

Mês/Ano
12/2023



Filtrar

Data do último saldo: 29/12/2023

Versão para impressão



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\$ 8.646,10	0,02978%	989	0,00021%	R\$ 4.049.178.389,19	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 Banco: BANCO DO BRASIL Agência: 2486-4 Conta: 16623-5	R\$ 1.239,31	0,00427%	989	0,00003%	R\$ 4.049.178.389,19	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 Banco: 001 Agência: 2486-4 Conta: 27249-3	R\$ 1.453.154,44	5,00469%	989	0,03589%	R\$ 4.049.178.389,19	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 Banco: 001 Agência: 2486-4 Conta: 9683-0	R\$ 5.159.250,22	17,76856%	884	0,08898%	R\$ 5.798.399.930,42	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 Banco: 001 Agência: 2486-4 Conta: 9683-0	R\$ 6.591.864,19	22,70251%	789	0,12602%	R\$ 5.230.672.087,91	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 Banco: BANCO DO BRASIL Agência: 2486-4 Conta: 16623-5	R\$ 16.532,24	0,05694%	633	0,00041%	R\$ 4.067.997.534,34	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 Banco: BANCO DO BRASIL Agência: 2486-4 Conta: 9683-0	R\$ 11.834.986,71	40,75993%	1141	0,15072%	R\$ 7.852.193.725,16	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 Banco: 001 Agência: 2486-4 Conta: 9683-0	R\$ 3.970.160,43	13,67331%	1133	0,0241%	R\$ 16.475.113.370,57	Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	Baixo	Fundo de Investimento
Total	R\$ 29.035.833,64							

Enquadramentos

Resolução

% Carteira | Saldo do grupo |

Situação

(RPPS) - Res. 4.963/2021 - Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º T "h" **81,287948% | R\$ 23.602.633,36 |**

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\$ 5.159.250,22	1396116.735825	0,088977%	R\$ 5.798.399.930,42	17,7685%	Lim. Resol.: 100,00% Lim. Política: 100,00% Lim. CNPJ: 100,00% Lim. PL.: 100,0000%	Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 03.543.447/0001-03	R\$ 6.591.864,19	249807.069248	0,126023%	R\$ 5.230.672.087,91	22,7025%	Lim. Resol.: 100,00% Lim. Política: 100,00% Lim. CNPJ: 100,00% Lim. PL.: 100,0000%	Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 07.111.384/0001-69	R\$ 16.532,24	2183.623226	0,000406%	R\$ 4.067.997.534,34	0,0569%	Lim. Resol.: 100,00% Lim. Política: 100,00% Lim. CNPJ: 100,00% Lim. PL.: 100,0000%	Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35	R\$ 11.834.986,71	3354738.027747	0,150722%	R\$ 7.852.193.725,16	40,7599%	Lim. Resol.: 100,00% Lim. Política: 100,00% Lim. CNPJ: 100,00% Lim. PL.: 100,0000%	Enquadrado

(RPPS) - Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, TTT "a" **18,712052% | R\$ 5.433.200,28 |**

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\$ 8.646,10	3179.922499	0,000214%	R\$ 4.049.178.389,19	0,0297%	Lim. Resol.: 60,00% Lim. Política: 60,00% 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\$ 1.239,31	455.800471	0,000031%	R\$ 4.049.178.389,19	0,0042%	Lim. Resol.: 60,00% Lim. Política: 60,00% 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\$ 1.453.154,44	534451.363436	0,035888%	R\$ 4.049.178.389,19	5,0046%	Lim. Resol.: 60,00% Lim. Política: 60,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 13.077.418/0001-49	R\$ 3.970.160,43	1296085.899536	0,024098%	R\$ 16.475.113.370,57	13,6733%	Lim. Resol.: 60,00% Lim. Política: 60,00% Lim. CNPJ: 20,00% Lim. PL.: 15,0000%	Enquadrado

Por benchmark

Benchmark

% Carteira | Saldo do grupo

IRF-M 1

40,759934% | R\$ 11.834.986,71

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35	40,759934%	R\$ 11.834.986,71

IMA-B 5

22,702514% | R\$ 6.591.864,19

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	22,702514%	R\$ 6.591.864,19

CDI

18,712052% | R\$ 5.433.200,28

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	0,029777%	R\$ 8.646,10
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	0,004268%	R\$ 1.239,31
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	5,004693%	R\$ 1.453.154,44
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 13.077.418/0001-49	13,673313%	R\$ 3.970.160,43

IDKA 2

17,768562% | R\$ 5.159.250,22

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.322.205/0001-35	17,768562%	R\$ 5.159.250,22

IRF-M**0,056937%****R\$ 16.532,24**

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 07.111.384/0001-69	0,056937%	R\$ 16.532,24

Por administradores

Administrador

% Carteira | Saldo do grupo

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

100,0000% | R\$ 29.035.833,64

Fundo	% saldo	Saldo
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	0,029777%	R\$ 8.646,10
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	0,004268%	R\$ 1.239,31
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05	5,004693%	R\$ 1.453.154,44
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.322.205/0001-35	17,768562%	R\$ 5.159.250,22
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 03.543.447/0001-03	22,702514%	R\$ 6.591.864,19
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 07.111.384/0001-69	0,056937%	R\$ 16.532,24
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI CNPJ: 11.328.882/0001-35	40,759934%	R\$ 11.834.986,71
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 13.077.418/0001-49	13,673313%	R\$ 3.970.160,43

