



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DOS SERVIDORES
DO MUNICÍPIO DE CACHOEIRA DO PIRIÁ**
Fevereiro 2022



Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE CACHOEIRA DO PIRIÁ
 CNPJ: 02.148.931/0001-67

Visão geral da carteira

CNPJ	Nome	P. Resgate	Participação	N. Cotistas	% PL.	Legislação	Saldo	Risco	Tipo	Taxa Adm.
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM C	0	1,36%	822	0,00%	'M) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 154.725,11	B	Fundo de Investim	0,20%
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FI EM C	4	16,57%	536	0,03%	ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 1.881.585,30	A	Fundo de Investim	0,50%
35.292.588/0001-89	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETOF	3	9,00%	581	0,02%	'M) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 1.022.562,64	B	Fundo de Investim	0,20%
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	1	17,32%	1,027	0,02%	ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 1.967.745,45	M	Fundo de Investim	0,20%
03.543.447/0001-03	BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO F	1	10,40%	789	0,02%	ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 1.181.117,18	A	Fundo de Investim	0,20%
07.861.554/0001-22	BB PREV RF IMA-B FI	1	8,88%	239	0,13%	'M) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 1.008.768,32	M	Fundo de Investim	0,30%
07.111.384/0001-69	BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	0	0,00%	518	0,00%	ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 0,00	M	Fundo de Investim	0,20%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	0	17,46%	1,120	0,04%	ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 1.983.274,35	B	Fundo de Investim	0,20%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONC	0	19,00%	895	0,03%	'M) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 2.158.067,90	B	Fundo de Investim	0,20%

R\$ 11.357.846,25

Retorno do mês

Nome Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI E	R\$ 85.347,59	R\$ 301.337,83	R\$ 233.469,10	R\$ 154.725,11	R\$ 1.508,79	0,3901%	CDI
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FI E	R\$ 1.870.065,46	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 1.881.585,30	R\$ 11.519,84	0,6160%	IMA-GERAL
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RE	R\$ 1.015.767,48	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 1.022.562,64	R\$ 6.795,16	0,6689%	IPCA
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 1.945.245,13	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 1.967.745,45	R\$ 22.500,32	1,1566%	IDKA 2
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZ	R\$ 1.168.793,87	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 1.181.117,18	R\$ 12.323,31	1,0543%	IMA-B 5
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 1.003.256,01	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 1.008.768,32	R\$ 5.512,31	0,5494%	IMA-B
BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ -	0,0000%	IRF-M
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F	R\$ 1.968.761,33	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 1.983.274,35	R\$ 14.513,02	0,7371%	IRF-M 1
BB PREV RF REFERENCIADO DI L	R\$ 2.050.622,80	R\$ 91.000,00	R\$ 0	R\$ 2.158.067,90	R\$ 16.445,10	0,7678%	CDI
Total	11,107,859.67	392,337.83	233,469.10	11,357,846.25	91,117.85	0,7923%	



Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE CACHOEIRA DO PIRIÁ
 CNPJ: 02.148.931/0001-67

Enquadramentos

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

% Carteira: : **38,25%**

Saldo do grupo: **R\$ 4.344.123,97**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 154.725,11	69,933.97	0,00%	7,445,522.66	1,36%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 20,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 1.008.768,32	176,850.03	0,13%	3,022,116.28	8,88%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 20,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,13%	Enquadrado
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.158.067,90	882,125.54	0,03%	3,104,845.31	19,00%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 20,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,03%	Enquadrado
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.022.562,64	945,534.89	0,02%	3,933,633.04	9,00%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 20,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,02%	Enquadrado

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

% Carteira: : **61,75%**

Saldo do grupo: **R\$ 7.013.722,28**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 1.983.274,35	699,561.88	0,04%	3,689,167.39	17,46%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,04%	Enquadrado
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 1.967.745,45	642,866.77	0,02%	2,864,987.26	17,32%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,02%	Enquadrado
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.881.585,30	1,228,412.63	0,03%	7,287,977.51	16,57%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,03%	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 0,00	0.00	0,00%	3,251,592.64	0,00%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.181.117,18	54,253.58	0,02%	3,804,434.87	10,40%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,02%	Enquadrado



Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE CACHOEIRA DO PIRIÁ
CNPJ: 02.148.931/0001-67



Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE CACHOEIRA DO PIRIÁ
 CNPJ: 02.148.931/0001-67

Enquadramento por Benchmark

CDI

% Carteira: **20,36%**

Saldo do grupo: **R\$ 2.312.793,01**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 154.725,11	69,933.97	0.00	1.36	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\$ 2.158.067,90	882,125.54	0.03	19.00	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 20,00%	Enquadrado

