



# **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 FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO <b>Banco:</b> BANCO DO BRASIL <b>Agência:</b> 1151-7 <b>Conta:</b> 9138-3	R\$ 26.929,84	1,21235%	895	0,0007%	R\$ 3.841.990.026,28	Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	Baixo	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI <b>Banco:</b> BANCO DO BRASIL <b>Agência:</b> 1151-7 <b>Conta:</b> 9138-3	R\$ 2.194.367,44	98,78765%	1114	0,03367%	R\$ 6.516.931.621,39	Res. 4.963/2021 - Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	Baixo	Fundo de Investimento
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO <b>Banco:</b> 001 <b>Agência:</b> 1151-7 <b>Conta:</b> 9138-3	R\$ 0,00	0,00%	70791	0,00%	R\$ 107.513.514.341,45	Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	Baixo	Fundo de Investimento
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI <b>Banco:</b> 001 <b>Agência:</b> 1151-7 <b>Conta:</b> 9138-3	R\$ 0,00	0,00%	160590	0,00%	R\$ 12.958.964.493,87	Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	Baixo	Fundo de Investimento
Total	<b>R\$ 2.221.297,28</b>							

# Enquadramentos

## Resolução

% Carteira

Saldo do grupo

Situação

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

**98,787653%**

**R\$ 2.194.367,44**

**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\$ 2.194.367,44	702149.755551	0,033672%	R\$ 6.516.931.621,39	98,7876%	Lim. Resol.: 100,00% Lim. Política: 100,00% Lim. CNPJ: 100,00% Lim. PL.: 100,0000%	<b>Enquadrado</b>

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

**1,212347%**

**R\$ 26.929,84**

**Enquadrado**

Fundo	Saldo	Saldo Cotas	% PL	P. Líq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	R\$ 26.929,84	11086.097848	0,000701%	R\$ 3.841.990.026,28	1,2123%	Lim. Resol.: 60,00% Lim. Política: 60,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	<b>Enquadrado</b>
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 42.592.315/0001-15	R\$ 0,00	0.006198	0,0000%	R\$ 107.513.514.341,45	0,0000%	Lim. Resol.: 60,00% Lim. Política: 60,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	<b>Enquadrado</b>
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI CNPJ: 04.288.966/0001-27	R\$ 0,00	0.001129	0,0000%	R\$ 12.958.964.493,87	0,0000%	Lim. Resol.: 60,00% Lim. Política: 60,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	<b>Enquadrado</b>

## Por benchmark

### Benchmark

**% Carteira | Saldo do grupo**

#### IRF-M 1

**98,787653% | R\$ 2.194.367,44**

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35	98,787653%	R\$ 2.194.367,44

#### CDI

**1,212347% | R\$ 26.929,84**

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	1,212347%	R\$ 26.929,84
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 42.592.315/0001-15	0,0000%	R\$ 0,00
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI CNPJ: 04.288.966/0001-27	0,0000%	R\$ 0,00

## Por administradores

### Administrador

% Carteira | Saldo do grupo

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

**100,0000% | R\$ 2.221.297,28**

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO <b>CNPJ:</b> 13.077.415/0001-05	1,212347%	R\$ 26.929,84
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI <b>CNPJ:</b> 11.328.882/0001-35	98,787653%	R\$ 2.194.367,44
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO <b>CNPJ:</b> 42.592.315/0001-15	0,0000%	R\$ 0,00
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC FI <b>CNPJ:</b> 04.288.966/0001-27	0,0000%	R\$ 0,00

# Retornos do mês

## RENDA FIXA

Fundo	Saldo anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Participação	Retorno R\$	Retorno %	Efetivo %
13.077.415/0001-05 - BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 21.468,68	R\$ 851.555,55	R\$ 847.795,87	R\$ 26.929,84	1,2123%	R\$ 1.701,48	1,0336%	1,0336%
11.328.882/0001-35 - BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 1.902.025,50	R\$ 270.000,00	R\$ 0,00	R\$ 2.194.367,44	98,7877%	R\$ 22.341,94	1,1571%	1,1571%
42.592.315/0001-15 - BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FI EM COTAS DE FI	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,0000%	R\$ 0,00	0,8931%	0,8931%
04.288.966/0001-27 - BB RF CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,0000%	R\$ 0,00	0,9577%	0,9577%

