



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DOS SERVIDORES  
DO MUNICÍPIO DE CACHOEIRA DO PIRIÁ**  
Setembro 2023



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	Perc. PL	Legislação	Saldo	Risco	Tipo	Taxa Adm.
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM C	0	0,78%	999	0.00	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 128.612,54	B	Fundo de Investimento	1,00%
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FI EM C	4	0,00%	0	0.00	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 0,00	A	Fundo de Investimento	0,50%
35.292.588/0001-89	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETOF	3	13,99%	685	0.04	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 2.308.127,96	B	Fundo de Investimento	0,20%
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	1	14,86%	903	0.04	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 2.452.751,84	M	Fundo de Investimento	0,20%
03.543.447/0001-03	BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO F	1	15,30%	794	0.05	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 2.524.236,23	A	Fundo de Investimento	0,20%
07.861.554/0001-22	BB PREV RF IMA-B FI	1	11,63%	246	0.21	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 1.919.724,53	M	Fundo de Investimento	0,30%
07.111.384/0001-69	BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	0	0,00%	598	0.00	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 0,00	M	Fundo de Investimento	0,20%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	0	28,00%	1,132	0.07	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 4.620.969,33	B	Fundo de Investimento	0,20%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONC	0	15,44%	1,116	0.02	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 2.547.040,71	B	Fundo de Investimento	0,20%

**R\$ 16.501.463,14**



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

## Retorno do mês

Nome Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI	R\$ 245.553,37	R\$ 505.064,71	R\$ 624.356,14	R\$ 128.612,54	R\$ 2.350,60	0,3131%	CDI
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FI E	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ -	0,0000%	IMA-GERAL
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RE	R\$ 2.288.031,46	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 2.308.127,96	R\$ 20.096,50	0,8783%	IPCA
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 2.447.570,30	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 2.452.751,84	R\$ 5.181,54	0,2117%	IDKA 2
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZ	R\$ 2.235.747,59	R\$ 286.711,25	R\$ 0	R\$ 2.524.236,23	R\$ 1.777,39	0,0704%	IMA-B 5
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 1.831.172,46	R\$ 107.600,54	R\$ 0	R\$ 1.919.724,53	R\$ -19.048,47	-0,9826%	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\$ 4.579.563,83	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 4.620.969,33	R\$ 41.405,50	0,9041%	IRF-M 1
BB PREV RF REFERENCIADO DI LI	R\$ 2.522.572,21	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 2.547.040,71	R\$ 24.468,50	0,9699%	CDI
Total	16,150,211.22	899,376.50	624,356.14	16,501,463.14	76,231.56	0,4471%	



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

% Carteira: : **72,15%**

Saldo do grupo: **R\$ 11.906.085,36**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.308.127,96	1,762,811.83	0,03815%	6,050,581,610.41	13,99%	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\$ 2.452.751,84	682,872.58	0,04045%	6,063,437,379.24	14,86%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,04%	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.524.236,23	98,455.04	0,04628%	5,453,684,801.95	15,30%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,05%	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 0,00	0.00	0,00000%	3,601,727,255.66	0,00%	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\$ 4.620.969,33	1,346,576.39	0,06575%	7,028,296,292.55	28,00%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,07%	Enquadrado

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

% Carteira: : **27,85%**

Saldo do grupo: **R\$ 4.595.377,78**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 128.612,54	48,521.19	0,00380%	3,380,807,738.12	0,78%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 1.919.724,53	286,378.25	0,20784%	923,636,374.46	11,63%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,21%	Enquadrado
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.547.040,71	855,039.65	0,01669%	15,259,689,366.93	15,44%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% 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

## Enquadramento por Benchmark

CDI

% Carteira: **16,21%**

Saldo do grupo: **R\$ 2.675.653,25**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 128.612,54	48,521.19	0.00	0.78	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\$ 2.547.040,71	855,039.65	0.02	15.44	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IDKA 2

% Carteira: **14,86%**

Saldo do grupo: **R\$ 2.452.751,84**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 2.452.751,84	682,872.58	0.04	14.86	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

IMA-B

% Carteira: **11,63%**

Saldo do grupo: **R\$ 1.919.724,53**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 1.919.724,53	286,378.25	0.21	11.63	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IMA-B 5

% Carteira: **15,30%**

Saldo do grupo: **R\$ 2.524.236,23**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.524.236,23	98,455.04	0.05	15.30	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

**IPCA**

% Carteira: **13,99%**

Saldo do grupo: **R\$ 2.308.127,96**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.308.127,96	1,762,811.83	0.04	13.99	Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	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: **28,00%**

