



DI BLASI
Consultoria Financeira

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE SOURE

Outubro 2022

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	2,03%	885	0.00	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 40.195,34	B	Fundo de Investimento	1,00%	
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	0	97,97%	1,096	0.03	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 1.939.970,55	B	Fundo de Investimento	0,20%	
42.592.315/0001-15	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO F	0	0,00%	1,496	0.00	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 0,01	B	Fundo de Investimento	0,20%	
04.288.966/0001-27	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO E	0	0,00%	161,797	0.00	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 0,00	B	Fundo de Investimento	0,20%	
							R\$ 1.980.165,90				

Retorno do mês

Nome Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI	R\$ 39.816,97	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 40.195,34	R\$ 378,37	0,9502%	CDI
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F	R\$ 1.921.070,85	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 1.939.970,55	R\$ 18.899,70	0,9838%	IRF-M 1
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTIC	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0,01	R\$ 0,01	0,0000%	CDI
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTIC	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ -	0,0000%	CDI
Total	1,960,887.82	0.00	0.00	1,980,165.90	19,278.08	0,9831%	

Enquadramentos

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

 % Carteira: : **97,97%** Saldo do grupo: **R\$ 1.939.970,55**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 1.939.970,55	633,671.20	0,03215%	6,033,726,634.06	97,97%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,03%	Enquadrado

Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"

 % Carteira: : **2,03%** Saldo do grupo: **R\$ 40.195,35**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 40.195,34	16,874.39	0,00104%	3,859,205,707.52	2,03%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FI EM COTAS DE FI	R\$ 0,01	0.01	0,00000%	16,503,186,034.60	0,00%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI	R\$ 0,00	0.00	0,00000%	15,633,204,111.10	0,00%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado

Enquadramento por Benchmark

CDI

 % Carteira: **2,03%**

 Saldo do grupo: **R\$ 40.195,35**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI	R\$ 0,00	0.00	0.00	0.00	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado
BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FI EM COTAS DE FI	R\$ 0,01	0.01	0.00	0.00	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 40.195,34	16,874.39	0.00	2.03	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IRF-M 1

 % Carteira: **97,97%**

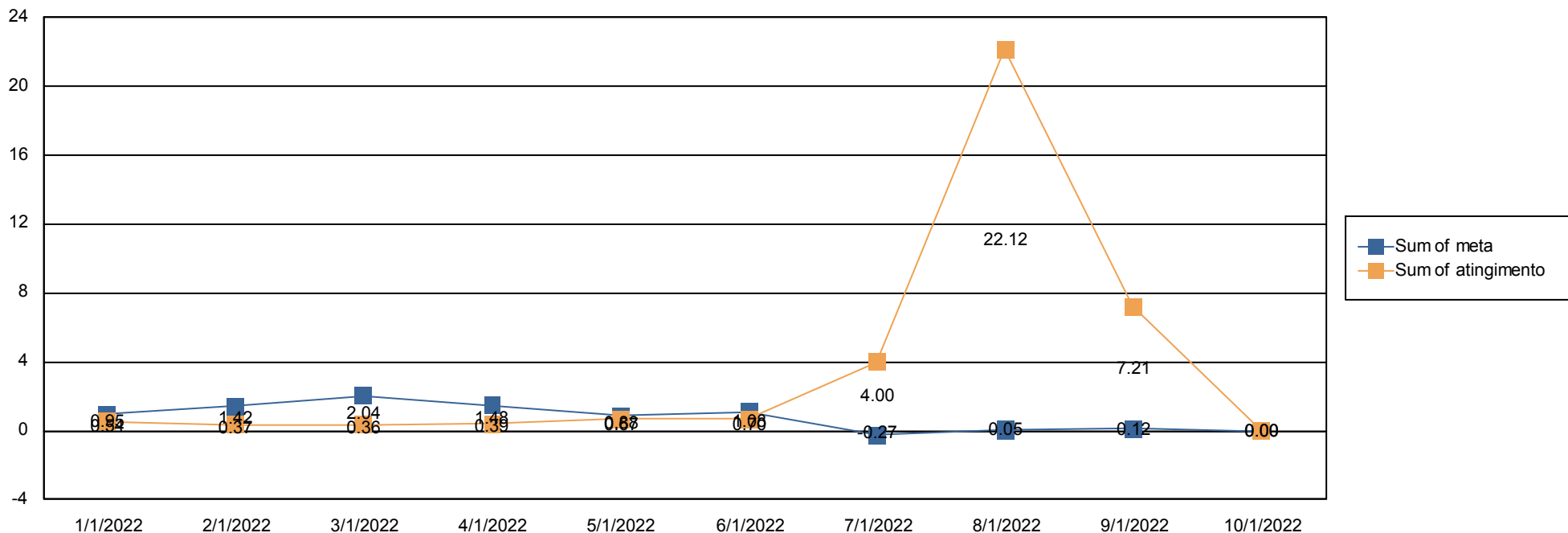
 Saldo do grupo: **R\$ 1.939.970,55**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 1.939.970,55	633,671.20	0.03	97.97	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

