



Filtrar

Versão para impressão



# INSTITUTO DE PREVIDENCIA MUNICIPAL DE SÃO SEBASTIÃO DA BOA VISTA

# 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> 001 <b>Agência:</b> 8242-2 <b>Conta:</b> 41246-5	R\$ 533.723,80	21,50582%	922	0,01346%	R\$ 3.964.919.513,24	Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	Baixo	Fundo de Investimento
BÑ 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\$ 173.953,69	7,00927%	965	0,00251%	R\$ 6.918.204.948,36	Res. 4.963/2021 - Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	Médio	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI <b>Banco:</b> 001 <b>Agência:</b> 8242-2 <b>Conta:</b> 41246-5	R\$ 386.368,50	15,5683%	765	0,00695%	R\$ 5.558.874.332,70	Res. 4.963/2021 - Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	Alto	Fundo de Investimento
BÑ 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\$ 895.140,07	36,06869%	1123	0,01381%	R\$ 6.481.837.661,08	Res. 4.963/2021 - Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	Baixo	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI <b>Banco:</b> 001 <b>Agência:</b> 8242-2 <b>Conta:</b> 41246-5	R\$ 492.578,62	19,84792%	1078	0,00355%	R\$ 13.891.144.708,98	Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	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%	1185	0,00%	R\$ 6.896.825.441,61	Res. 4.963/2021 - Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	Baixo	Fundo de Investimento
<b>Total</b>	<b>R\$ 2.481.764,68</b>							

# Enquadramentos

Resolução

% Carteira

Saldo do grupo

Situação

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

58,64113%

R\$ 1.455.462,26

Enquadrado

T "h"

Fundo	Saldo	Saldo Cotas	% PL	P. Líq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.322.205/0001-35	R\$ 173.953,69	51085.738757	0,002514%	R\$ 6.918.204.948,36	7,0086%	Lim. Resol.: 100,00% Lim. Política: 100,00% Lim. CNPJ: 100,00% Lim. PL.: 100,0000%	Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 03.543.447/0001-03	R\$ 386.368,50	15943.84177	0,00695%	R\$ 5.558.874.332,70	15,5669%	Lim. Resol.: 100,00% Lim. Política: 100,00% Lim. CNPJ: 100,00% Lim. PL.: 100,0000%	Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35	R\$ 895.140,07	280730.807806	0,01381%	R\$ 6.481.837.661,08	36,0655%	Lim. Resol.: 100,00% Lim. Política: 100,00% Lim. CNPJ: 100,00% Lim. PL.: 100,0000%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA CNPJ: 10.740.670/0001-06	R\$ 0,00	-0.001498954	0,0000%	R\$ 6.896.825.441,61	0,0000%	Lim. Resol.: 100,00% Lim. Política: 100,00% Lim. CNPJ: 100,00% Lim. PL.: 100,0000%	Enquadrado

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

41,35887%

R\$ 1.026.519,69

Não enquadrado

"a"

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\$ 533.941,07	215719.999244	0,013467%	R\$ 3.964.919.513,24	21,5126%	Lim. Resol.: 60,00% Lim. Política: 60,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	Desenquadrado - limite de CNPJ
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 13.077.418/0001-49	R\$ 492.578,62	178134.901792	0,003546%	R\$ 13.891.144.708,98	19,8461%	Lim. Resol.: 60,00% Lim. Política: 60,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	Enquadrado

## Por benchmark

### Benchmark

**% Carteira** | **Saldo do grupo**

#### CDI

**41,35887%** | **R\$ 1.026.519,69**

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	21,512689%	R\$ 533.941,07
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI <b>CNPJ:</b> 13.077.418/0001-49	19,846181%	R\$ 492.578,62

#### IRF-M 1

**36,065535%** | **R\$ 895.140,07**

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI <b>CNPJ:</b> 11.328.882/0001-35	36,065535%	R\$ 895.140,07
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA <b>CNPJ:</b> 10.740.670/0001-06	0,0000%	R\$ 0,00

#### IMA-B 5

**15,566934%** | **R\$ 386.368,50**

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI <b>CNPJ:</b> 03.543.447/0001-03	15,566934%	R\$ 386.368,50

#### IDKA 2

**7,008661%** | **R\$ 173.953,69**

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO <b>CNPJ:</b> 13.322.205/0001-35	7,008661%	R\$ 173.953,69

