



INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DE PORTEL - PA

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 Banco: BANCO DO BRASIL Agência: 2486-4 Conta: 16622-7	R\$ 6.861,93	0,10611%	810	0,00027%	R\$ 2.523.785.410,34	FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a	Baixo	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO Banco: BANCO DO BRASIL Agência: 2486-4 Conta: 16623-5	R\$ 983,57	0,01521%	810	0,00004%	R\$ 2.523.785.410,34	FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a	Baixo	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO Banco: 001 Agência: 2486-4 Conta: 9683-0	R\$ 2.491.454,93	38,52538%	1026	0,02692%	R\$ 9.253.803.912,06	FI 100% títulos TN – 7º, I, b	Médio	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI Banco: 001 Agência: 2486-4 Conta: 9683-0	R\$ 2.484.706,48	38,42103%	778	0,04086%	R\$ 6.081.334.244,20	FI 100% títulos TN – 7º, I, b	Alto	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO Banco: BANCO DO BRASIL Agência: 2486-4 Conta: 16623-5	R\$ 12.648,91	0,19559%	562	0,00026%	R\$ 4.936.979.120,19	FI 100% títulos TN – 7º, I, b	Médio	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Banco: BANCO DO BRASIL Agência: 2486-4 Conta: 9683-0	R\$ 1.470.392,28	22,73668%	1136	0,02144%	R\$ 6.857.913.148,95	FI 100% títulos TN – 7º, I, b	Baixo	Fundo de Investimento
Total	R\$ 6.467.048,10							

Enquadramentos

Resolução

% Carteira | Saldo do grupo |

Situação

(RPPS) - FI 100% títulos TN – 7º, I, b

99,878685% | R\$ 6.459.202,60 |

Não enquadrado

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\$ 2.491.454,93	849417.9244	0,026924%	R\$ 9.253.803.912,06	38,5253%	Lim. Resol.: 100,00% Lim. Política: 100,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	Desenquadrado - limite de CNPJ
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 03.543.447/0001-03	R\$ 2.484.706,48	119181.0145	0,040858%	R\$ 6.081.334.244,20	38,4210%	Lim. Resol.: 100,00% Lim. Política: 100,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	Desenquadrado - limite de CNPJ
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 07.111.384/0001-69	R\$ 12.648,91	2183.6232	0,000256%	R\$ 4.936.979.120,19	0,1955%	Lim. Resol.: 100,00% Lim. Política: 100,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35	R\$ 1.470.392,28	534220.016	0,021441%	R\$ 6.857.913.148,95	22,7366%	Lim. Resol.: 100,00% Lim. Política: 100,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	Desenquadrado - limite de CNPJ

(RPPS) - FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a

0,121315% | R\$ 7.845,50 |

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\$ 6.861,93	3179.9224	0,000272%	R\$ 2.523.785.410,34	0,1061%	Lim. Resol.: 40,00% Lim. Política: 40,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	R\$ 983,57	455.8004	0,000039%	R\$ 2.523.785.410,34	0,0152%	Lim. Resol.: 40,00% Lim. Política: 40,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	Enquadrado

Por benchmark

Benchmark

% Carteira | Saldo do grupo

IDKA 2

38,525381% | R\$ 2.491.454,93

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.322.205/0001-35	38,525381%	R\$ 2.491.454,93

IMA-B 5

38,42103% | R\$ 2.484.706,48

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 03.543.447/0001-03	38,42103%	R\$ 2.484.706,48

IRF-M 1

22,736684% | R\$ 1.470.392,28

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35	22,736684%	R\$ 1.470.392,28

IRF-M

0,19559% | R\$ 12.648,91

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 07.111.384/0001-69	0,19559%	R\$ 12.648,91

CDI

0,121315% | R\$ 7.845,50

Fundo	% saldo	Saldo
-------	---------	-------

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	0,106106%	R\$ 6.861,93
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	0,015209%	R\$ 983,57

Por administradores

Administrador

% Carteira | Saldo do grupo

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

100,0000% | R\$ 6.467.048,10

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	0,106106%	R\$ 6.861,93
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	0,015209%	R\$ 983,57
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.322.205/0001-35	38,525381%	R\$ 2.491.454,93
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 03.543.447/0001-03	38,42103%	R\$ 2.484.706,48
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 07.111.384/0001-69	0,19559%	R\$ 12.648,91
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35	22,736684%	R\$ 1.470.392,28

