



DI BLASI  
Consultoria Financeira

## **Instituto Municipal de Previdência de Portel - PA**

Setembro 2022



## 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	0,04%	868	0.00	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 7.503,38	B	Fundo de Investimento	1,00%
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM C	0	0,01%	868	0.00	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 1.075,51	B	Fundo de Investimento	1,00%
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM C	0	2,33%	868	0.01	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 445.739,60	B	Fundo de Investimento	1,00%
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	1	23,52%	1,050	0.05	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 4.508.645,71	M	Fundo de Investimento	0,20%
03.543.447/0001-03	BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO F	1	25,11%	796	0.08	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 4.812.738,75	A	Fundo de Investimento	0,20%
07.111.384/0001-69	BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	0	0,07%	461	0.00	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 14.015,04	M	Fundo de Investimento	0,20%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	0	32,89%	1,087	0.10	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 6.304.257,62	B	Fundo de Investimento	0,20%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONC	0	16,03%	1,028	0.03	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 3.072.108,43	B	Fundo de Investimento	0,20%

**R\$ 19.166.084,04**



## Retorno do mês

Nome Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI	R\$ 7.429,51	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 7.503,38	R\$ 73,87	0,9942%	CDI
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI	R\$ 1.064,92	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 1.075,51	R\$ 10,59	0,9944%	CDI
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI	R\$ 427.724,09	R\$ 144.960,17	R\$ 131.058,58	R\$ 445.739,60	R\$ 4.113,92	0,7183%	CDI
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 4.484.896,73	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 4.508.645,71	R\$ 23.748,98	0,5295%	IDKA 2
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZ	R\$ 4.793.530,88	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 4.812.738,75	R\$ 19.207,87	0,4007%	IMA-B 5
BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 13.824,78	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 14.015,04	R\$ 190,26	1,3762%	IRF-M
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F	R\$ 4.454.927,83	R\$ 1.800.000,00	R\$ 0	R\$ 6.304.257,62	R\$ 49.329,79	0,7886%	IRF-M 1
BB PREV RF REFERENCIADO DI L	R\$ 2.643.021,80	R\$ 400.000,00	R\$ 0	R\$ 3.072.108,43	R\$ 29.086,63	0,9558%	CDI
Total	16,826,420.54	2,344,960.17	131,058.58	19,166,084.04	125,761.91	0,6560%	

## Enquadramentos

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

 % Carteira: : **81,60%**

 Saldo do grupo: **R\$ 15.639.657,12**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 4.508.645,71	1,396,116.74	0,05153%	8,749,817,040.89	23,52%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,05%	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 4.812.738,75	209,135.81	0,07688%	6,260,416,458.58	25,11%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,08%	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 14.015,04	2,183.62	0,00035%	4,037,691,715.74	0,07%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 6.304.257,62	2,079,478.99	0,10383%	6,071,749,354.31	32,89%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,10%	Enquadrado

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

 % Carteira: : **18,40%**

 Saldo do grupo: **R\$ 3.526.426,92**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 7.503,38	3,179.92	0,00022%	3,459,949,589.95	0,04%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.075,51	455.80	0,00003%	3,459,949,589.95	0,01%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 445.739,60	188,903.97	0,01288%	3,459,949,589.95	2,33%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,01%	Enquadrado
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 3.072.108,43	1,169,525.03	0,02583%	11,894,605,297.71	16,03%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,03%	Enquadrado

## Enquadramento por Benchmark

**CDI**

 % Carteira: **18,40%**

 Saldo do grupo: **R\$ 3.526.426,92**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 7.503,38	3,179.92	0.00	0.04	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 20,00%	Enquadrado
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.075,51	455.80	0.00	0.01	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 20,00%	Enquadrado
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 3.072.108,43	1,169,525.03	0.03	16.03	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 20,00%	Enquadrado
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 445.739,60	188,903.97	0.01	2.33	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 20,00%	Enquadrado

**IDKA 2**

 % Carteira: **23,52%**

 Saldo do grupo: **R\$ 4.508.645,71**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 4.508.645,71	1,396,116.74	0.05	23.52	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

**IMA-B 5**

 % Carteira: **25,11%**

 Saldo do grupo: **R\$ 4.812.738,75**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 4.812.738,75	209,135.81	0.08	25.11	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado



**IRF-M**

% Carteira: **0,07%**

Saldo do grupo: **R\$ 14.015,04**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 14.015,04	2,183.62	0.00	0.07	Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

