



FUNPREV
Fundo de Previdência Social do Município de
São Sebastião da Boa Vista

**INSTITUTO DE PREVIDENCIA MUNICIPAL DE SÃO SEBASTIÃO DA
BOA VISTA**
Janeiro 2024

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	34,85%	1,003	0.03	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 1.387.801,11	B	Fundo de Investimento	1,00%
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	1	4,78%	883	0.00	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 190.127,54	M	Fundo de Investimento	0,20%
03.543.447/0001-03	BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO F	1	10,64%	795	0.01	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 423.500,92	A	Fundo de Investimento	0,20%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	0	35,85%	1,148	0.02	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 1.427.242,97	B	Fundo de Investimento	0,20%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONC	0	13,89%	1,135	0.00	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 552.990,04	B	Fundo de Investimento	0,20%
10.740.670/0001-06	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	0	0,00%	1,191	0.00	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 0,00	B	Fundo de Investimento	0,20%

R\$ 3.981.662,58

Retorno do mês

Nome Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI	R\$ 1.070.980,19	R\$ 889.197,03	R\$ 581.779,60	R\$ 1.387.801,11	R\$ 9.403,49	0,4797%	CDI
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 188.783,72	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 190.127,54	R\$ 1.343,82	0,7118%	IDKA 2
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZ	R\$ 420.723,24	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 423.500,92	R\$ 2.777,68	0,6602%	IMA-B 5
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F	R\$ 1.415.008,83	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 1.427.242,97	R\$ 12.234,14	0,8645%	IRF-M 1
BB PREV RF REFERENCIADO DI LI	R\$ 547.695,27	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 552.990,04	R\$ 5.294,77	0,9667%	CDI
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB	R\$ -0,01	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0,01	0,0000%	IRF-M 1
Total	3,643,191.24	889,197.03	581,779.60	3,981,662.58	31,053.91	0,6852%	

Enquadramentos

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

% Carteira: : **51,26%**

Saldo do grupo: **R\$ 2.040.871,43**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 190.127,54	51,085.74	0,00326%	5,834,557,206.92	4,78%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 423.500,92	15,943.84	0,00800%	5,294,436,148.21	10,64%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,01%	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 1.427.242,97	401,097.53	0,01793%	7,961,364,534.06	35,85%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,02%	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R\$ 0,00	0.00	0,00000%	8,572,761,910.40	0,00%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado

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

% Carteira: : **48,74%**

Saldo do grupo: **R\$ 1.940.791,15**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.387.801,11	505,962.44	0,03306%	4,198,417,498.27	34,85%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,03%	Desenquadrado - limite c
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 552.990,04	178,798.85	0,00337%	16,400,080,186.89	13,89%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado

Enquadramento por Benchmark

CDI

% Carteira: **48,74%**

Saldo do grupo: **R\$ 1.940.791,15**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.387.801,11	505,962.44	0.03	34.85	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Desenquadrado - limite c
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 552.990,04	178,798.85	0.00	13.89	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IDKA 2

% Carteira: **4,78%**

Saldo do grupo: **R\$ 190.127,54**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 190.127,54	51,085.74	0.00	4.78	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

IMA-B 5

% Carteira: **10,64%**

Saldo do grupo: **R\$ 423.500,92**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 423.500,92	15,943.84	0.01	10.64	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

IRF-M 1

% Carteira: **35,85%**

Saldo do grupo: **R\$ 1.427.242,97**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R\$ 0,00	0.00	0.00	0.00	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado