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\$ 1.229,22	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.239,31	0,0043%	R\$ 10,09	0,8206%	0,8208%
13.077.415/0001-05 - BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 8.575,72	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 8.646,10	0,0298%	R\$ 70,38	0,8206%	0,8207%
13.077.415/0001-05 - BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.502.470,36	R\$ 267.053,21	R\$ 328.538,42	R\$ 1.453.154,44	5,0047%	R\$ 12.169,29	0,8206%	0,6877%
13.322.205/0001-35 - BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 5.087.286,32	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 5.159.250,22	17,7686%	R\$ 71.963,90	1,4146%	1,4146%
03.543.447/0001-03 - BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 6.497.998,94	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 6.591.864,19	22,7025%	R\$ 93.865,25	1,4445%	1,4445%
07.111.384/0001-69 - BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 16.294,50	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 16.532,24	0,0569%	R\$ 237,74	1,4590%	1,4590%
11.328.882/0001-35 - BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 10.491.010,33	R\$ 1.250.000,00	R\$ 0,00	R\$ 11.834.986,71	40,7599%	R\$ 93.976,38	0,8857%	0,8004%
13.077.418/0001-49 - BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 3.934.662,72	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 3.970.160,43	13,6733%	R\$ 35.497,71	0,9022%	0,9022%

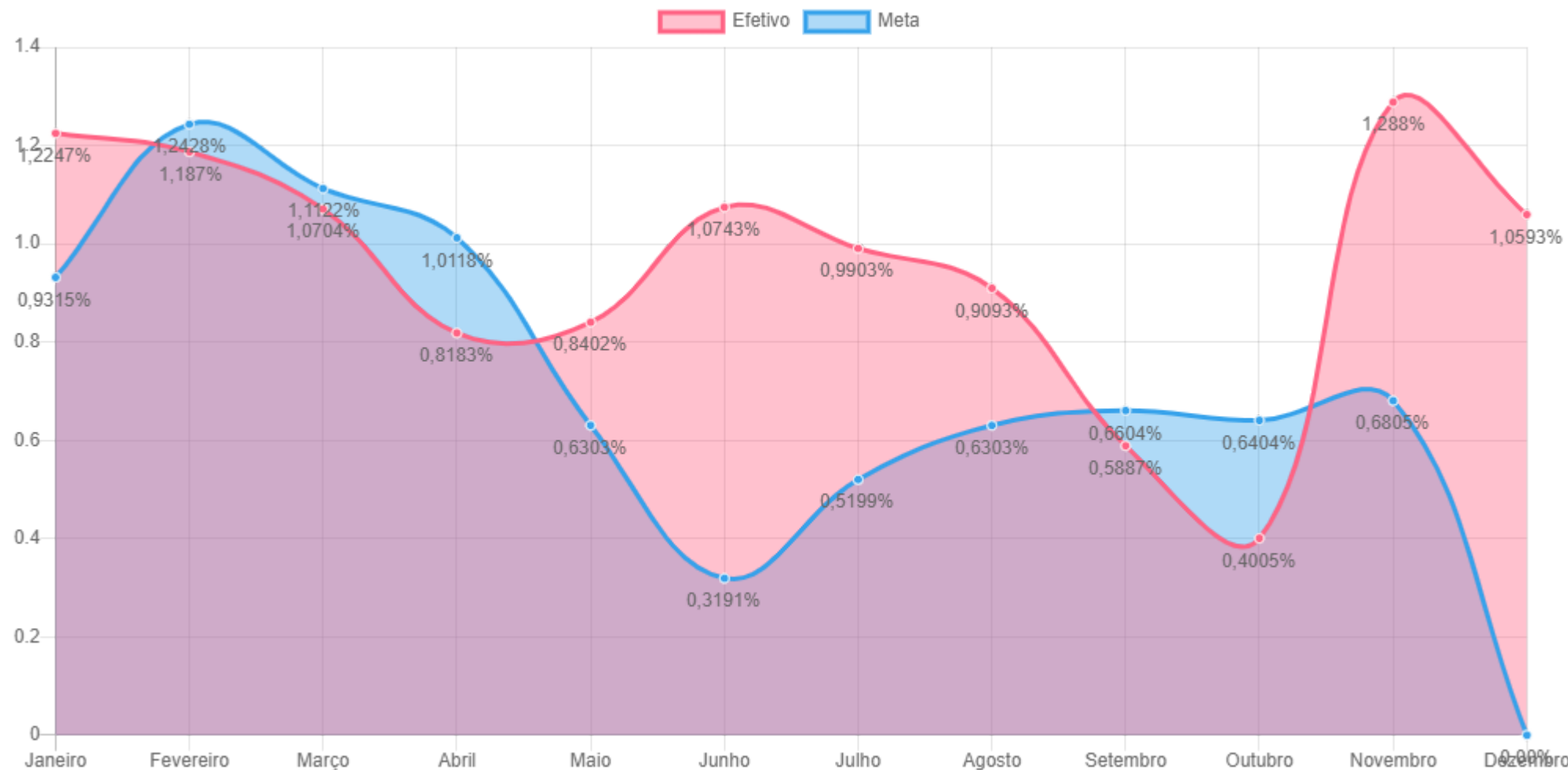
Tipo	Saldo anterior	Total aplicações	Total resgates	Saldo atual	Total retorno	Total retorno %	Total retorno efetivo
RENDA FIXA	R\$ 27.539.528,11	R\$ 1.517.053,21	R\$ 328.538,42	R\$ 29.035.833,64	R\$ 307.790,74	1,1059%	1,0593%
Totais	R\$ 27.539.528,11	R\$ 1.517.053,21	R\$ 328.538,42	R\$ 29.035.833,64	R\$ 307.790,74	1,1059%	1,0593%