Saldo do grupo: **R\$ 4.620.969,33**

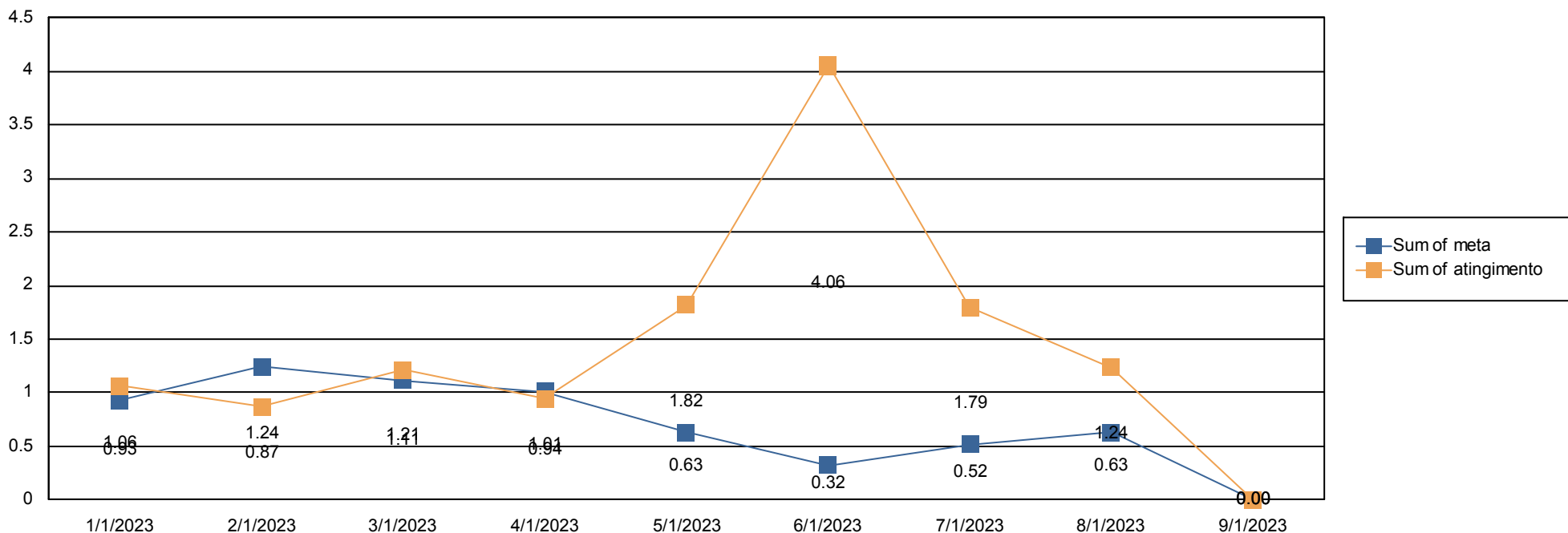
Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 4.620.969,33	1,346,576.39	0.07	28.00	Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado