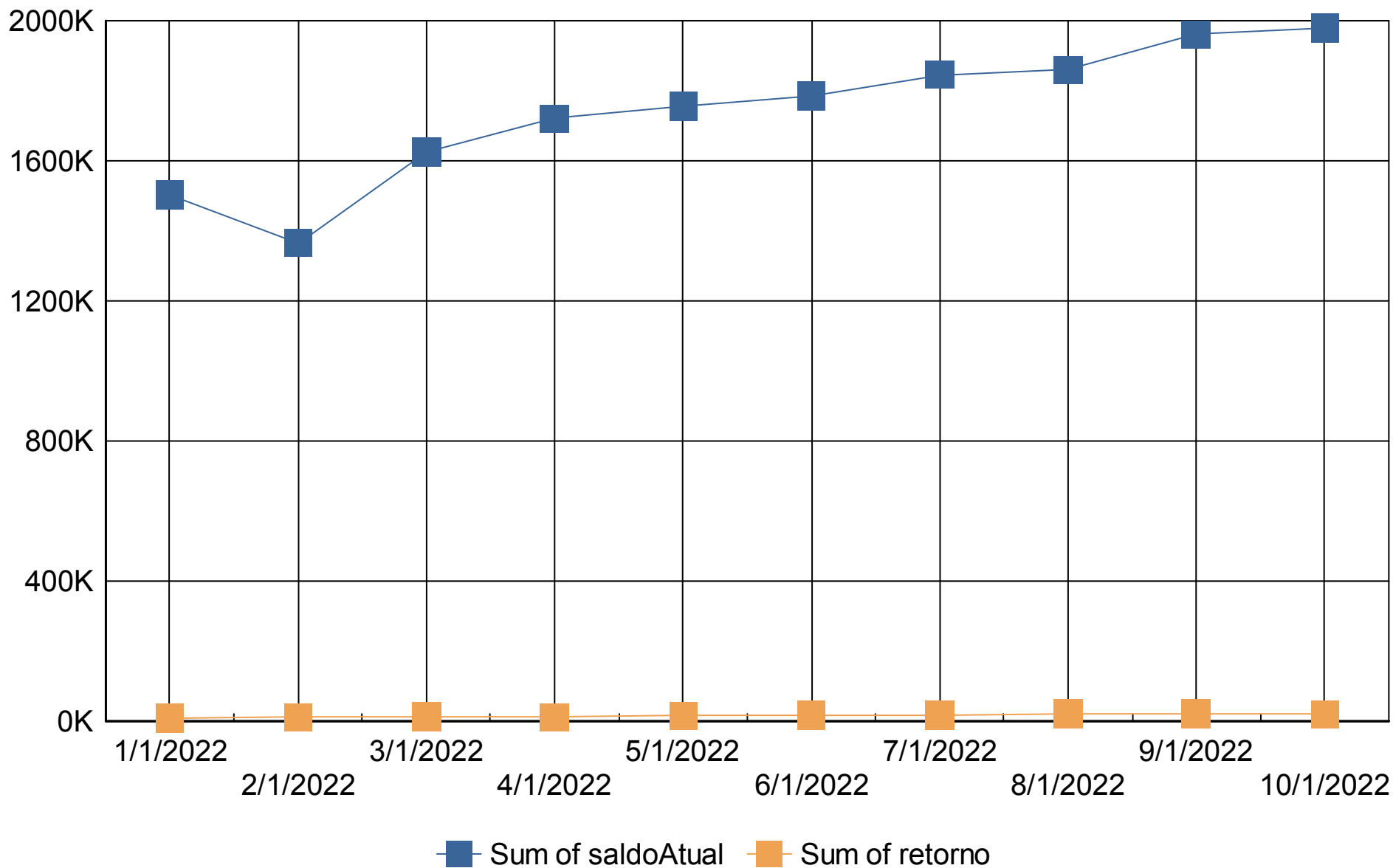
Retorno acumulado no ano

Período	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Retorno %	Meta	Atingimento
Janeiro	R\$ 1.478.045,65	R\$ 255.766,84	R\$ 239.191,69	R\$ 1.503.574,25	R\$ 8.953,45	0,5164%	0,9528	54,1984%
Fevereiro	R\$ 1.503.574,25	R\$ 597.112,73	R\$ 745.008,86	R\$ 1.366.672,94	R\$ 10.994,82	0,5234%	1,4247	36,7370%
Março	R\$ 1.366.672,94	R\$ 422.725,79	R\$ 176.873,37	R\$ 1.625.779,99	R\$ 13.254,63	0,7407%	2,0373	36,3585%
Abril	R\$ 1.625.779,99	R\$ 341.594,40	R\$ 257.529,94	R\$ 1.721.043,32	R\$ 11.198,87	0,5692%	1,4750	38,5918%
Mai	R\$ 1.721.043,32	R\$ 849.466,00	R\$ 828.119,10	R\$ 1.757.658,85	R\$ 15.268,63	0,5940%	0,8825	67,3079%
Junho	R\$ 1.757.658,85	R\$ 335.050,35	R\$ 322.357,63	R\$ 1.786.187,05	R\$ 15.835,48	0,7567%	1,0834	69,8447%
Julho	R\$ 1.786.187,05	R\$ 407.648,06	R\$ 365.059,34	R\$ 1.846.679,14	R\$ 17.903,37	0,8161%	-0,2722	399,8076%
Agosto	R\$ 1.846.679,14	R\$ 136.208,80	R\$ 144.127,77	R\$ 1.860.297,82	R\$ 21.537,65	1,0862%	0,0491	2.212,1708%
Setembro	R\$ 1.860.297,82	R\$ 486.906,08	R\$ 406.535,87	R\$ 1.960.887,82	R\$ 20.219,79	0,8614%	0,1194	721,4753%
Outubro	R\$ 1.960.887,82	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.980.165,90	R\$ 19.278,08	0,9831%	0,0000	0,0000%
Total		3,832,479.05	3,484,803.57		154,444.77	7,7000%	7,9999%	96,2512%