# Por administradores

## Administrador

**% Carteira | Saldo do grupo**

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

**100,0000% | R\$ 2.481.981,95**

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	21,512689%	R\$ 533.941,07
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO <b>CNPJ:</b> 13.322.205/0001-35	7,008661%	R\$ 173.953,69
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI <b>CNPJ:</b> 03.543.447/0001-03	15,566934%	R\$ 386.368,50
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI <b>CNPJ:</b> 11.328.882/0001-35	36,065535%	R\$ 895.140,07
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI <b>CNPJ:</b> 13.077.418/0001-49	19,846181%	R\$ 492.578,62

### **00.360.305/0001-04 - CAIXA ECONOMICA FEDERAL**

**0,0000% | R\$ 0,00**

Fundo	% saldo	Saldo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA <b>CNPJ:</b> 10.740.670/0001-06	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\$ 874.078,39	R\$ 156.326,37	R\$ 503.771,15	R\$ 533.941,07	21,5127%	R\$ 7.307,46	0,8508%	0,7092%
13.322.205/0001-35 - BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 171.399,37	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 173.953,69	7,0087%	R\$ 2.554,32	1,4903%	1,4903%
03.543.447/0001-03 - BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 381.038,22	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 386.368,50	15,5669%	R\$ 5.330,28	1,3989%	1,3989%
11.328.882/0001-35 - BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 886.616,78	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 895.140,07	36,0655%	R\$ 8.523,29	0,9613%	0,9613%
13.077.418/0001-49 - BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 488.408,20	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 492.578,62	19,8462%	R\$ 4.170,42	0,8539%	0,8539%
10.740.670/0001-06 - FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,0000%	R\$ 0,00	0,9664%	0,0000%

Tipo	Saldo anterior	Total aplicações	Total resgates	Saldo atual	Total retorno	Total retorno %	Total retorno efetivo
RENDA FIXA	R\$ 2.801.540,96	R\$ 156.326,37	R\$ 503.771,15	R\$ 2.481.981,95	R\$ 27.885,77	1,0214%	0,9428%
Totais	R\$ 2.801.540,96	R\$ 156.326,37	R\$ 503.771,15	R\$ 2.481.981,95	R\$ 27.885,77	1,0214%	0,9428%



# Retornos acumulados

Mês	Saldo anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
JANEIRO	R\$ 2.598.101,27	R\$ 585.157,55	R\$ 411.540,02	R\$ 2.801.540,96	R\$ 29.822,16	0,9368%	0,0000%	0,0000%
FEVEREIRO	R\$ 2.801.540,96	R\$ 156.326,37	R\$ 503.771,15	R\$ 2.481.981,95	R\$ 27.885,77	0,9428%	0,0000%	0,0000%