FUNPREV
Fundo de Previdência Social do Município de
São Sebastião da Boa Vista

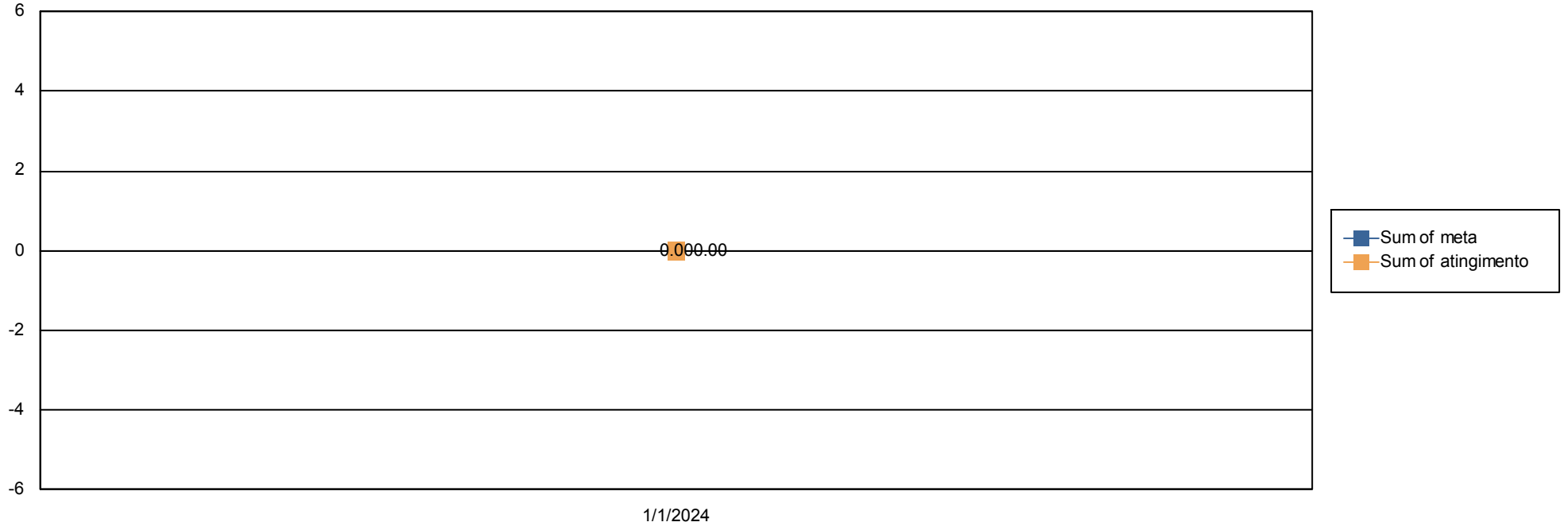
Cliente: INSTITUTO DE PREVIDENCIA MUNICIPAL DE SÃO SEBASTIÃO DA BOA VISTA
CNPJ: 09.177.715/0001-99

BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 1.427.242,97	401,097.53	0.02	35.85	Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado
-----------------------------------	------------------	------------	------	-------	--	------------

