



DI BLASI
Consultoria Financeira

Instituto Municipal de Previdência de Portel - PA

Setembro 2023

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 | 0,03% | 999 | 0.00 | Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a" | R\$ 8.428,85 | B | Fundo de Investimento | 1,00% | |
| 13.077.415/0001-05 | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM C | 0 | 0,00% | 999 | 0.00 | Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a" | R\$ 1.208,17 | B | Fundo de Investimento | 1,00% | |
| 13.077.415/0001-05 | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM C | 0 | 5,19% | 999 | 0.04 | Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a" | R\$ 1.400.122,08 | B | Fundo de Investimento | 1,00% | |
| 13.322.205/0001-35 | BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI | 1 | 18,57% | 903 | 0.08 | Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b" | R\$ 5.014.592,75 | M | Fundo de Investimento | 0,20% | |
| 03.543.447/0001-03 | BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO F | 1 | 23,72% | 794 | 0.12 | Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b" | R\$ 6.404.670,15 | A | Fundo de Investimento | 0,20% | |
| 07.111.384/0001-69 | BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI | 0 | 0,06% | 598 | 0.00 | Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b" | R\$ 15.846,82 | M | Fundo de Investimento | 0,20% | |
| 11.328.882/0001-35 | BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI | 0 | 38,13% | 1,132 | 0.15 | Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b" | R\$ 10.295.322,84 | B | Fundo de Investimento | 0,20% | |
| 13.077.418/0001-49 | BB PREV RF REFERENCIADO DI LONC | 0 | 14,30% | 1,116 | 0.03 | Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a" | R\$ 3.860.854,36 | B | Fundo de Investimento | 0,20% | |
| | | | | | | | R\$ 27.001.046,02 | | | | |



Retorno do mês

| Nome Fundo | Saldo Inicial | Aplicações | Resgates | Saldo Final | Rentabilidade | Efetivo | Bench. |
|----------------------------------|-------------------|----------------|----------------|-------------------|---------------|---------|---------|
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI | R\$ 8.353,99 | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 8.428,85 | R\$ 74,86 | 0,8960% | CDI |
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI | R\$ 1.197,44 | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 1.208,17 | R\$ 10,73 | 0,8960% | CDI |
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI | R\$ 1.378.533,68 | R\$ 251.249,23 | R\$ 241.961,59 | R\$ 1.400.122,08 | R\$ 12.300,76 | 0,7547% | CDI |
| BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI | R\$ 5.003.999,23 | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 5.014.592,75 | R\$ 10.593,52 | 0,2117% | IDKA 2 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZ | R\$ 6.397.559,16 | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 6.404.670,15 | R\$ 7.110,99 | 0,1111% | IMA-B 5 |
| BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI | R\$ 15.824,73 | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 15.846,82 | R\$ 22,09 | 0,1395% | IRF-M |
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F | R\$ 10.203.073,15 | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 10.295.322,84 | R\$ 92.249,69 | 0,9041% | IRF-M 1 |
| BB PREV RF REFERENCIADO DI L | R\$ 3.823.764,53 | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 3.860.854,36 | R\$ 37.089,83 | 0,9699% | CDI |
| Total | 26,832,305.91 | 251,249.23 | 241,961.59 | 27,001,046.02 | 159,452.47 | 0,5887% | |

Enquadramentos

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

 % Carteira: : **80,48%**

 Saldo do grupo: **R\$ 21.730.432,56**

| Fundo | Saldo | N. Cotas | % PL | P. Liq. | % Carteira | Limites | Situação |
|--|-------------------|--------------|----------|------------------|------------|--|------------|
| BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI | R\$ 5.014.592,75 | 1,396,116.74 | 0,08270% | 6,063,437,379.24 | 18,57% | Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,08% | Enquadrado |
| BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI | R\$ 6.404.670,15 | 249,807.07 | 0,11744% | 5,453,684,801.95 | 23,72% | Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,12% | Enquadrado |
| BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI | R\$ 15.846,82 | 2,183.62 | 0,00044% | 3,601,727,255.66 | 0,06% | 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\$ 10.295.322,84 | 3,000,114.84 | 0,14648% | 7,028,296,292.55 | 38,13% | Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,15% | Enquadrado |

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

 % Carteira: : **19,52%**

 Saldo do grupo: **R\$ 5.270.613,46**

| Fundo | Saldo | N. Cotas | % PL | P. Liq. | % Carteira | Limites | Situação |
|---|------------------|--------------|----------|-------------------|------------|--|------------|
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI | R\$ 8.428,85 | 3,179.92 | 0,00025% | 3,380,807,738.12 | 0,03% | 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\$ 1.208,17 | 455.80 | 0,00004% | 3,380,807,738.12 | 0,00% | 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\$ 1.400.122,08 | 528,219.02 | 0,04141% | 3,380,807,738.12 | 5,19% | Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,04% | Enquadrado |
| BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI | R\$ 3.860.854,36 | 1,296,085.90 | 0,02530% | 15,259,689,366.93 | 14,30% | Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,03% | Enquadrado |