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%	0,9315%	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%
MAIO	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%	0,6604%	89,1494%
OUTUBRO	R\$ 27.001.046,02	R\$ 231.759,98	R\$ 161.543,34	R\$ 27.180.342,06	R\$ 109.079,40	0,4005%	0,6404%	62,5459%
NOVEMBRO	R\$ 27.180.342,06	R\$ 193.542,54	R\$ 186.932,90	R\$ 27.539.528,11	R\$ 352.576,41	1,2880%	0,6805%	189,2730%
DEZEMBRO	R\$ 27.539.528,11	R\$ 1.517.053,21	R\$ 328.538,42	R\$ 29.035.833,64	R\$ 307.790,74	1,0593%	0,0000%	0,0000%

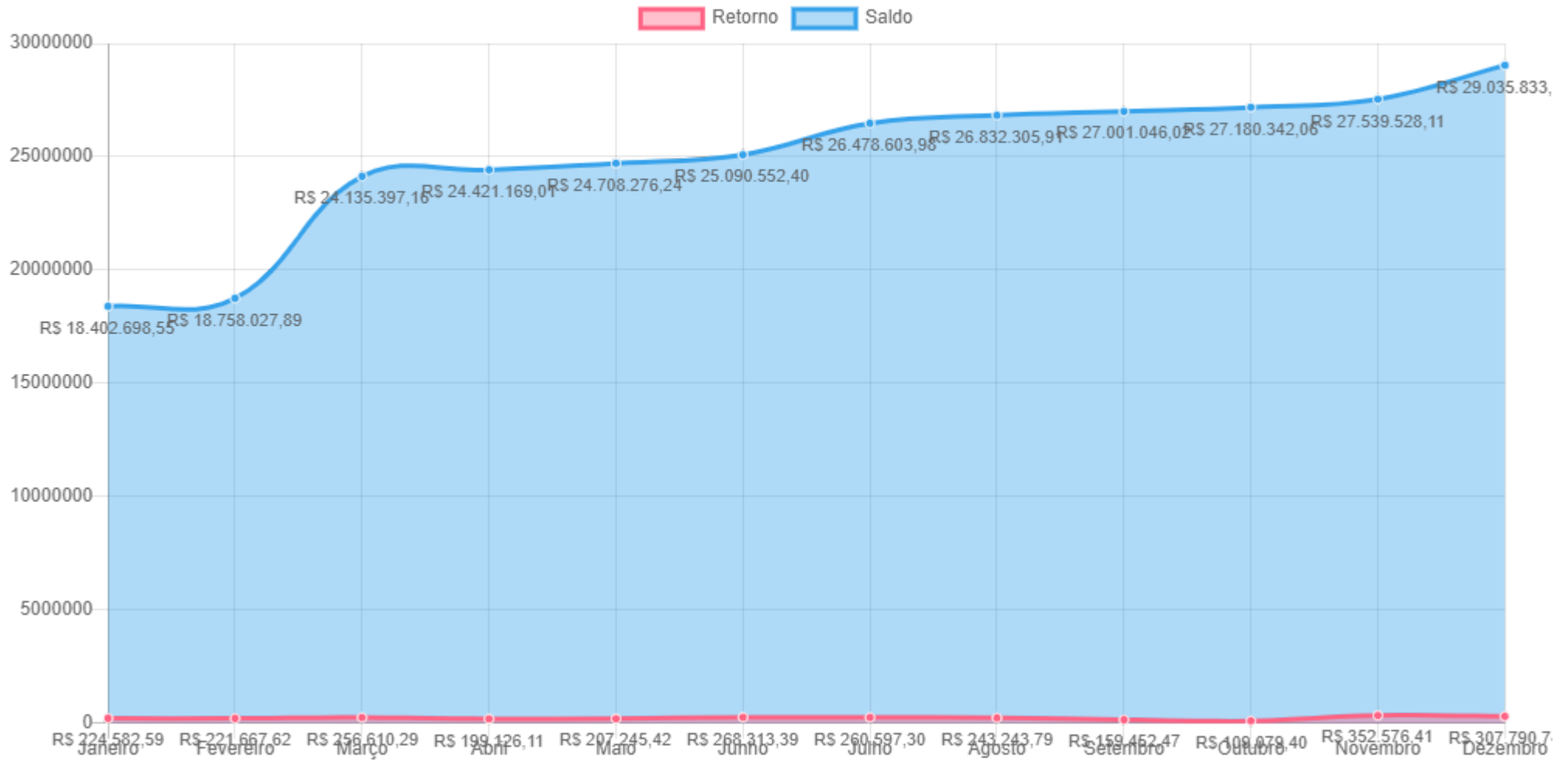
	Total aplicações	Total Resgates	Total retorno R\$	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
Total	R\$ 10.159.977,64	R\$ 2.001.469,51	R\$ 2.810.285,53	12,0674%	8,7016%	138,6795%

Gráfico - retorno acumulado no ano



	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Mai	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
Efetivo	1,225%	1,187%	1,070%	0,818%	0,840%	1,074%	0,990%	0,909%	0,589%	0,401%	1,288%	1,059%
Meta	0,932%	1,243%	1,112%	1,012%	0,630%	0,319%	0,520%	0,630%	0,660%	0,640%	0,681%	0,000%