### Retorno acumulado no ano

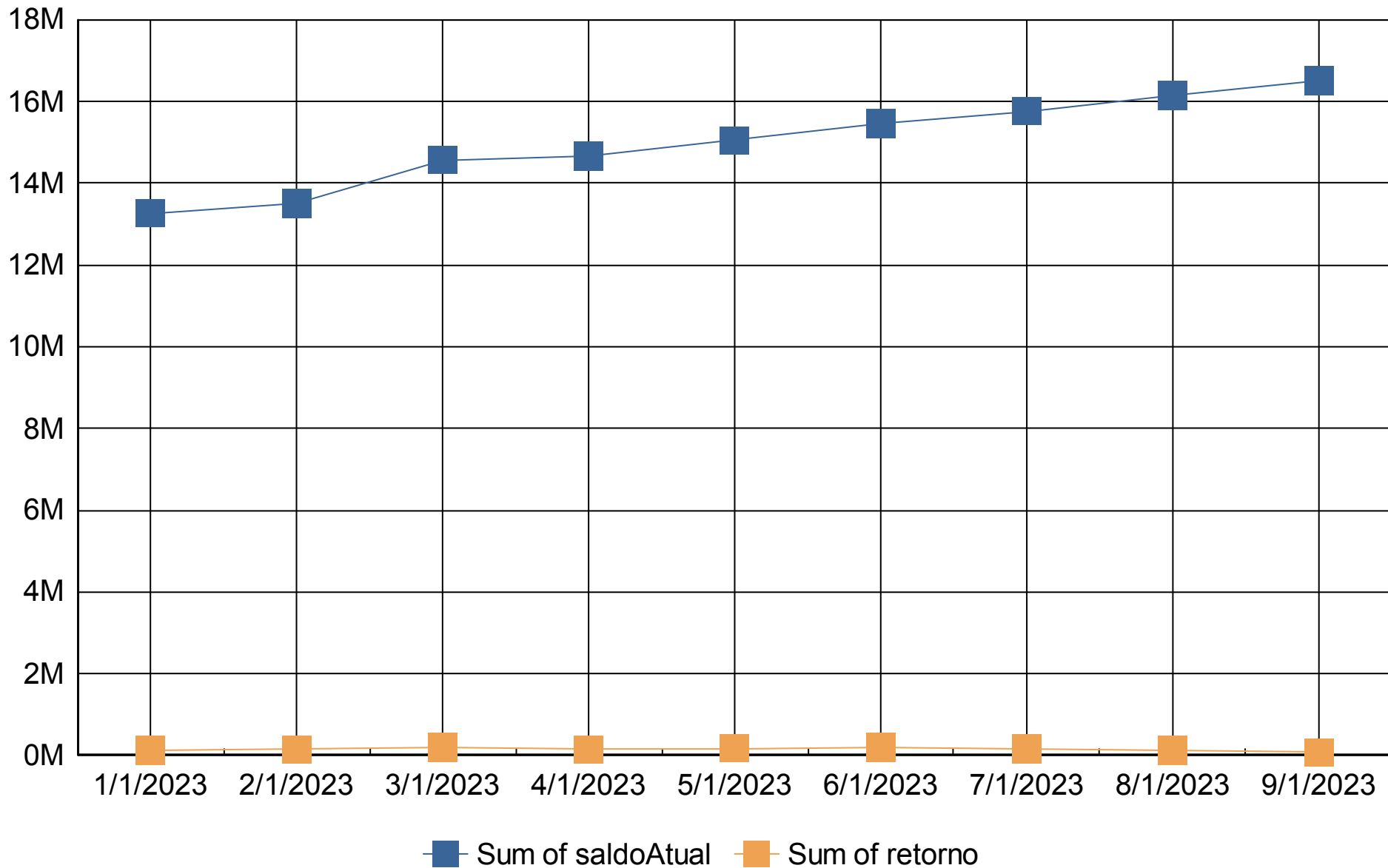
Período	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Retorno %	Meta	Atingimento
Janeiro	R\$ 13.092.685,74	R\$ 509.890,72	R\$ 466.914,26	R\$ 13.270.151,45	R\$ 134.489,25	0,9887%	0,9315	106,1411%
Fevereiro	R\$ 13.270.151,45	R\$ 390.433,59	R\$ 298.043,93	R\$ 13.510.229,57	R\$ 147.688,46	1,0811%	1,2428	86,9913%
Março	R\$ 13.510.229,57	R\$ 1.540.651,22	R\$ 682.076,04	R\$ 14.571.974,49	R\$ 203.169,74	1,3499%	1,1122	121,3708%
Abril	R\$ 14.571.974,49	R\$ 516.828,94	R\$ 581.229,73	R\$ 14.651.527,57	R\$ 143.953,87	0,9540%	1,0118	94,2918%
Mai	R\$ 14.651.527,57	R\$ 688.688,15	R\$ 467.601,21	R\$ 15.048.556,81	R\$ 175.942,30	1,1469%	0,6303	181,9665%
Junho	R\$ 15.048.556,81	R\$ 644.203,89	R\$ 433.547,84	R\$ 15.462.316,60	R\$ 203.103,74	1,2943%	0,3191	405,5942%
Julho	R\$ 15.462.316,60	R\$ 512.125,92	R\$ 360.711,69	R\$ 15.762.624,15	R\$ 148.893,32	0,9321%	0,5199	179,2791%
Agosto	R\$ 15.762.624,15	R\$ 624.683,72	R\$ 364.822,18	R\$ 16.150.211,22	R\$ 127.725,53	0,7794%	0,6303	123,6582%
Setembro	R\$ 16.150.211,22	R\$ 899.376,50	R\$ 624.356,14	R\$ 16.501.463,14	R\$ 76.231,56	0,4471%	0,0000	0,0000%
<b>Total</b>		6,326,882.65	4,279,303.02		1,361,197.77	9,3367%	6,5761%	141,9794%