IDKA 2

% Carteira: **17,32%**

Saldo do grupo: **R\$ 1.967.745,45**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 1.967.745,45	642,866.77	0.02	17.32	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

IMA-B

% Carteira: **8,88%**

Saldo do grupo: **R\$ 1.008.768,32**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 1.008.768,32	176,850.03	0.13	8.88	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 20,00%	Enquadrado

IMA-B 5

% Carteira: **10,40%**

Saldo do grupo: **R\$ 1.181.117,18**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.181.117,18	54,253.58	0.02	10.40	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado



Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE CACHOEIRA DO PIRIÁ
CNPJ: 02.148.931/0001-67

IMA-GERAL

% Carteira: **16,57%**

Saldo do grupo: **R\$ 1.881.585,30**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.881.585,30	1,228,412.63	0.03	16.57	Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

IPCA

% Carteira: **9,00%**

Saldo do grupo: **R\$ 1.022.562,64**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.022.562,64	945,534.89	0.02	9.00	Lim. Res.: 60.00% Lim. Pol.: 60.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 20,00%	Enquadrado

IRF-M

% Carteira: **0,00%**

Saldo do grupo: **R\$ 0,00**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 0,00	0.00	0.00	0.00	Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

IRF-M 1

% Carteira: **17,46%**

Saldo do grupo: **R\$ 1.983.274,35**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 1.983.274,35	699,561.88	0.04	17.46	Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

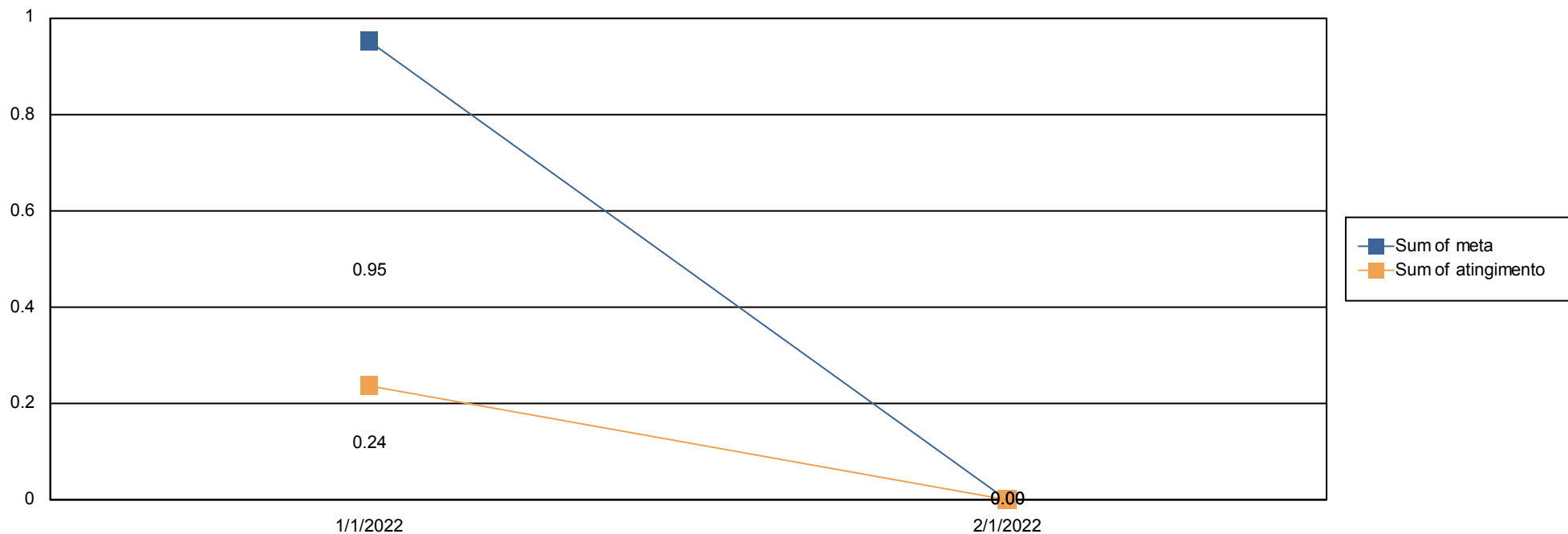


Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE CACHOEIRA DO PIRIÁ
 CNPJ: 02.148.931/0001-67