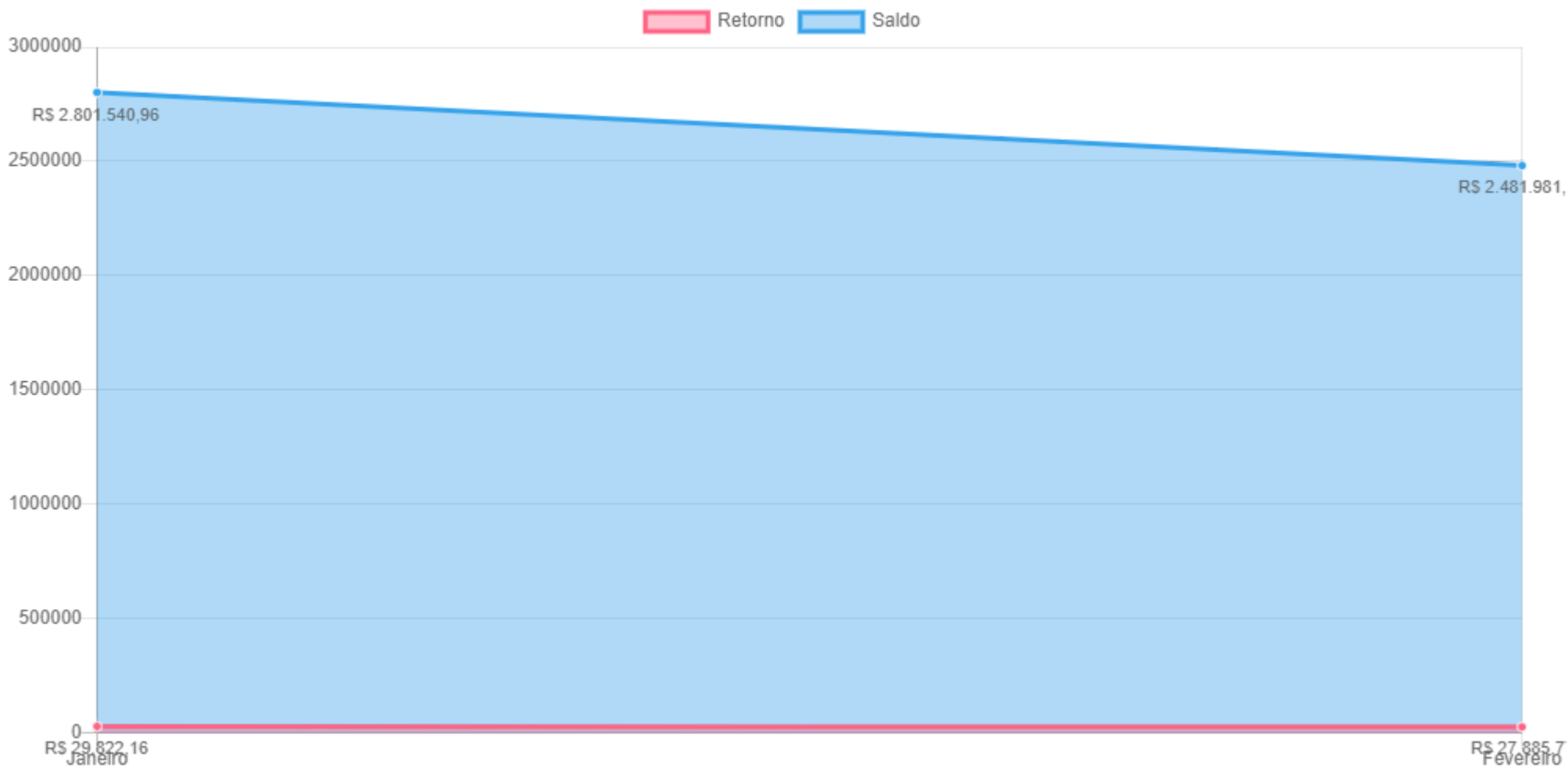
	Total aplicações	Total Resgates	Total retorno R\$	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
Total	R\$ 741.483,92	R\$ 915.311,17	R\$ 57.707,93	1,8884%	0,0000%	∞%