Retornos do mês

Fundo de 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\$ 979,66	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 983,57	0,0152%	R\$ 3,91	0,3984%	0,3991%
13.077.415/0001-05 - BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 6.834,70	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.861,93	0,1061%	R\$ 27,23	0,3984%	0,3984%
13.322.205/0001-35 - BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 2.523.062,83	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 2.491.454,93	38,5254%	-R\$ 31.607,90	-1,2528%	-1,2528%
03.543.447/0001-03 - BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.516.789,53	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 2.484.706,48	38,4210%	-R\$ 32.083,05	-1,2748%	-1,2748%
07.111.384/0001-69 - BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 12.996,96	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 12.648,91	0,1956%	-R\$ 348,05	-2,6779%	-2,6780%
11.328.882/0001-35 - BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 1.478.059,60	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.470.392,28	22,7367%	-R\$ 7.667,32	-0,5187%	-0,5188%

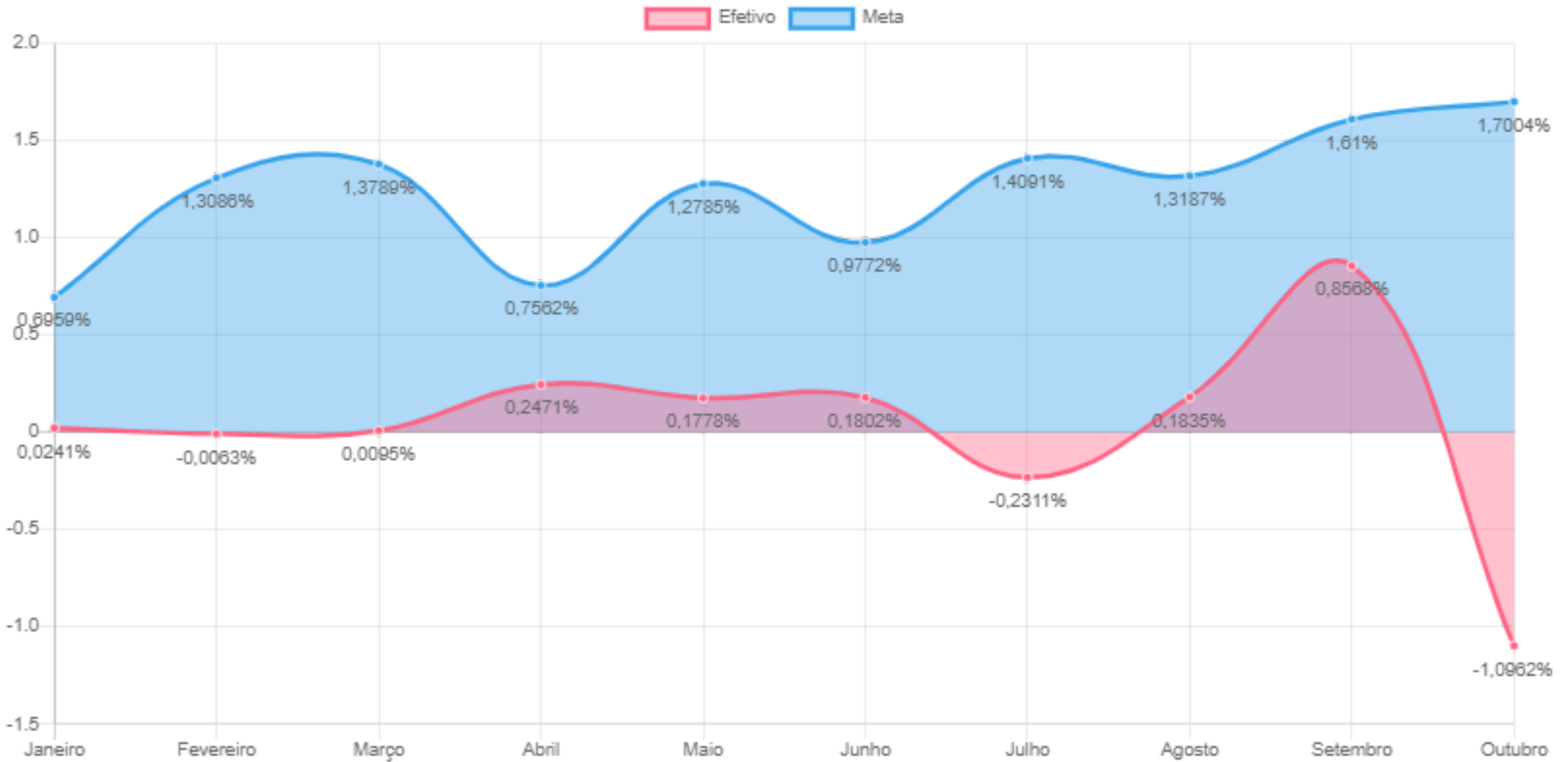
Tipo	Saldo anterior	Total aplicações	Total resgates	Saldo atual	Total retorno	Total retorno %	Total retorno efetivo
Fundo de Renda Fixa	R\$ 6.538.723,28	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.467.048,10	-R\$ 71.675,18	-1,0951%	-1,0962%
Totais	R\$ 6.538.723,28	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.467.048,10	-R\$ 71.675,18	-1,0951%	-1,0962%