Meta x Atingimento

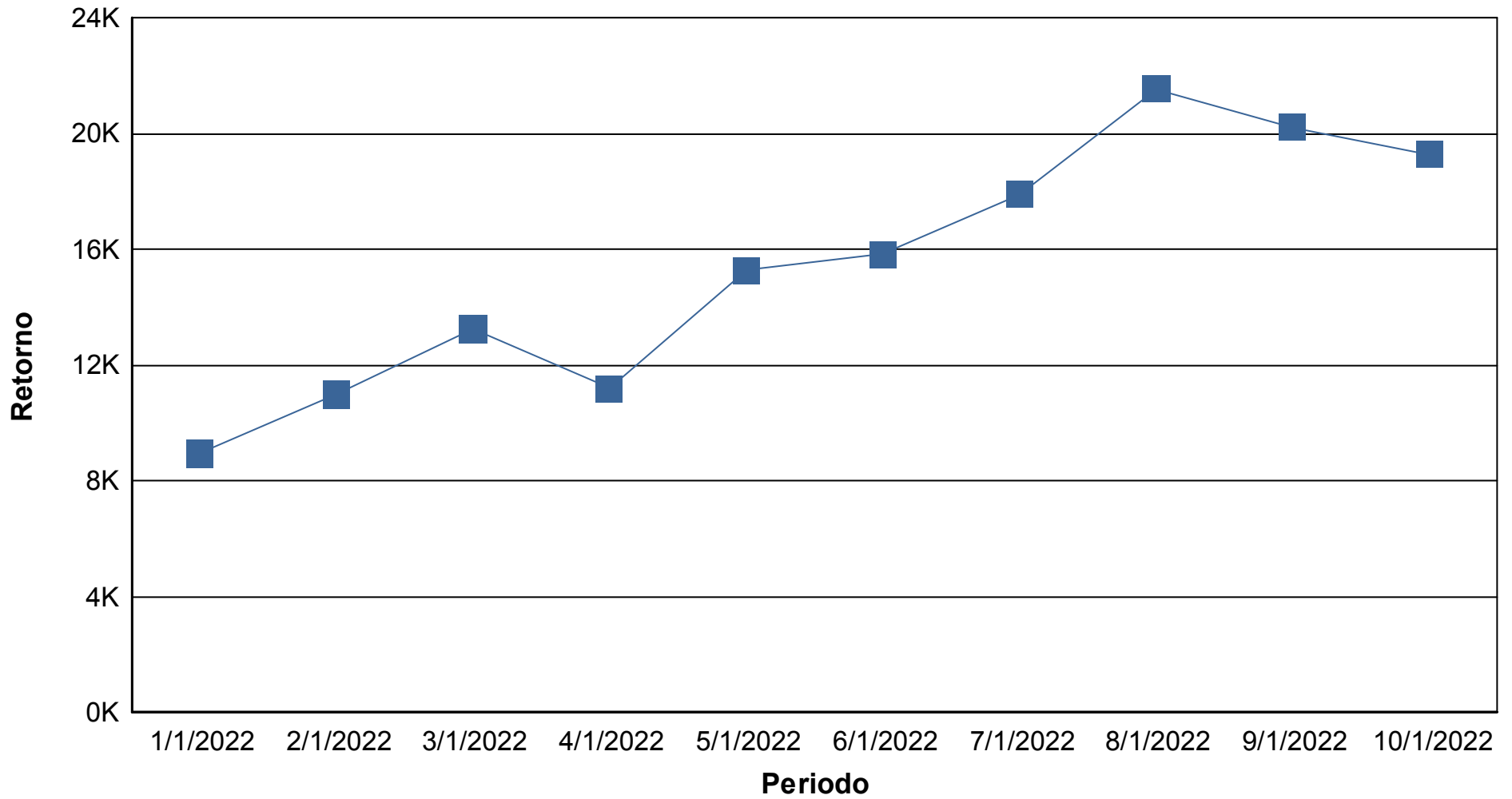


Evolução do patrimônio

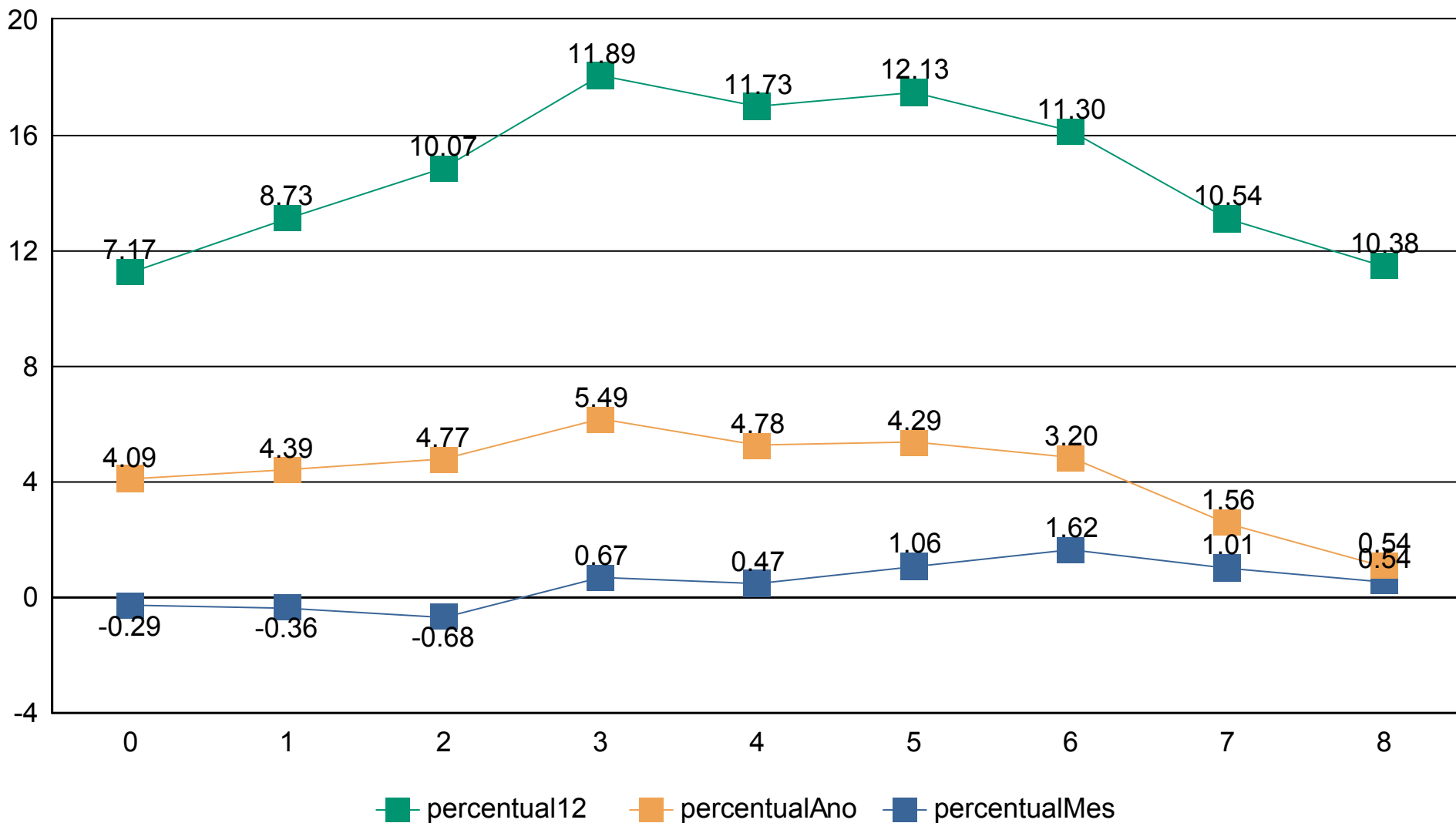




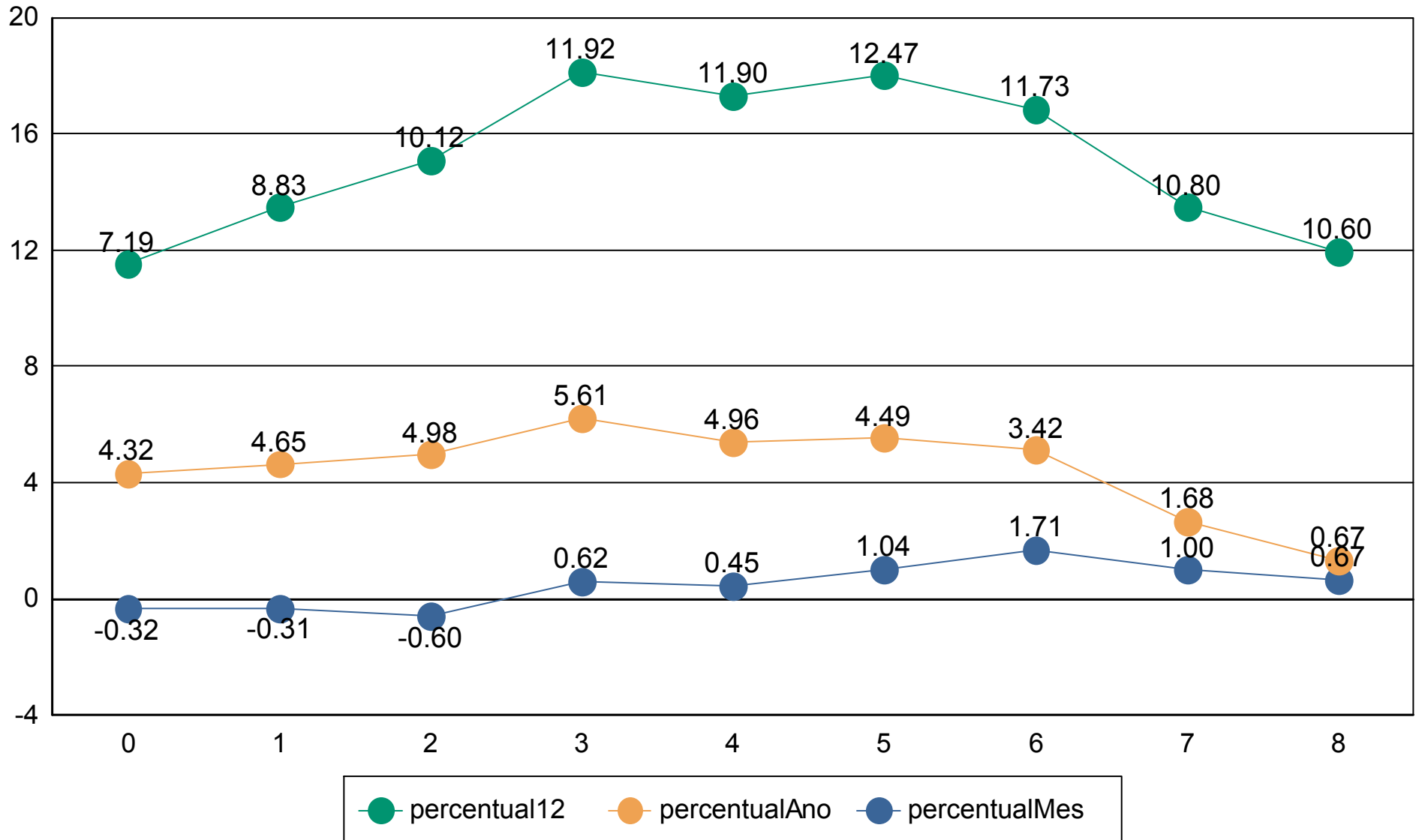
Retorno Mensal



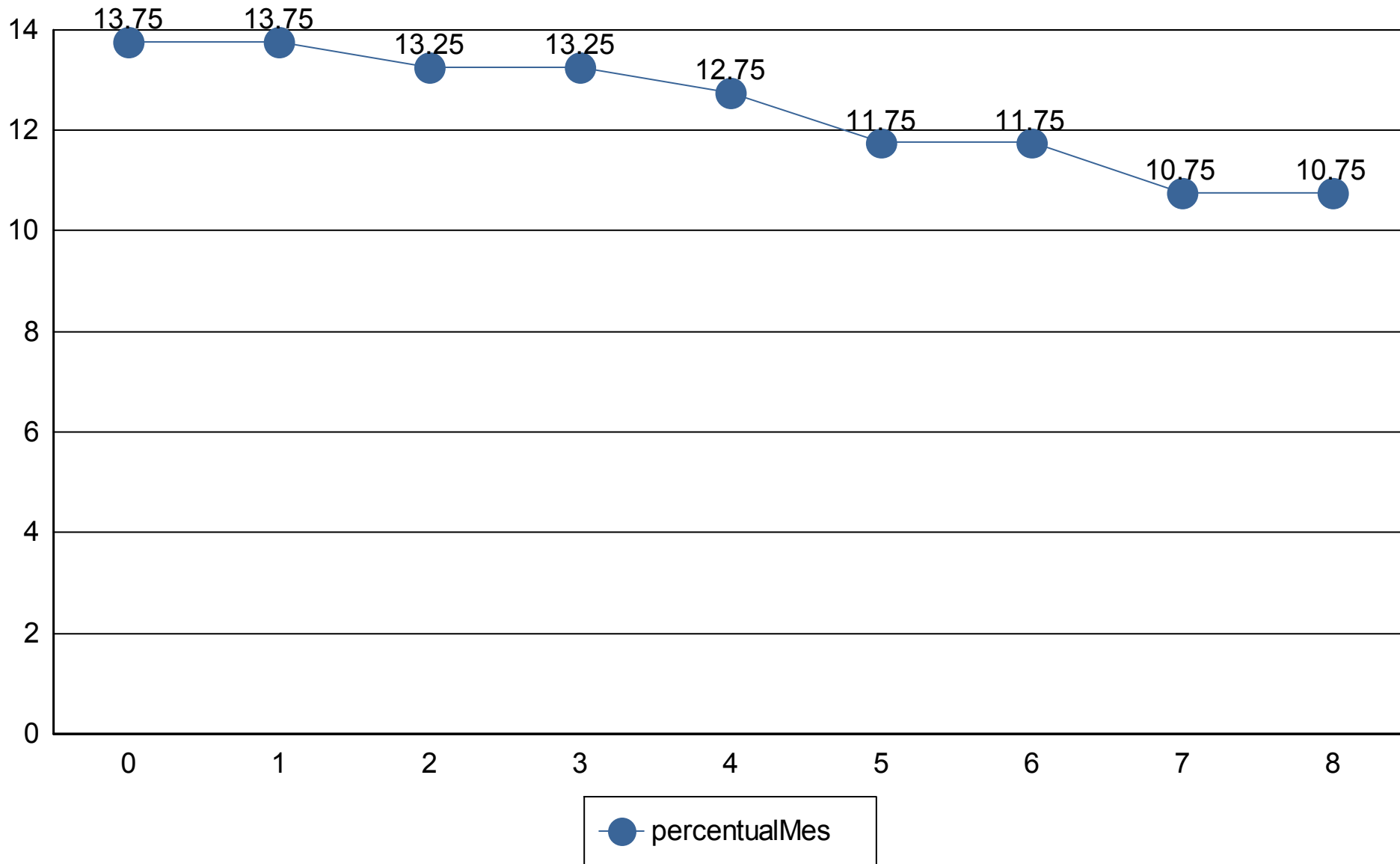
Índices Econômicos - IPCA



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 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.

CNPJ	Nome fundo	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL3	VOL6	VOL12
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	IRF-M 1	25,94%	0,00%	9,14%	24,28%	52,31%
04.288.966/0001-27	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC F	CDI	25,23%	0,00%	7,75%	20,31%	44,82%
42.592.315/0001-15	BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FI EM COTAS DE FI	CDI	25,29%	0,00%	7,20%	18,93%	42,62%
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	CDI	25,18%	0,00%	8,53%	22,41%	50,02%
			101,63%	0,00%	32,62%	85,93%	189,76%