# Gráfico - retorno acumulado no ano



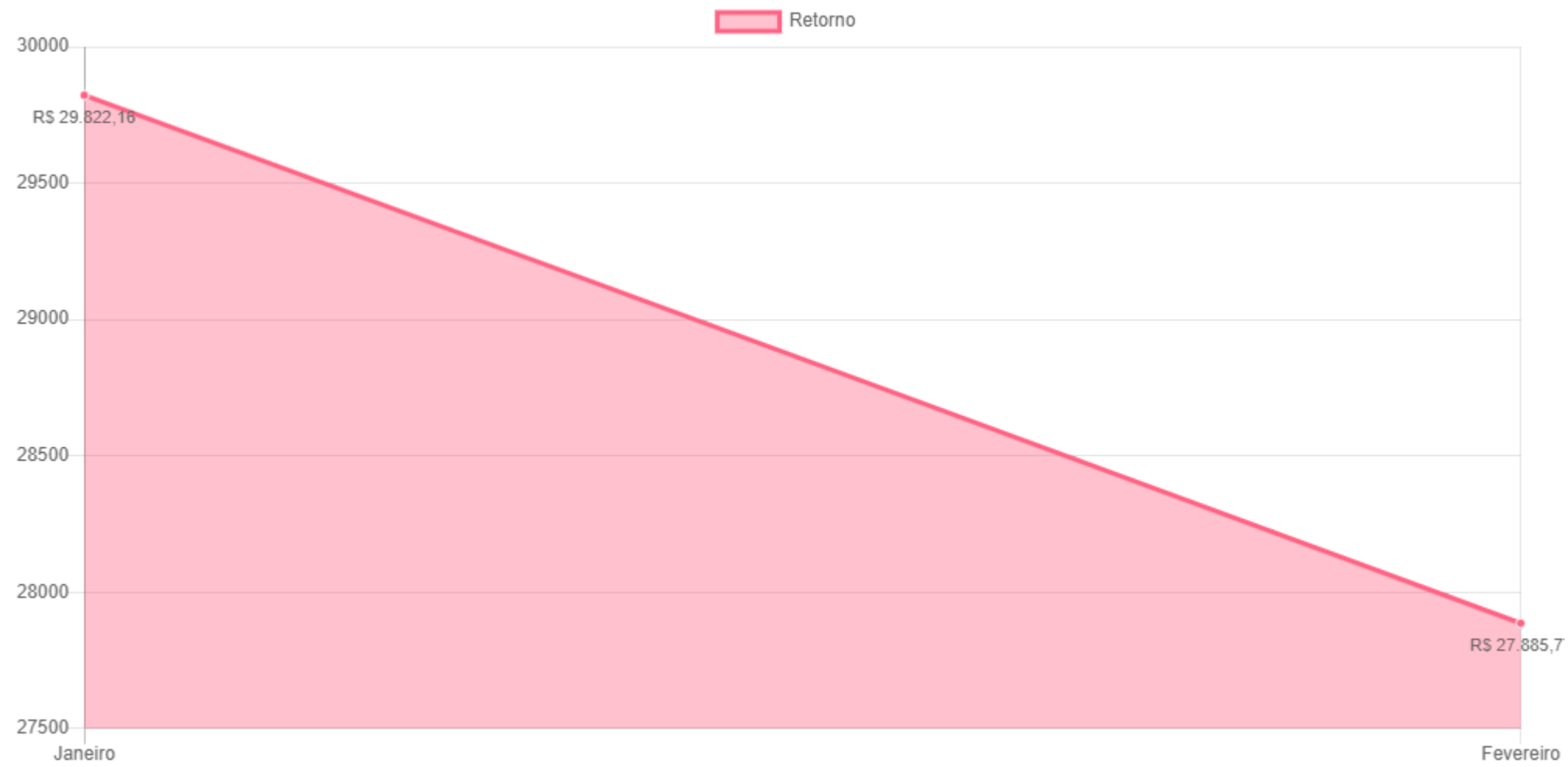
	Janeiro	Fevereiro
Efetivo	0,937%	0,943%
Meta	0,000%	0,000%