Retornos acumulados

Mês	Saldo anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
JANEIRO	R\$ 1.476.928,75	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.477.284,79	R\$ 356,04	0,0241%	0,6959%	3,4641%
FEVEREIRO	R\$ 1.477.284,79	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.477.191,40	-R\$ 93,39	-0,0063%	1,3086%	-0,4831%
MARÇO	R\$ 1.477.191,40	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.477.332,00	R\$ 140,60	0,0095%	1,3789%	0,6903%
ABRIL	R\$ 1.477.332,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.480.982,85	R\$ 3.650,85	0,2471%	0,7562%	32,6798%
MAIO	R\$ 1.480.982,85	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.483.615,64	R\$ 2.632,79	0,1778%	1,2785%	13,9048%
JUNHO	R\$ 1.483.615,64	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.486.289,33	R\$ 2.673,69	0,1802%	0,9772%	18,4419%
JULHO	R\$ 1.486.289,33	R\$ 5.000.000,00	R\$ 0,00	R\$ 6.471.301,57	-R\$ 14.987,76	-0,2311%	1,4091%	-16,3983%
AGOSTO	R\$ 6.471.301,57	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.483.177,25	R\$ 11.875,68	0,1835%	1,3187%	13,9162%
SETEMBRO	R\$ 6.483.177,25	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.538.723,28	R\$ 55.546,03	0,8568%	1,6100%	53,2156%
OUTUBRO	R\$ 6.538.723,28	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.467.048,10	-R\$ 71.675,18	-1,0962%	1,7004%	-64,4651%

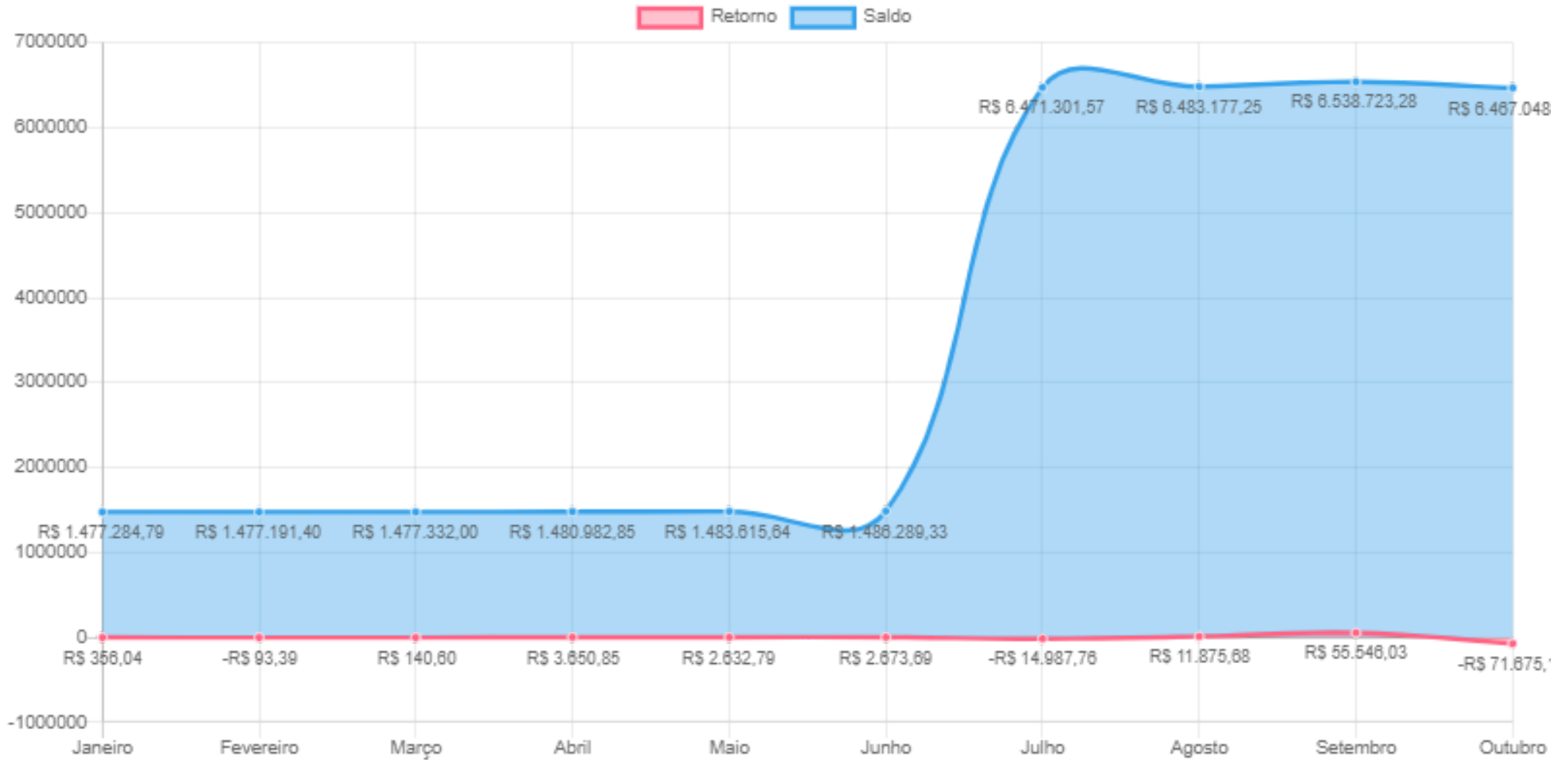
	Total aplicações	Total Resgates	Total retorno R\$	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
Total	R\$ 5.000.000,00	R\$ 0,00	-R\$ 9.880,65	0,3353%	13,1472%	2,5501%

