



# 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<br><b>Banco:</b> BANCO DO BRASIL <b>Agência:</b> 2486-4 <b>Conta:</b> 16622-7 | R\$ 7.804,41             | 0,04241%     | 907           | 0,0002%      | R\$ 3.853.684.843,62  | Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"  | Baixo      | Fundo de Investimento |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO<br><b>Banco:</b> BANCO DO BRASIL <b>Agência:</b> 2486-4 <b>Conta:</b> 16623-5 | R\$ 1.118,66             | 0,00608%     | 907           | 0,00003%     | R\$ 3.853.684.843,62  | Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"  | Baixo      | Fundo de Investimento |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO<br><b>Banco:</b> 001 <b>Agência:</b> 2486-4 <b>Conta:</b> 27249-3             | R\$ 541.249,75           | 2,94114%     | 907           | 0,01404%     | R\$ 3.853.684.843,62  | Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"  | Baixo      | Fundo de Investimento |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO<br><b>Banco:</b> 001 <b>Agência:</b> 2486-4 <b>Conta:</b> 9683-0                                       | R\$ 4.684.155,26         | 25,45363%    | 977           | 0,0652%      | R\$ 7.184.164.479,15  | 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<br><b>Banco:</b> 001 <b>Agência:</b> 2486-4 <b>Conta:</b> 9683-0                            | R\$ 4.998.088,69         | 27,15954%    | 769           | 0,08824%     | R\$ 5.664.338.306,58  | Res. 4.963/2021 - Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b" | Alto       | Fundo de Investimento |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO<br><b>Banco:</b> BANCO DO BRASIL <b>Agência:</b> 2486-4 <b>Conta:</b> 16623-5                           | R\$ 14.360,52            | 0,07803%     | 481           | 0,00036%     | R\$ 3.963.755.899,38  | Res. 4.963/2021 - Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b" | Médio      | Fundo de Investimento |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI<br><b>Banco:</b> BANCO DO BRASIL <b>Agência:</b> 2486-4 <b>Conta:</b> 9683-0  | R\$ 6.567.504,98         | 35,68773%    | 1116          | 0,10007%     | R\$ 6.562.900.517,46  | 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<br><b>Banco:</b> 001 <b>Agência:</b> 2486-4 <b>Conta:</b> 9683-0             | R\$ 1.588.416,28         | 8,63143%     | 1070          | 0,01225%     | R\$ 12.971.898.325,20 | Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"  | Baixo      | Fundo de Investimento |
| <b>Total</b>  | <b>R\$ 18.402.698,55</b> |              |               |              |                       |   |            |                       |

# Enquadramentos

Resolução

% Carteira | Saldo do grupo |

Situação

**(RPPS) - Res. 4.963/2021 - Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º T "b"** **88,378938% | R\$ 16.264.109,45 |**

**Enquadrado**

| Fundo  | Saldo            | Saldo Cotas    | % PL      | P. Líq.              | % Carteira | Limites   | Situação          |
|--|------------------|----------------|-----------|----------------------|------------|---|-------------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO<br><b>CNPJ:</b> 13.322.205/0001-35            | R\$ 4.684.155,26 | 1396116.735825 | 0,065201% | R\$ 7.184.164.479,15 | 25,4536%   | Lim. Resol.: 100,00%<br>Lim. Política: 100,00%<br>Lim. CNPJ: 100,00%<br>Lim. PL.: 100,0000% | <b>Enquadrado</b> |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI<br><b>CNPJ:</b> 03.543.447/0001-03 | R\$ 4.998.088,69 | 209135.805216  | 0,088238% | R\$ 5.664.338.306,58 | 27,1595%   | Lim. Resol.: 100,00%<br>Lim. Política: 100,00%<br>Lim. CNPJ: 100,00%<br>Lim. PL.: 100,0000% | <b>Enquadrado</b> |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO<br><b>CNPJ:</b> 07.111.384/0001-69             | R\$ 14.360,52    | 2183.623226    | 0,000362% | R\$ 3.963.755.899,38 | 0,0780%    | Lim. Resol.: 100,00%<br>Lim. Política: 100,00%<br>Lim. CNPJ: 100,00%<br>Lim. PL.: 100,0000% | <b>Enquadrado</b> |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI<br><b>CNPJ:</b> 11.328.882/0001-35                           | R\$ 6.567.504,98 | 2079478.992358 | 0,10007%  | R\$ 6.562.900.517,46 | 35,6877%   | Lim. Resol.: 100,00%<br>Lim. Política: 100,00%<br>Lim. CNPJ: 100,00%<br>Lim. PL.: 100,0000% | <b>Enquadrado</b> |