**IRF-M 1**

% Carteira: **32,89%**

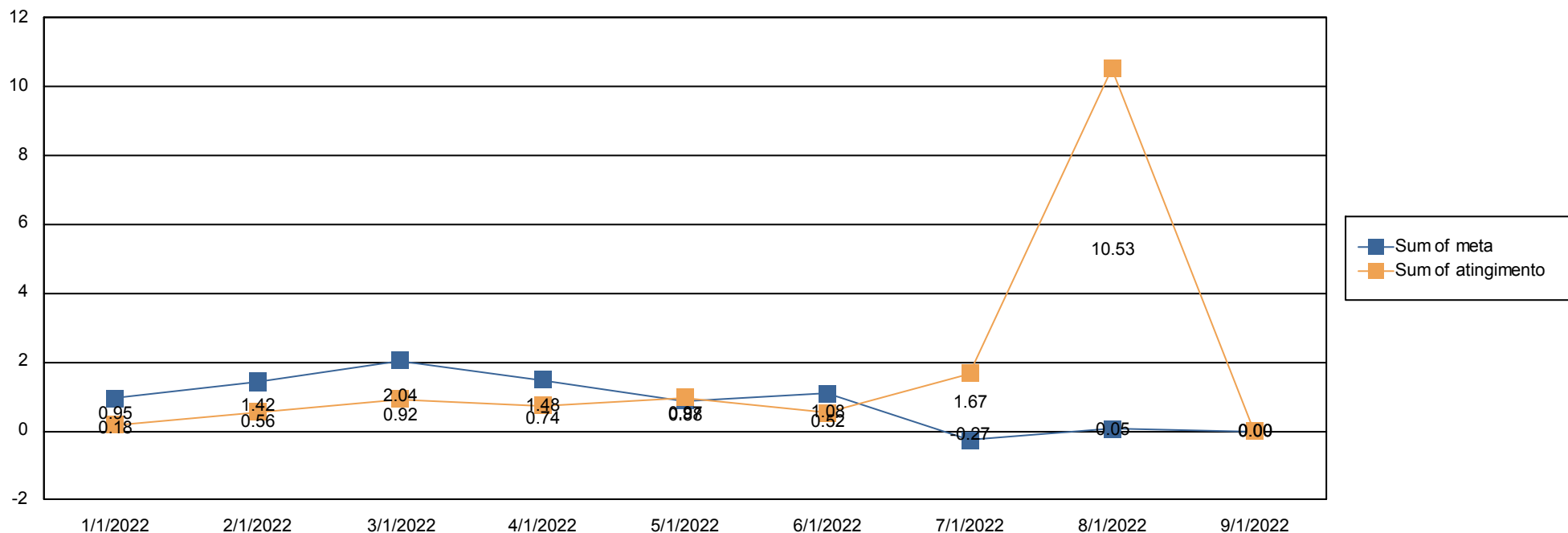
Saldo do grupo: **R\$ 6.304.257,62**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 6.304.257,62	2,079,478.99	0.10	32.89	Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