Grafico - Evolução do patrimônio



Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Mai	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
R\$ 18.402.698,55	R\$ 18.758.027,89	R\$ 24.135.397,16	R\$ 24.421.169,01	R\$ 24.708.276,24	R\$ 25.090.552,40	R\$ 26.478.603,98	R\$ 26.832.305,91	R\$ 27.001.046,02	R\$ 27.180.342,06	R\$ 27.539.528,11	R\$ 29.035.833,64
R\$ 224.582,59	R\$ 221.667,62	R\$ 256.610,29	R\$ 199.126,11	R\$ 207.245,42	R\$ 268.313,39	R\$ 260.597,30	R\$ 243.243,79	R\$ 159.452,47	R\$ 109.079,40	R\$ 352.576,41	R\$ 307.790,74

Grafico - Retorno mensal

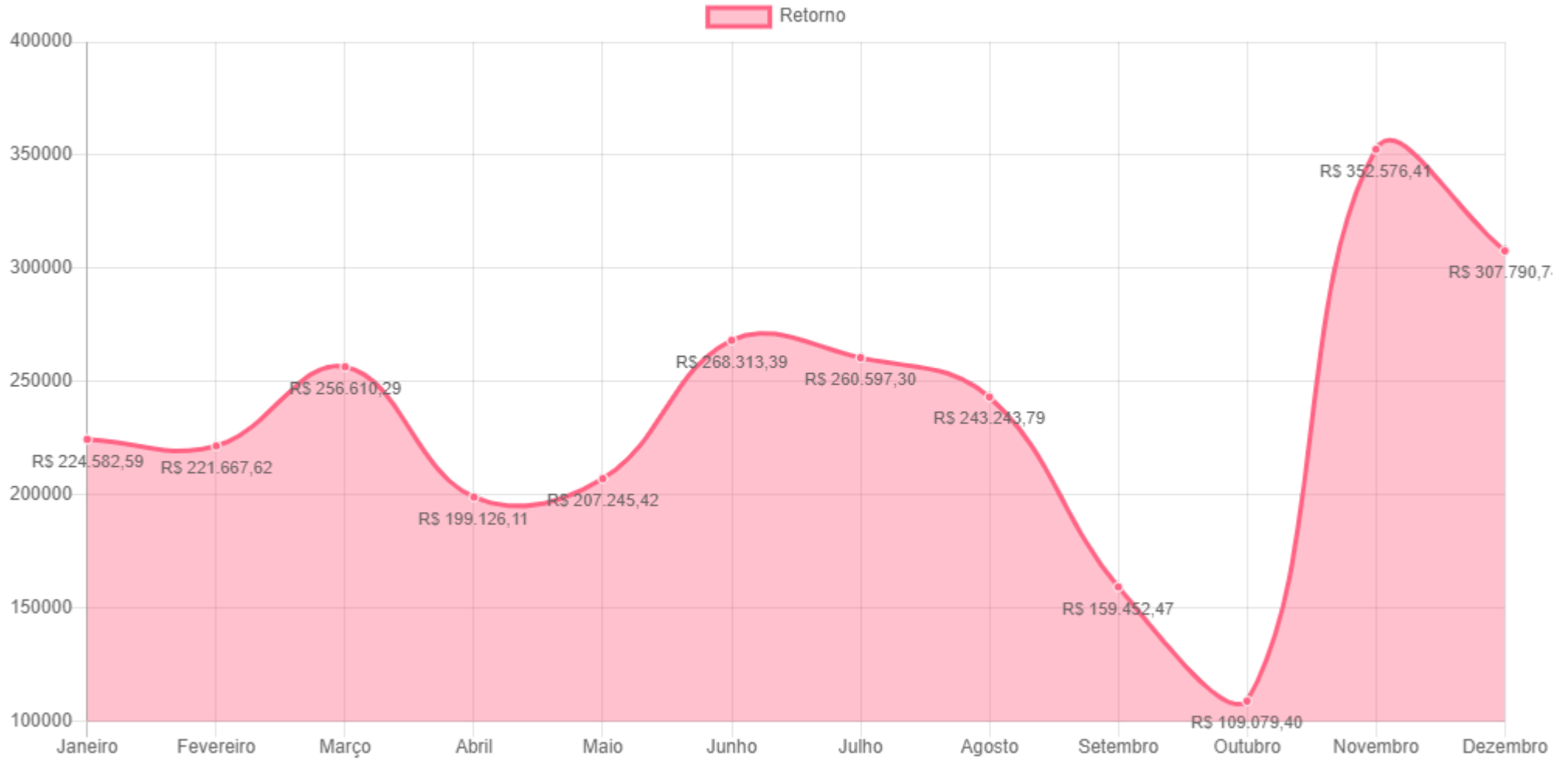
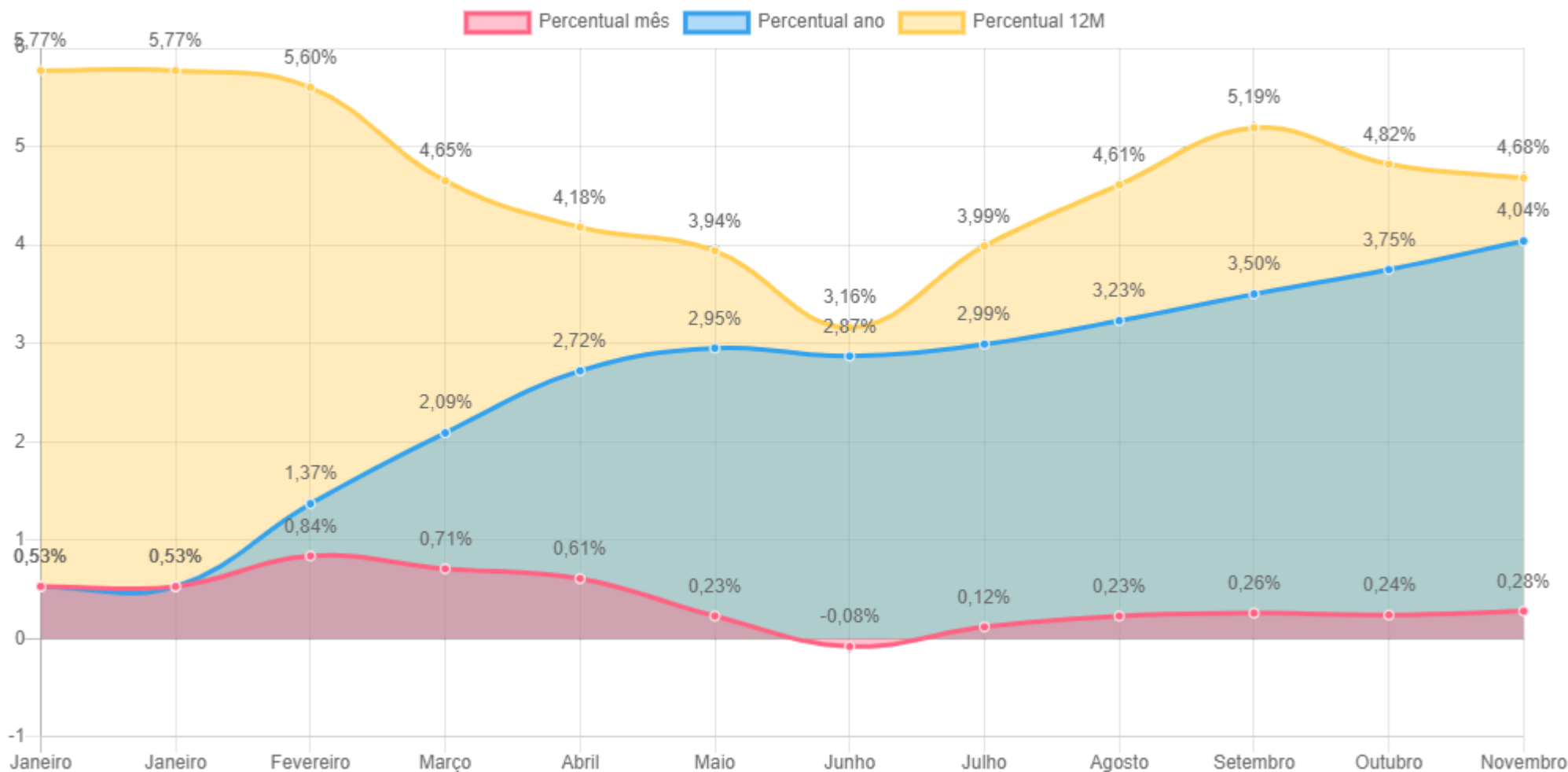