Retorno acumulado no ano

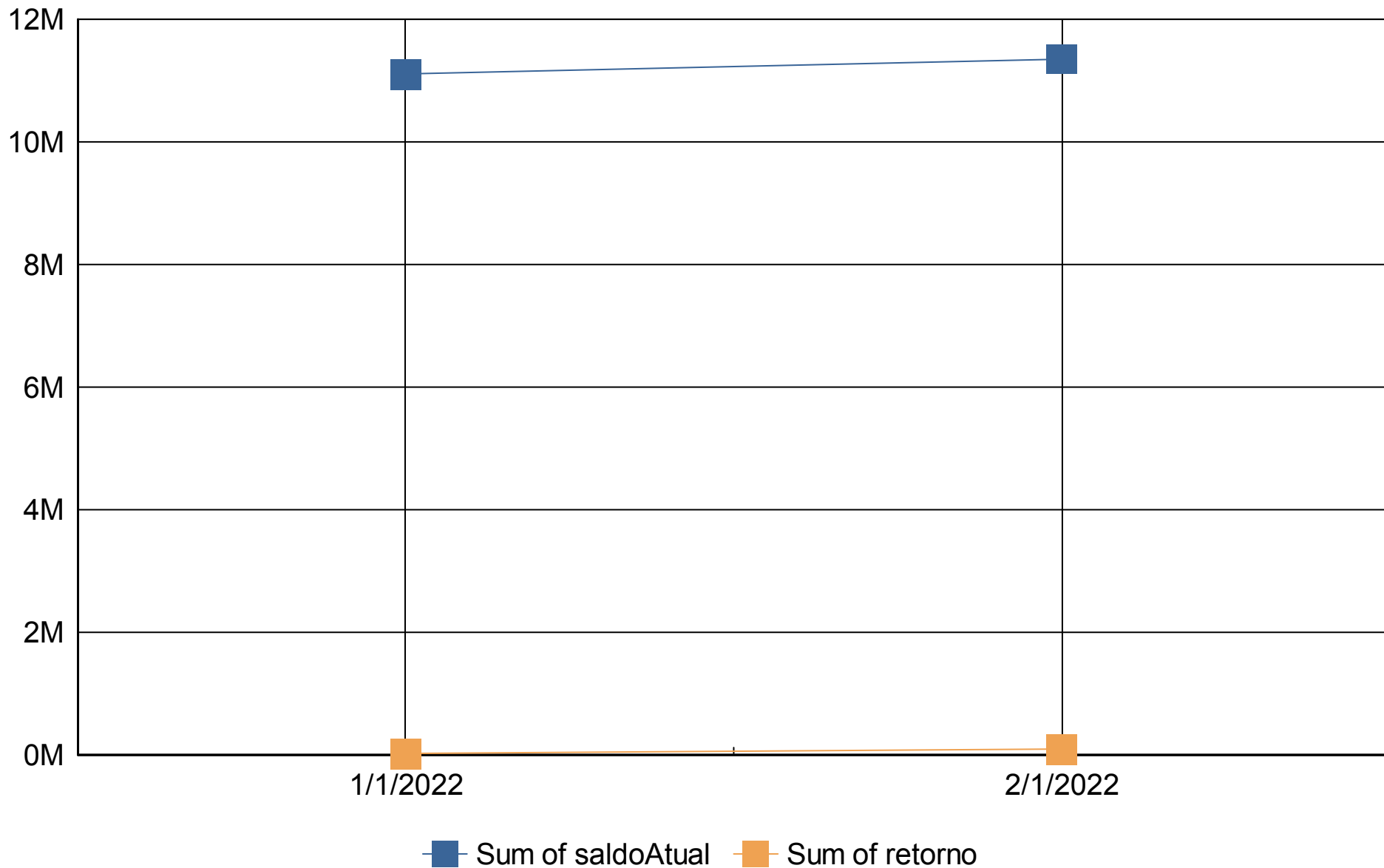
Período	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Retorno %	Meta	Atingimento
Janeiro	R\$ 11.179.636,89	R\$ 48.740,57	R\$ 145.814,78	R\$ 11.107.859,67	R\$ 25.296,99	0,2253%	0,9528	23,6456%
Fevereiro	R\$ 11.107.859,67	R\$ 392.337,83	R\$ 233.469,10	R\$ 11.357.846,25	R\$ 91.117,85	0,7923%	0,0000	0,0000%
Total		441,078.40	379,283.88		116,414.84	1,0194%	0,9528%	106,9895%