Gráfico - retorno acumulado no ano



	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Mai	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro
Efetivo	0,024%	-0,006%	0,010%	0,247%	0,178%	0,180%	-0,231%	0,184%	0,857%	-1,096%
Meta	0,696%	1,309%	1,379%	0,756%	1,279%	0,977%	1,409%	1,319%	1,610%	1,700%

Grafico - Evolução do patrimônio



Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maior	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro
R\$ 1.477.284,79	R\$ 1.477.191,40	R\$ 1.477.332,00	R\$ 1.480.982,85	R\$ 1.483.615,64	R\$ 1.486.289,33	R\$ 6.471.301,57	R\$ 6.483.177,25	R\$ 6.538.723,28	R\$ 6.467.048,10
R\$ 356,04	-R\$ 93,39	R\$ 140,60	R\$ 3.650,85	R\$ 2.632,79	R\$ 2.673,69	-R\$ 14.987,76	R\$ 11.875,68	R\$ 55.546,03	-R\$ 71.675,18

Grafico - Retorno mensal

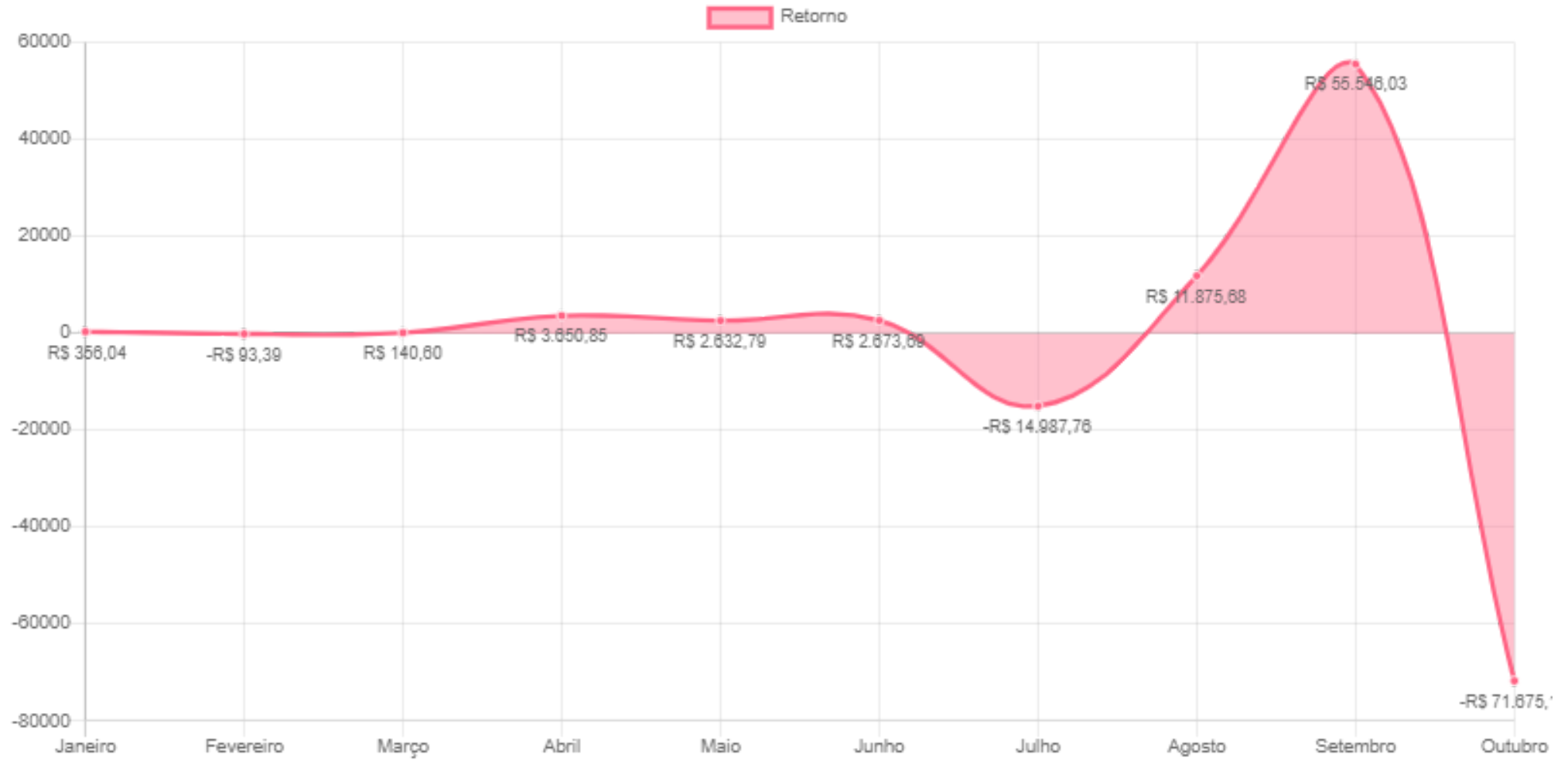
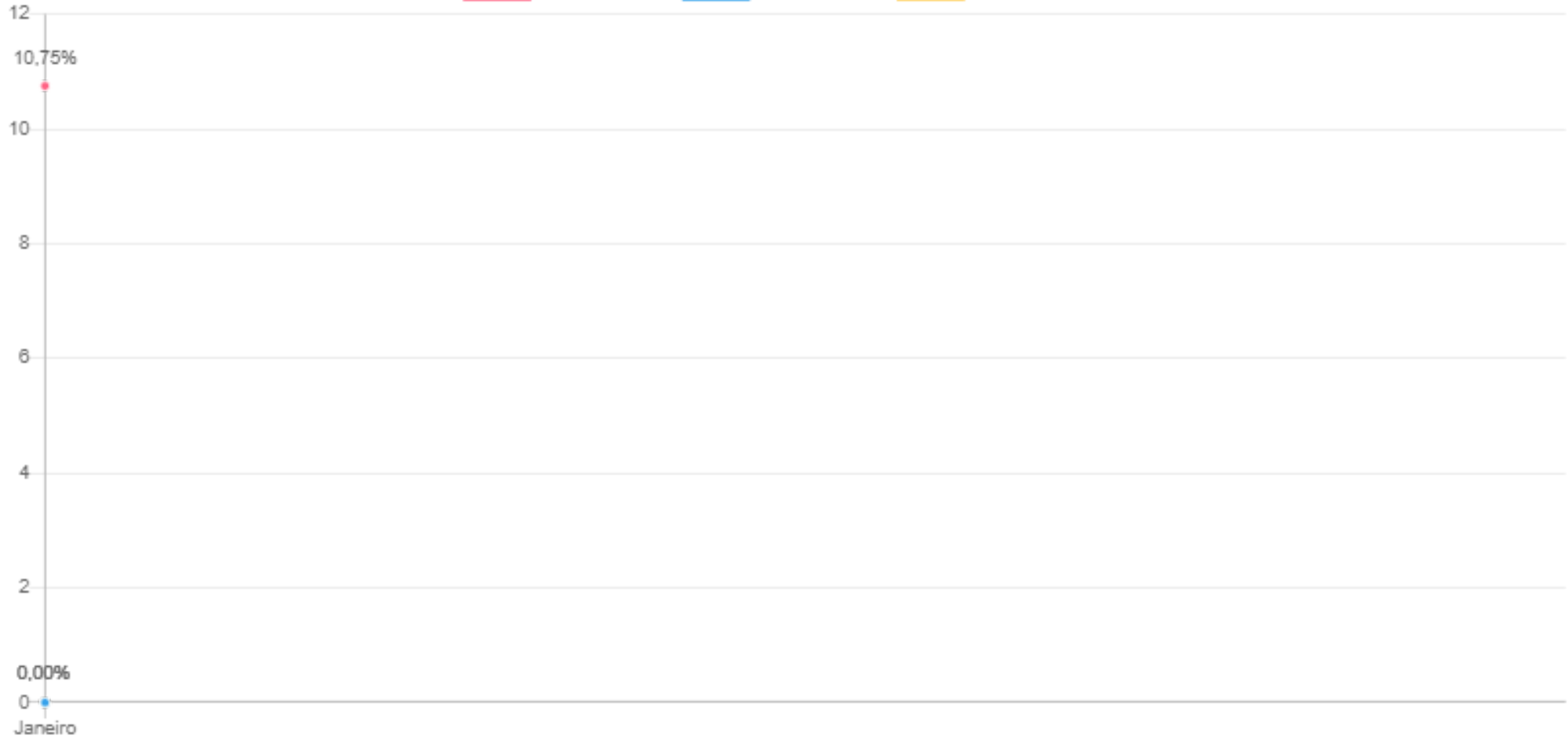