**(RPPS) - Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, TTT "a"** **11,621062% | R\$ 2.138.589,10 |**

**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<br><b>CNPJ:</b> 13.077.415/0001-05  | R\$ 7.804,41     | 3179.922499   | 0,000203% | R\$ 3.853.684.843,62  | 0,0424%    | Lim. Resol.: 60,00%<br>Lim. Política: 60,00%<br>Lim. CNPJ: 20,00%<br>Lim. PL.: 15,0000% | <b>Enquadrado</b> |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO<br><b>CNPJ:</b> 13.077.415/0001-05  | R\$ 1.118,66     | 455.800471    | 0,000029% | R\$ 3.853.684.843,62  | 0,0060%    | Lim. Resol.: 60,00%<br>Lim. Política: 60,00%<br>Lim. CNPJ: 20,00%<br>Lim. PL.: 15,0000% | <b>Enquadrado</b> |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO<br><b>CNPJ:</b> 13.077.415/0001-05  | R\$ 541.249,75   | 220533.263255 | 0,014045% | R\$ 3.853.684.843,62  | 2,9411%    | Lim. Resol.: 60,00%<br>Lim. Política: 60,00%<br>Lim. CNPJ: 20,00%<br>Lim. PL.: 15,0000% | <b>Enquadrado</b> |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI<br><b>CNPJ:</b> 13.077.418/0001-49 | R\$ 1.588.416,28 | 579335.851909 | 0,012245% | R\$ 12.971.898.325,20 | 8,6314%    | Lim. Resol.: 60,00%<br>Lim. Política: 60,00%<br>Lim. CNPJ: 20,00%<br>Lim. PL.: 15,0000% | <b>Enquadrado</b> |

## Por benchmark

### Benchmark

**% Carteira | Saldo do grupo**

#### IRF-M 1

**35,687728% | R\$ 6.567.504,98**

| Fundo  | % saldo    | Saldo            |
|--|------------|------------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI<br><b>CNPJ:</b> 11.328.882/0001-35 | 35,687728% | R\$ 6.567.504,98 |

#### IMA-B 5

**27,159542% | R\$ 4.998.088,69**

| Fundo  | % saldo    | Saldo            |
|--|------------|------------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI<br><b>CNPJ:</b> 03.543.447/0001-03 | 27,159542% | R\$ 4.998.088,69 |

#### IDKA 2

**25,453633% | R\$ 4.684.155,26**

| Fundo   | % saldo    | Saldo            |
|---|------------|------------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO<br><b>CNPJ:</b> 13.322.205/0001-35 | 25,453633% | R\$ 4.684.155,26 |

#### CDI

**11,621062% | R\$ 2.138.589,10**

| Fundo   | % saldo   | Saldo            |
|---|-----------|------------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO<br><b>CNPJ:</b> 13.077.415/0001-05  | 0,042409% | R\$ 7.804,41     |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO<br><b>CNPJ:</b> 13.077.415/0001-05  | 0,006079% | R\$ 1.118,66     |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO<br><b>CNPJ:</b> 13.077.415/0001-05  | 2,941143% | R\$ 541.249,75   |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI<br><b>CNPJ:</b> 13.077.418/0001-49 | 8,631431% | R\$ 1.588.416,28 |

**IRF-M****0,078035%****R\$ 14.360,52**

| Fundo  | % saldo   | Saldo         |
|--|-----------|---------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO<br><b>CNPJ:</b> 07.111.384/0001-69 | 0,078035% | R\$ 14.360,52 |

## Por administradores

### Administrador

% Carteira | Saldo do grupo

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

**100,0000% | R\$ 18.402.698,55**

| Fundo   | % saldo    | Saldo            |
|---|------------|------------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO<br><b>CNPJ:</b> 13.077.415/0001-05  | 0,042409%  | R\$ 7.804,41     |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO<br><b>CNPJ:</b> 13.077.415/0001-05  | 0,006079%  | R\$ 1.118,66     |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO<br><b>CNPJ:</b> 13.077.415/0001-05  | 2,941143%  | R\$ 541.249,75   |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO<br><b>CNPJ:</b> 13.322.205/0001-35                           | 25,453633% | R\$ 4.684.155,26 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI<br><b>CNPJ:</b> 03.543.447/0001-03                | 27,159542% | R\$ 4.998.088,69 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO<br><b>CNPJ:</b> 07.111.384/0001-69                            | 0,078035%  | R\$ 14.360,52    |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI<br><b>CNPJ:</b> 11.328.882/0001-35  | 35,687728% | R\$ 6.567.504,98 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI<br><b>CNPJ:</b> 13.077.418/0001-49 | 8,631431%  | R\$ 1.588.416,28 |

