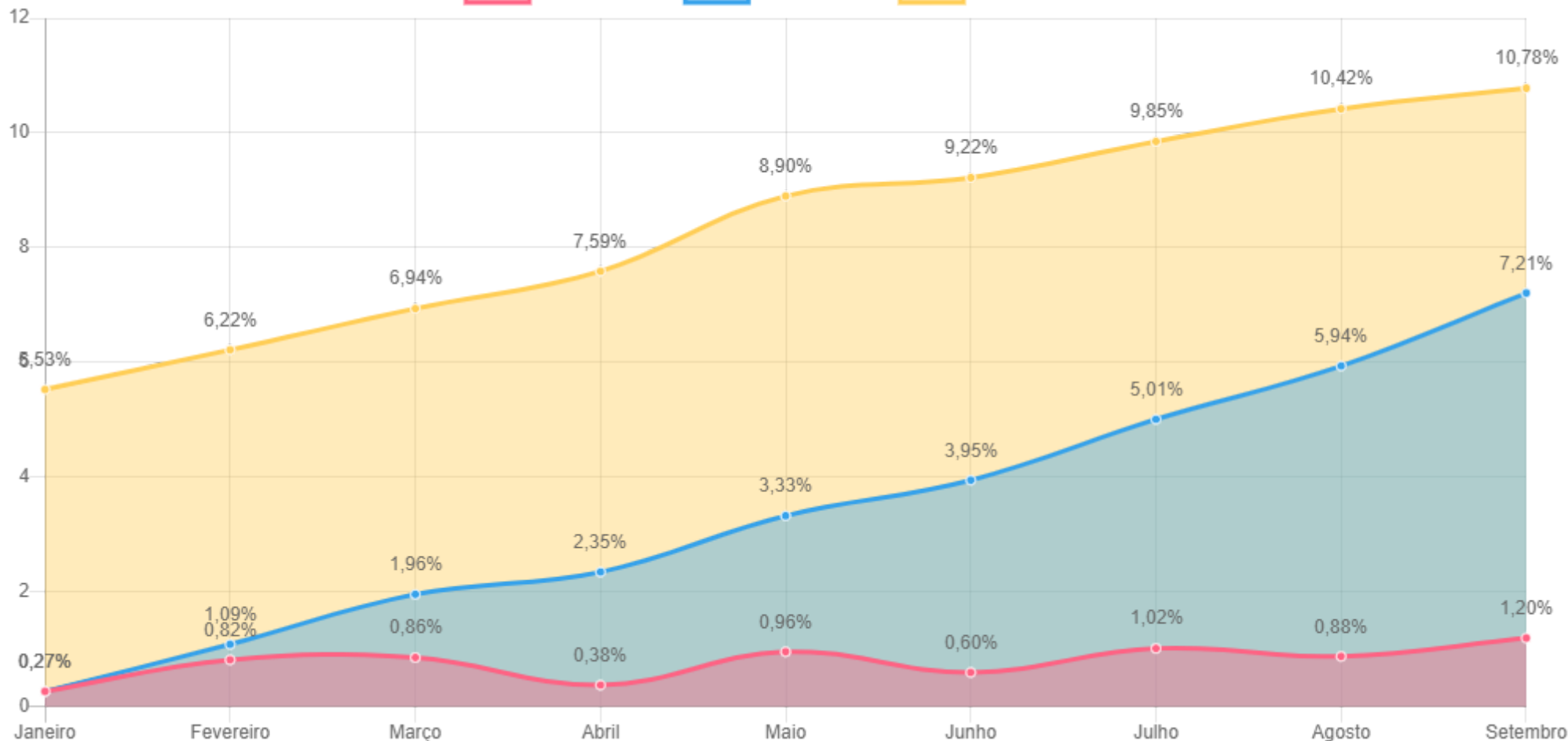


| Mês | Janeiro | Fevereiro | Março | Abril | Maió | Junho | Julho | Agosto | Setembro |
|----------------|---------|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|----------|
| Percentual mês | 0,25% | 0,86% | 0,93% | 0,31% | 0,83% | 0,53% | 0,96% | 0,87% | 1,16% |
| Percentual ano | 0,25% | 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 | Maio | 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 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 RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | IRF-M 1 | 26,768950% | 0,000087% | 1,385264% | 3,585021% | 7,404771% |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC FI | CDI | 26,773104% | 0,000041% | 1,407788% | 2,495607% | 3,059013% |

| | Benchmark | Sharpe | VAR 12M | VOL 3M | VOL 6M | VOL 12M |
|-------|-----------|------------|-----------|--------|--------|---------|
| Geral | | 26,771027% | 0,000064% | | | |