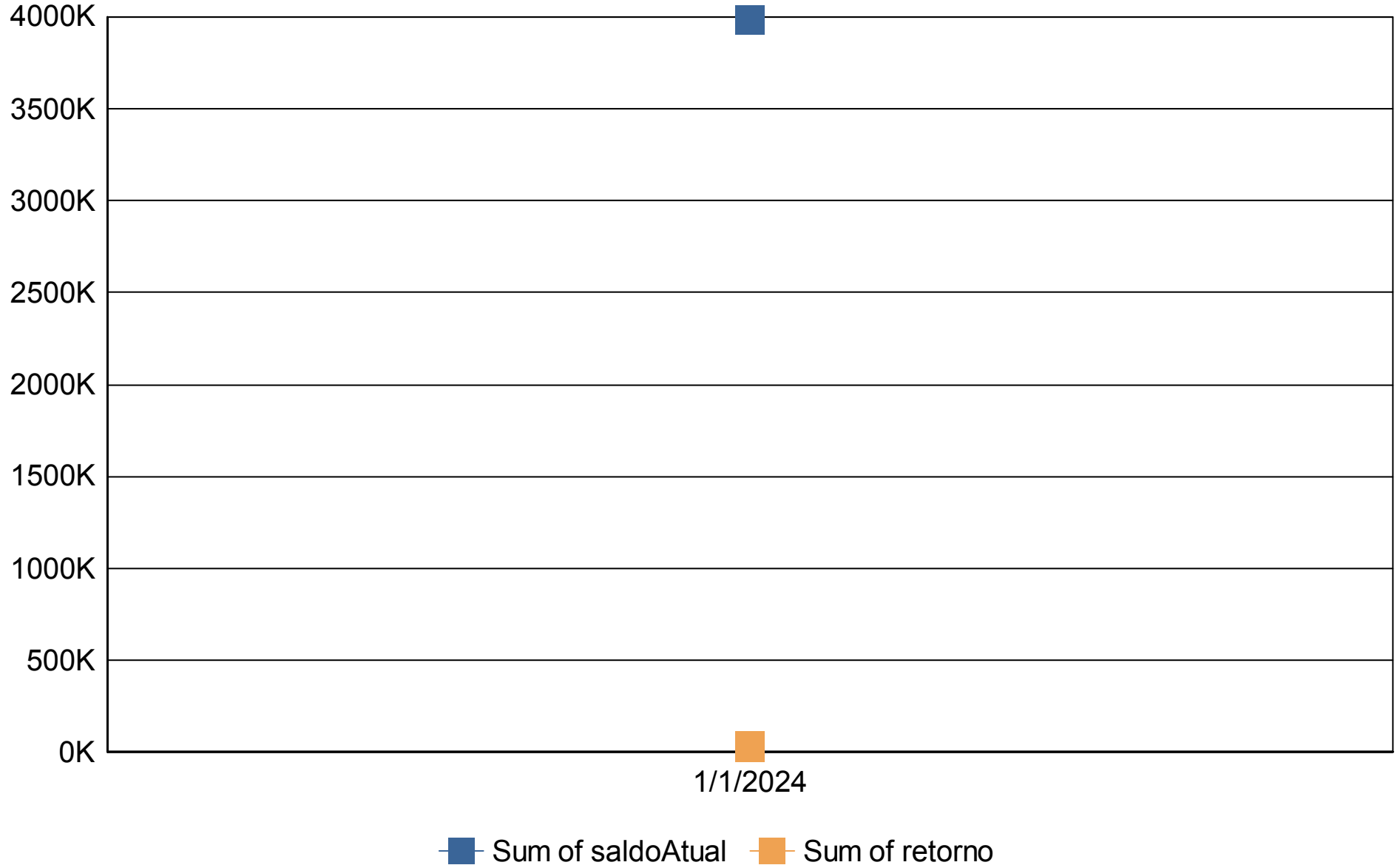
Retorno acumulado no ano

Período	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Retorno %	Meta	Atingimento
Janeiro	R\$ 3.643.191,24	R\$ 889.197,03	R\$ 581.779,60	R\$ 3.981.662,58	R\$ 31.053,91	0,6852%	0,0000	0,0000%
Total		889,197.03	581,779.60		31,053.91	0,6852%	0,0000%	0,0000%