Meta x Atingimento



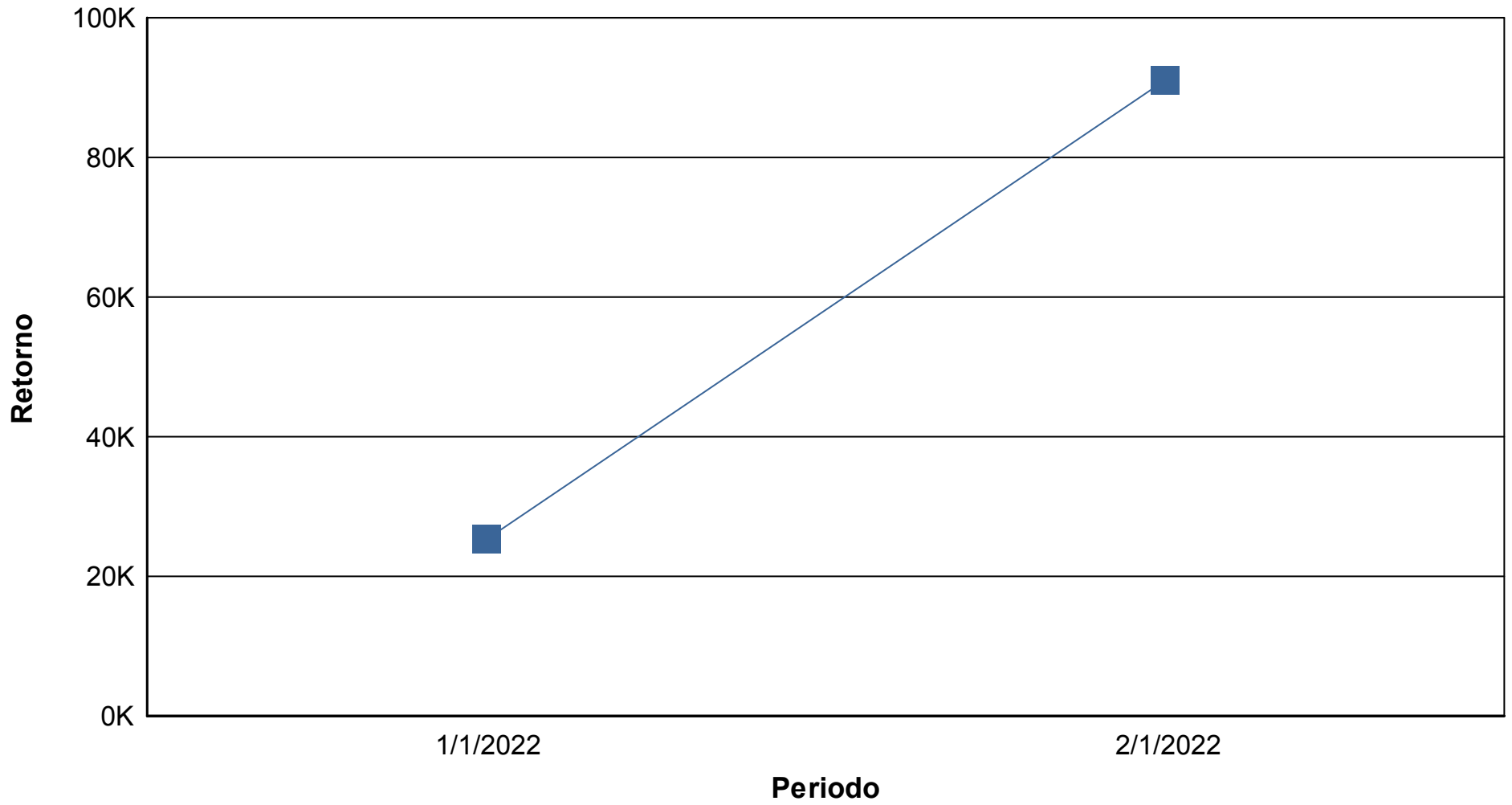


Evolução do patrimônio



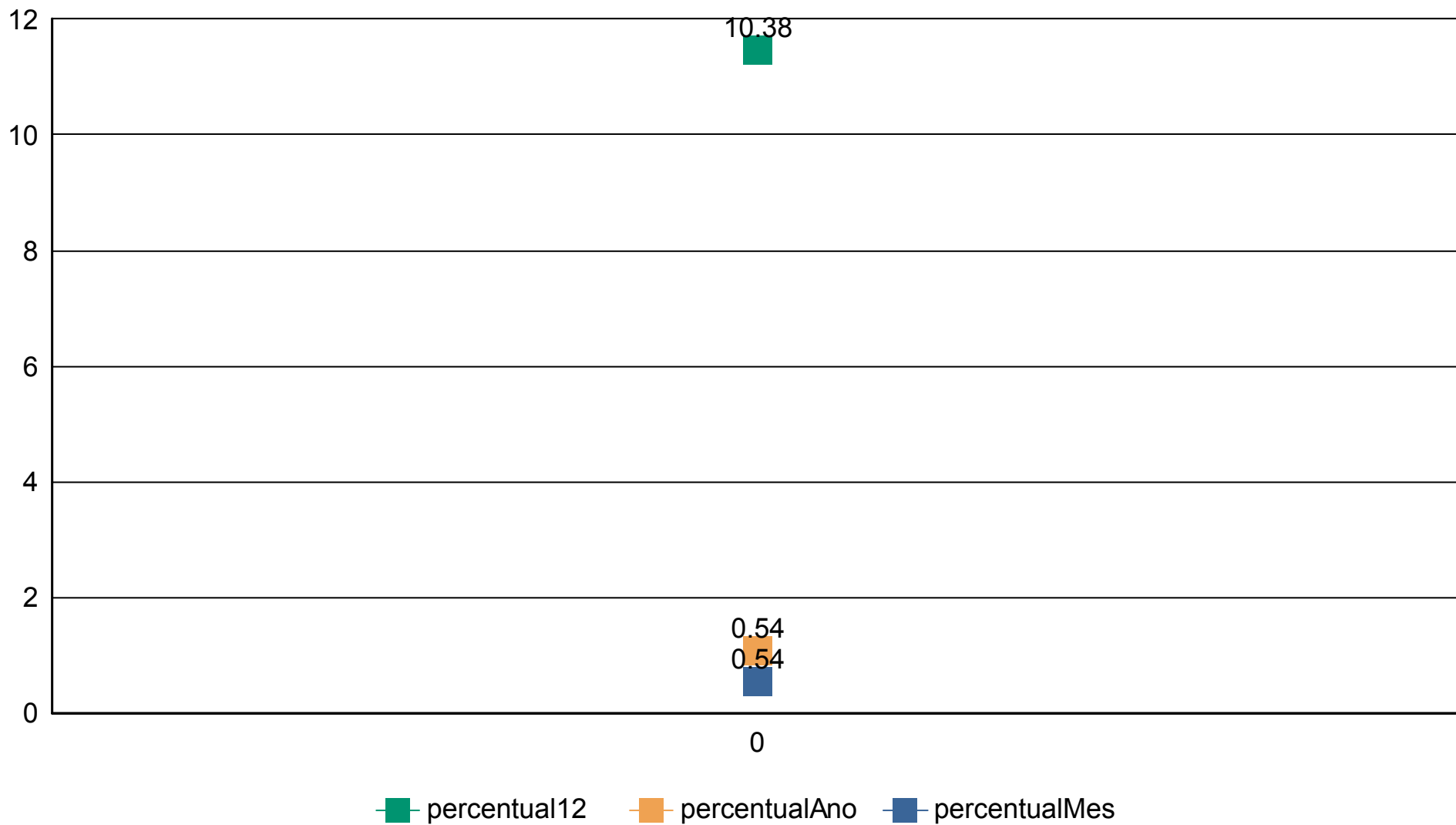


Retorno Mensal



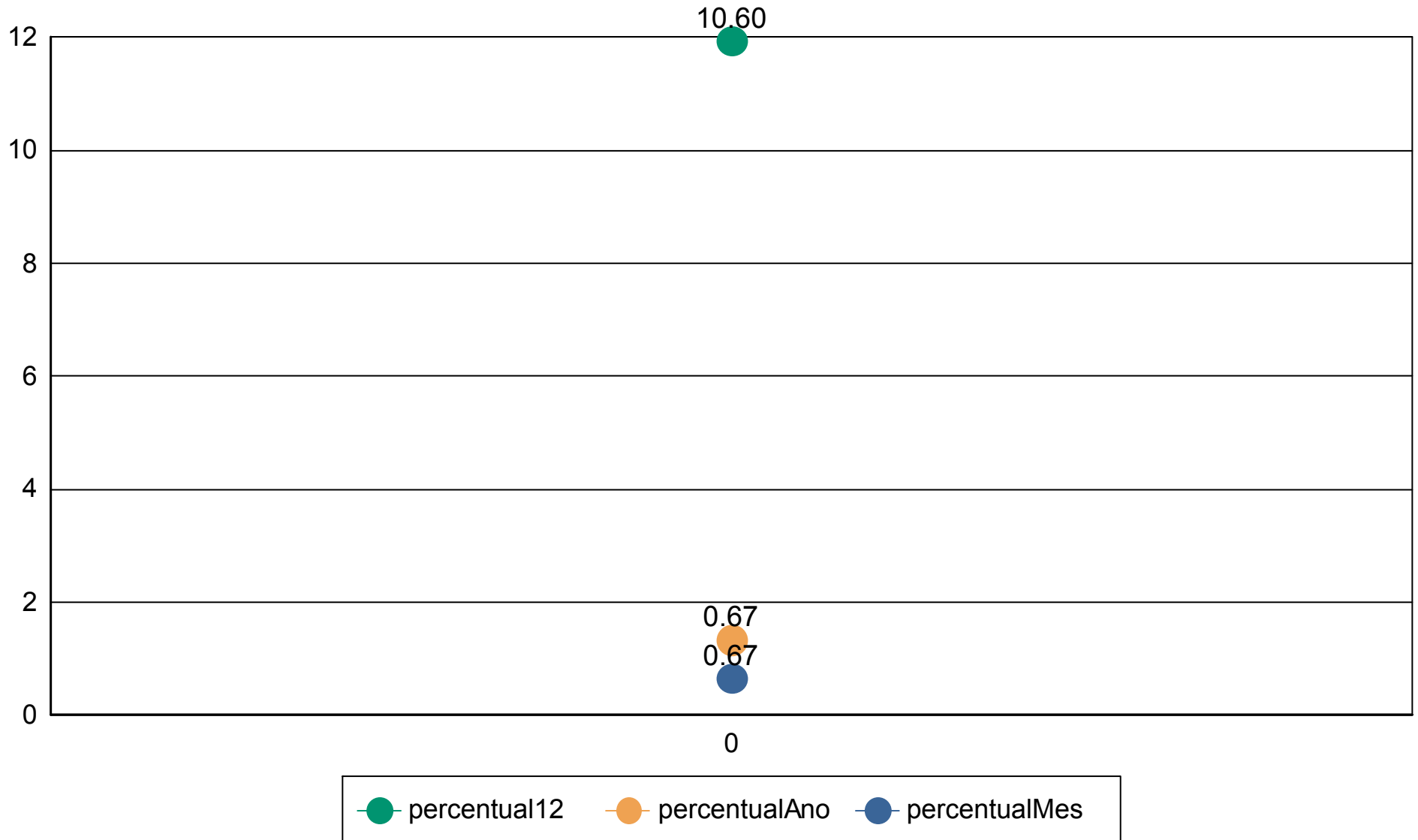


Índices Econômicos - IPCA



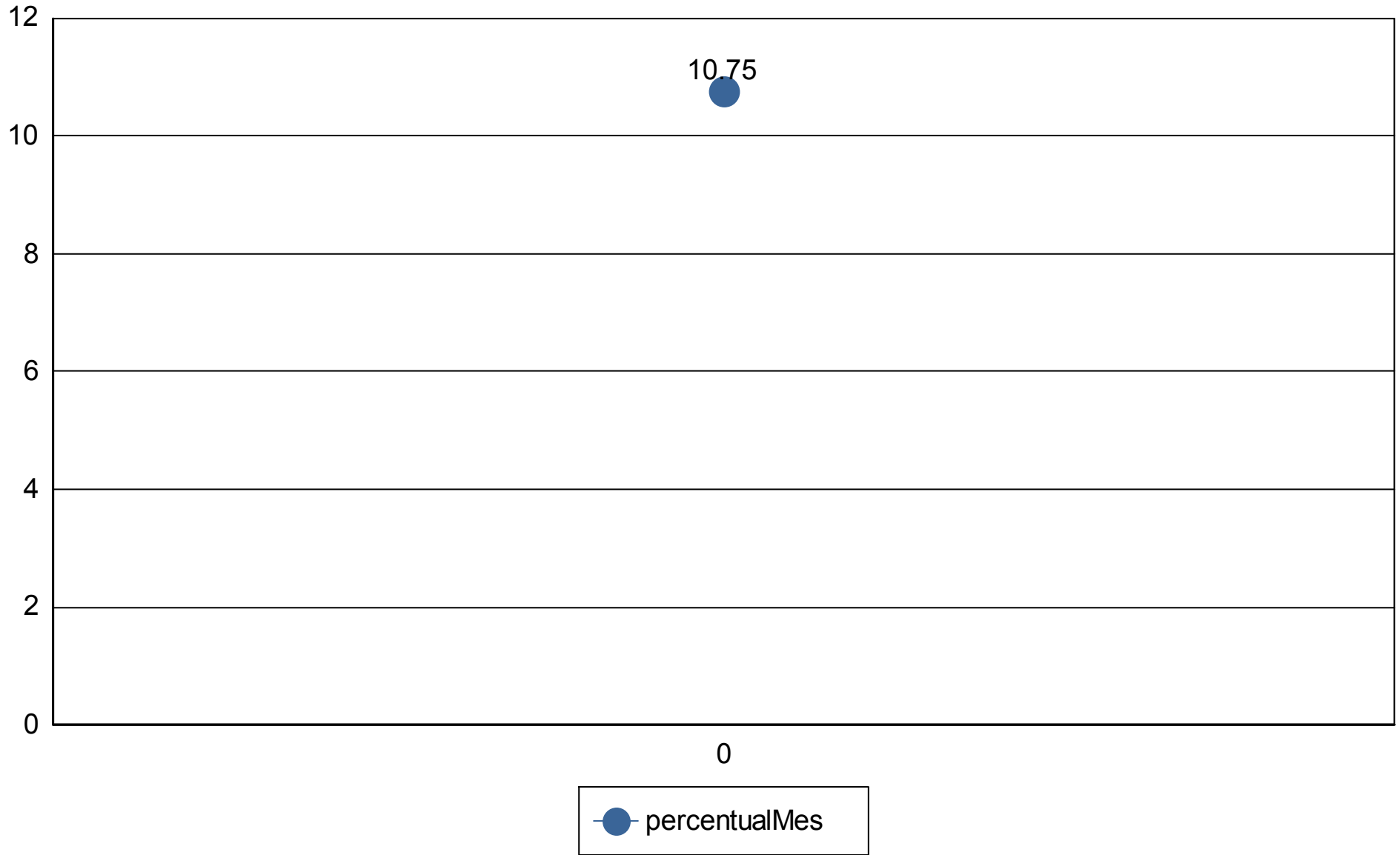


Índices Econômicos - INPC





Índices Econômicos - SELIC





Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE CACHOEIRA DO PIRIÁ
 CNPJ: 02.148.931/0001-67

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
03.543.447/0001-03	BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	IMA-B 5	27,42%	0,01%	5,35%	18,28%	27,21%