Gráfico - Índices econômicos

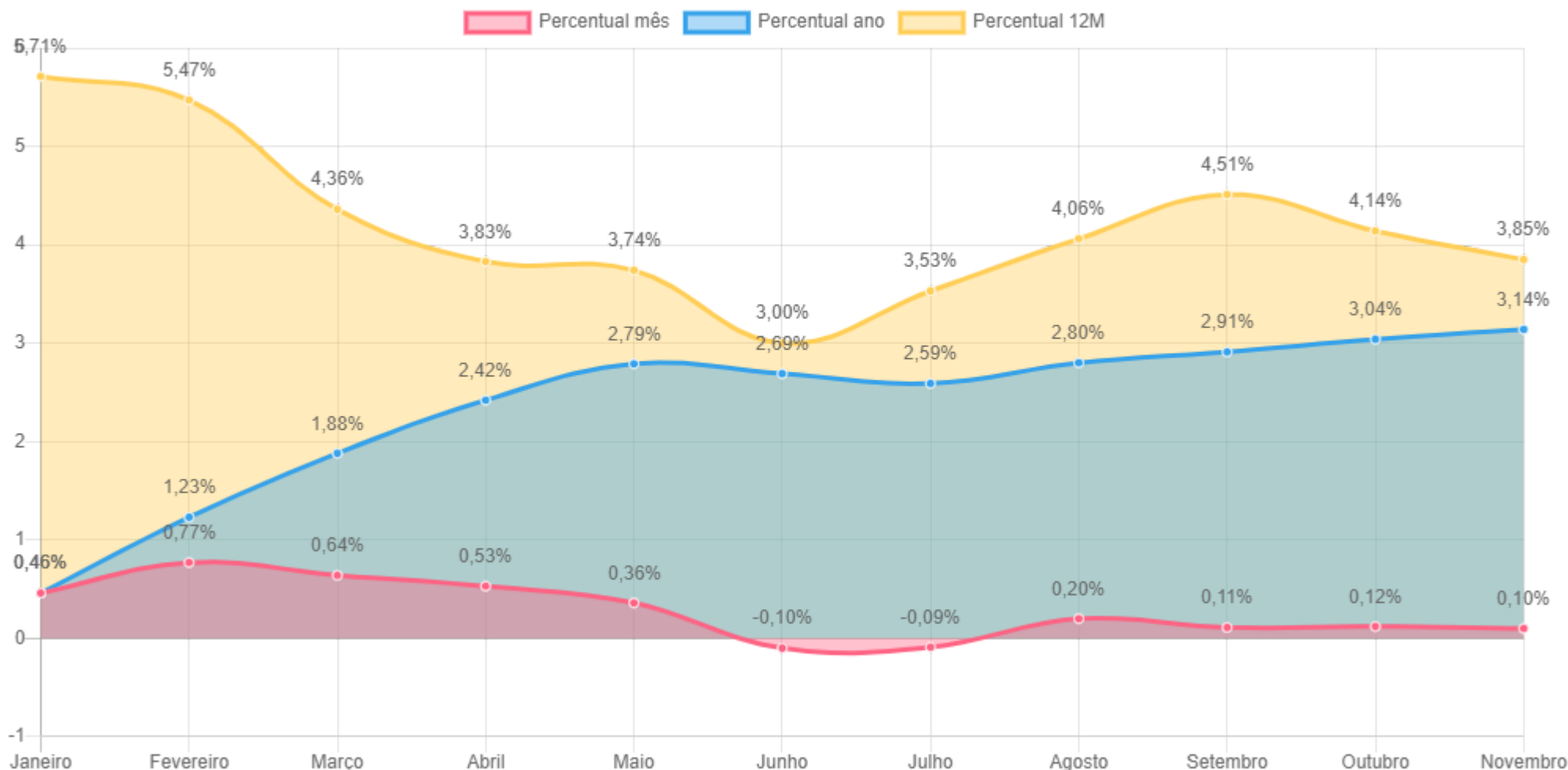
IPCA



Mês	Janeiro	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Mai	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro
Percentual mês	0,53%	0,53%	0,84%	0,71%	0,61%	0,23%	-0,08%	0,12%	0,23%	0,26%	0,24%	0,28%
Percentual ano	0,53%	0,53%	1,37%	2,09%	2,72%	2,95%	2,87%	2,99%	3,23%	3,50%	3,75%	4,04%
Percentual 12M	5,77%	5,77%	5,60%	4,65%	4,18%	3,94%	3,16%	3,99%	4,61%	5,19%	4,82%	4,68%

Gráfico - Índices econômicos

INPC



Mês	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Mai	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro
Percentual mês	0,46%	0,77%	0,64%	0,53%	0,36%	-0,10%	-0,09%	0,20%	0,11%	0,12%	0,10%
Percentual ano	0,46%	1,23%	1,88%	2,42%	2,79%	2,69%	2,59%	2,80%	2,91%	3,04%	3,14%
Percentual 12M	5,71%	5,47%	4,36%	3,83%	3,74%	3,00%	3,53%	4,06%	4,51%	4,14%	3,85%

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	25,911248%	0,000088%	7,196256%	20,579027%	55,232070%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	25,911248%	0,000088%	7,196256%	20,579027%	55,232070%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	25,911248%	0,000088%	7,196256%	20,579027%	55,232070%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA 2	31,090401%	0,003538%	13,768957%	17,404278%	45,275290%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	IMA-B 5	30,572455%	0,003503%	13,923402%	16,883485%	46,819907%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IRF-M	25,554331%	0,005648%	17,569431%	25,393674%	74,131009%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M 1	25,786873%	0,000130%	8,125642%	22,020313%	59,693127%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	CDI	25,704502%	0,000123%	7,971439%	22,660449%	60,300705%