# Grafico - Evolução do patrimônio



Janeiro	Fevereiro
R\$ 2.801.540,96	R\$ 2.481.981,95
R\$ 29.822,16	R\$ 27.885,77

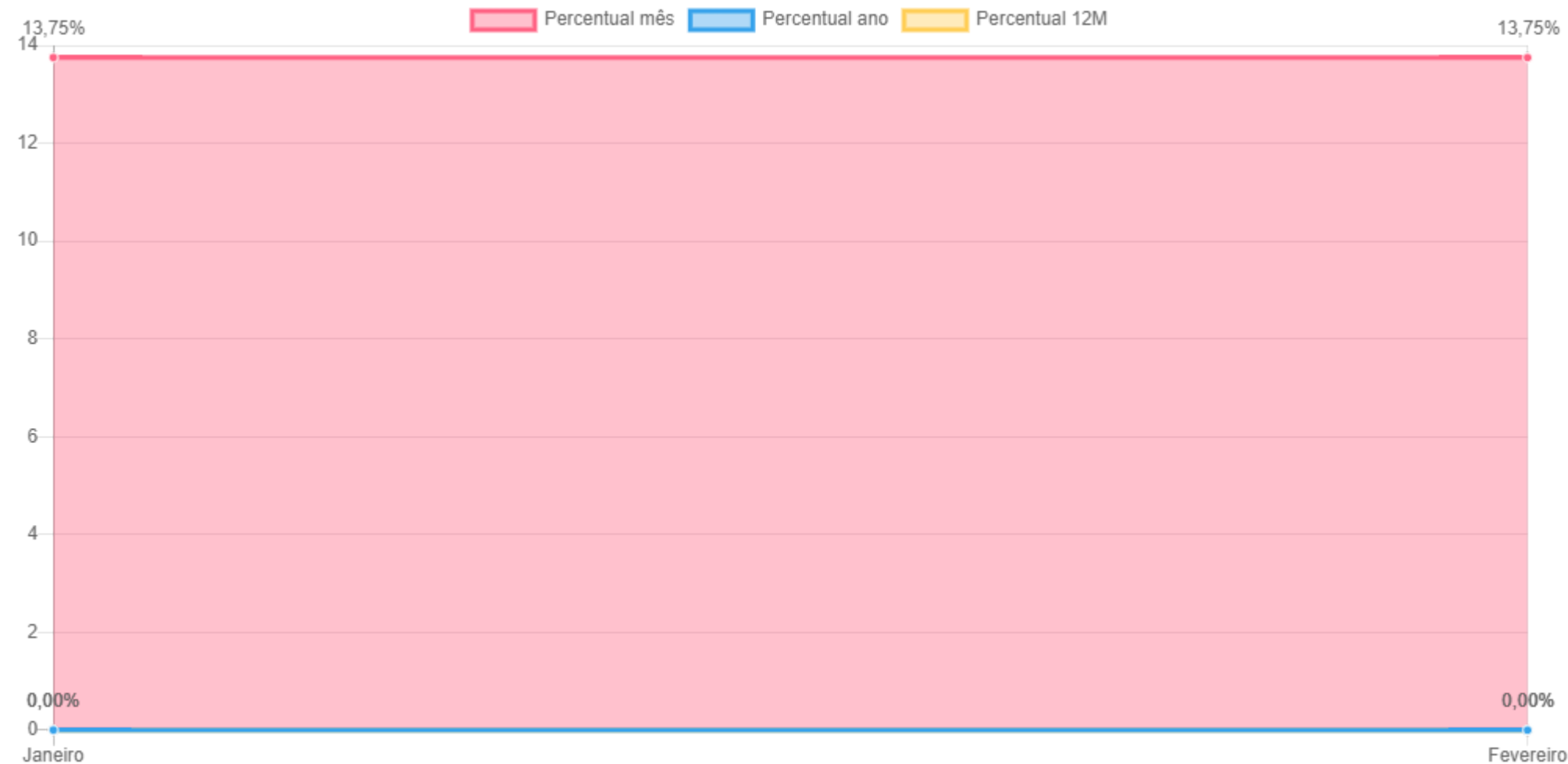
# Grafico - Retorno mensal