Meta x Atingimento



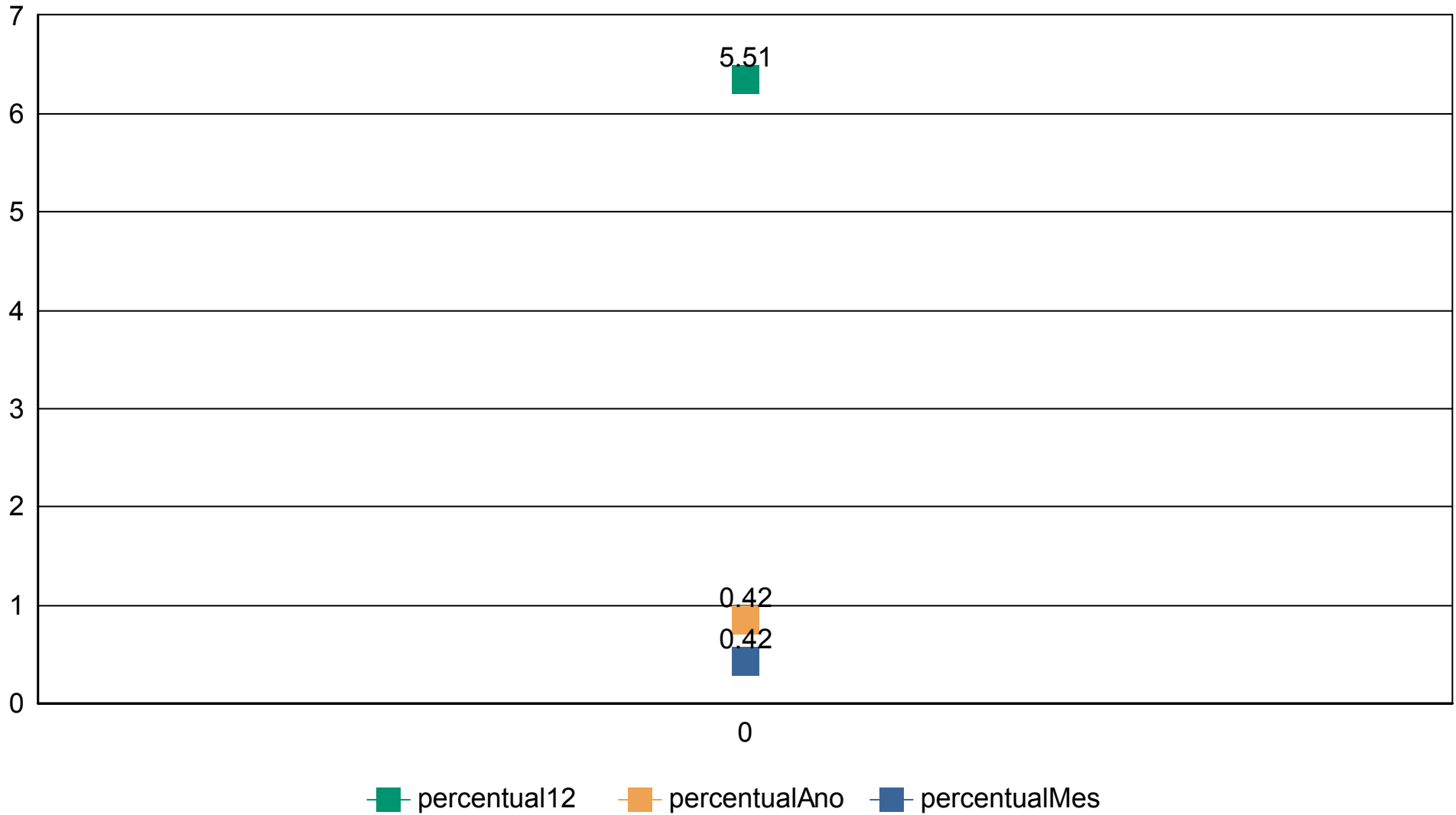
Evolução do patrimônio