# 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\$ 1.107,21     | R\$ 0,00       | R\$ 0,00       | R\$ 1.118,66     | 0,0061%      | R\$ 11,45     | 1,0342%   | 1,0341%   |
| 13.077.415/0001-05 - BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI                      | R\$ 7.724,52     | R\$ 0,00       | R\$ 0,00       | R\$ 7.804,41     | 0,0424%      | R\$ 79,89     | 1,0342%   | 1,0342%   |
| 13.077.415/0001-05 - BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI                      | R\$ 426.242,57   | R\$ 271.263,06 | R\$ 160.187,08 | R\$ 541.249,75   | 2,9411%      | R\$ 3.931,20  | 1,0342%   | 0,5636%   |
| 13.322.205/0001-35 - BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI                                   | R\$ 4.617.832,63 | R\$ 0,00       | R\$ 0,00       | R\$ 4.684.155,26 | 25,4536%     | R\$ 66.322,63 | 1,4362%   | 1,4362%   |
| 03.543.447/0001-03 - BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI                | R\$ 4.930.310,08 | R\$ 0,00       | R\$ 0,00       | R\$ 4.998.088,69 | 27,1595%     | R\$ 67.778,61 | 1,3747%   | 1,3747%   |
| 07.111.384/0001-69 - BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI                                    | R\$ 14.244,17    | R\$ 0,00       | R\$ 0,00       | R\$ 14.360,52    | 0,0780%      | R\$ 116,35    | 0,8168%   | 0,8168%   |
| 11.328.882/0001-35 - BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI                               | R\$ 6.498.814,48 | R\$ 0,00       | R\$ 0,00       | R\$ 6.567.504,98 | 35,6877%     | R\$ 68.690,50 | 1,0570%   | 1,0570%   |
| 13.077.418/0001-49 - BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI | R\$ 1.570.764,32 | R\$ 0,00       | R\$ 0,00       | R\$ 1.588.416,28 | 8,6314%      | R\$ 17.651,96 | 1,1238%   | 1,1238%   |

| Tipo       | Saldo anterior    | Total aplicações | Total resgates | Saldo atual       | Total retorno  | Total retorno % | Total retorno efetivo |
|------------|-------------------|------------------|----------------|-------------------|----------------|-----------------|-----------------------|
| RENDA FIXA | R\$ 18.067.039,98 | R\$ 271.263,06   | R\$ 160.187,08 | R\$ 18.402.698,55 | R\$ 224.582,59 | 1,2447%         | 1,2247%               |
| Totais     | R\$ 18.067.039,98 | R\$ 271.263,06   | R\$ 160.187,08 | R\$ 18.402.698,55 | R\$ 224.582,59 | 1,2447%         | 1,2247%               |