07.111.384/0001-69	BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	IRF-M	0,91%	0,01%	2,39%	16,88%	18,27%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	IRF-M 1	26,26%	0,00%	5,62%	12,97%	19,09%
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	IDKA 2	27,72%	0,01%	5,68%	17,86%	28,06%
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FI EM COTAS DE FI	IMA-GERAL	17,12%	0,01%	2,99%	13,09%	12,88%
07.861.554/0001-22	BB PREV RF IMA-B FI	IMA-B	5,48%	0,02%	3,18%	15,12%	17,04%
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	CDI	25,17%	0,00%	5,55%	12,89%	22,45%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI	CDI	25,53%	0,00%	6,68%	15,71%	29,27%
35.292.588/0001-89	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FI EM CO	IPCA	24,21%	0,00%	3,72%	13,15%	14,74%
			179,83%	0,06%	41,15%	135,96%	189,01%

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\$ 154.725,11	0,00%	22,45%	R\$ 0,64
25.078.994/0001-90	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO	IMA-GERAL	R\$ 1.881.585,30	0,01%	12,88%	R\$ 120,42
13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICO	IDKA 2	R\$ 1.967.745,45	0,01%	28,06%	R\$ 140,73
03.543.447/0001-03	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FL	IMA-B 5	R\$ 1.181.117,18	0,01%	27,21%	R\$ 87,42
07.861.554/0001-22	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTII	IMA-B	R\$ 1.008.768,32	0,02%	17,04%	R\$ 192,49
07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	IRF-M	R\$ 0,00	0,01%	18,27%	R\$ 0,00
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO	IRF-M 1	R\$ 1.983.274,35	0,00%	19,09%	R\$ 26,57
13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO	CDI	R\$ 2.158.067,90	0,00%	29,27%	R\$ 9,41