Tipo	Saldo anterior	Total aplicações	Total resgates	Saldo atual	Total retorno	Total retorno %	Total retorno efetivo
RENTA FIXA	R\$ 1.923.494,18	R\$ 1.121.555,55	R\$ 847.795,87	R\$ 2.221.297,28	R\$ 24.043,42	1,1556%	0,7896%
Totais	R\$ 1.923.494,18	R\$ 1.121.555,55	R\$ 847.795,87	R\$ 2.221.297,28	R\$ 24.043,42	1,1556%	0,7896%

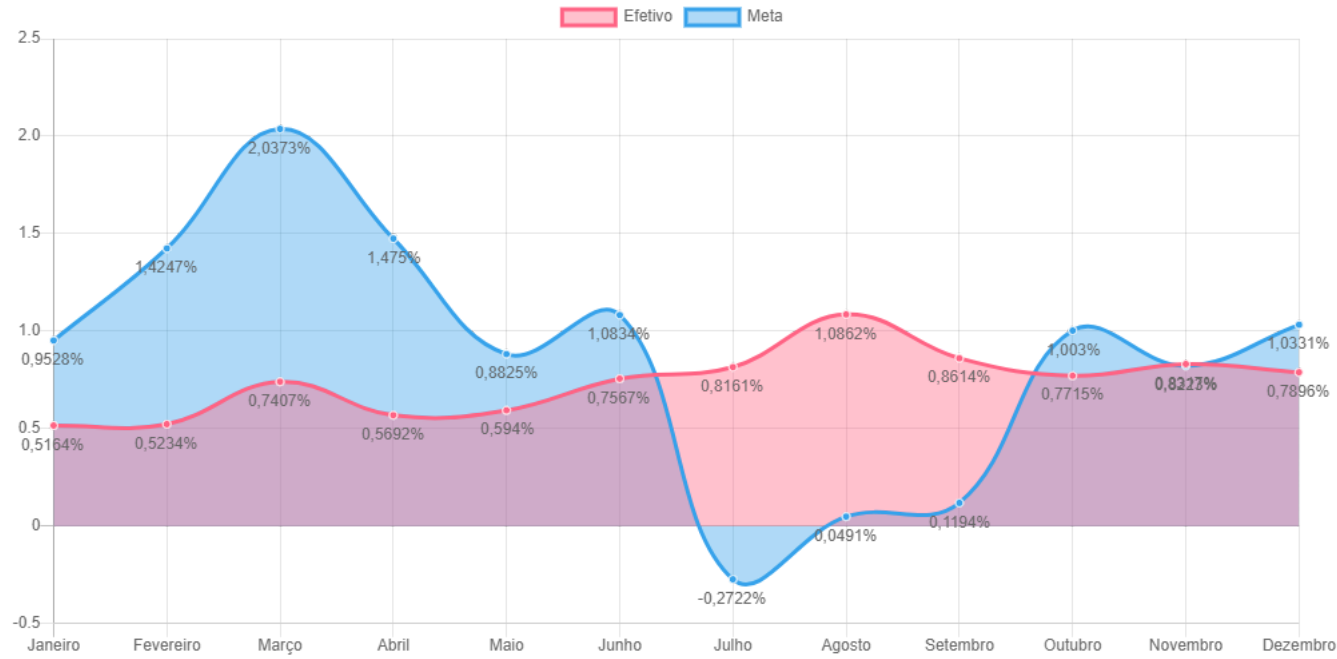
# Retornos acumulados

Mês	Saldo anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Efetivo %	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%
MAIO	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\$ 497.724,25	R\$ 461.741,93	R\$ 2.015.837,80	R\$ 18.967,66	0,7715%	1,0030%	76,9171%
NOVEMBRO	R\$ 2.015.837,80	R\$ 84.648,63	R\$ 194.461,98	R\$ 1.923.494,18	R\$ 17.469,73	0,8317%	0,8223%	101,1430%
DEZEMBRO	R\$ 1.923.494,18	R\$ 1.121.555,55	R\$ 847.795,87	R\$ 2.221.297,28	R\$ 24.043,42	0,7896%	1,0331%	76,4292%