### Meta x Atingimento





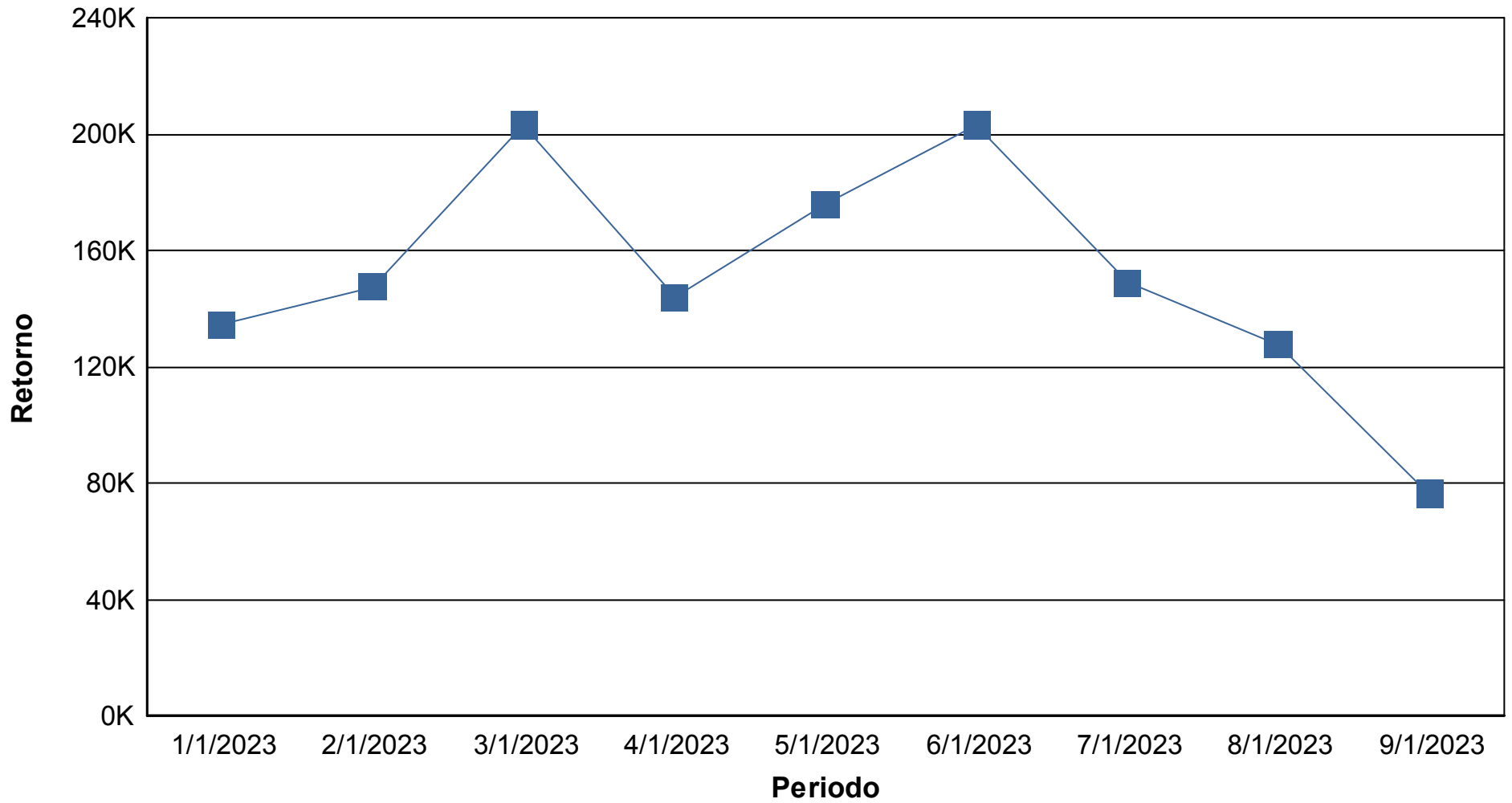
### Evolução do patrimônio





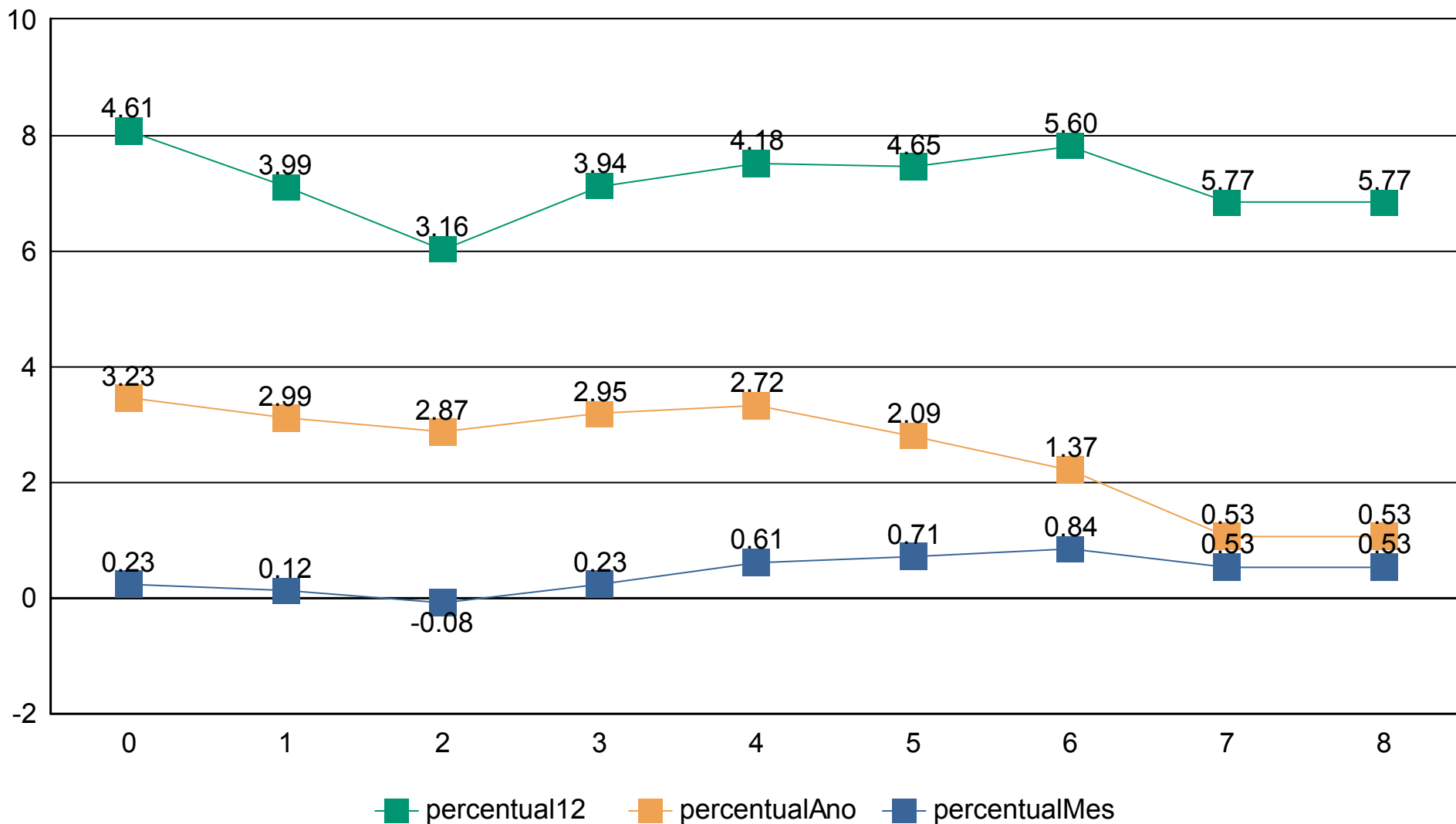


### Retorno Mensal



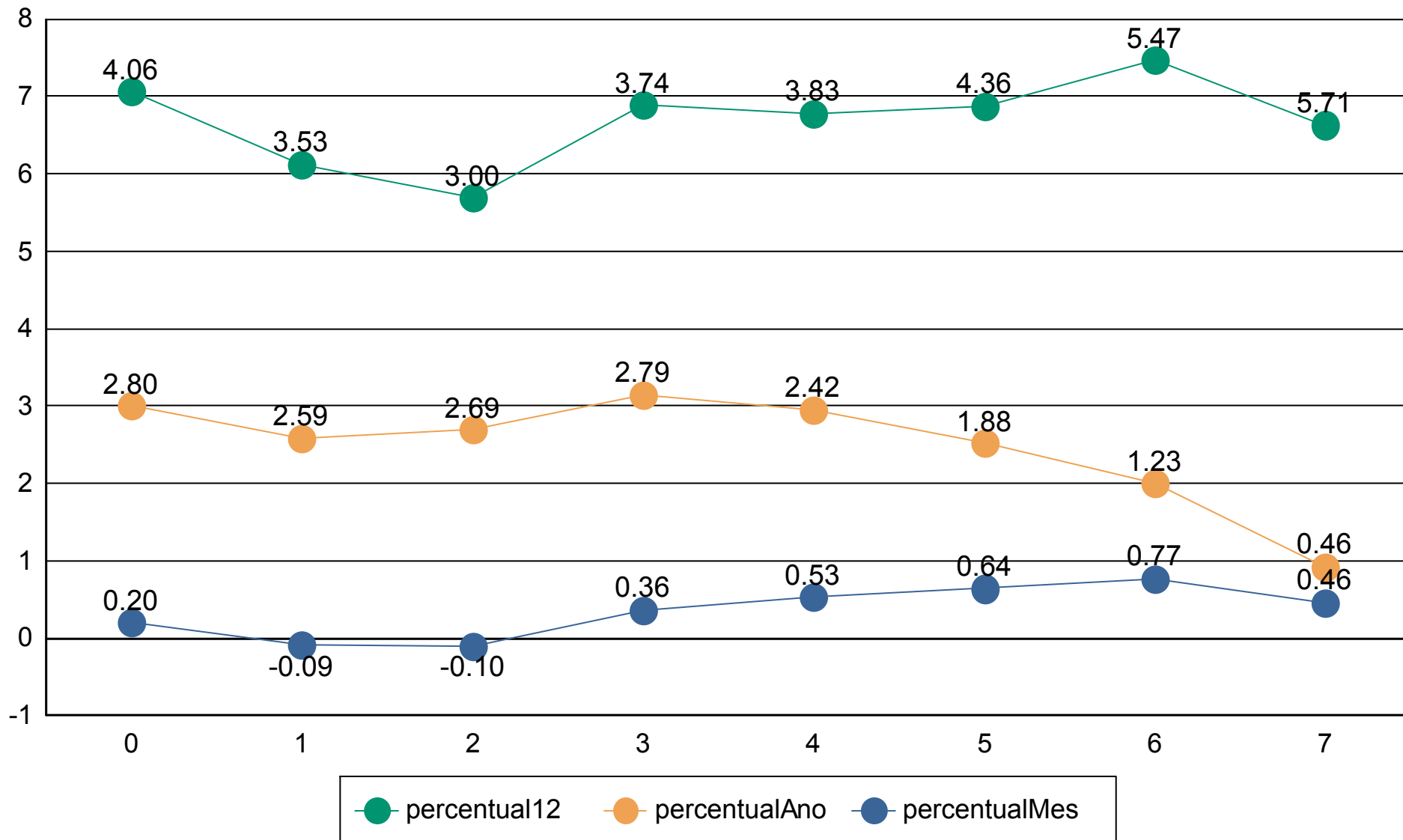


## Índices Econômicos - IPCA



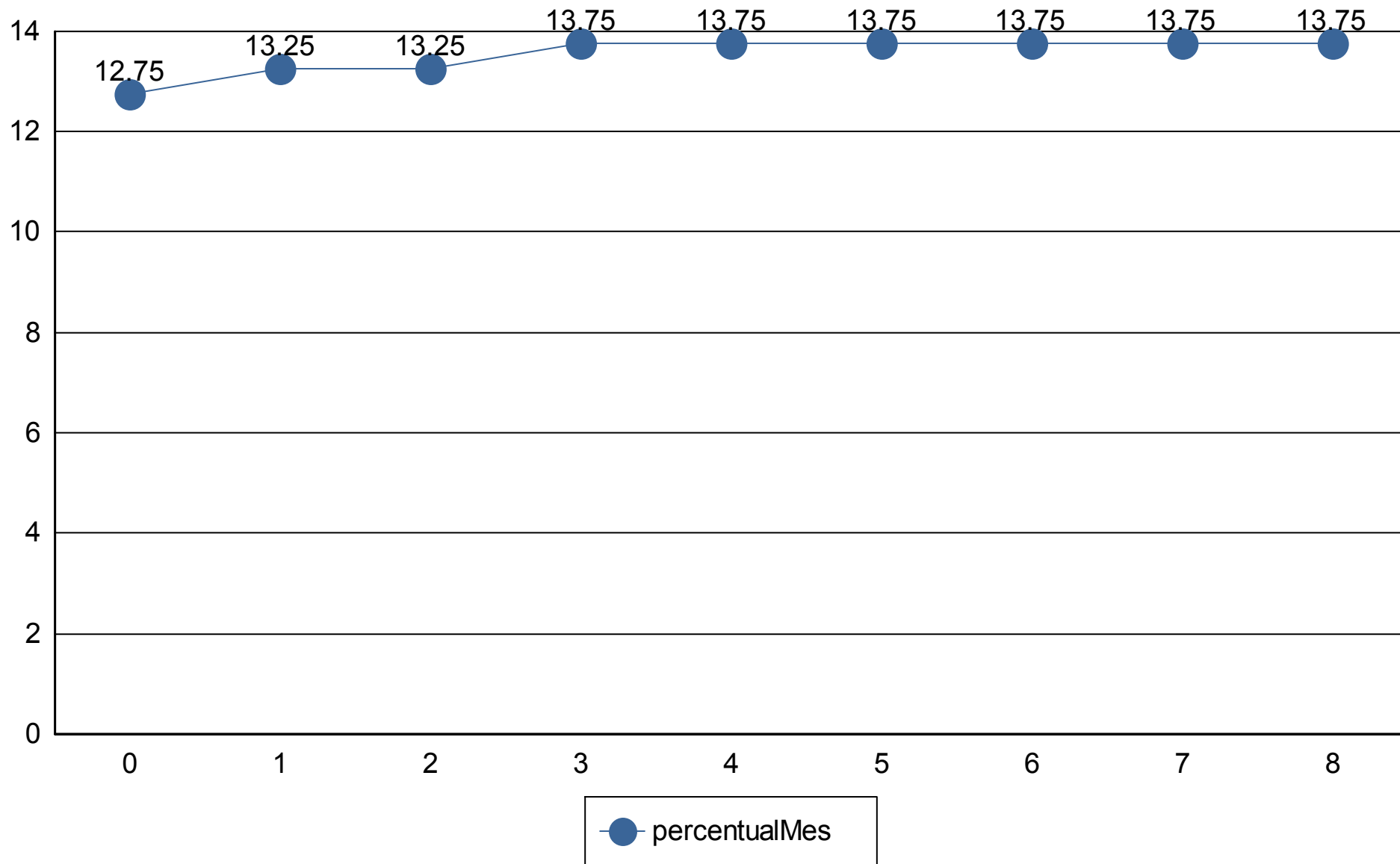


## Índices Econômicos - INPC





## 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 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.

CNPJ	Nome fundo	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL3	VOL6	VOL12
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%
07.861.554/0001-22	BB PREV RF IMA-B FI	IMA-B	16,85%	0,02%	6,64%	26,81%	77,19%
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%
13.322.205/0001-35	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%
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%
35.292.588/0001-89	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FI EM CO	IPCA	22,54%	0,00%	8,73%	29,42%	71,99%
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%
			<b>187,38%</b>	<b>0,03%</b>	<b>54,99%</b>	<b>193,00%</b>	<b>514,39%</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\$ 128.612,54	0,00%	56,83%	R\$ 0,08
35.292.588/0001-89	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORN	IPCA	R\$ 2.308.127,96	0,00%	71,99%	R\$ 71,10
13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICO	IDKA 2	R\$ 2.452.751,84	0,00%	54,41%	R\$ 104,65
07.861.554/0001-22	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTI	IMA-B	R\$ 1.919.724,53	0,02%	77,19%	R\$ 317,49
07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	IRF-M	R\$ 0,00	0,01%	74,78%	R\$ 0,00
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO	IRF-M 1	R\$ 4.620.969,33	0,00%	61,47%	R\$ 5,93
13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO	CDI	R\$ 2.547.040,71	0,00%	61,62%	R\$ 2,52