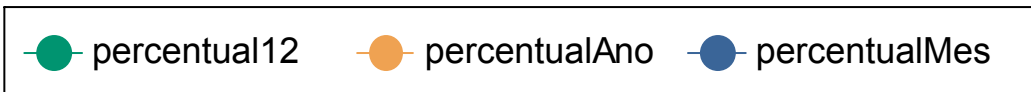
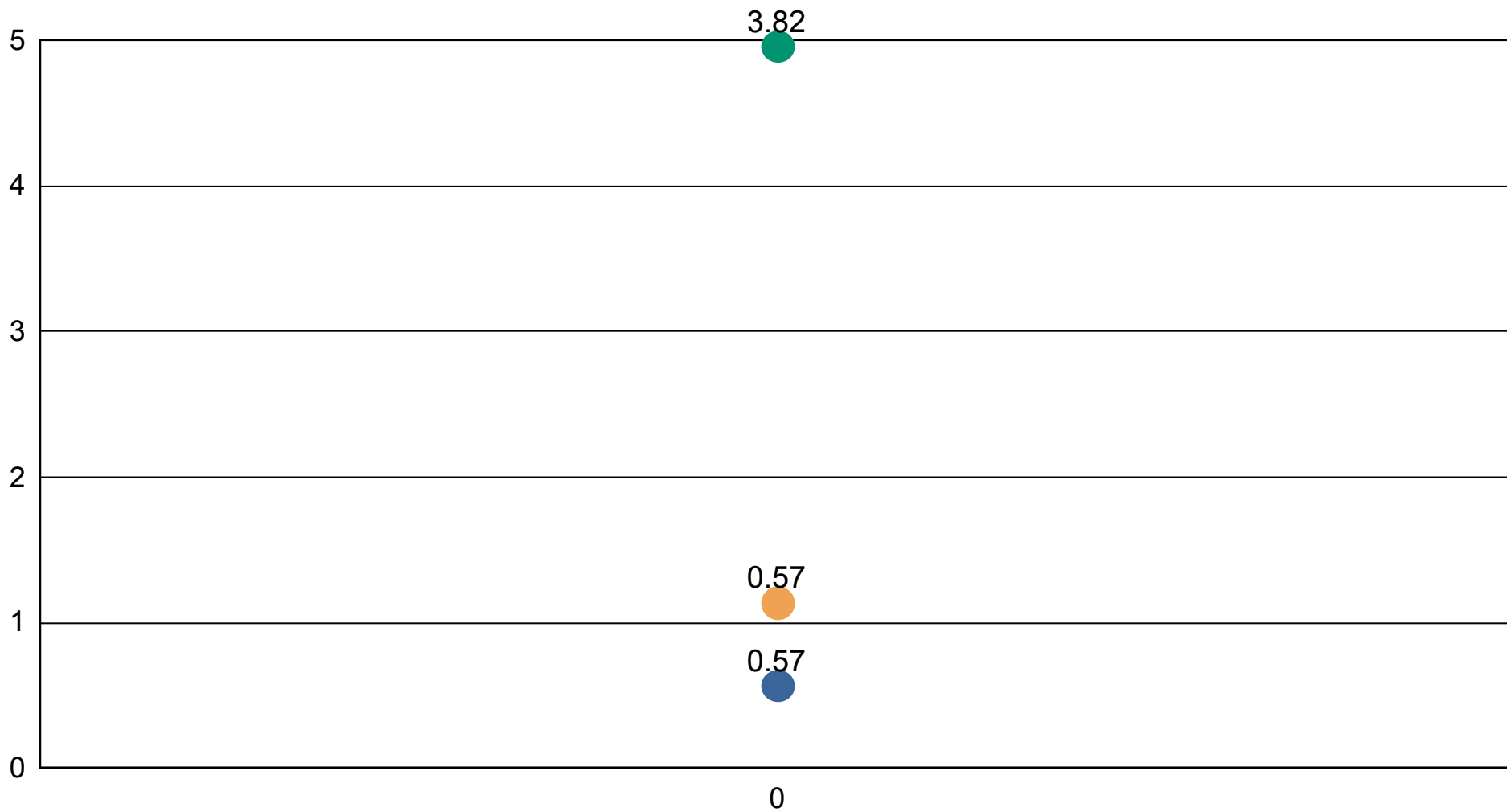
Retorno Mensal