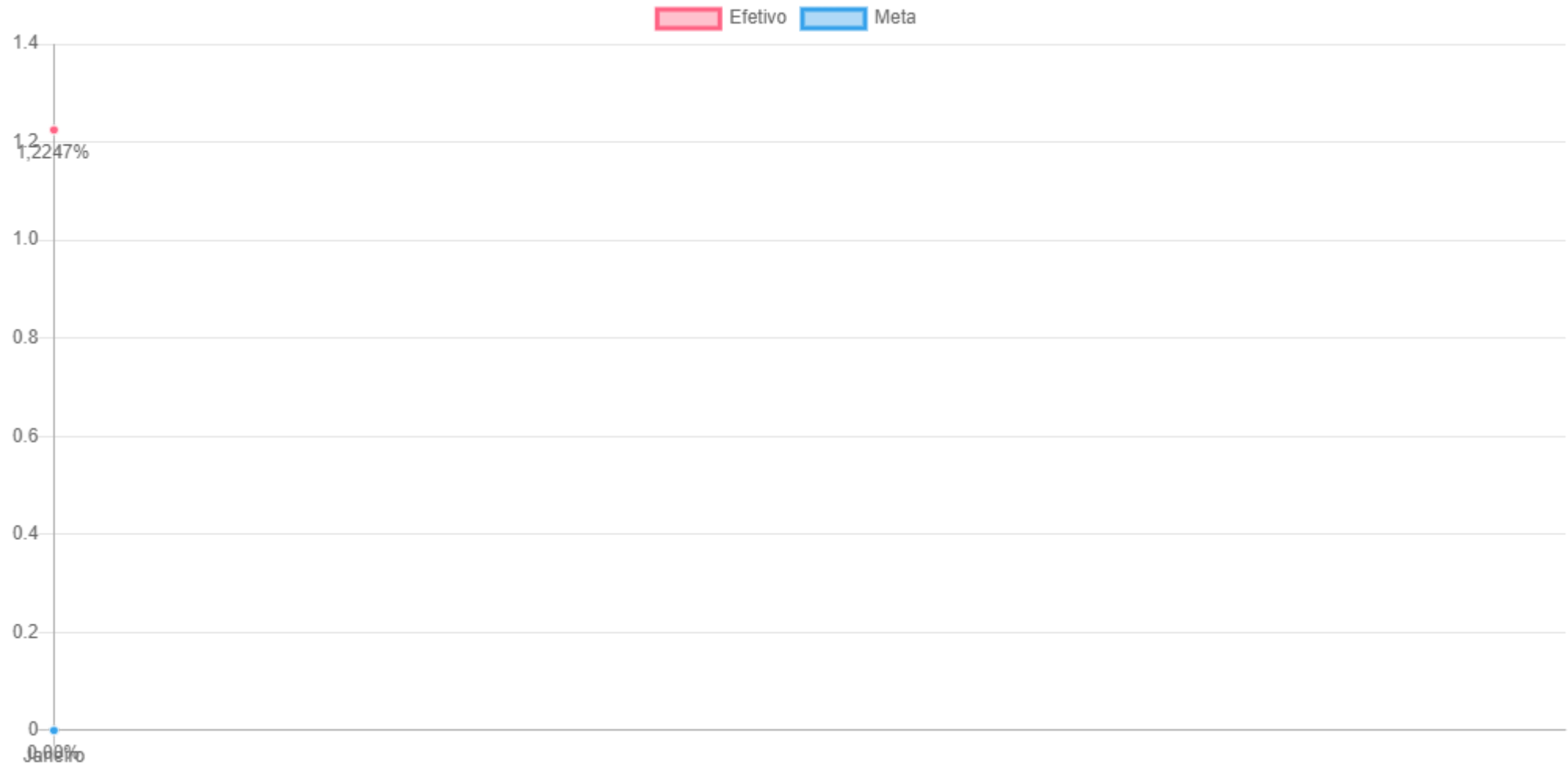


# Retornos acumulados

| Mês     | Saldo anterior    | Aplicações     | Resgates       | Saldo Atual       | Retorno R\$    | Efetivo % | Meta %  | Atingimento % |
|---------|-------------------|----------------|----------------|-------------------|----------------|-----------|---------|---------------|
| JANEIRO | R\$ 18.067.039,98 | R\$ 271.263,06 | R\$ 160.187,08 | R\$ 18.402.698,55 | R\$ 224.582,59 | 1,2247%   | 0,0000% | 0,0000%       |