Enquadramento por Benchmark

CDI

 % Carteira: **19,52%**

 Saldo do grupo: **R\$ 5.270.613,46**

| Nome fundo | Saldo | Saldo cotas | %PL | % Carteira | Limites | Situação |
|---|------------------|--------------|------|------------|---|------------|
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI | R\$ 8.428,85 | 3,179.92 | 0.00 | 0.03 | Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00% | Enquadrado |
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI | R\$ 1.208,17 | 455.80 | 0.00 | 0.00 | Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00% | Enquadrado |
| BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI | R\$ 3.860.854,36 | 1,296,085.90 | 0.03 | 14.30 | Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00% | Enquadrado |
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI | R\$ 1.400.122,08 | 528,219.02 | 0.04 | 5.19 | Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00% | Enquadrado |

IDKA 2

 % Carteira: **18,57%**

 Saldo do grupo: **R\$ 5.014.592,75**

| Nome fundo | Saldo | Saldo cotas | %PL | % Carteira | Limites | Situação |
|-------------------------------|------------------|--------------|------|------------|--|------------|
| BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI | R\$ 5.014.592,75 | 1,396,116.74 | 0.08 | 18.57 | Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00% | Enquadrado |

IMA-B 5

 % Carteira: **23,72%**

 Saldo do grupo: **R\$ 6.404.670,15**

| Nome fundo | Saldo | Saldo cotas | %PL | % Carteira | Limites | Situação |
|--|------------------|-------------|------|------------|--|------------|
| BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI | R\$ 6.404.670,15 | 249,807.07 | 0.12 | 23.72 | Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00% | Enquadrado |



IRF-M

% Carteira: **0,06%**

Saldo do grupo: **R\$ 15.846,82**

| Nome fundo | Saldo | Saldo cotas | %PL | % Carteira | Limites | Situação |
|------------------------------|---------------|-------------|------|------------|--|------------|
| BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI | R\$ 15.846,82 | 2,183.62 | 0.00 | 0.06 | Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00% | Enquadrado |

IRF-M 1

% Carteira: **38,13%**

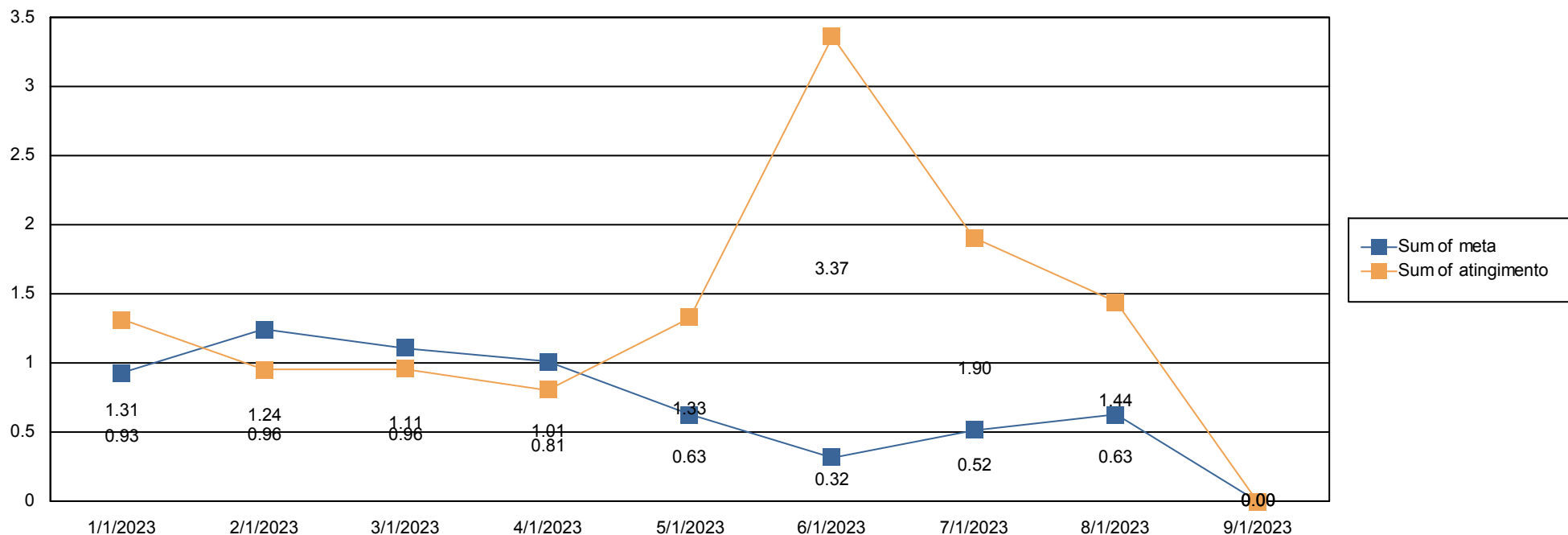
Saldo do grupo: **R\$ 10.295.322,84**

| Nome fundo | Saldo | Saldo cotas | %PL | % Carteira | Limites | Situação |
|-----------------------------------|-------------------|--------------|------|------------|--|------------|
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI | R\$ 10.295.322,84 | 3,000,114.84 | 0.15 | 38.13 | Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00% | Enquadrado |