	Total aplicações	Total Resgates	Total retorno R\$	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
Total	R\$ 5.536.407,48	R\$ 4.988.803,35	R\$ 195.647,50	9,2238%	11,1164%	82,9752%

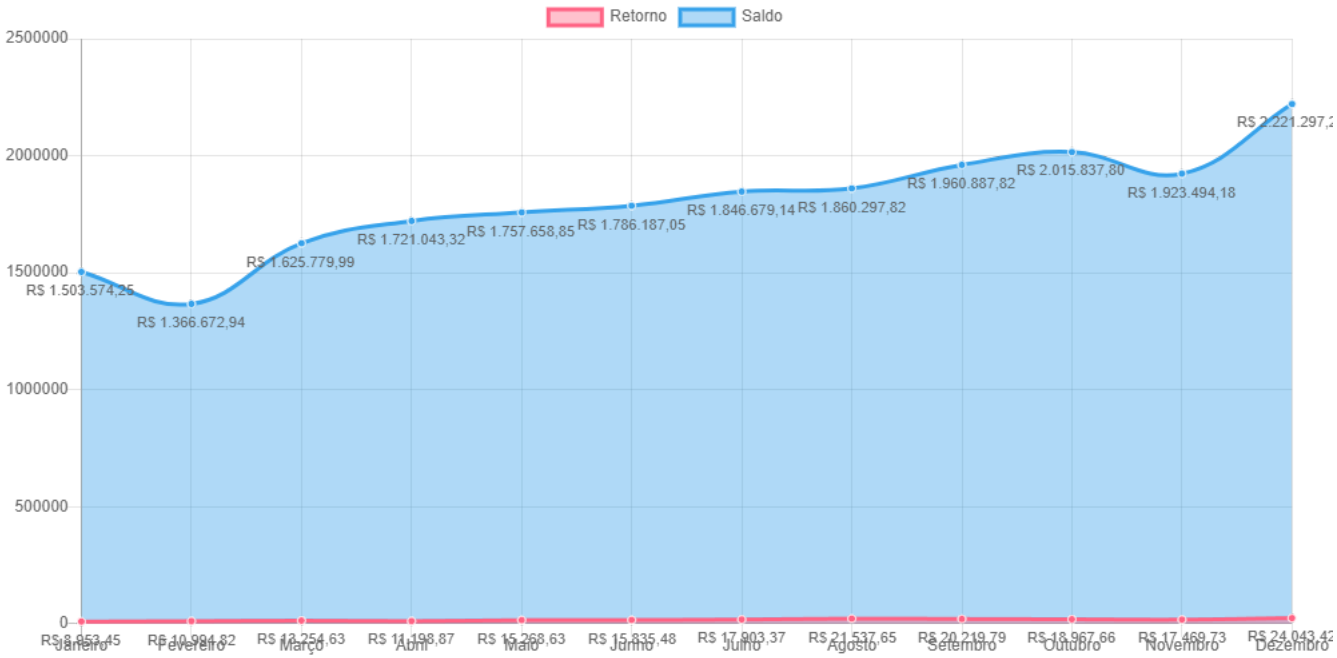


## Gráfico - retorno acumulado no ano



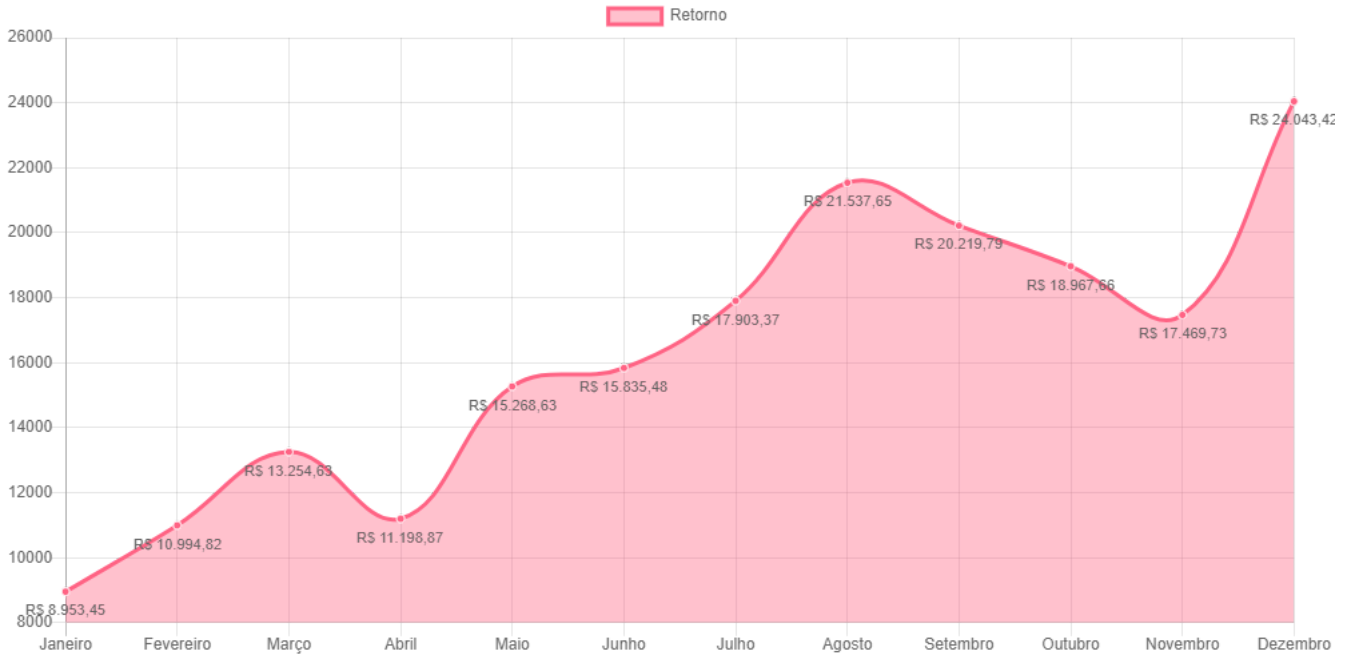
	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maiο	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
Efetivo	0,516%	0,523%	0,741%	0,569%	0,594%	0,757%	0,816%	1,086%	0,861%	0,771%	0,832%	0,790%