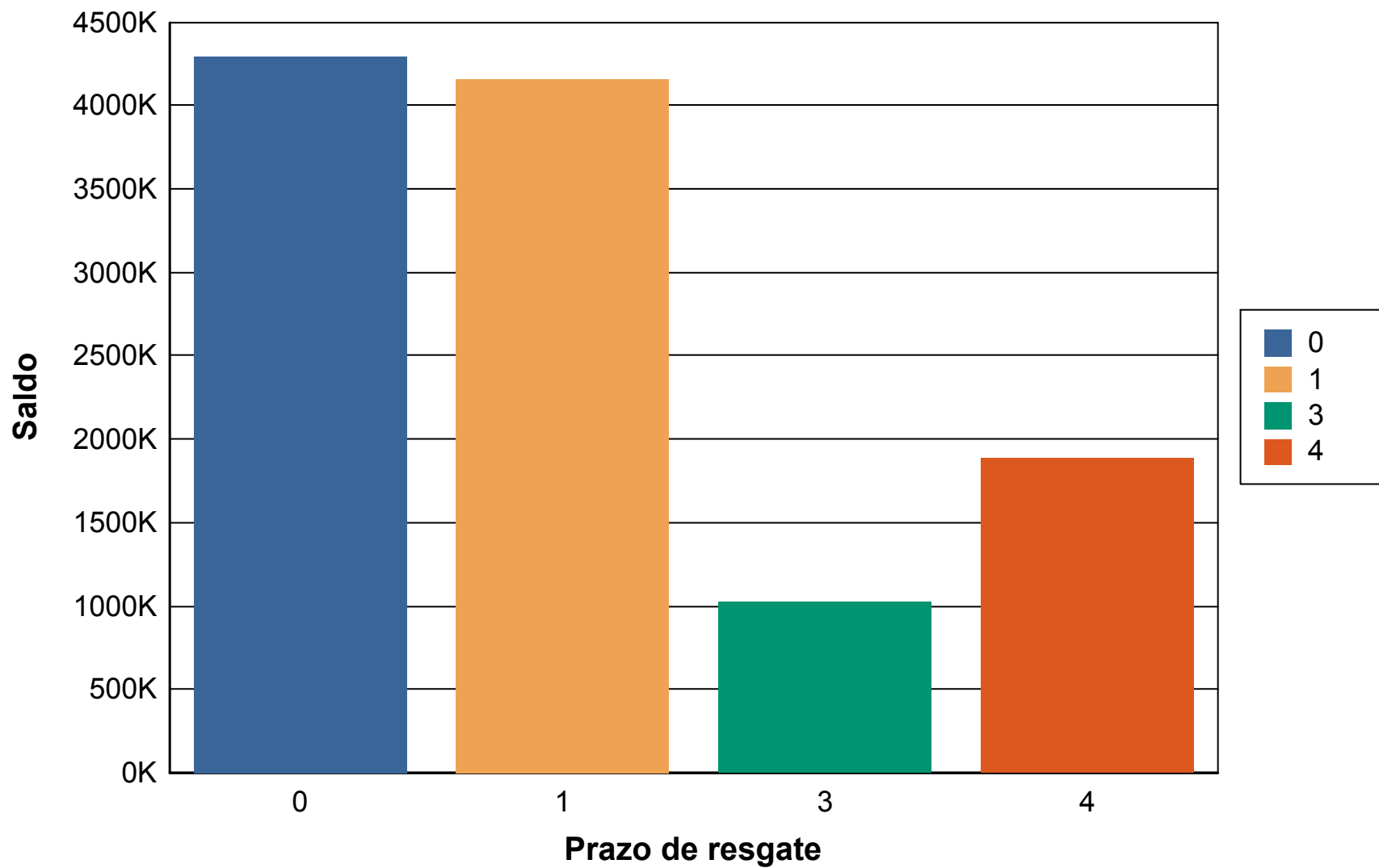
Saldo Total:	R\$ 10.335.283,61
Provisão para perda e Investimentos	R\$ 577,68
% Provisão de perda	0,01%
% Aceitavel perda	2%
Limite de utilização	0,28%



Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE CACHOEIRA DO PIRIÁ
CNPJ: 02.148.931/0001-67

Nome do Fundo	Saldo	% Part.	N. Cotistas	% PL	PL do Fundo	Legislação	Grau risco	Prazo Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE	R\$ 154.725,11	1,36%	822	0,00%	R\$ 3.177.445.522,66	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO AT	R\$ 1.881.585,30	16,57%	536	0,03%	R\$ 6.887.287.977,51	ixa 100% TP/E	Alto	D+ 4
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO AT	R\$ 1.022.562,64	9,00%	581	0,02%	R\$ 4.159.933.633,04	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 3
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULO	R\$ 1.967.745,45	17,32%	1,027	0,02%	R\$ 9.012.864.987,26	ixa 100% TP/E	Médio	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO	R\$ 1.181.117,18	10,40%	789	0,02%	R\$ 6.375.804.434,87	ixa 100% TP/E	Alto	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO I	R\$ 1.008.768,32	8,88%	239	0,13%	R\$ 778.022.116,28	da Fixa (CVM)	Médio	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS	R\$ 0,00	0,00%	518	0,00%	R\$ 4.398.251.592,64	ixa 100% TP/E	Médio	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS	R\$ 1.983.274,35	17,46%	1,120	0,04%	R\$ 5.025.689.167,39	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIAD	R\$ 2.158.067,90	19,00%	895	0,03%	R\$ 7.639.104.845,31	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
0	R\$ 4.296.067,36	4	37,82%
1	R\$ 4.157.630,95	3	36,61%
3	R\$ 1.022.562,64	1	9,00%
4	R\$ 1.881.585,30	1	16,57%





Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE CACHOEIRA DO PIRIÁ
CNPJ: 02.148.931/0001-67

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\$ 7.013.722,28	61,75
Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	60,00%	60,00%	R\$ 4.344.123,97	38,25

	Saldo	% Carteira
100% títulos públicos	0.00	0.00
50% Títulos públicos e 50% Títulos privados	0.00	0.00
100% títulos privados	11,357,846.25	100.00

Distribuição dos saldos