|       | Total aplicações | Total Resgates | Total retorno R\$ | Efetivo % | Meta %  | Atingimento % |
|-------|------------------|----------------|-------------------|-----------|---------|---------------|
| Total | R\$ 271.263,06   | R\$ 160.187,08 | R\$ 224.582,59    | 1,2247%   | 0,0000% | ∞%            |

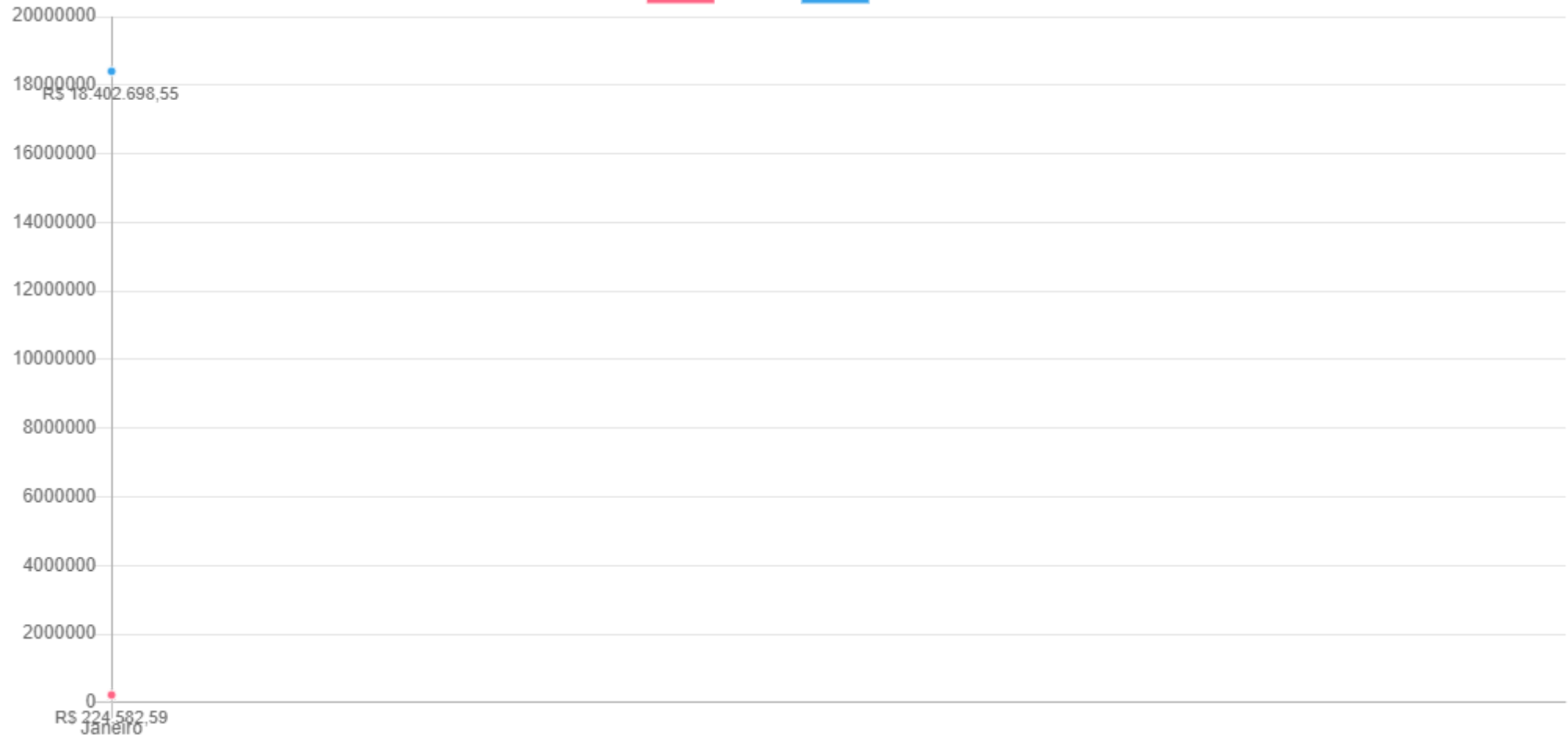
# Gráfico - retorno acumulado no ano



|         | Janeiro |
|---------|---------|
| Efetivo | 1,225%  |
| Meta    | 0,000%  |