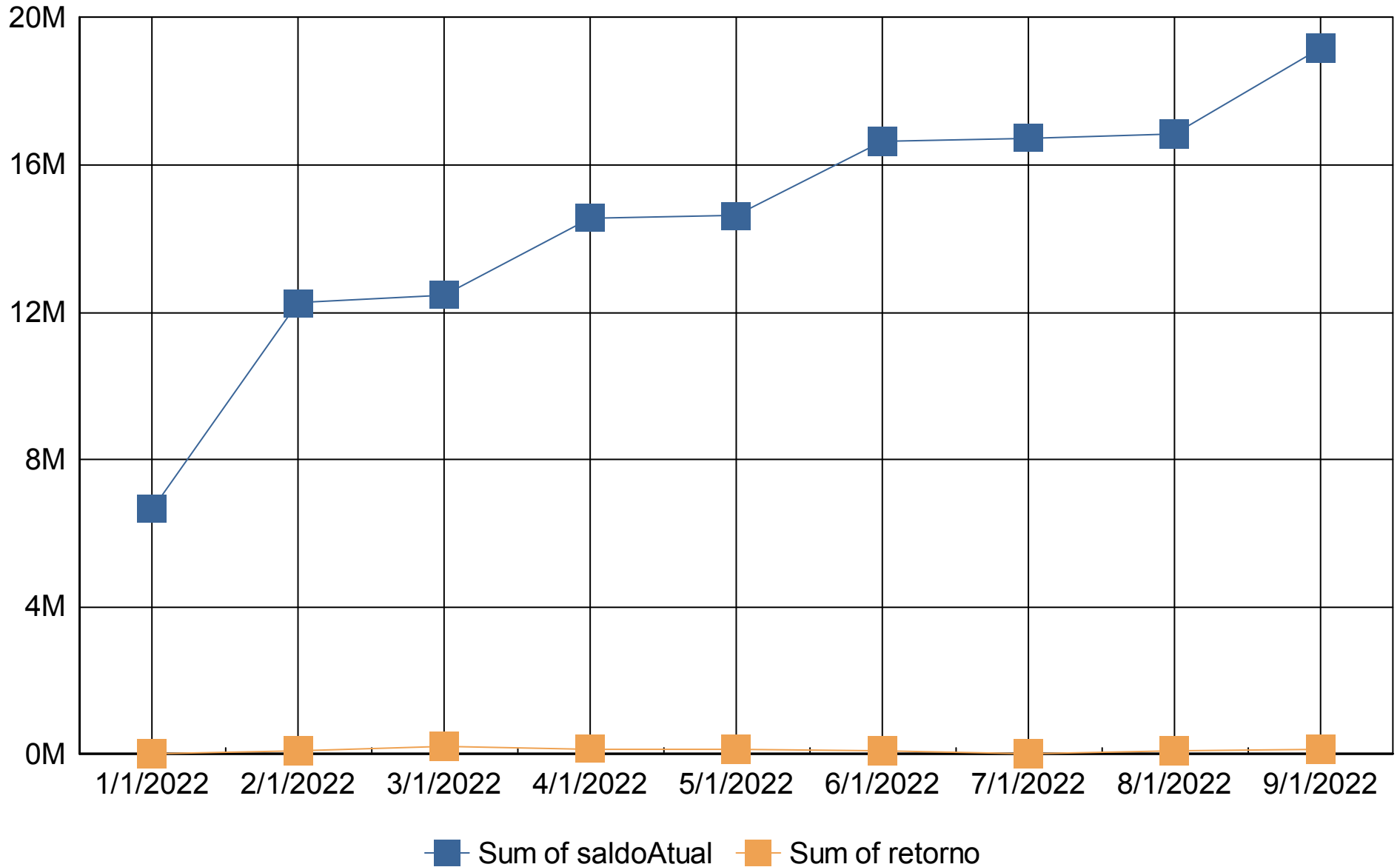
## Retorno acumulado no ano

Período	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Retorno %	Meta	Atingimento
Janeiro	R\$ 6.650.888,97	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.662.317,82	R\$ 11.428,85	0,1718%	0,9528	18,0352%
Fevereiro	R\$ 6.662.317,82	R\$ 5.546.186,13	R\$ 61.798,99	R\$ 12.244.401,87	R\$ 97.696,91	0,8002%	1,4247	56,1688%
Março	R\$ 12.244.401,87	R\$ 114.949,17	R\$ 113.205,32	R\$ 12.478.282,80	R\$ 232.137,08	1,8782%	2,0373	92,1921%
Abril	R\$ 12.478.282,80	R\$ 2.057.428,51	R\$ 128.781,67	R\$ 14.565.258,53	R\$ 158.328,89	1,0892%	1,4750	73,8468%
Mai	R\$ 14.565.258,53	R\$ 114.186,42	R\$ 191.475,11	R\$ 14.613.766,39	R\$ 125.796,55	0,8570%	0,8825	97,1056%
Junho	R\$ 14.613.766,39	R\$ 1.986.452,57	R\$ 60.037,12	R\$ 16.634.013,64	R\$ 93.831,80	0,5652%	1,0834	52,1732%
Julho	R\$ 16.634.013,64	R\$ 272.646,76	R\$ 202.540,69	R\$ 16.735.127,92	R\$ 31.008,21	0,1834%	-0,2722	167,3800%
Agosto	R\$ 16.735.127,92	R\$ 100.636,28	R\$ 96.397,39	R\$ 16.826.420,54	R\$ 87.053,73	0,5171%	0,0491	1.053,1084%
Setembro	R\$ 16.826.420,54	R\$ 2.344.960,17	R\$ 131.058,58	R\$ 19.166.084,04	R\$ 125.761,91	0,6560%	0,0000	0,0000%
<b>Total</b>		12,537,446.01	985,294.87		963,043.93	6,9110%	7,8711%	87,8024%