	Benchmark	Sharpe	VAR 12M	VOL 3M	VOL 6M	VOL 12M
Geral		27,055288%	0,001651%			

Provisão de risco - Mercado

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

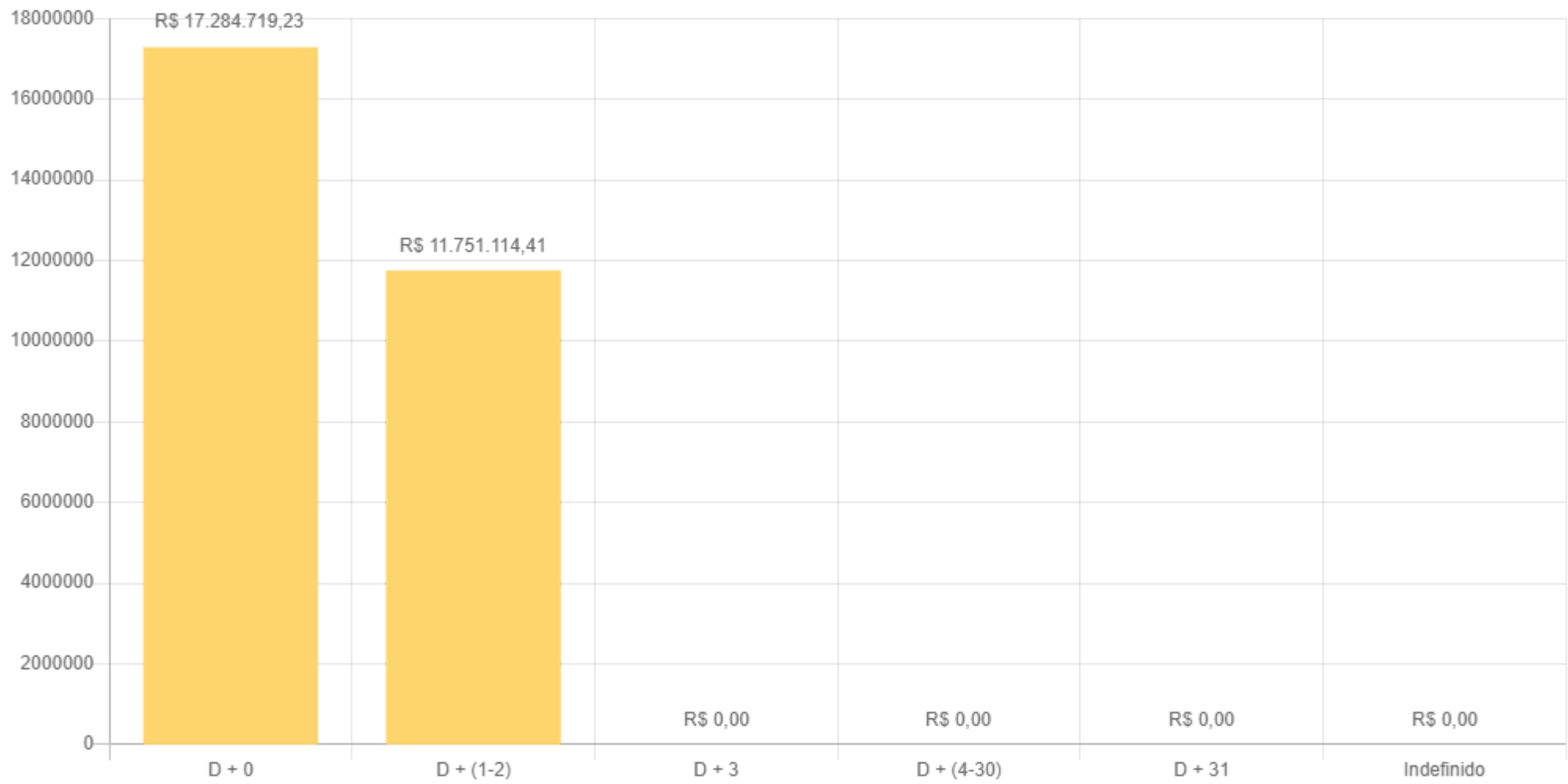
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	R\$ 8.646,10	0,087619%	55,232070%	R\$ 0,01
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	R\$ 1.239,31	0,087619%	55,232070%	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\$ 1.453.154,44	0,087619%	55,232070%	R\$ 1,27
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	13.322.205/0001-35	IDKA 2	R\$ 5.159.250,22	3,537886%	45,275290%	R\$ 182,53
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\$ 6.591.864,19	3,502943%	46,819907%	R\$ 230,91
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	07.111.384/0001-69	IRF-M	R\$ 16.532,24	5,647615%	74,131009%	R\$ 0,93
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M 1	R\$ 11.834.986,71	0,130267%	59,693127%	R\$ 15,42
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	13.077.418/0001-49	CDI	R\$ 3.970.160,43	0,122932%	60,300705%	R\$ 4,88

Risco de mercado

Saldo Total	R\$ 29.035.833,64
Provisão para perda e Investimentos:	R\$ 435,95
% Provisão de perda	0,0015%
% Aceitavel perda	2,0%
Limite de utilização	0,0751%

Risco de liquidez

Prazo Resgate	Quantidade Fundos	% carteira	Saldo
D + 0	6	59,5289%	R\$ 17.284.719,23
D + 1	2	40,4711%	R\$ 11.751.114,41



Risco crédito

Risco crédito	% carteira	Saldo
100% Títulos publicos	90,6440%	R\$ 26.319.233,50
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	9,3560%	R\$ 2.716.600,14
100% Títulos privados	0,0000%	R\$ 0,00
Aceitavel carteira Titulos Privados		30,00%
Limite de Utilização		31,19%