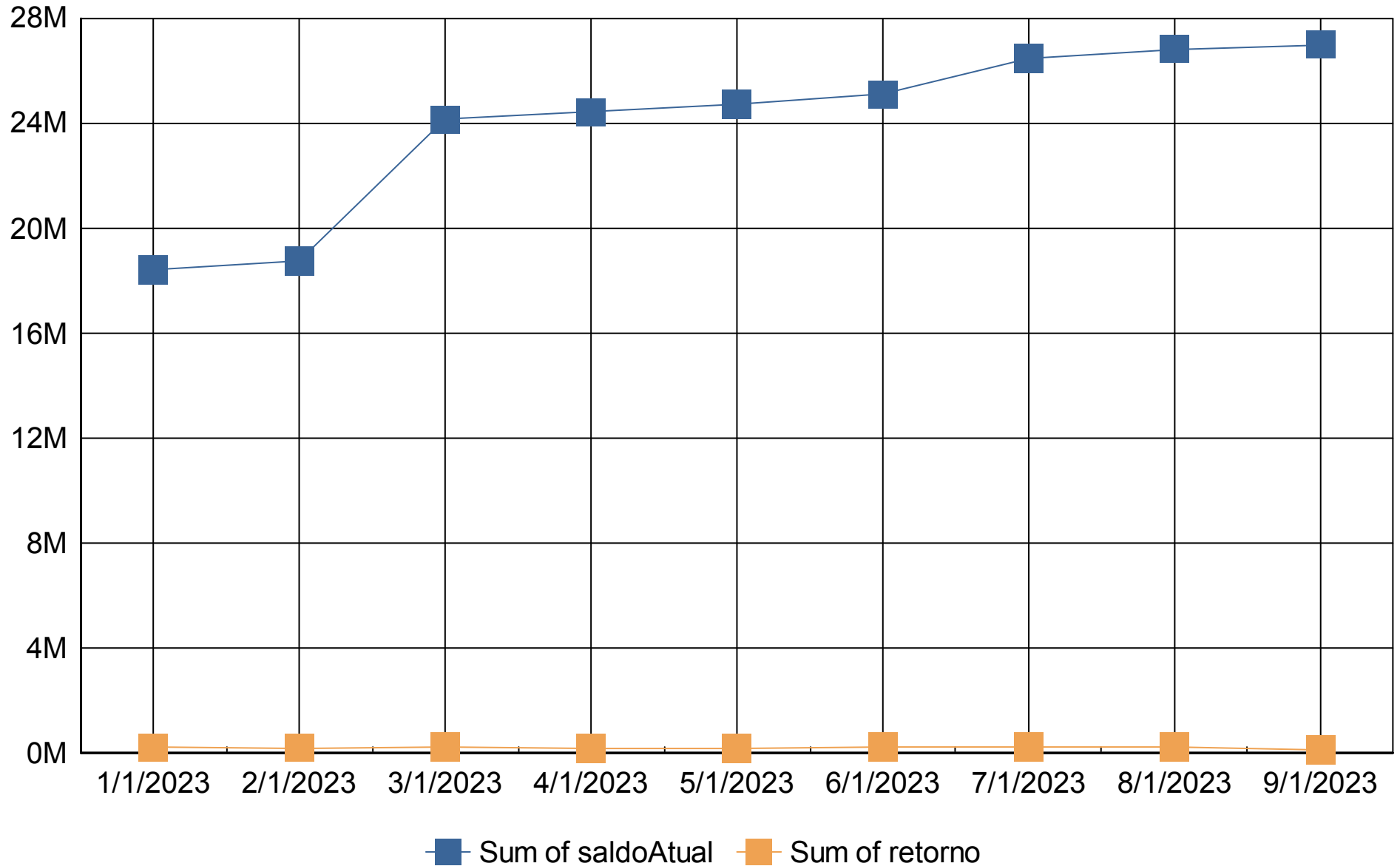
Retorno acumulado no ano

| Período | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno R\$ | Retorno % | Meta | Atingimento |
|--------------|-------------------|------------------|----------------|-------------------|----------------|-----------|---------|-------------|
| Janeiro | R\$ 18.067.039,98 | R\$ 271.263,06 | R\$ 160.187,08 | R\$ 18.402.698,55 | R\$ 224.582,59 | 1,2247% | 0,9315 | 131,4722% |
| Fevereiro | R\$ 18.402.698,55 | R\$ 272.174,56 | R\$ 138.512,84 | R\$ 18.758.027,89 | R\$ 221.667,62 | 1,1870% | 1,2428 | 95,5088% |
| Março | R\$ 18.758.027,89 | R\$ 5.214.426,61 | R\$ 93.667,63 | R\$ 24.135.397,16 | R\$ 256.610,29 | 1,0704% | 1,1122 | 96,2451% |
| Abril | R\$ 24.135.397,16 | R\$ 199.136,69 | R\$ 112.490,95 | R\$ 24.421.169,01 | R\$ 199.126,11 | 0,8183% | 1,0118 | 80,8743% |
| Mai | R\$ 24.421.169,01 | R\$ 244.372,11 | R\$ 164.510,30 | R\$ 24.708.276,24 | R\$ 207.245,42 | 0,8402% | 0,6303 | 133,3052% |
| Junho | R\$ 24.708.276,24 | R\$ 267.729,56 | R\$ 153.766,79 | R\$ 25.090.552,40 | R\$ 268.313,39 | 1,0743% | 0,3191 | 336,6608% |
| Julho | R\$ 25.090.552,40 | R\$ 1.225.095,53 | R\$ 97.641,25 | R\$ 26.478.603,98 | R\$ 260.597,30 | 0,9903% | 0,5199 | 190,4741% |
| Agosto | R\$ 26.478.603,98 | R\$ 272.174,56 | R\$ 161.716,42 | R\$ 26.832.305,91 | R\$ 243.243,79 | 0,9093% | 0,6303 | 144,2640% |
| Setembro | R\$ 26.832.305,91 | R\$ 251.249,23 | R\$ 241.961,59 | R\$ 27.001.046,02 | R\$ 159.452,47 | 0,5887% | 0,0000 | 0,0000% |
| Total | | 8,217,621.91 | 1,324,454.85 | | 2,040,838.98 | 9,0458% | 6,5761% | 137,5564% |