Meta	0,953%	1,425%	2,037%	1,475%	0,883%	1,083%	-0,272%	0,049%	0,119%	1,003%	0,822%	1,033%

# Grafico - Evolução do patrimônio



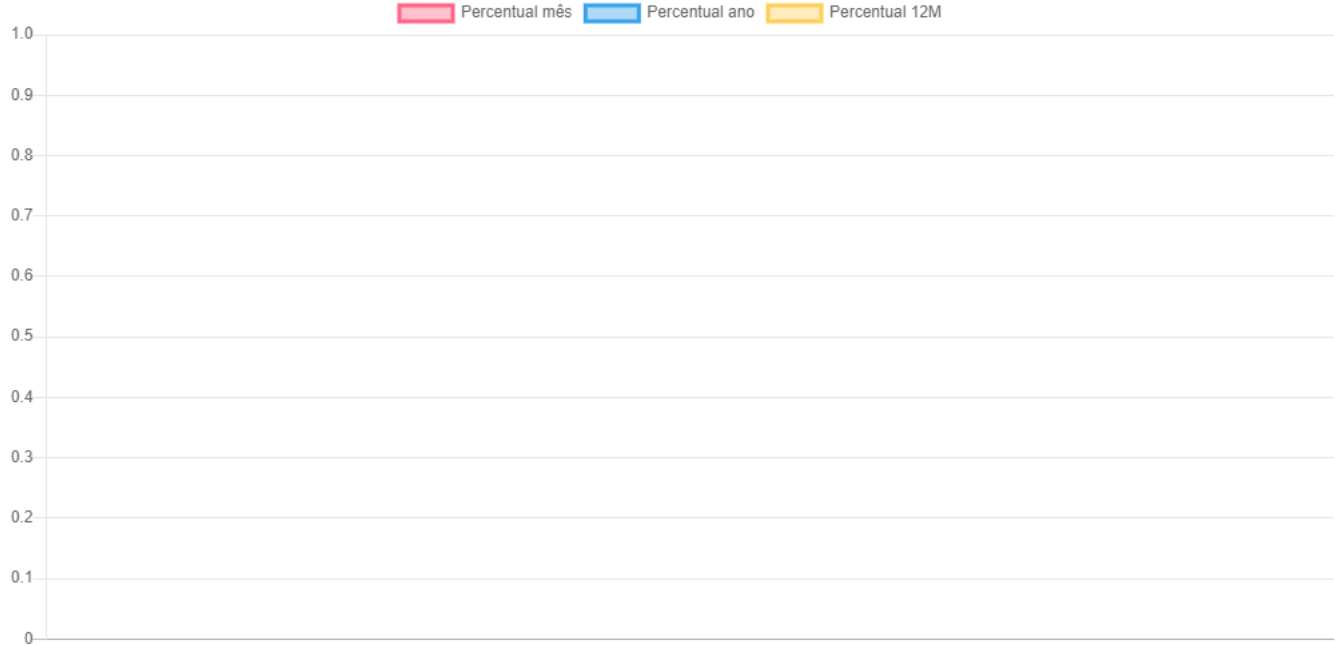
Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
R\$ 1.503.574,25	R\$ 1.366.672,94	R\$ 1.625.779,99	R\$ 1.721.043,32	R\$ 1.757.658,85	R\$ 1.786.187,05	R\$ 1.846.679,14	R\$ 1.860.297,82	R\$ 1.960.887,82	R\$ 2.015.837,80	R\$ 1.923.494,18	R\$ 2.221.297,28
R\$ 8.953,45	R\$ 10.994,82	R\$ 13.254,63	R\$ 11.198,87	R\$ 15.268,63	R\$ 15.835,48	R\$ 17.903,37	R\$ 21.537,65	R\$ 20.219,79	R\$ 18.967,66	R\$ 17.469,73	R\$ 24.043,42