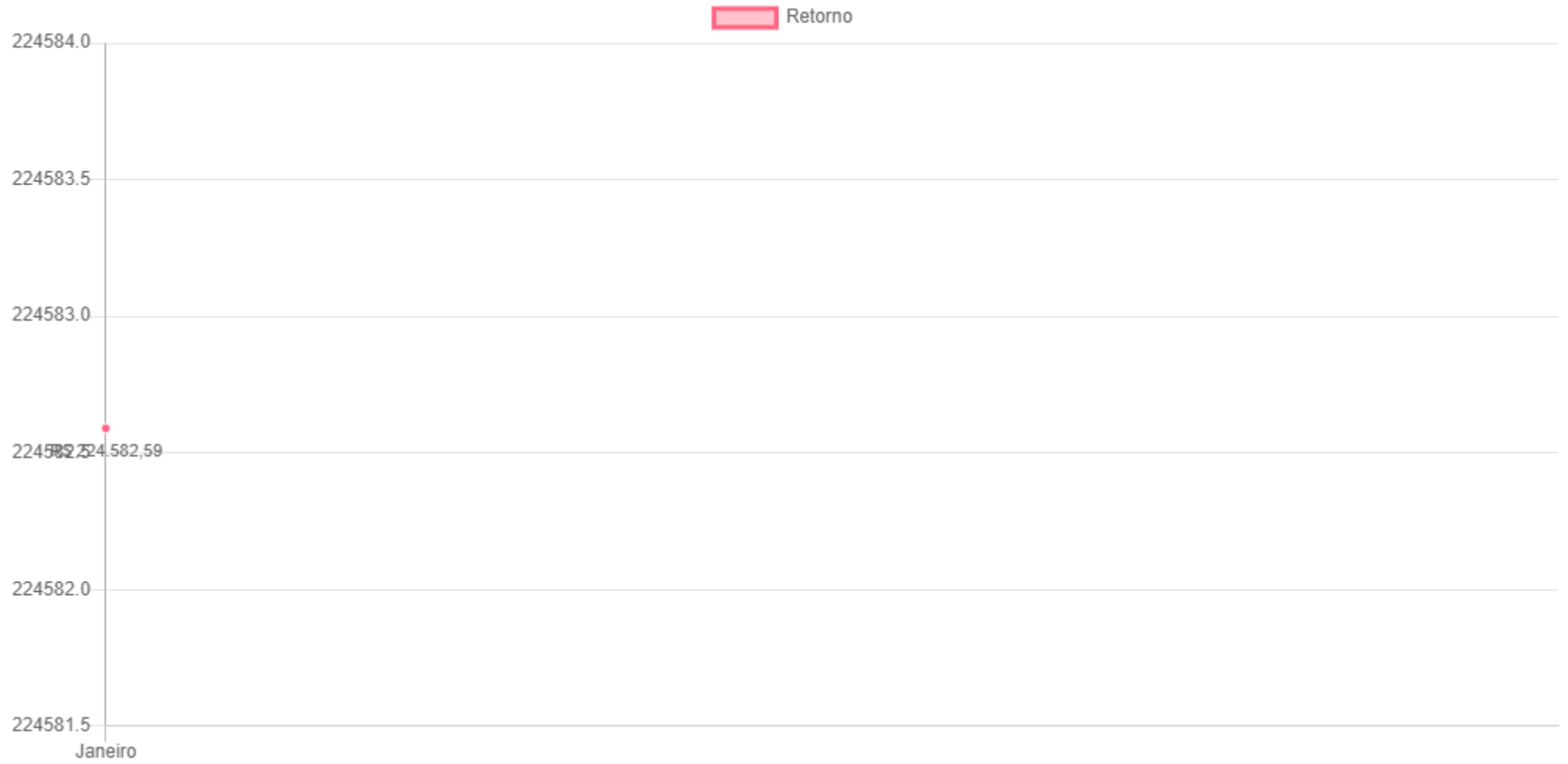
# Grafico - Evolução do patrimônio

Retorno Saldo



|                   |
|-------------------|
| Janeiro           |
| R\$ 18.402.698,55 |
| R\$ 224.582,59    |