## Meta x Atingimento



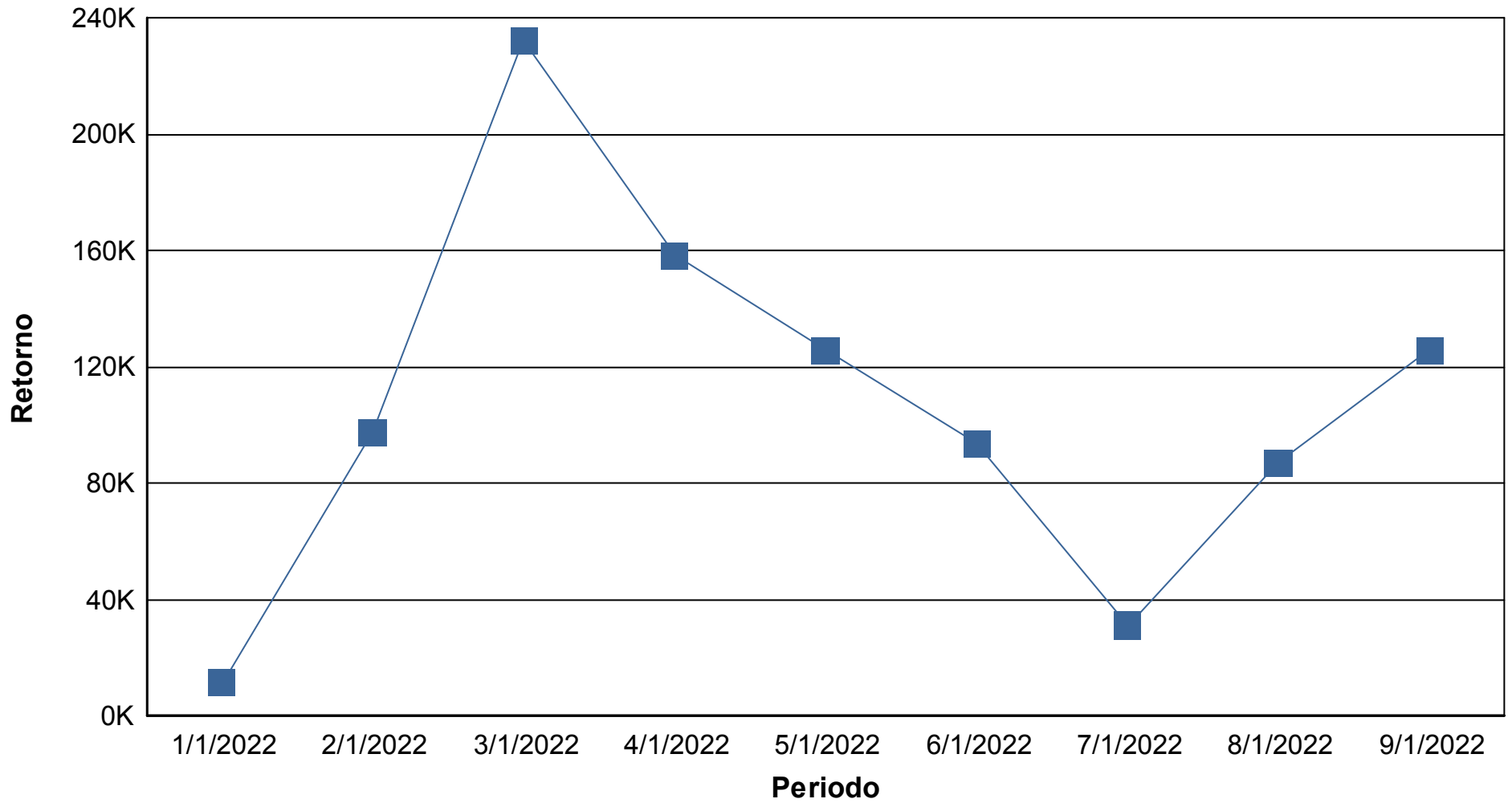
### Evolução do patrimônio



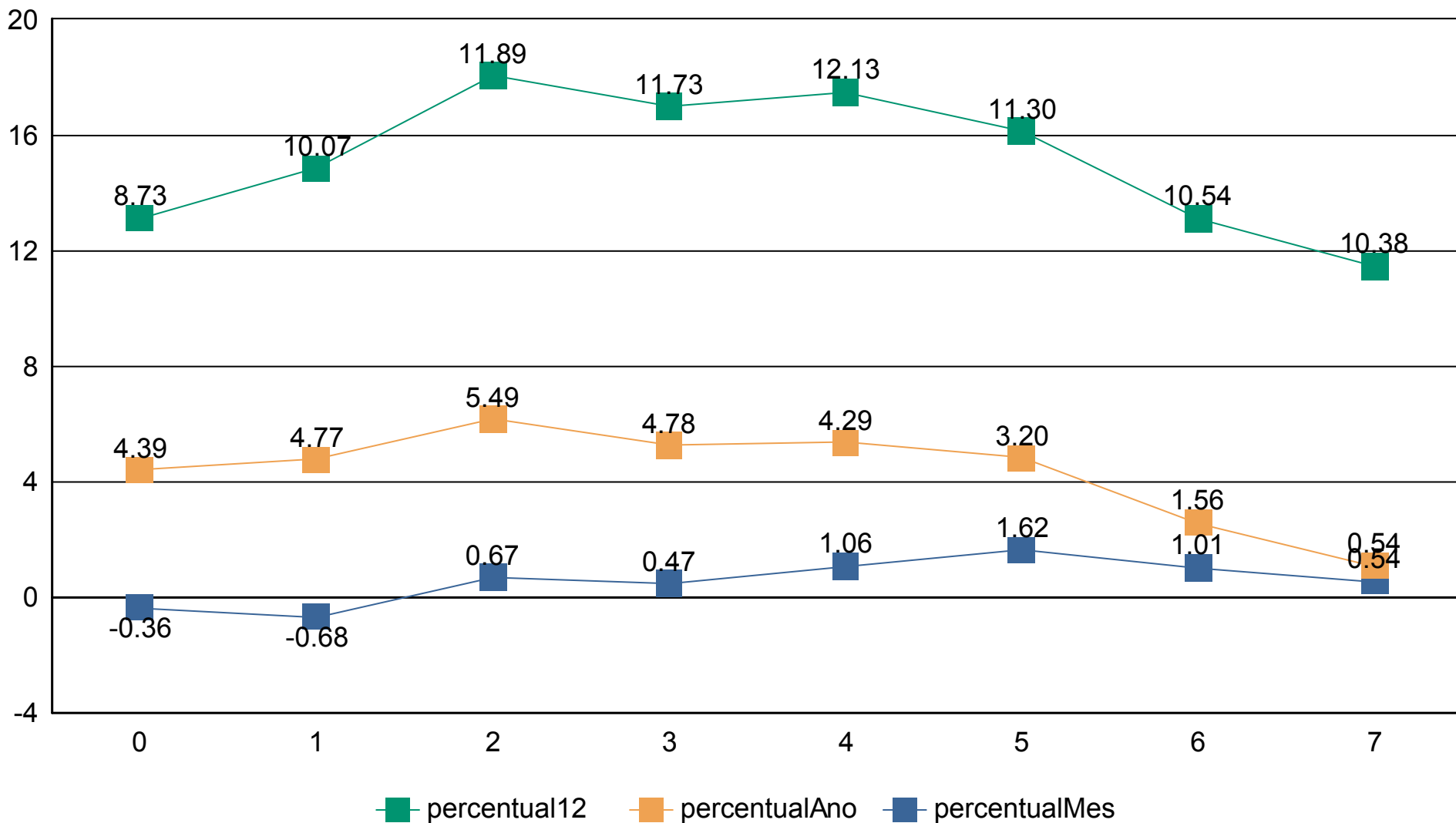




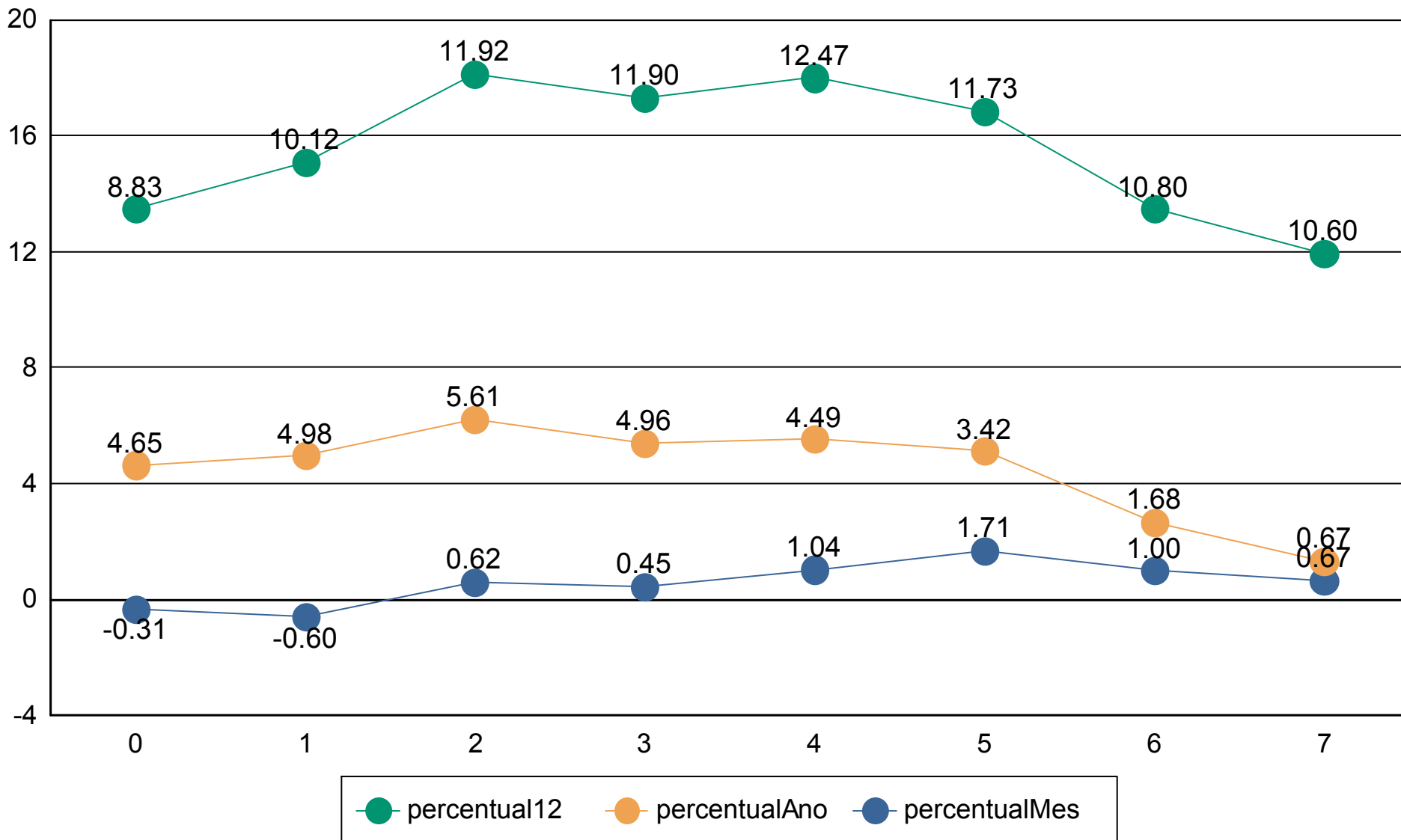
### Retorno Mensal



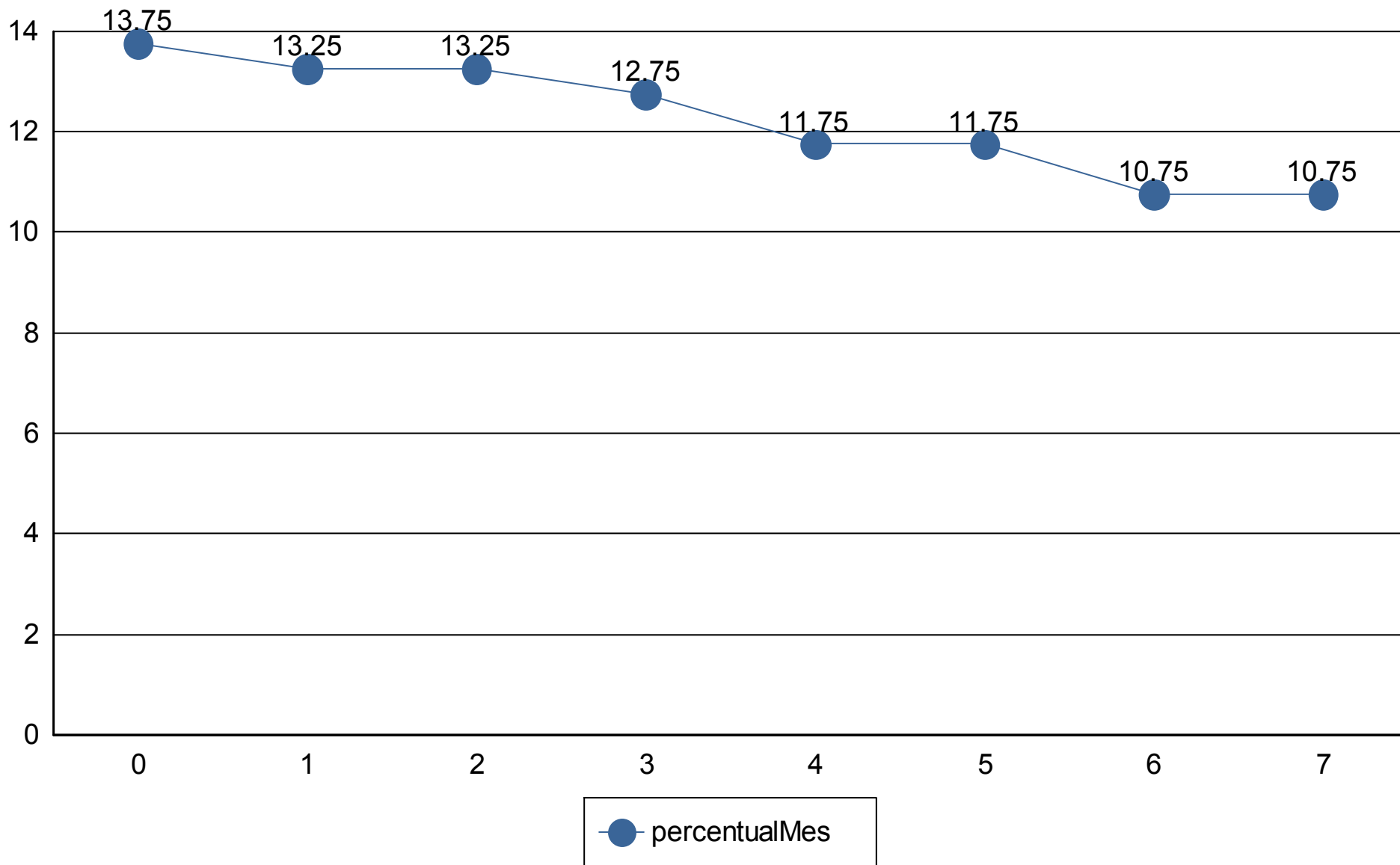
## Índices Econômicos - IPCA



## 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 emittentes 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
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	IRF-M 1	23,55%	0,00%	10,02%	23,51%	49,46%
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	CDI	25,12%	0,00%	9,11%	22,27%	47,35%
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	CDI	25,12%	0,00%	9,11%	22,27%	47,35%
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	CDI	25,12%	0,00%	9,11%	22,27%	47,35%
07.111.384/0001-69	BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	IRF-M	21,82%	0,01%	14,72%	25,63%	44,00%
03.543.447/0001-03	BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	IMA-B 5	19,80%	0,01%	2,06%	6,19%	55,30%
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	IDKA 2	19,68%	0,01%	2,58%	5,34%	54,13%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI	CDI	25,16%	0,00%	10,11%	24,71%	53,73%
			<b>185,36%</b>	<b>0,04%</b>	<b>66,82%</b>	<b>152,19%</b>	<b>398,67%</b>