# Grafico - Retorno mensal



# Gráfico - Índices econômicos

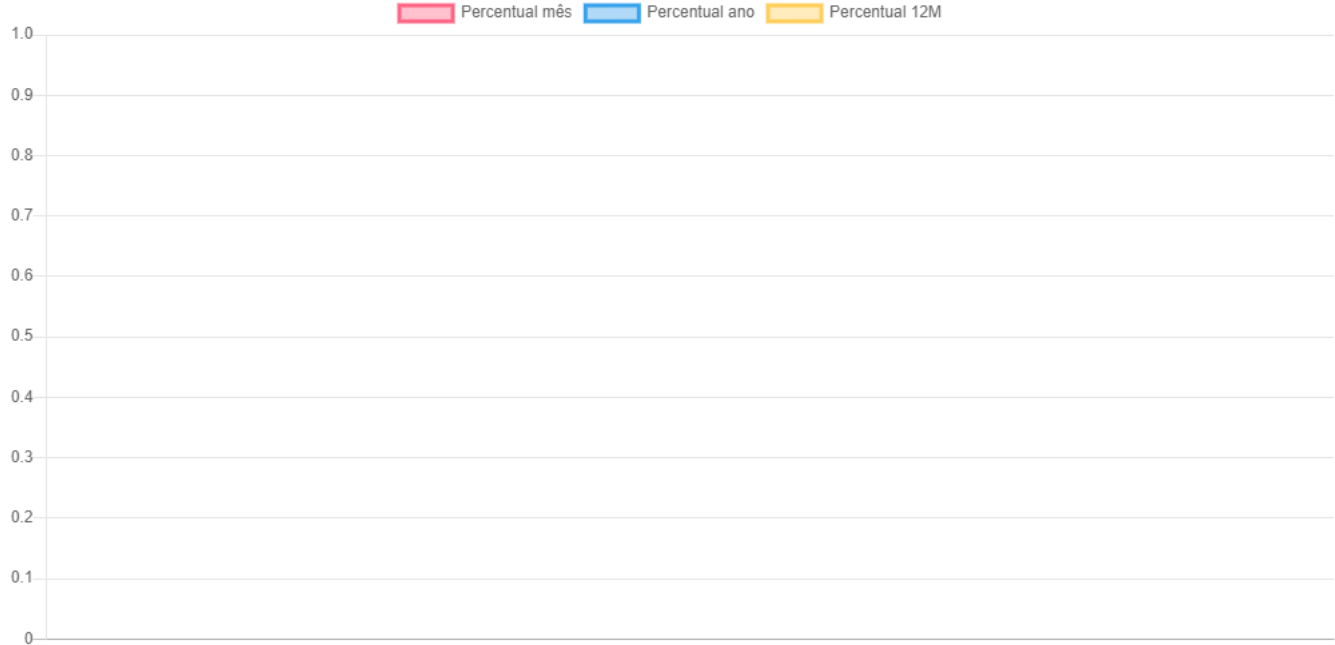
## SELIC



	Mês
Percentual mês	
Percentual ano	
Percentual 12M	

# Gráfico - Índices econômicos

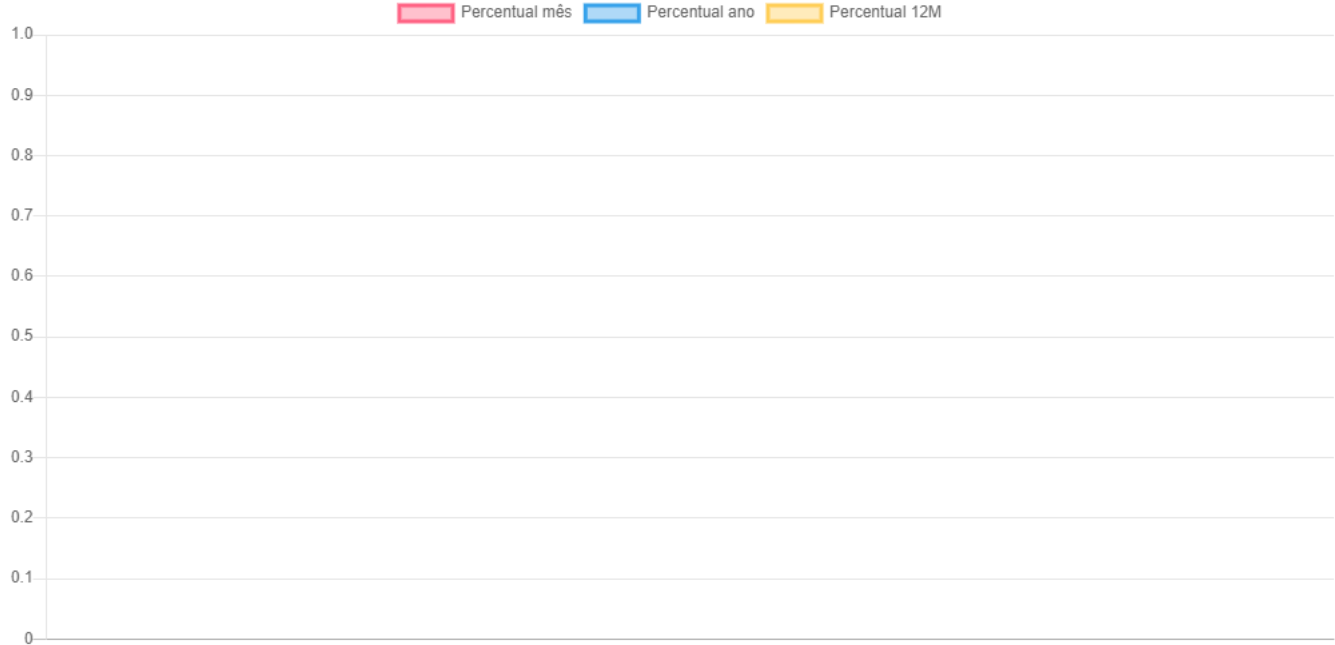
## IPCA



	Mês
Percentual mês	
Percentual ano	
Percentual 12M	

# Gráfico - Índices econômicos

## INPC



	Mês
Percentual mês	
Percentual ano	
Percentual 12M	

## 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 emissores 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 FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	25,224181%	0,000178%	8,501233%	22,487910%	53,698141%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	25,076205%	0,000301%	8,992958%	23,922146%	56,160725%
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	25,510317%	0,000122%	7,269433%	19,110488%	45,652954%
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI	CDI	25,262030%	0,000176%	7,819472%	20,545005%	48,593117%

	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 3M	VOL 6M	VOL 12M
Geral		25,268184%	0,000194%			