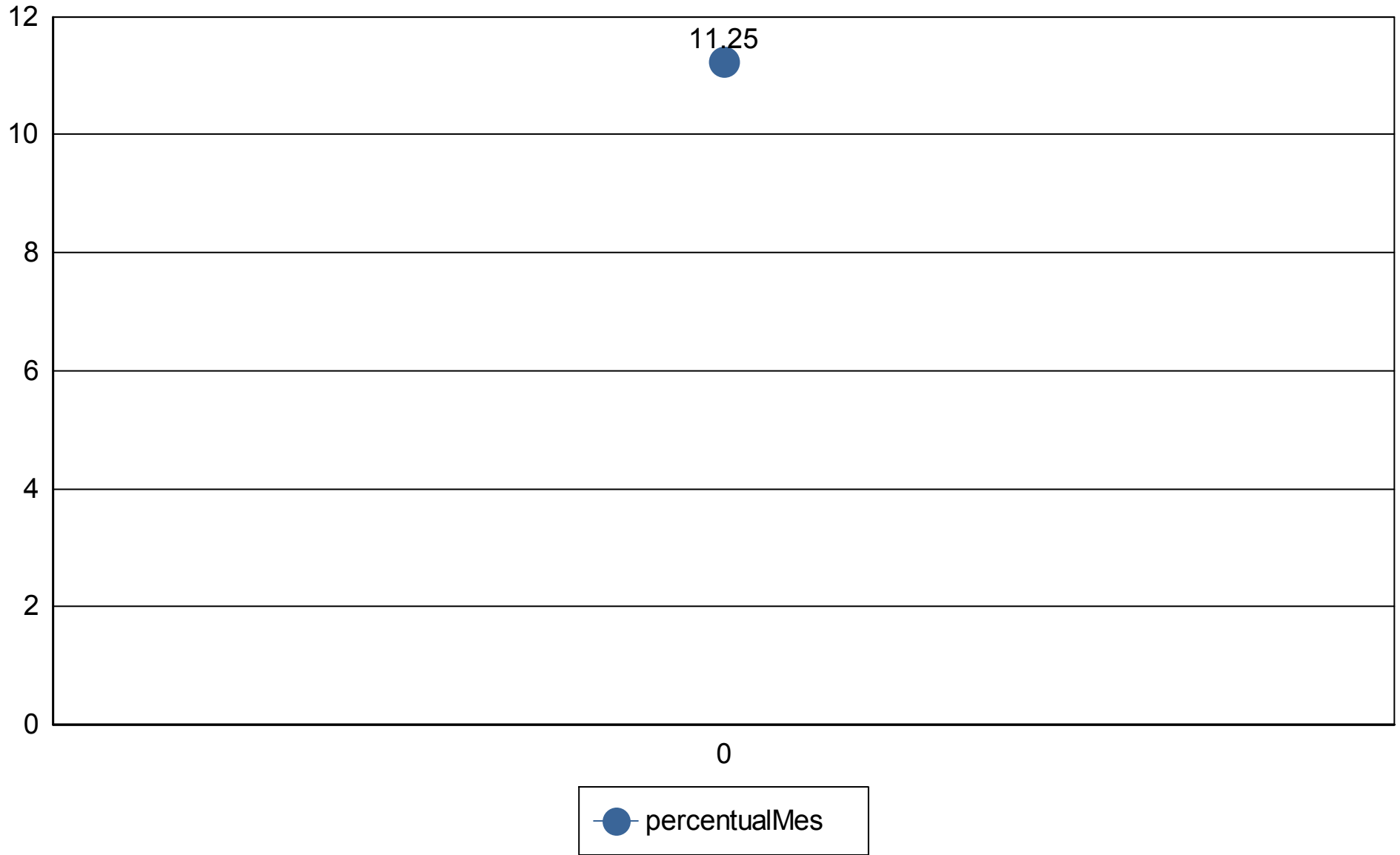
Índices Econômicos - IPCA



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 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.

CNPJ	Nome fundo	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL3	VOL6	VOL12
10.740.670/0001-06	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	IRF-M 1	25,85%	0,00%	7,81%	21,29%	58,74%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	IRF-M 1	25,80%	0,00%	7,60%	20,99%	58,33%
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	IDKA 2	30,16%	0,00%	9,22%	20,39%	43,36%
03.543.447/0001-03	BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	IMA-B 5	30,16%	0,00%	9,19%	20,26%	44,17%
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	CDI	25,87%	0,00%	7,33%	19,63%	54,21%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI	CDI	25,59%	0,00%	8,12%	21,65%	59,40%
			163,43%	0,01%	49,27%	124,22%	318,22%

Provisão de risco - Mercado

CNPJ	Nome do fundo	Benchmark	Saldo	VAR12	VOL12	VAR% BASE 1
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO C	CDI	R\$ 1.387.801,11	0,00%	54,21%	R\$ 1,15
13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICO	IDKA 2	R\$ 190.127,54	0,00%	43,36%	R\$ 6,33
03.543.447/0001-03	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FL	IMA-B 5	R\$ 423.500,92	0,00%	44,17%	R\$ 14,32
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO	IRF-M 1	R\$ 1.427.242,97	0,00%	58,33%	R\$ 2,07
10.740.670/0001-06	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS F	IRF-M 1	R\$ 0,00	0,00%	58,74%	R\$ 0,00