Rentabilidade Média

RENDA FIXA

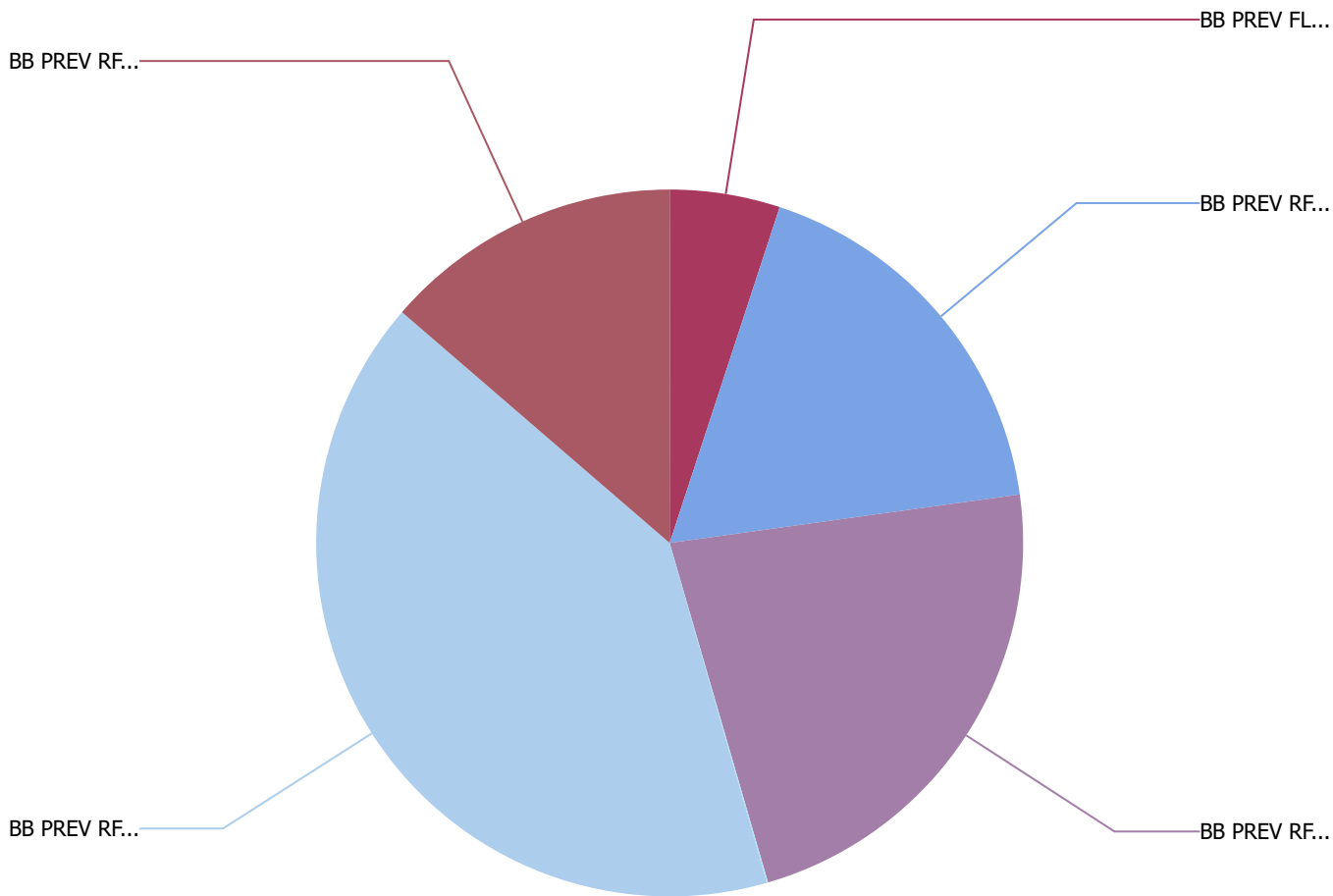
Fundo	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.239,31	0,8208%	0,0000%	0,0000%
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 8.646,10	0,8207%	0,0000%	0,0000%
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.453.154,44	0,6877%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 5.159.250,22	1,4146%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 6.591.864,19	1,4445%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 16.532,24	1,4590%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 11.834.986,71	0,8004%	0,0000%	0,0000%
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 3.970.160,43	0,9022%	0,0000%	0,0000%

Total	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
	R\$ 29.035.833,64	1,0593%	0,0000%	∞%

Total: R\$ R\$ 29.035.833,64

A rentabilidade média da carteira é de 1,0593%, enquanto que a meta atuarial foi de 0,0000%, sendo assim, atingindo ∞% da meta Atuarial

Carteira Atual



Comparativo com a Meta Atuarial

Mês	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
JANEIRO	1,2247%	0,9315%	131,4722%
FEVEREIRO	1,1870%	1,2428%	95,5088%
MARÇO	1,0704%	1,1122%	96,2451%
ABRIL	0,8183%	1,0118%	80,8743%
MAIO	0,8402%	0,6303%	133,3052%
JUNHO	1,0743%	0,3191%	336,6608%
JULHO	0,9903%	0,5199%	190,4741%
AGOSTO	0,9093%	0,6303%	144,2640%
SETEMBRO	0,5887%	0,6604%	89,1494%
OUTUBRO	0,4005%	0,6404%	62,5459%
NOVEMBRO	1,2880%	0,6805%	189,2730%
DEZEMBRO	1,0593%	0,0000%	0,0000%

	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
Total	12,0674%	8,7016%	138,6795%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 12,0674% enquanto que a meta acumulada no período é de 8,7016%, sendo assim o RPPS atingiu 138,6795% da meta atuarial

Gerenciamento de Risco

VaR - VALUE AT RISK

Value-at-Risk ou Valor sob Risco pode se definido como perda máxima num determinado Período sob condições normais de mercado com determinado grau de confiança

Nome	Saldo	VAR 12M
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 8.646,10	0,000088%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 1.239,31	0,000088%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 1.453.154,44	0,000088%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE	R\$ 5.159.250,22	0,003538%

INVESTIMENTO		
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 6.591.864,19	0,003503%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 16.532,24	0,005648%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 11.834.986,71	0,000130%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 3.970.160,43	0,000123%

	Saldo	VAR 12M
Geral	R\$ 29.035.833,64	0,001651%

O fundo BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI obteve o menor VaR% dentre os fundos da carteira, sendo assim, é o fundo que apresenta menor risco.

INDICE 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 e rentabilidades semanais, mensais ou anuais

Nome	Sharpe
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	25,911248%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	25,911248%
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	25,911248%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	31,090401%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	30,572455%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	25,554331%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	25,786873%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	25,704502%

	Sharpe
--	--------

Geral	27,055288%
-------	------------

O fundo BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI teve o melhor Índice Sharpe positivo, portanto foi o fundo que teve melhor desempenho analisando a relação risco/retorno.