## Provisão de risco - Mercado

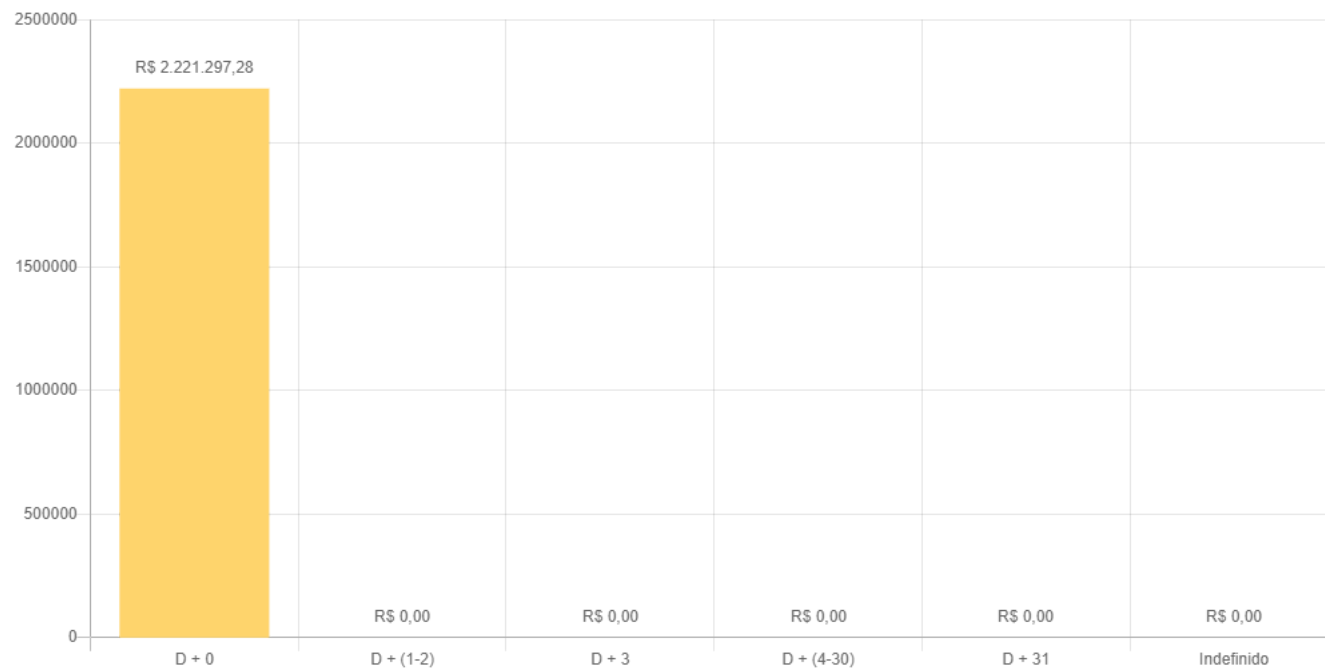
Nome	CNPJ Fundo	Benchmark	Saldo	VAR 12M	VOL 12M	VAR% BASE 1 DIA CONFIANÇA 95% 252 DU* (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	R\$ 26.929,84	0,178292%	53,698141%	R\$ 0,05
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M 1	R\$ 2.194.367,44	0,300824%	56,160725%	R\$ 6,60
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	42.592.315/0001-15	CDI	R\$ 0,00	0,121982%	45,652954%	R\$ 0,00
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO AUTOMÁTICO SETOR PUBLICO FIC FI	04.288.966/0001-27	CDI	R\$ 0,00	0,175728%	48,593117%	R\$ 0,00

Risco de mercado	
Saldo Total	R\$ 2.221.297,28
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 6,65
% Provisão de perda	0,0003%
% Aceitavel perda	2,0%
Limite de utilização	<b>0,015%</b>

## Risco de liquidez

Fundo	Saldo	Participação	Num. Cotistas	% sobre o PL	Patrimonio	Resolução	Grau Risco	Tipo	Prazo Resgate
Total	<b>R\$ 0,00</b>								

Prazo Resgate	Quantidade Fundos	% carteira	Saldo
D + 0	4	100,0000%	R\$ 2.221.297,28



## Risco crédito

Risco crédito	% carteira	Saldo
Aceitavel carteira Titulos Privados	30,00%	
Limite de Utilização	<b>2,02%</b>	