# Grafico - Retorno mensal

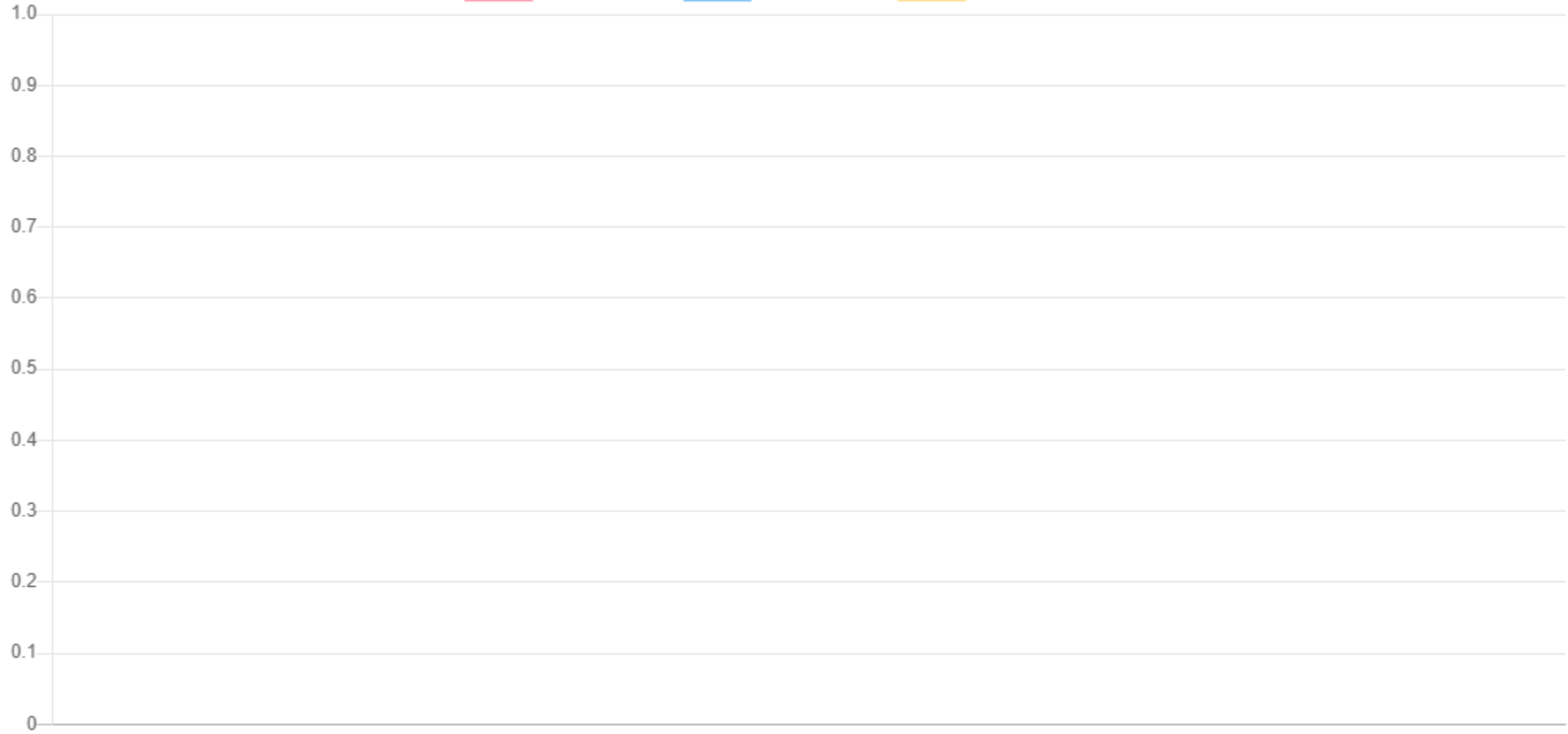




# Gráfico - Índices econômicos

## SELIC

Percentual mês    Percentual ano    Percentual 12M



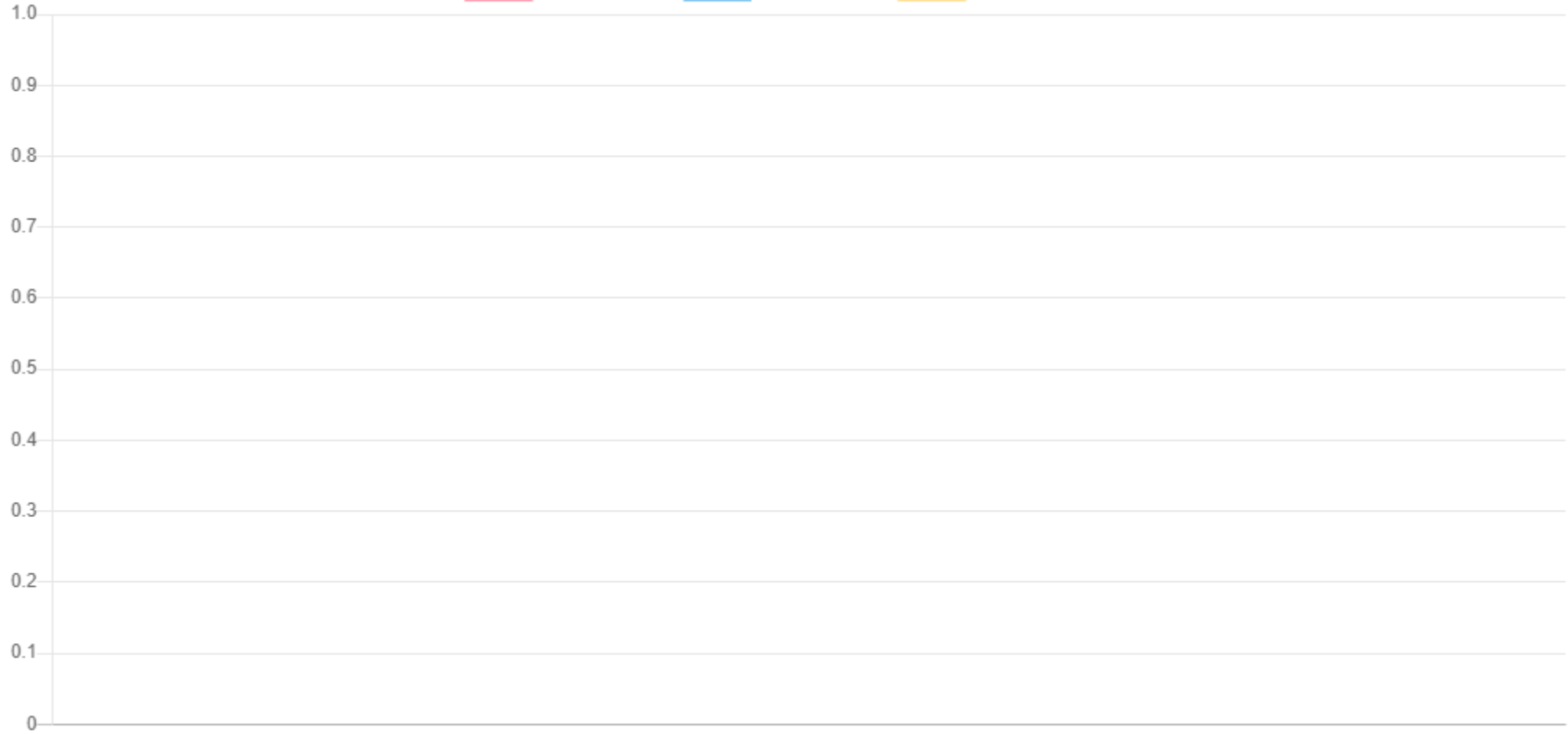
Mês

|                |
|----------------|
| Percentual mês |
| Percentual ano |
| Percentual 12M |