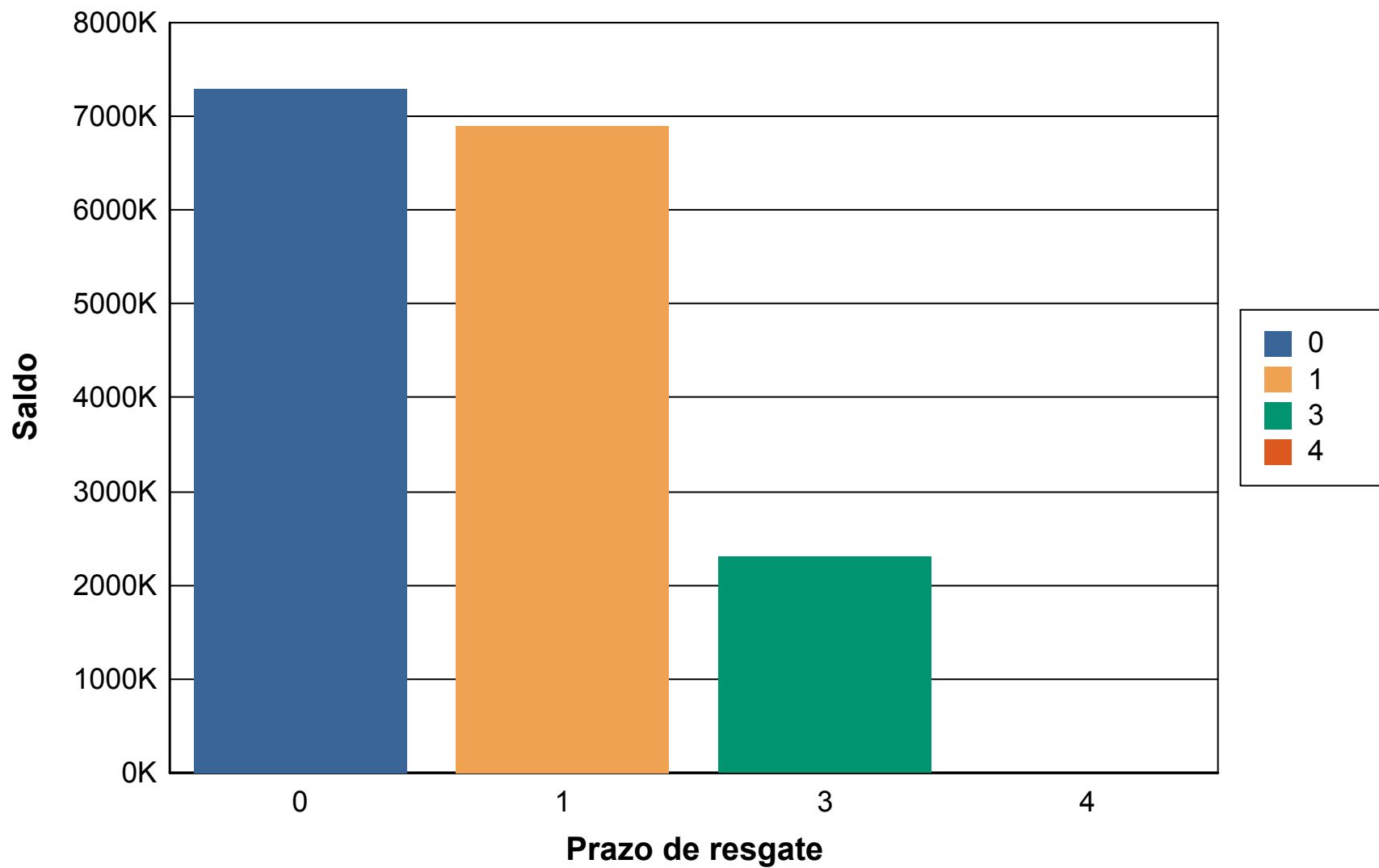
Saldo Total:	<b>R\$ 13.977.226,91</b>
Provisão para perda e Investimentos	<b>R\$ 501,77</b>
% Provisão de perda	0,00%
% Aceitavel perda	2%
Limite de utilização	<b>0,18%</b>



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\$ 128.612,54	0,78%	999	0,00%	R\$ 3.380.807.738,12	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO AT	R\$ 0,00	0,00%	0	0,00%	R\$ 0,00	ixa 100% TP/E	Alto	D+ 4
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO AT	R\$ 2.308.127,96	13,99%	685	0,04%	R\$ 6.050.581.610,41	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 3
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULO	R\$ 2.452.751,84	14,86%	903	0,04%	R\$ 6.063.437.379,24	ixa 100% TP/E	Médio	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO	R\$ 2.524.236,23	15,30%	794	0,05%	R\$ 5.453.684.801,95	ixa 100% TP/E	Alto	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO I	R\$ 1.919.724,53	11,63%	246	0,21%	R\$ 923.636.374,46	da Fixa (CVM)	Médio	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS	R\$ 0,00	0,00%	598	0,00%	R\$ 3.601.727.255,66	ixa 100% TP/E	Médio	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS	R\$ 4.620.969,33	28,00%	1.132	0,07%	R\$ 7.028.296.292,55	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIAD	R\$ 2.547.040,71	15,44%	1.116	0,02%	R\$ 15.259.689.366,93	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
0	R\$ 7.296.622,58	4	44,22%
1	R\$ 6.896.712,60	3	41,79%
3	R\$ 2.308.127,96	1	13,99%
4	R\$ 0,00	1	0,00%





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\$ 11.906.085,36	72,15
Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	60,00%	60,00%	R\$ 4.595.377,78	27,85

	Saldo	% Carteira
100% títulos públicos	0.00	0.00
50% Títulos públicos e 50% Títulos privados	0.00	0.00
100% títulos privados	<b>16,501,463.14</b>	100.00

### Distribuição dos saldos

