



**FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE  
SÃO SEBASTIÃO DA BOA VISTA - FUNPREVSSBV  
CNPJ 09.177.715/0001-99**

## 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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	25,649625%	0,003073%	2,076423%	10,449277%	28,814011%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF- M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	26,879888%	0,000088%	1,436430%	3,624400%	7,434350%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASILRF- M1 TÍTULOS PÚBLICOSRENDA FIXA	IRF-M 1	27,861347%	0,000082%	1,492788%	3,818767%	7,913330%

	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 3M	VOL 6M	VOL 12M
Geral		26,796953%	0,001081%			



**FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE  
SÃO SEBASTIÃO DA BOA VISTA - FUNPREVSSBV  
CNPJ 09.177.715/0001-99**

**Provisão de risco - Mercado**

Nome	CNPJ Fundo	Benchmark	Saldo	VAR 12M	VOL 12M	VAR% BASE 1 DIA CONFIANÇA 95% 252DU* (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.205/0001-35	IDKA 2	R\$ 401,09	0,003073%	28,814011%	R\$ 0,01
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF- M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M 1	R\$ 204,02	0,000088%	7,434350%	R\$ 0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M 1	R\$ 0,00	0,000082%	7,913330%	R\$ 0,00

Risco de mercado	
Saldo Total	R\$ 605,11
Risco de mercado	
Provisão para perda e investimentos:	R\$ 0,01
% Provisão de perda	0,0021%
% Aceitável perda	2,0%
Limite de utilização	0,1033%



**FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE  
SÃO SEBASTIÃO DA BOA VISTA - FUNPREVSSBV  
CNPJ 09.177.715/0001-99**

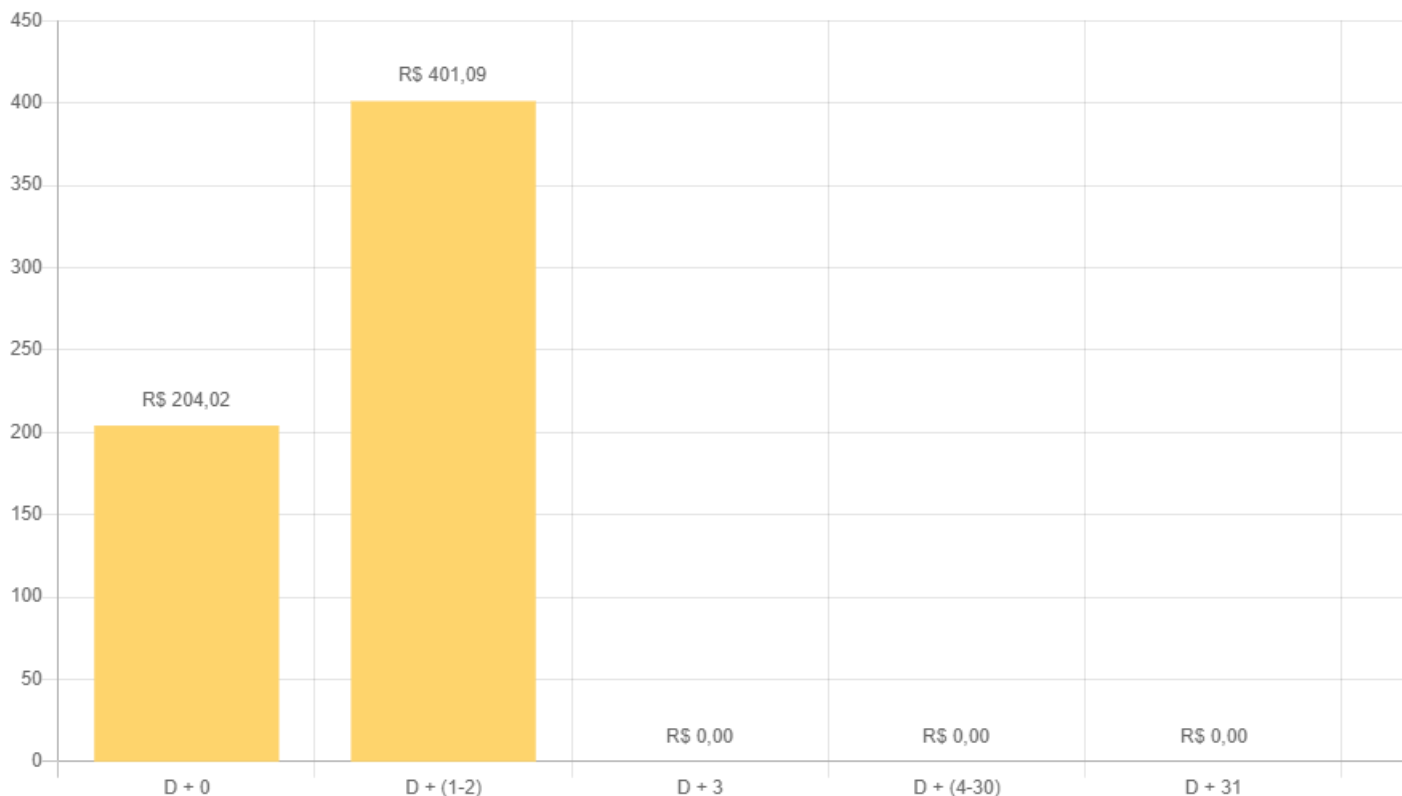
**Risco de liquidez**

Fundo	Saldo	Participação	Num. Cotistas	% sobre o PL	Patrimonio	Resolução	Grau Risco	Tipo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO <b>Banco:</b> BANCO DO BRASIL <b>Agência:</b> 8242-2 <b>Conta:</b> 41246-5	R\$ 401,09	66,28382%	1003	0,00%	R\$ 10.461.788.672,78	Art 7º, I, "b"	Médio	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI <b>Banco:</b> BANCO DO BRASIL <b>Agência:</b> 8242-2 <b>Conta:</b> 41246-5	R\$ 204,02	33,71618%	1163	0,00%	R\$ 6.517.855.686,84	Art 7º, I, "b"	Baixo	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA <b>Banco:</b> CAIXA FEDERAL <b>Agência:</b> 0820 <b>Conta:</b> 006.00000126-8	R\$ 0,00	0,00%	1307	0,00%	R\$ 8.111.343.721,75	Art 7º, I, "b"	Baixo	Fundo de Investimento
<b>Total</b>	<b>R\$ 605,11</b>							



**FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE  
SÃO SEBASTIÃO DA BOA VISTA - FUNPREVSSBV  
CNPJ 09.177.715/0001-99**

Prazo Resgate	Quantidade Fundos	% carteira	Saldo
D + 0	2	33,7162%	R\$ 204,02
D + 1	1	66,2838%	R\$ 401,09



**Risco crédito**

Artigos	Limite	Limite Política	Saldo	% carteira
FI 100% títulos TN - 7º, I, b	100,0000%	100,0000%	R\$ 605,11	100,0000%

Risco crédito	% carteira	Saldo
100% Títulos publicos	100,0000 %	R\$ 605,11



**FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE  
SÃO SEBASTIÃO DA BOA VISTA - FUNPREVSSBV  
CNPJ 09.177.715/0001-99**

50% Títulos públicos e 50% Títulos privados	0,0000%	R\$ 0,00
100% Títulos privados	0,0000%	R\$ 0,00
Aceitavel carteira Titulos Privados	30,00 %	
Limite de Utilização	<b>0,00%</b>	