# Gráfico - Índices econômicos

## IPCA

Percentual mês    Percentual ano    Percentual 12M



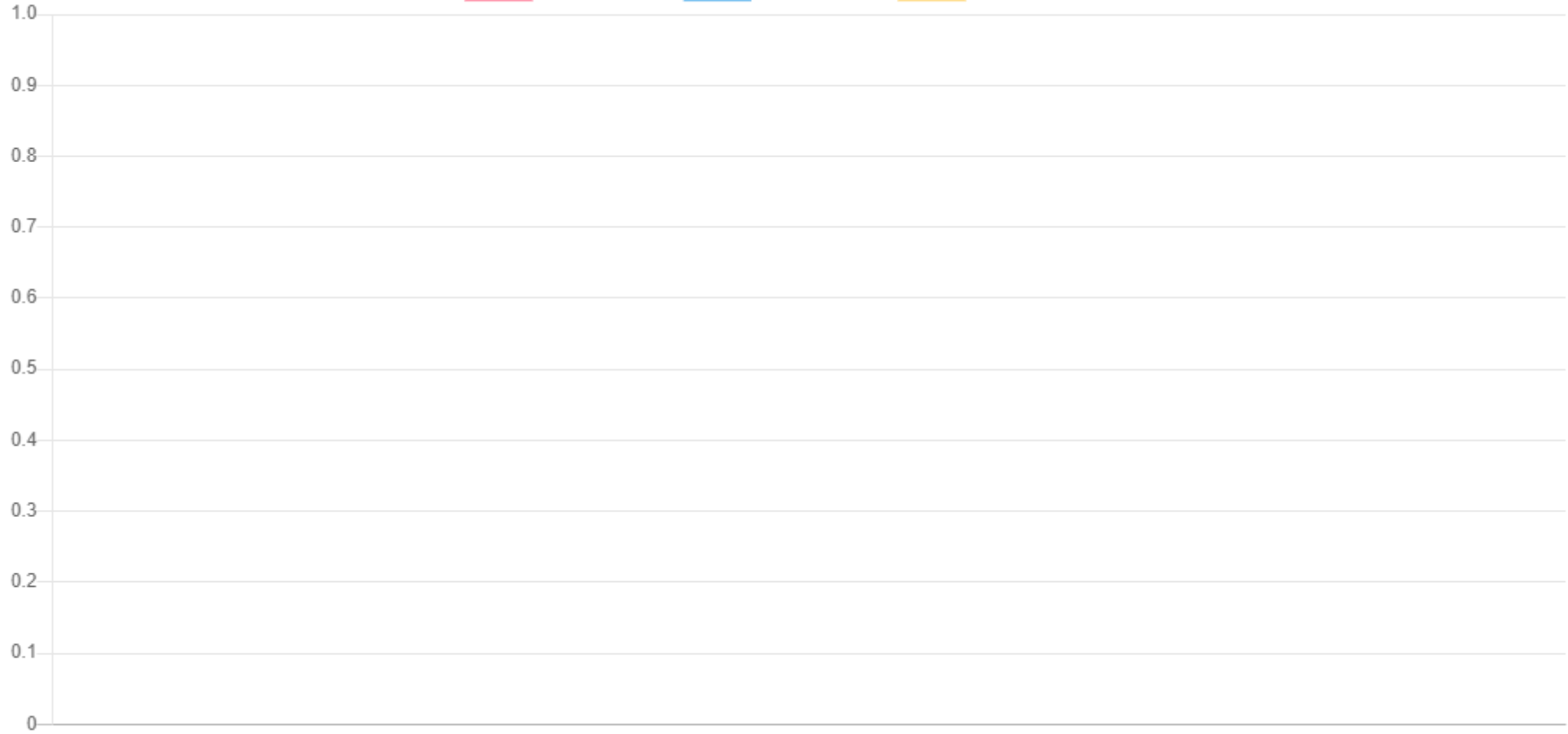
Mês

|                |
|----------------|
| 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       | 25,372682% | 0,000136% | 8,953076%  | 22,494816% | 55,288132% |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO  | CDI       | 25,372682% | 0,000136% | 8,953076%  | 22,494816% | 55,288132% |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO  | CDI       | 25,372682% | 0,000136% | 8,953076%  | 22,494816% | 55,288132% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                           | IDKA 2    | 33,878863% | 0,008142% | 11,376879% | 19,505292% | 38,695692% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI                | IMA-B 5   | 32,849330% | 0,006882% | 9,892916%  | 18,966137% | 40,095864% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                            | IRF-M     | 23,471801% | 0,004802% | 9,657640%  | 16,155496% | 49,584320% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI  | IRF-M 1   | 25,240137% | 0,000218% | 9,624415%  | 23,654034% | 58,016149% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | CDI       | 25,373974% | 0,000137% | 9,824307%  | 24,766013% | 61,038678% |

|       | Benchmark | Sharpe     | VAR 12M   | VOL 3M | VOL 6M | VOL 12M |
|-------|-----------|------------|-----------|--------|--------|---------|
| Geral |           | 27,116519% | 0,002574% |        |        |         |

## Provisão de risco - Mercado

| Nome | CNPJ Fundo | Benchmark | Saldo | VAR 12M | VOL 12M | VAR%<br>BASE 1 DIA<br>CONFIANÇA<br>95%<br>252 DU*<br>(R\$) |
|------|------------|-----------|-------|---------|---------|--|
|      |            |           |       |         |         |  |

|  |                    |         |                  |           |            |            |
|--|--------------------|---------|------------------|-----------|------------|------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO  | 13.077.415/0001-05 | CDI     | R\$ 7.804,41     | 0,136327% | 55,288132% | 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\$ 1.118,66     | 0,136327% | 55,288132% | R\$ 0,00   |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO  | 13.077.415/0001-05 | CDI     | R\$ 541.249,75   | 0,136327% | 55,288132% | R\$ 0,74   |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                           | 13.322.205/0001-35 | IDKA 2  | R\$ 4.684.155,26 | 8,141735% | 38,695692% | R\$ 381,37 |
| 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\$ 4.998.088,69 | 6,881945% | 40,095864% | R\$ 343,97 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                            | 07.111.384/0001-69 | IRF-M   | R\$ 14.360,52    | 4,802449% | 49,584320% | R\$ 0,69   |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI  | 11.328.882/0001-35 | IRF-M 1 | R\$ 6.567.504,98 | 0,218368% | 58,016149% | R\$ 14,34  |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI | 13.077.418/0001-49 | CDI     | R\$ 1.588.416,28 | 0,137416% | 61,038678% | R\$ 2,18   |

#### Risco de mercado

|                                      |                   |
|--------------------------------------|-------------------|
| Saldo Total                          | R\$ 18.402.698,55 |
| Provisão para perda e Investimentos: | R\$ 743,30        |
| % Provisão de perda                  | 0,004%            |
| % Aceitavel perda                    | 2,0%              |
| Limite de utilização                 | <b>0,202%</b>     |



| Prazo Resgate | Quantidade Fundos | % carteira | Saldo            |
|---------------|-------------------|------------|------------------|
| D + 0         | 6                 | 47,3868%   | R\$ 8.720.454,60 |
| D + 1         | 2                 | 52,6132%   | R\$ 9.682.243,95 |