# Gráfico - Índices econômicos

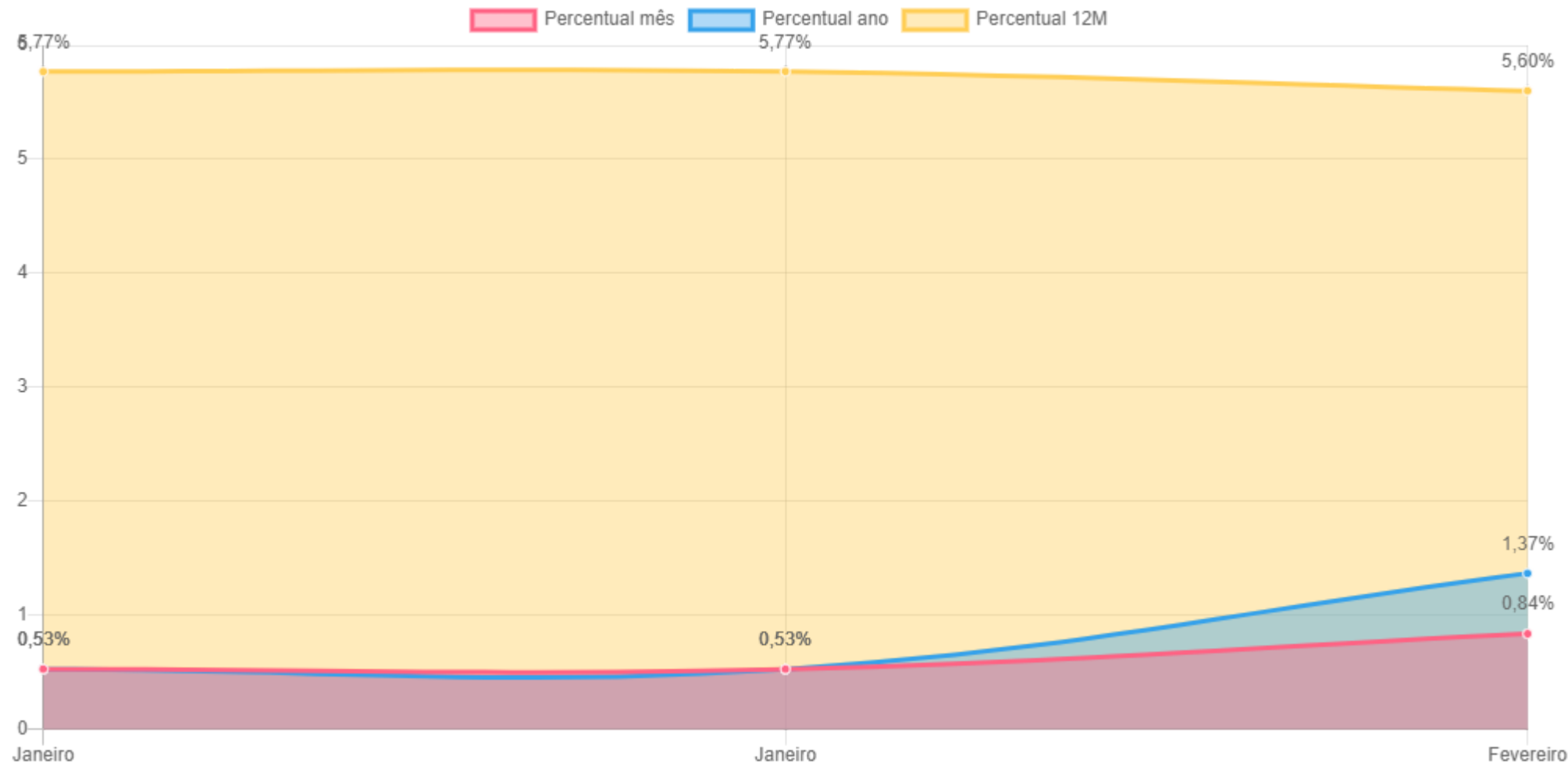
## SELIC



Mês	Janeiro	Fevereiro
Percentual mês	13,75%	13,75%
Percentual ano	0,00%	0,00%
Percentual 12M	0,00%	0,00%