Meta x Atingimento

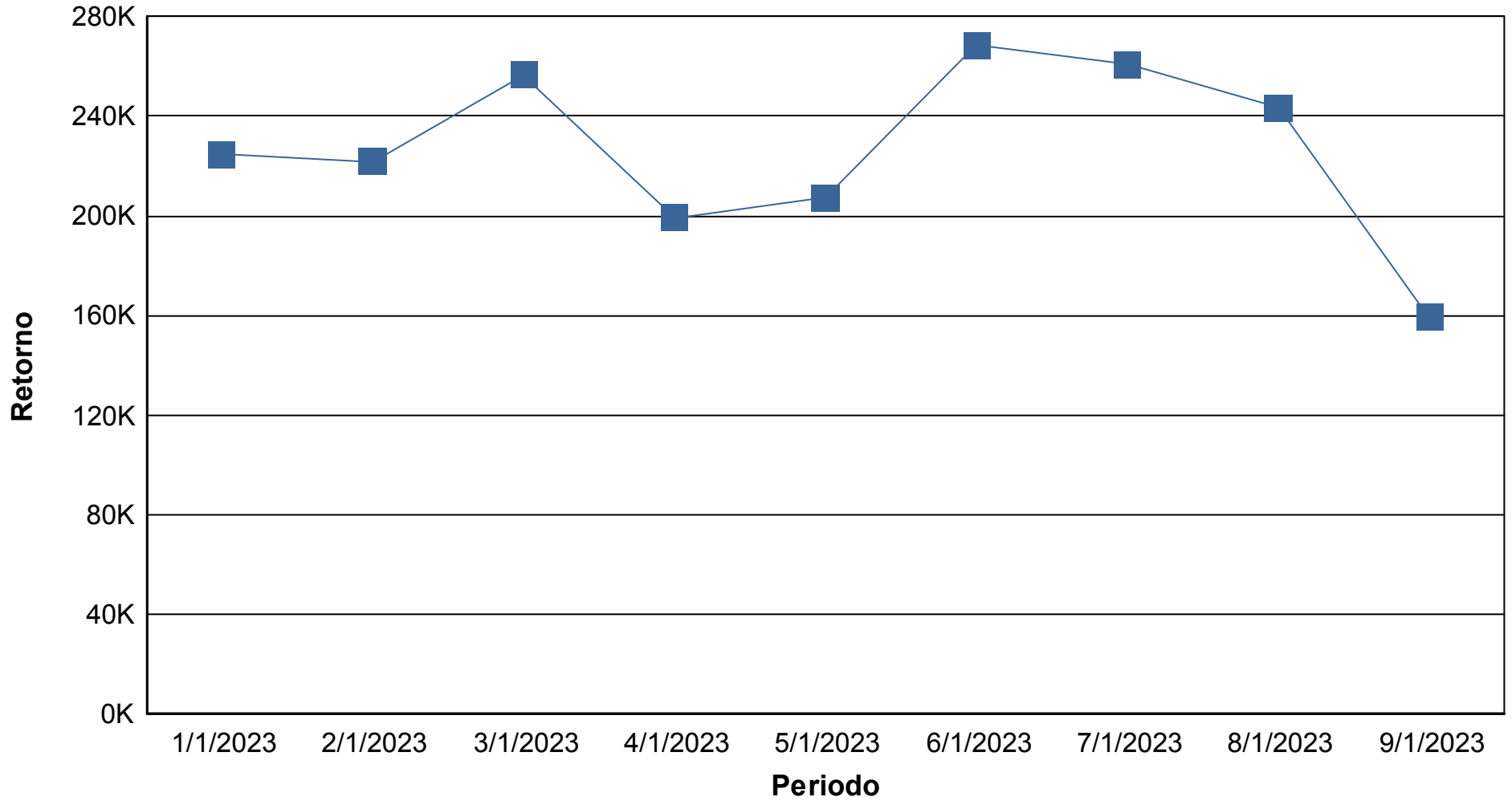


Evolução do patrimônio

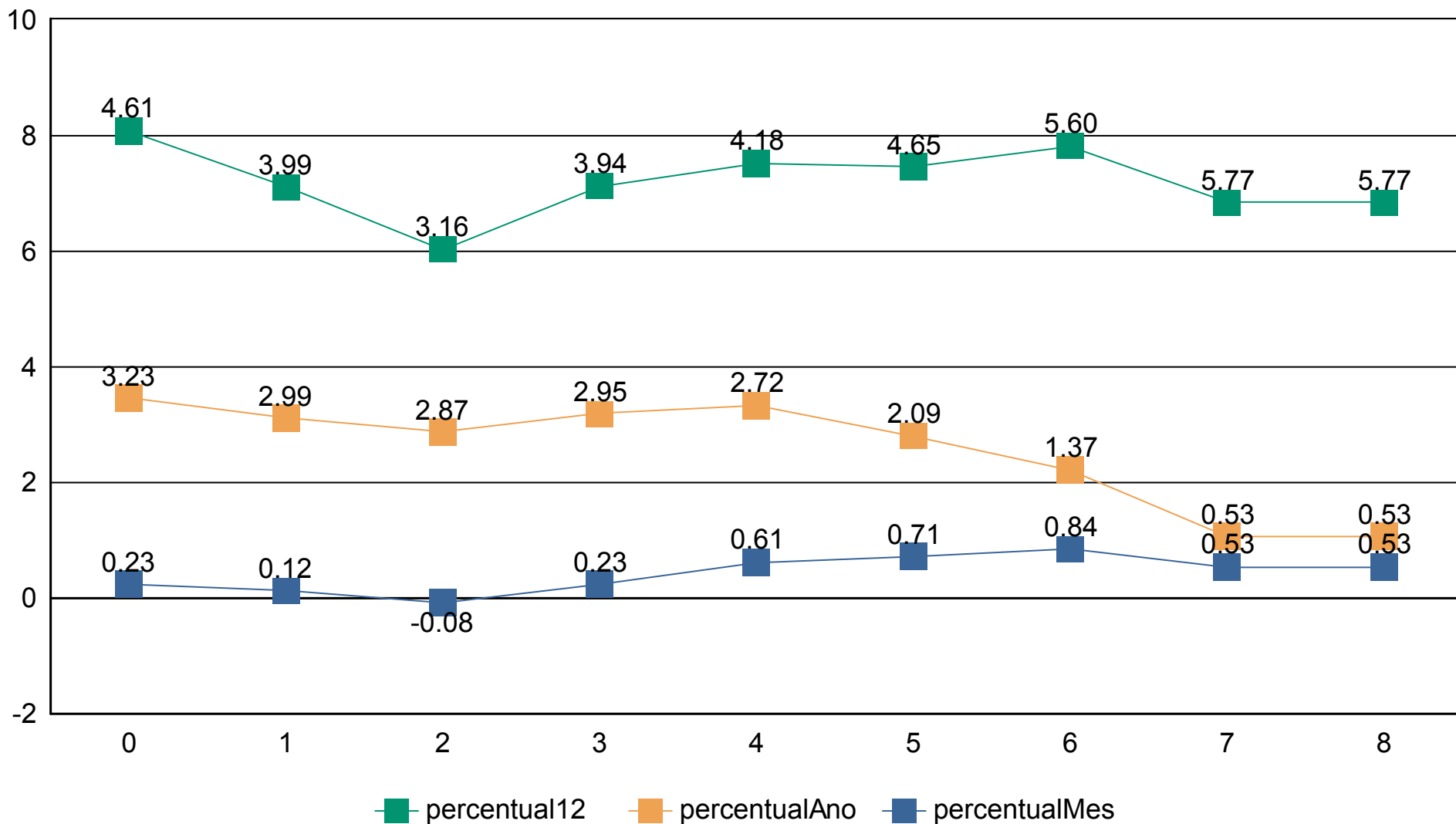




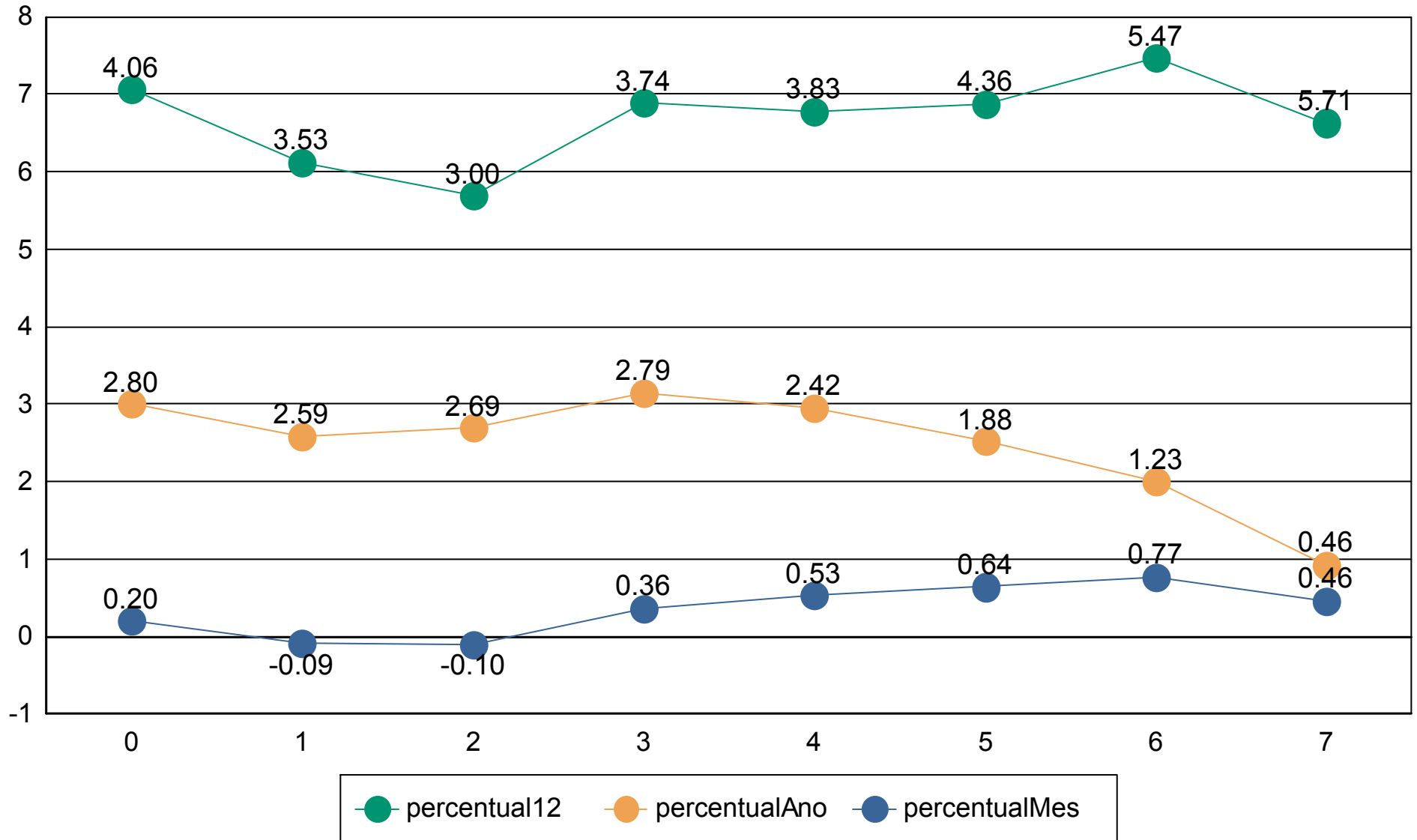
Retorno Mensal



Índices Econômicos - IPCA

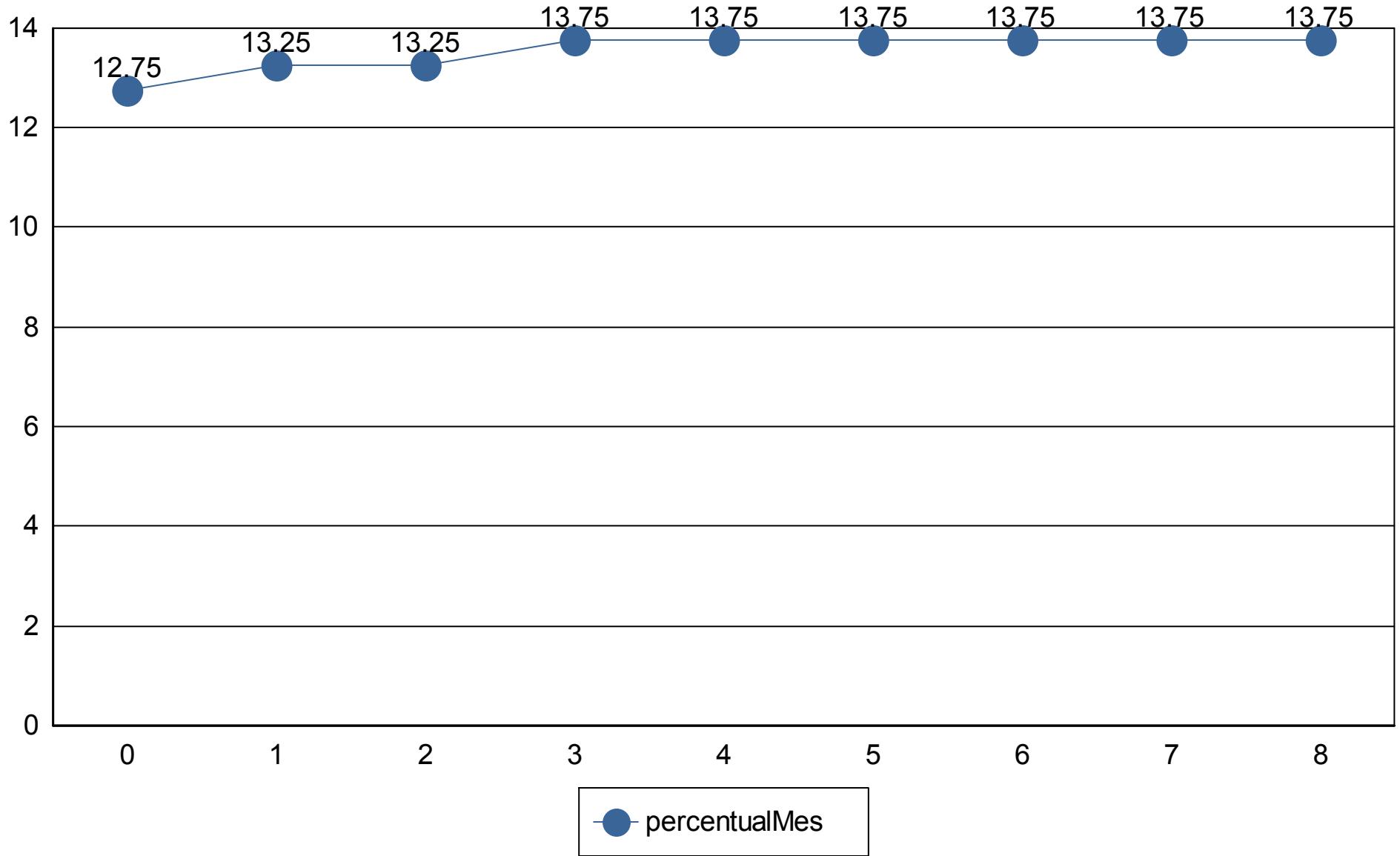


Índices Econômicos - INPC





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 | 25,67% | 0,00% | 9,16% | 25,21% | 61,47% |
| 13.077.415/0001-05 | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI | CDI | 26,05% | 0,00% | 8,77% | 23,15% | 56,83% |
| 13.077.415/0001-05 | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI | CDI | 26,05% | 0,00% | 8,77% | 23,15% | 56,83% |