Gráfico - Índices econômicos

SELIC

■ Percentual mês ■ Percentual ano ■ Percentual 12M

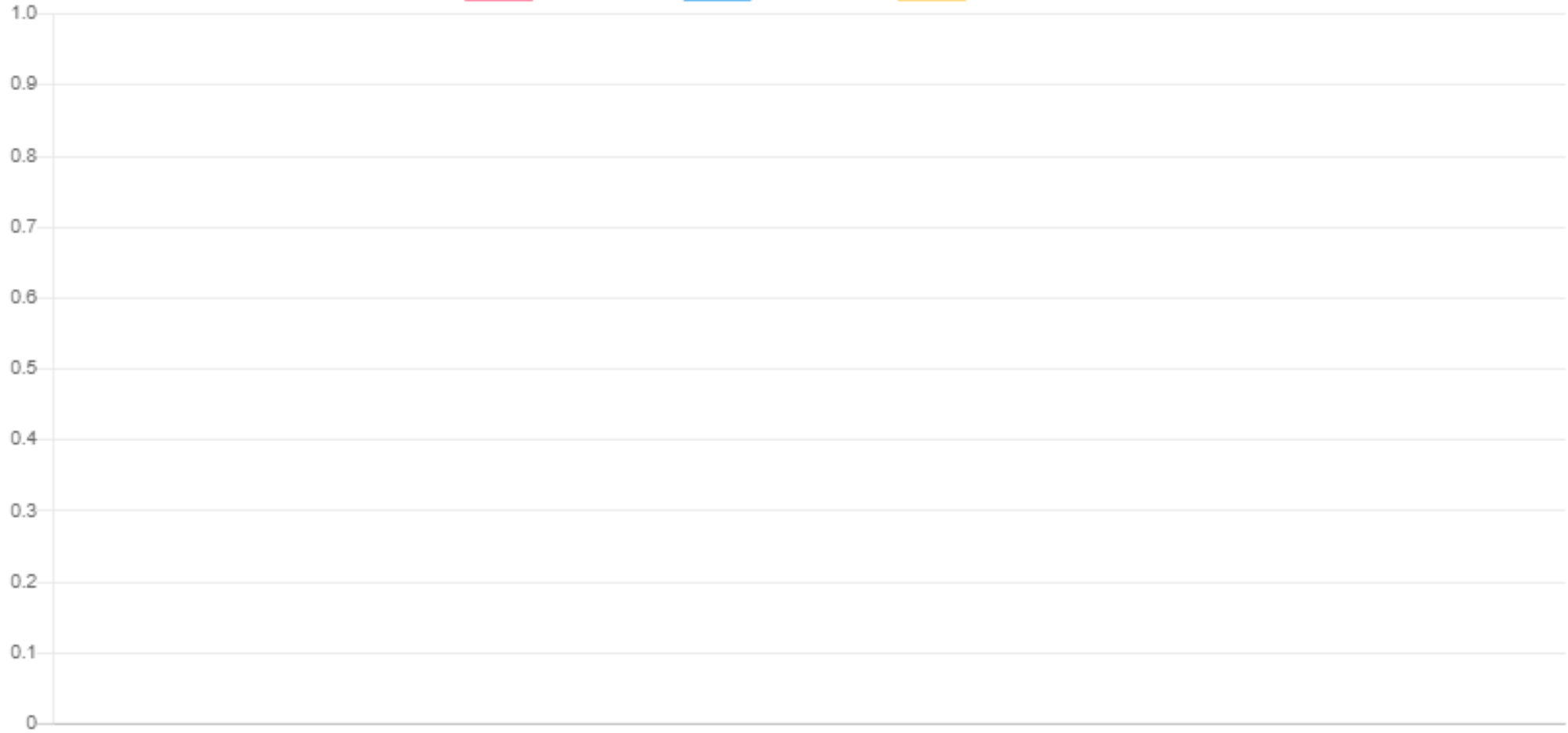


Mês	Janeiro
Percentual mês	10,75%
Percentual ano	0,00%
Percentual 12M	0,00%

Gráfico - Índices econômicos

IPCA

Percentual mês Percentual ano Percentual 12M



Mês

Percentual mês

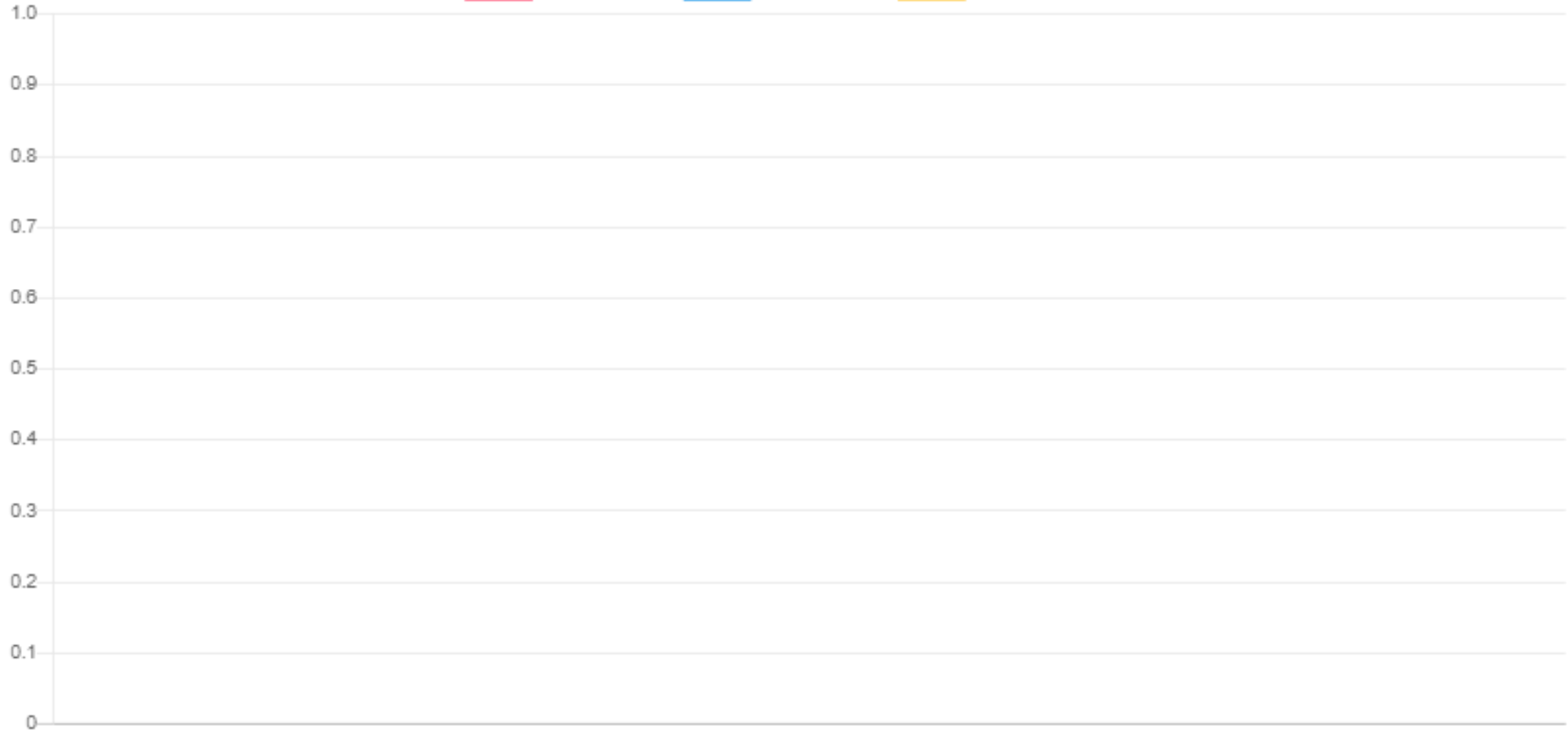
Percentual ano

Percentual 12M

Gráfico - Índices econômicos

INPC

Percentual mês Percentual ano Percentual 12M



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 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	26,057317%	0,000130%	3,084738%	6,504316%	10,727197%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	26,057317%	0,000130%	3,084738%	6,504316%	10,727197%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	30,083170%	0,005729%	5,726732%	5,903952%	18,061921%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	IMA-B 5	30,514838%	0,006594%	5,702850%	5,391885%	16,931579%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IRF-M	-21,165524%	0,011985%	13,404122%	17,464099%	21,906242%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	22,316260%	0,000511%	2,208884%	4,284194%	8,552485%