Provisão de risco - Mercado

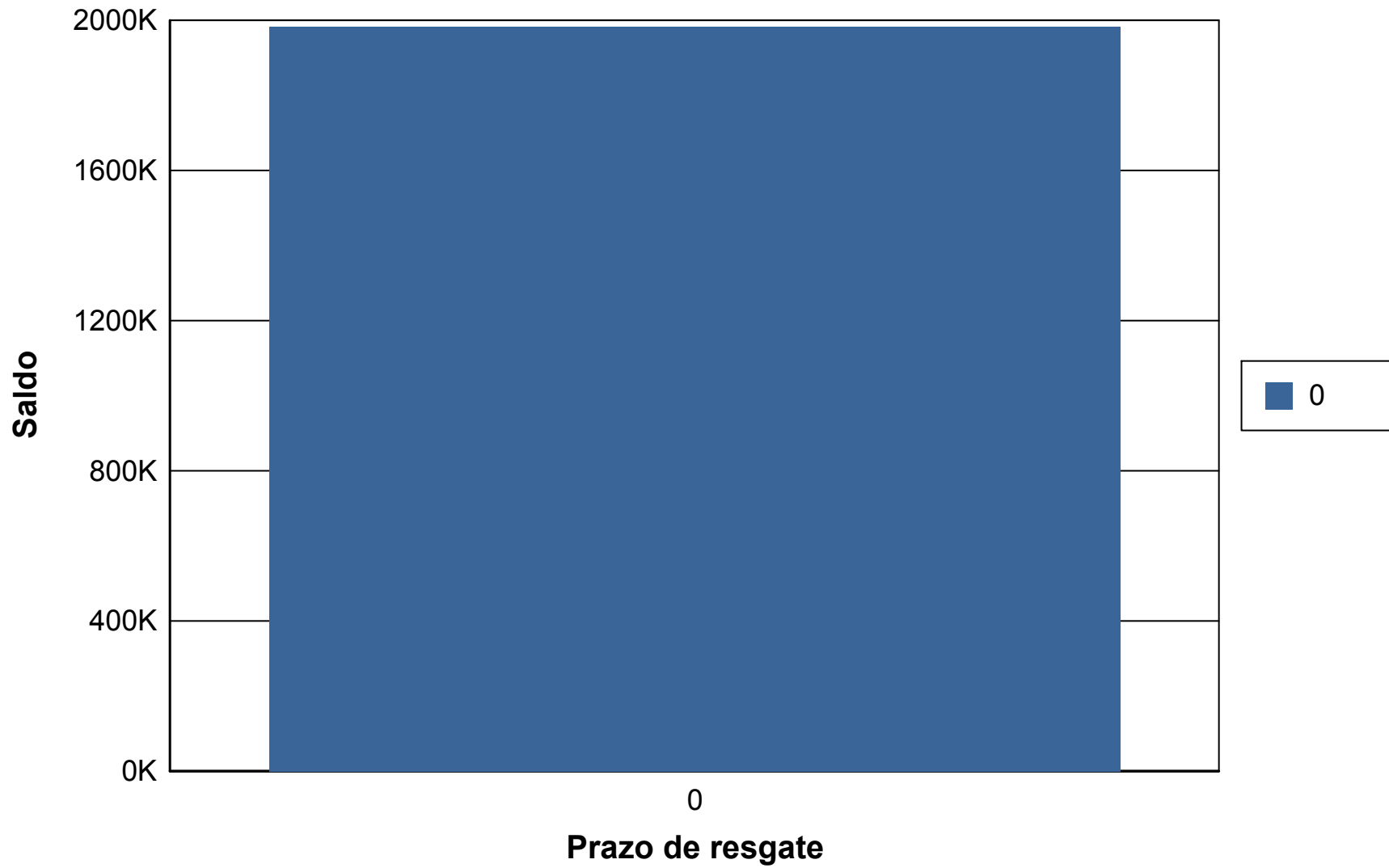
CNPJ	Nome do fundo	Benchmark	Saldo	VAR12	VOL12	VAR% BASE 1
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO	IRF-M 1	R\$ 1.939.970,55	0,00%	52,31%	R\$ 5,22
42.592.315/0001-15	BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INV	CDI	R\$ 0,01	0,00%	42,62%	R\$ 0,00
04.288.966/0001-27	BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PÚBLIC	CDI	R\$ 0,00	0,00%	44,82%	R\$ 0,00

Saldo Total:	R\$ 1.939.970,56
Provisão para perda e Investimentos	R\$ 5,22
% Provisão de perda	0,00%
% Aceitável perda	2%
Limite de utilização	0,01%



Nome do Fundo	Saldo	% Part.	N. Cotistas	% PL	PL do Fundo	Legislação	Grau risco	Prazo Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE	R\$ 40.195,34	2,03%	885	0,00%	R\$ 3.867.637.680,22	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULC	R\$ 1.939.970,55	97,97%	1,096	0,03%	R\$ 6.030.046.758,75	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUI	R\$ 0,01	0,00%	1,496	0,00%	R\$ 116.636.976.196,32	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SE	R\$ 0,00	0,00%	161,797	0,00%	R\$ 15.542.426.467,48	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
0	R\$ 1.980.165,90	4	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\$ 1.939.970,55	97,97
Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	60,00%	60,00%	R\$ 40.195,35	2,03

	Saldo	% Carteira
100% títulos públicos	0.00	0.00
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	0.00	0.00
100% títulos privados	1,980,165.90	100.00