| 13.077.415/0001-05 | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI | CDI | 26,05% | 0,00% | 8,77% | 23,15% | 56,83% |
| 07.111.384/0001-69 | BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI | IRF-M | 20,91% | 0,01% | 4,23% | 28,85% | 74,78% |
| 03.543.447/0001-03 | BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI | IMA-B 5 | 24,51% | 0,00% | 3,34% | 16,96% | 56,10% |
| 13.322.205/0001-35 | BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI | IDKA 2 | 24,87% | 0,00% | 4,47% | 17,15% | 54,41% |
| 13.077.418/0001-49 | BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI | CDI | 25,99% | 0,00% | 9,65% | 25,45% | 61,62% |
| | | | 200,08% | 0,01% | 57,18% | 183,07% | 478,87% |

Provisão de risco - Mercado

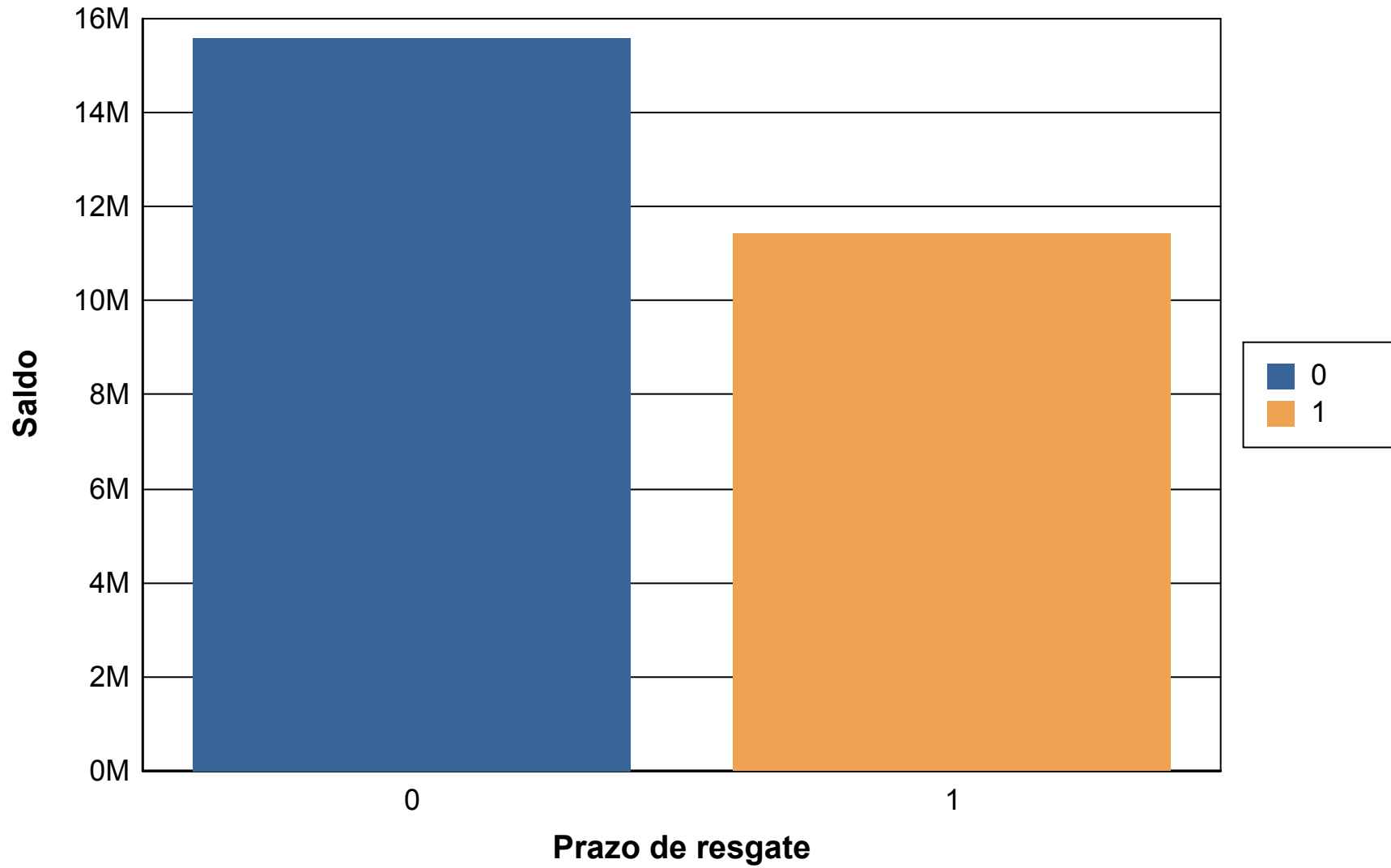
| CNPJ | Nome do fundo | Benchmark | Saldo | VAR12 | VOL12 | VAR% BASE 1 |
|--------------------|--|-----------|-------------------|-------|--------|-------------|
| 13.077.415/0001-05 | BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO C | CDI | R\$ 8.428,85 | 0,00% | 56,83% | R\$ 0,01 |
| 13.077.415/0001-05 | BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO C | CDI | R\$ 1.208,17 | 0,00% | 56,83% | R\$ 0,00 |
| 13.077.415/0001-05 | BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO C | CDI | R\$ 1.400.122,08 | 0,00% | 56,83% | R\$ 0,85 |
| 13.322.205/0001-35 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS | IDKA 2 | R\$ 5.014.592,75 | 0,00% | 54,41% | R\$ 213,96 |
| 03.543.447/0001-03 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FL | IMA-B 5 | R\$ 6.404.670,15 | 0,00% | 56,10% | R\$ 225,96 |
| 07.111.384/0001-69 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS | IRF-M | R\$ 15.846,82 | 0,01% | 74,78% | R\$ 1,03 |
| 11.328.882/0001-35 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO | IRF-M 1 | R\$ 10.295.322,84 | 0,00% | 61,47% | R\$ 13,21 |