## Provisão de risco - Mercado

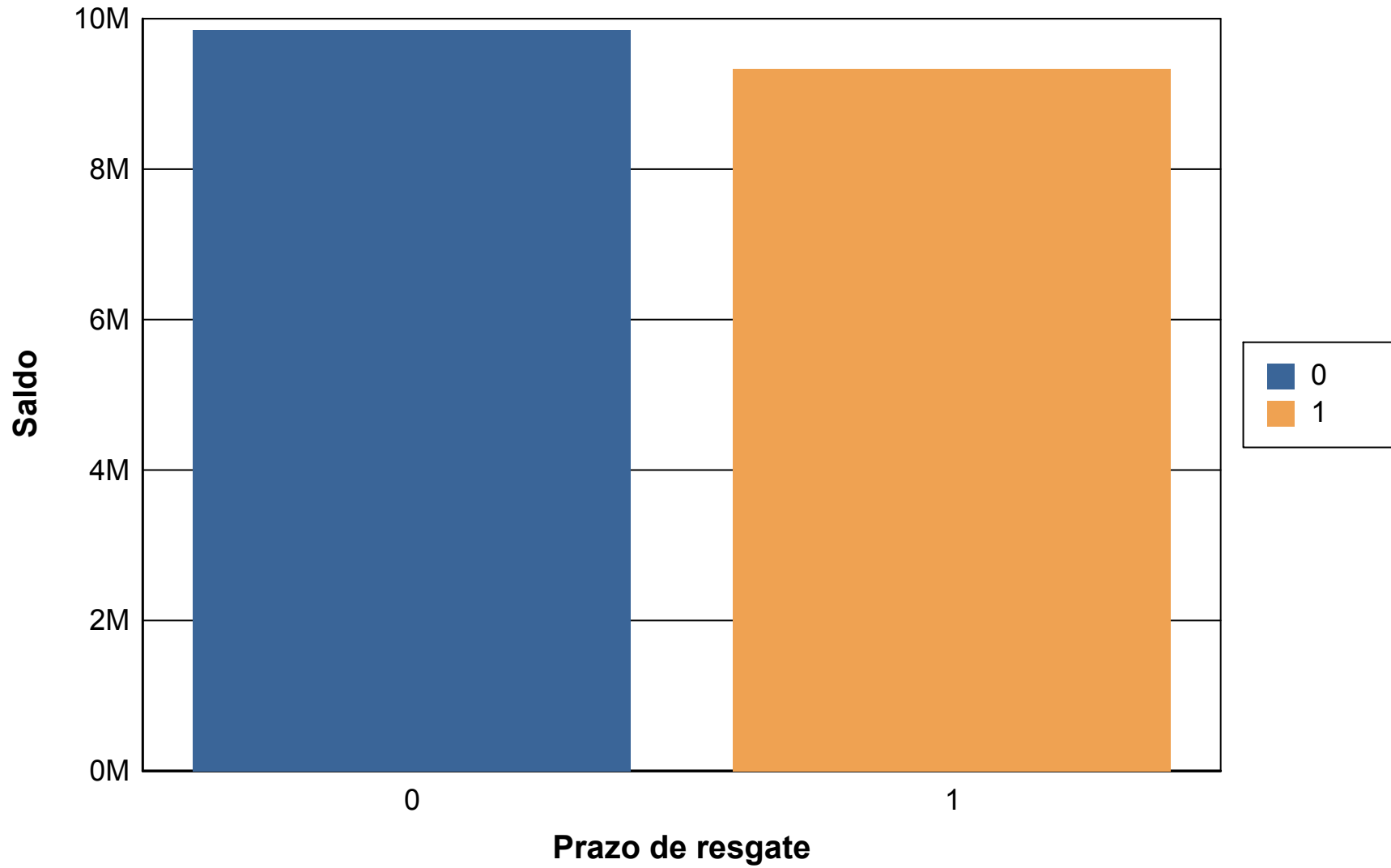
CNPJ	Nome do fundo	Benchmark	Saldo	VAR12	VOL12	VAR% BASE 1
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO C	CDI	R\$ 7.503,38	0,00%	47,35%	R\$ 0,03
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO C	CDI	R\$ 1.075,51	0,00%	47,35%	R\$ 0,00
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO C	CDI	R\$ 445.739,60	0,00%	47,35%	R\$ 1,80
13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	IDKA 2	R\$ 4.508.645,71	0,01%	54,13%	R\$ 504,03
03.543.447/0001-03	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FL	IMA-B 5	R\$ 4.812.738,75	0,01%	55,30%	R\$ 520,79
07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	IRF-M	R\$ 14.015,04	0,01%	44,00%	R\$ 2,10
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO	IRF-M 1	R\$ 6.304.257,62	0,00%	49,46%	R\$ 111,02

Saldo Total:	<b>R\$ 16.093.975,61</b>
Provisão para perda e Investimentos	<b>R\$ 1.139,77</b>
% Provisão de perda	0,01%
% Aceitavel perda	2%
Limite de utilização	<b>0,35%</b>



Nome do Fundo	Saldo	% Part.	N. Cotistas	% PL	PL do Fundo	Legislação	Grau risco	Prazo Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE	R\$ 7.503,38	0,04%	868	0,00%	R\$ 3.459.949.589,95	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE	R\$ 1.075,51	0,01%	868	0,00%	R\$ 3.459.949.589,95	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE	R\$ 445.739,60	2,33%	868	0,01%	R\$ 3.459.949.589,95	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULO	R\$ 4.508.645,71	23,52%	1,050	0,05%	R\$ 8.749.817.040,89	ixa 100% TP/E	Médio	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO	R\$ 4.812.738,75	25,11%	796	0,08%	R\$ 6.260.416.458,58	ixa 100% TP/E	Alto	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS	R\$ 14.015,04	0,07%	461	0,00%	R\$ 4.037.691.715,74	ixa 100% TP/E	Médio	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS	R\$ 6.304.257,62	32,89%	1,087	0,10%	R\$ 6.071.749.354,31	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIAD	R\$ 3.072.108,43	16,03%	1,028	0,03%	R\$ 11.894.605.297,71	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
0	R\$ 9.844.699,58	6	51,37%
1	R\$ 9.321.384,46	2	48,63%



## 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\$ 15.639.657,12	81,60
Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	60,00%	60,00%	R\$ 3.526.426,92	18,40

	Saldo	% Carteira
100% títulos públicos	0.00	0.00
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	0.00	0.00
100% títulos privados	<b>19,166,084.04</b>	100.00

### Distribuição dos saldos