# Gráfico - Índices econômicos

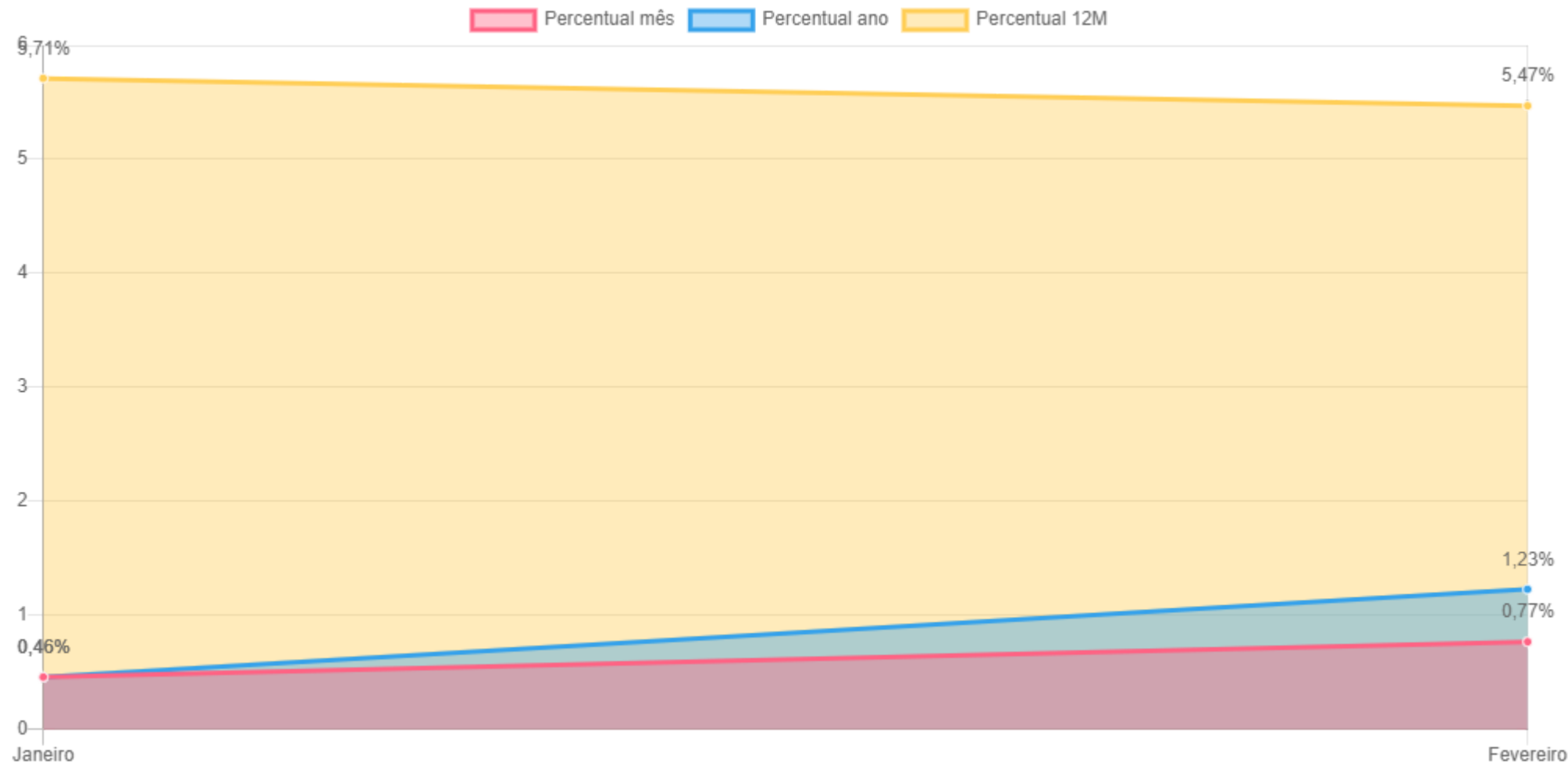
## IPCA



Mês	Janeiro	Janeiro	Fevereiro
Percentual mês	0,53%	0,53%	0,84%
Percentual ano	0,53%	0,53%	1,37%
Percentual 12M	5,77%	5,77%	5,60%

# Gráfico - Índices econômicos

## INPC



Mês	Janeiro	Fevereiro
Percentual mês	0,46%	0,77%
Percentual ano	0,46%	1,23%
Percentual 12M	5,71%	5,47%



# 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 FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	25,409170%	0,000088%	8,393927%	22,489875%	56,556572%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	36,581334%	0,008387%	12,842701%	23,344313%	37,304566%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	IMA-B 5	36,186404%	0,007077%	12,191945%	22,321454%	37,922941%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	25,210819%	0,000171%	9,016643%	23,801056%	59,721379%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	25,277356%	0,000119%	8,903622%	24,460399%	62,083158%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IRF-M 1	25,253628%	0,000172%	9,334563%	24,202642%	60,095982%

	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 3M	VOL 6M	VOL 12M
Geral		28,986452%	0,002669%			

## 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\$ 533.723,80	0,087854%	56,556572%	R\$ 0,47
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.205/0001-35	IDKA 2	R\$ 173.953,69	8,386991%	37,304566%	R\$ 14,59
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	03.543.447/0001-03	IMA-B 5	R\$ 386.368,50	7,077389%	37,922941%	R\$ 27,34
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M 1	R\$ 895.140,07	0,171384%	59,721379%	R\$ 1,53
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	13.077.418/0001-49	CDI	R\$ 492.578,62	0,119124%	62,083158%	R\$ 0,59

FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	IRF-M 1	R\$ 0,00	0,171838%	60,095982%	R\$ 0,00
------------------------------------------------------------------------	--------------------	---------	----------	-----------	------------	----------

Risco de mercado	
Saldo Total	R\$ 2.481.764,68
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 44,52
% Provisão de perda	0,0018%
% Aceitavel perda	2,0%
Limite de utilização	<b>0,0897%</b>



Prazo Resgate	Quantidade Fundos	% carteira	Saldo
D + 0	4	77,4224%	R\$ 1.921.442,49
D + 1	2	22,5776%	R\$ 560.322,19