| | |
|-------------------------------------|--------------------------|
| Saldo Total: | R\$ 23.140.191,66 |
| Provisão para perda e Investimentos | R\$ 455,03 |
| % Provisão de perda | 0,00% |
| % Aceitavel perda | 2% |
| Limite de utilização | 0,10% |



| Nome do Fundo | Saldo | % Part. | N. Cotistas | % PL | PL do Fundo | Legislação | Grau risco | Prazo Resgate |
|---|-------------------|---------|-------------|-------|-----------------------|---------------|------------|---------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE | R\$ 8.428,85 | 0,03% | 999 | 0,00% | R\$ 3.380.807.738,12 | da Fixa (CVM) | Baixo | D+ 0 |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE | R\$ 1.208,17 | 0,00% | 999 | 0,00% | R\$ 3.380.807.738,12 | da Fixa (CVM) | Baixo | D+ 0 |
| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE | R\$ 1.400.122,08 | 5,19% | 999 | 0,04% | R\$ 3.380.807.738,12 | da Fixa (CVM) | Baixo | D+ 0 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULO | R\$ 5.014.592,75 | 18,57% | 903 | 0,08% | R\$ 6.063.437.379,24 | ixa 100% TP/E | Médio | D+ 1 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO | R\$ 6.404.670,15 | 23,72% | 794 | 0,12% | R\$ 5.453.684.801,95 | ixa 100% TP/E | Alto | D+ 1 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS | R\$ 15.846,82 | 0,06% | 598 | 0,00% | R\$ 3.601.727.255,66 | ixa 100% TP/E | Médio | D+ 0 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS | R\$ 10.295.322,84 | 38,13% | 1.132 | 0,15% | R\$ 7.028.296.292,55 | ixa 100% TP/E | Baixo | D+ 0 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADA | R\$ 3.860.854,36 | 14,30% | 1.116 | 0,03% | R\$ 15.259.689.366,93 | da Fixa (CVM) | Baixo | D+ 0 |

| Prazo Resgate | Saldo | N. Fundo | % Carteira |
|---------------|-------------------|----------|------------|
| 0 | R\$ 15.581.783,12 | 6 | 57,71% |
| 1 | R\$ 11.419.262,90 | 2 | 42,29% |



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\$ 21.730.432,56 | 80,48 |
| Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a" | 60,00% | 60,00% | R\$ 5.270.613,46 | 19,52 |

| | Saldo | % Carteira |
|---|----------------------|------------|
| 100% títulos públicos | 0.00 | 0.00 |
| 50% Títulos publicos e 50% Títulos privados | 0.00 | 0.00 |
| 100% títulos privados | 27,001,046.02 | 100.00 |

Distribuição dos saldos