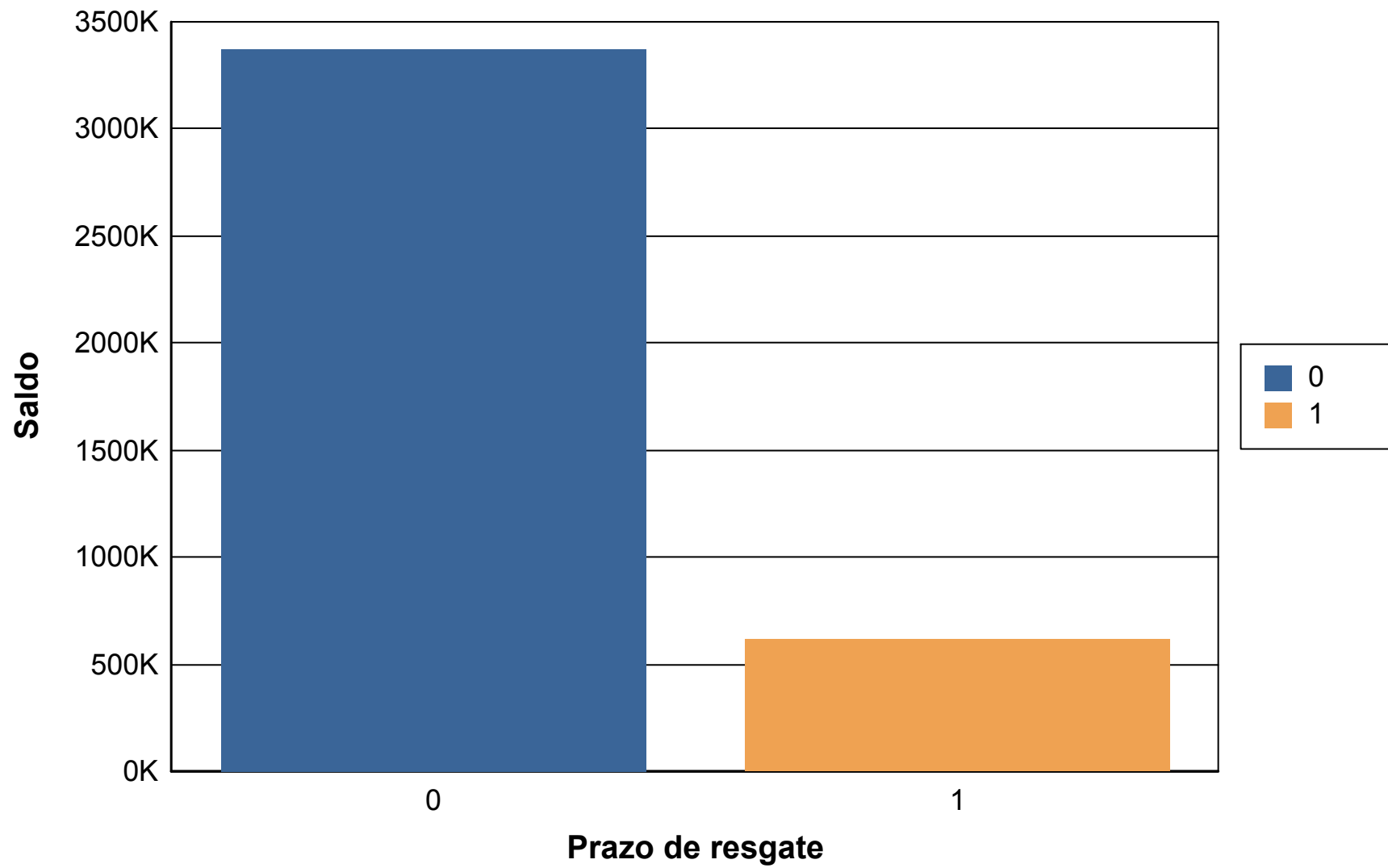
Saldo Total:	R\$ 3.428.672,54
Provisão para perda e Investimentos	R\$ 23,86
% Provisão de perda	0,00%
% Aceitavel perda	2%
Limite de utilização	0,03%



Cliente: INSTITUTO DE PREVIDENCIA MUNICIPAL DE SÃO SEBASTIÃO DA BOA VISTA
 CNPJ: 09.177.715/0001-99

Nome do Fundo	Saldo	% Part.	N. Cotistas	% PL	PL do Fundo	Legislação	Grau risco	Prazo Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE	R\$ 1.387.801,11	34,85%	1,003	0,03%	R\$ 4.314.329.493,08	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULO	R\$ 190.127,54	4,78%	883	0,00%	R\$ 5.832.791.775,38	ixa 100% TP/E	Médio	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO	R\$ 423.500,92	10,64%	795	0,01%	R\$ 5.292.071.734,95	ixa 100% TP/E	Alto	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULC	R\$ 1.427.242,97	35,85%	1,148	0,02%	R\$ 7.998.645.992,80	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIAD	R\$ 552.990,04	13,89%	1,135	0,00%	R\$ 16.682.311.912,63	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1	R\$ 0,00	0,00%	1,191	0,00%	R\$ 8.584.659.558,78	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
0	R\$ 3.368.034,12	4	84,59%
1	R\$ 613.628,46	2	15,41%



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\$ 2.040.871,43	51,26
Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	60,00%	60,00%	R\$ 1.940.791,15	48,74

	Saldo	% Carteira
100% títulos públicos	0.00	0.00
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	0.00	0.00
100% títulos privados	3,981,662.58	100.00

Distribuição dos saldos