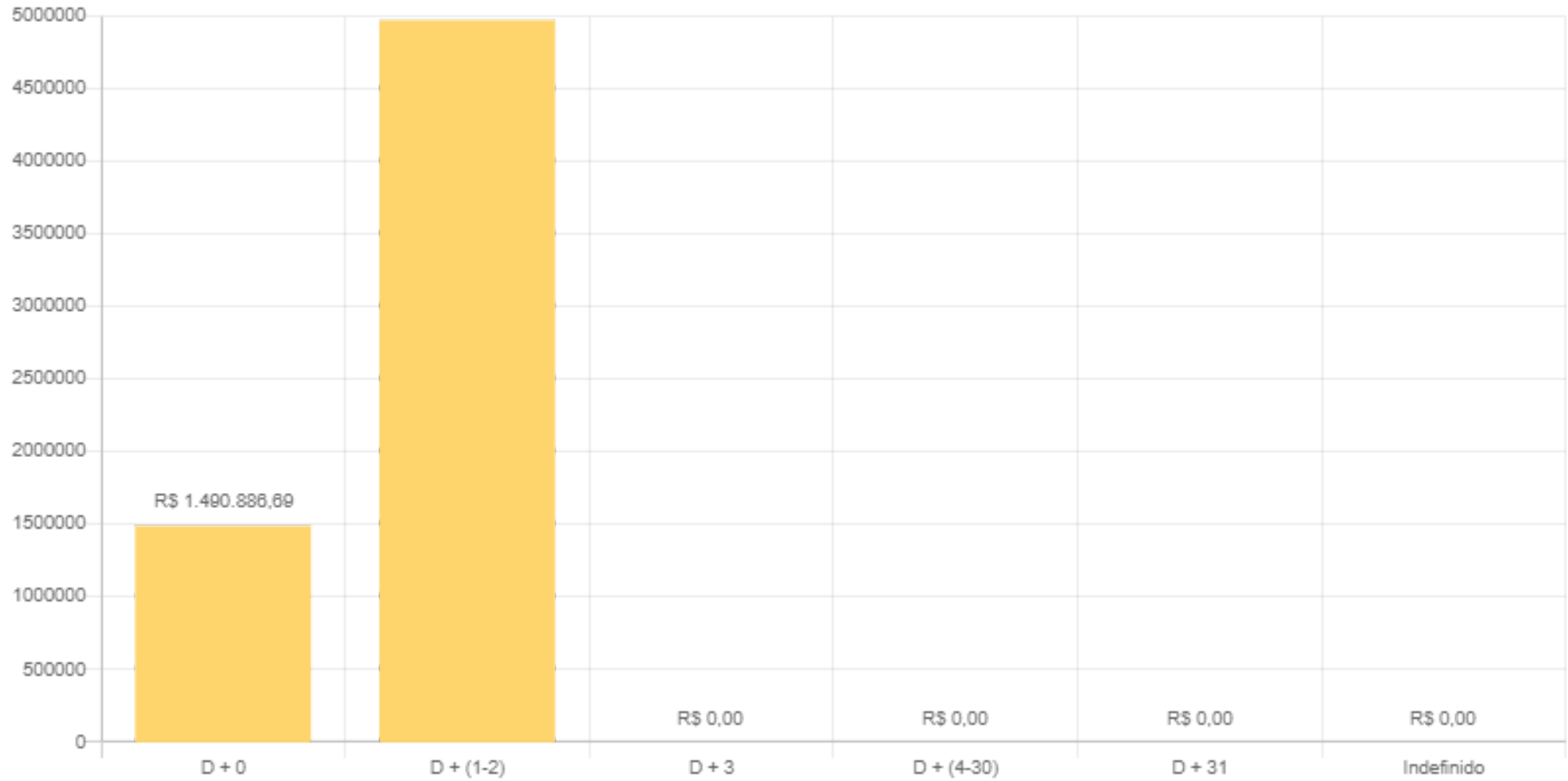
	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 3M	VOL 6M	VOL 12M
Geral		18,977230%	0,004180%			

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\$ 6.861,93	0,000130%	10,727197%	R\$ 0,01
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	R\$ 983,57	0,000130%	10,727197%	R\$ 0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.205/0001-35	IDKA 2	R\$ 2.491.454,93	0,005729%	18,061921%	R\$ 142,72
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\$ 2.484.706,48	0,006594%	16,931579%	R\$ 163,84
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	07.111.384/0001-69	IRF-M	R\$ 12.648,91	0,011985%	21,906242%	R\$ 1,52
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M 1	R\$ 1.470.392,28	0,000511%	8,552485%	R\$ 7,52

Risco de mercado	
Saldo Total	R\$ 6.467.048,10
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 315,61
% Provisão de perda	0,0049%
% Aceitavel perda	2,0%
Limite de utilização	0,244%

Prazo Resgate	Quantidade Fundos	% carteira	Saldo
D + 0	4	23,0536%	R\$ 1.490.886,69
D + 1	2	76,9464%	R\$ 4.976.161,41



Risco crédito

Risco crédito	% carteira	Saldo
Aceitavel carteira Titulos Privados	30,00%	
Limite de Utilização	0,20%	