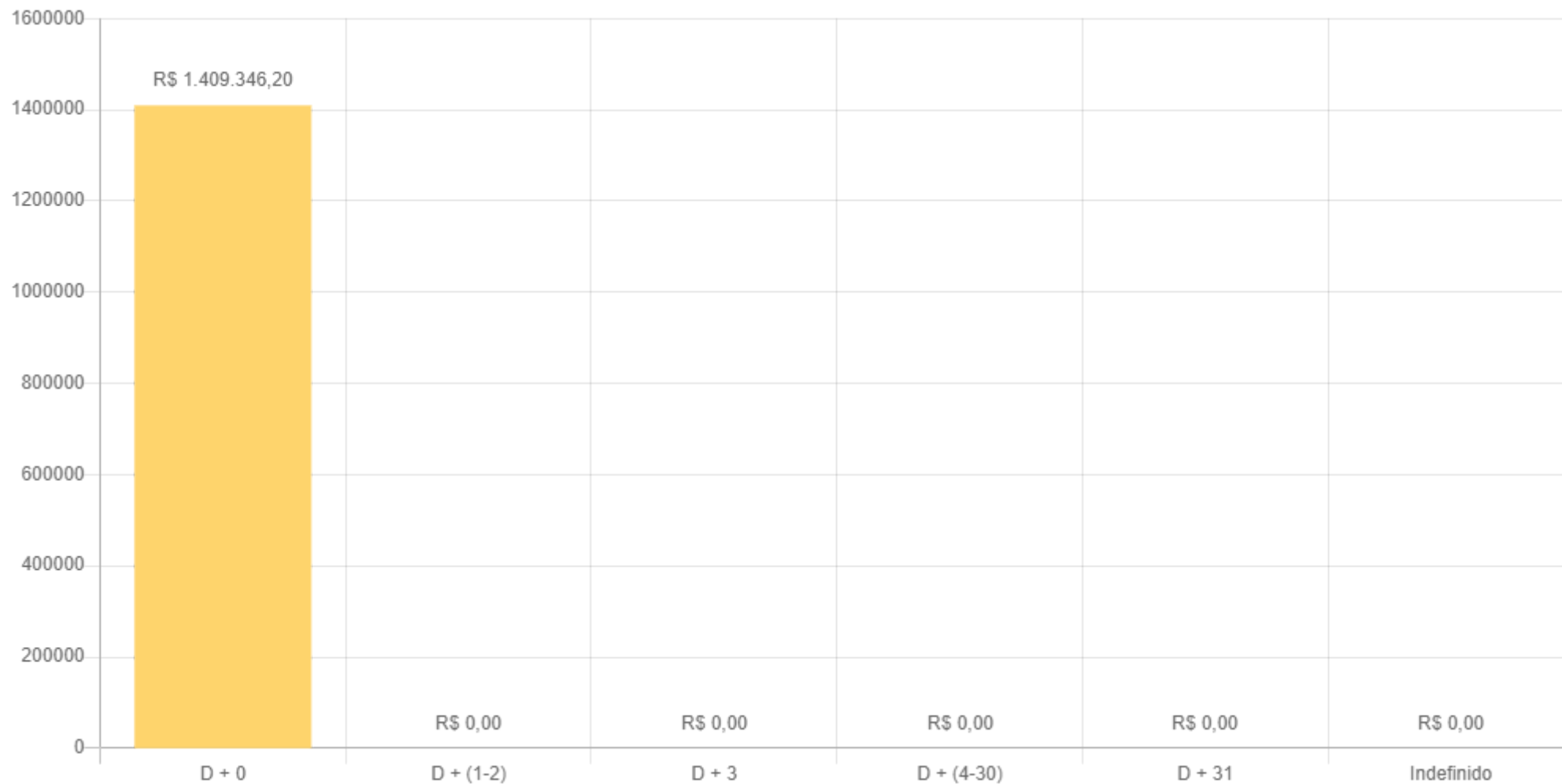
Provisão de risco - Mercado

| 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\$ 1.235.970,12 | 0,000087% | 7,404771% | R\$ 1,08 |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC FI | 04.288.966/0001-27 | CDI | R\$ 173.376,08 | 0,000041% | 3,059013% | R\$ 0,07 |

Risco de mercado

| | |
|--------------------------------------|------------------|
| Saldo Total | R\$ 1.409.346,20 |
| Provisão para perda e Investimentos: | R\$ 1,15 |
| % Provisão de perda | 0,0001% |
| % Aceitavel perda | 2,0% |
| Limite de utilização | 0,0041% |

| Prazo Resgate | Quantidade Fundos | % carteira | Saldo |
|---------------|-------------------|------------|------------------|
| D + 0 | 2 | 100,0000% | R\$ 1.409.346,20 |



Risco crédito

| Artigos | Limite | Limite Política | Saldo | % carteira |
|-------------------------------|-----------|-----------------|------------------|------------|
| FI 100% títulos TN – 7º, I, b | 100,0000% | 100,0000% | R\$ 1.235.970,12 | 87,6981% |

| Artigos | Limite | Limite Política | Saldo | % carteira |
|-----------------------------------|----------|-----------------|----------------|------------|
| FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a | 40,0000% | 40,0000% | R\$ 173.376,08 | 12,3019% |

| Risco crédito | % carteira | Saldo |
|---|---------------|------------------|
| 100% Títulos publicos | 93,8491% | R\$ 1.322.658,16 |
| 50% Títulos publicos e 50% Títulos privados | 6,1509% | R\$ 86.688,04 |
| 100% Títulos privados | 0,0000% | R\$ 0,00 |
| Aceitavel carteira Titulos Privados | 30,00% | |
| Limite de Utilização | 20,50% | |

