

Comitê de Investimentos

ATA DA 4º REUNIÃO ORDINÁRIA

Ata da 4º Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência do Município Cachoeira do Piriá – IPMCP, realizada em 08 de novembro de 2023.

Aos 08 dias do mês de novembro de 2023 às 13h011min, os membros do Comitê de Investimentos do IPMCP – Instituto de Previdência do Município de Cachoeira do Piriá Pará, sito Rua Getúlio Vargas, nº 534, Bairro Centro, reuniram-se o **Sr. Luis Dieggo Costa da Fonseca, Sr. Santiago Abdon Lopes de Almeida e o Sr. Leandro Teixeira de Oliveira**, todos nomeados pela Portaria Nº 017/2023 para o acompanhamento da Política de Investimentos executada no ano de 2023, objetivando a análise do cenário econômico, segurança, rentabilidade, solvência, liquidez e transparência dos recursos previdenciários e administrativos. O membro Presidente do comitê e Gestor de Recursos Financeiros, Sr. Luis Dieggo Costa da Fonseca, iniciou cumprimentando a todos presentes e convidou o Sr. Walcirney Soares Rosa (Assessor jurídico do IPMCP) para participar da reunião e acompanhar todo procedimento de aprovação da ata. Em seguida o Sr. Luis Dieggo Costa da Fonseca disponibilizou aos demais membros do Comitê, extratos bancários, cópias dos relatórios de investimentos que compõem a carteira de ativos financeiros do IPMCP referente ao mês de outubro de 2023, através dos quais estão demonstradas todas as movimentações financeiras de aplicação e resgates, e o desempenho da carteira no período. O Comitê constatou a posição da carteira em 01 de outubro do ano de 2023 com um PL investido no valor de R\$ 16.501.463,14 (Dezesseis milhões, quinhentos e um mil, quatrocentos e sessenta e três reais e quatorze centavos), alocados em 7 fundos de investimentos devidamente enquadrados, conforme relatório do período em anexo, que contém todas as informações extraídas de todos os extratos bancários, com os indicadores dos resultados obtidos, investimentos estes todos adequados com as normas específicas do Conselho Monetário Nacional – CMN – (Resolução 4.963/2021). No décimo mês do ano de 2023, a carteira registrou uma rentabilidade no valor total de R\$ 59.579,97 (Cinquenta e nove mil, quinhentos e setenta e nove reais e noventa e sete centavos), atingindo assim uma rentabilidade percentual de lucros alcançados de 0,36%, onde a meta foi de 0,74%. As operações de resgates somaram o valor total de R\$ 231.790,42 e as aplicações registradas no período foram R\$ 212.036,74 totalizando o saldo geral no dia (31/10/2023) no valor de R\$ 16.541.289,43 (Dezesseis milhões, quinhentos e quarenta e um mil, duzentos e oitenta e nove reais e quarenta e três centavos).

Em seguida o Comitê verificou a aderência dos investimentos com a Política Anual de Investimentos (PAI) do ano findo, bem como com a PAI/2023, está fundamentada na Resolução CMN 4.963/2021 e Portarias: MPS nº 519/2011 (texto consolidado) e SPREV Nº 6.132/2021. A política de Investimentos do RPPS, trata-se, portanto, de uma formalidade legal que fundamenta e norteia todo o processo de tomada de decisão relativa aos investimentos do Instituto de Previdência do Município, utilizado como instrumento necessário para garantir a consistência da gestão dos recursos no decorrer do tempo e visar à manutenção do equilíbrio econômico-financeiro entre os seus ativos e passivos. O Comitê constatou que a meta percentual exigida na política de investimentos no décimo mês do ano que era de (IPCA + 0,5%) não foi superada. O IPMCP - Instituto de Previdência do Município de Cachoeira do Piriá - IPMCP junto com a Di Blasi Consultoria Financeira Ltda responsável pelo acompanhamento da carteira de investimentos, executaram a sua política de investimentos corretamente e devidamente ajustada com os limites e critérios estabelecidos na Resolução CMN 4.963/21. Por fim o Comitê de Investimentos do IPMCP aprova todas as movimentações de aplicação e resgates executadas no mês de outubro de 2023, que, apresentou o acompanhamento das rentabilidades, dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações de acordo com a Política Anual de Investimentos do exercício de 2023. O Comitê de Investimento recomenda a diversificação da carteira, com investimentos nas diversas classes de ativos, buscando reduzir a correlação das aplicações e captura de retornos superiores de capital ao longo do tempo. Como não houve mais nada a ser tratado, o membro Presidente do Comitê e Gestor de Recursos Financeiros Sr. Luis Dieggo Costa da Fonseca, deu por encerrada a reunião às 15h38min do mesmo dia, e eu Santiago Abdon Lopes de Almeida (Membro representante do IPMCP), lavrei a presente ata que vai assinada por mim e pelos demais membros do Comitê de Investimentos do IPMCP - Instituto de Previdência do Município de Cachoeira do Piriá e convidados, presentes na reunião.

Cachoeira do Piriá – PA, 08 de novembro de 2023.

LUIS DIEGGO COSTA DA
FONSECA:95660259200
LUIS DIEGGO COSTA DA FONSECA
(Presidente do Comitê)

Assinado de forma digital
por LUIS DIEGGO COSTA
DA
FONSECA:95660259200

SANTIAGO ABDON LOPES DE
ALMEIDA:00227160258
SANTIAGO ABDON LOPES DE ALMEIDA
(Membro Representante do IPMCP)

Assinado de forma digital por
SANTIAGO ABDON LOPES DE
ALMEIDA:00227160258

LEANDRO TEIXEIRA DE OLIVEIRA:90281241287
LEANDRO TEIXEIRA DE OLIVEIRA
(Membro Representante dos Servidores Efetivos)

Assinado de forma digital
por LEANDRO TEIXEIRA DE
OLIVEIRA:90281241287



WALCIRNEY SOARES ROSA
(Assessor Jurídico do IPMCP)

Assinado de forma digital por WALCIRNEY SOARES
ROSA:36207977220
DN: c=BR, o=ICP-Brasil, ou=000001010767404, ou=Secretaria
da Receita Federal do Brasil - RFB, ou=RFB e CPF A3, ou=AC
SERASA RFB, ou=21286543000197, ou=PRESENCIAL,
cn=WALCIRNEY SOARES ROSA:36207977220
Versão do Adobe Acrobat Reader: 2024.001.20615



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DOS SERVIDORES
DO MUNICÍPIO DE CACHOEIRA DO PIRIÁ**
Outubro 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	0,67%	1,004	0.00	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 110.165,01	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	14,07%	699	0.04	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 2.327.765,99	B	Fundo de Investimento	0,20%
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	1	14,78%	883	0.04	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 2.444.664,16	M	Fundo de Investimento	0,20%
03.543.447/0001-03	BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO F	1	15,21%	794	0.05	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 2.516.058,10	A	Fundo de Investimento	0,20%
07.861.554/0001-22	BB PREV RF IMA-B FI	1	11,53%	246	0.21	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 1.906.702,20	M	Fundo de Investimento	0,30%
07.111.384/0001-69	BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	0	0,00%	641	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	28,19%	1,143	0.06	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 4.663.675,11	B	Fundo de Investimento	0,20%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONC	0	15,55%	1,134	0.02	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 2.572.211,32	B	Fundo de Investimento	0,20%

R\$ 16.541.241,89



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\$ 128.612,54	R\$ 212.036,74	R\$ 231.790,42	R\$ 110.212,55	R\$ 1.353,69	0,3973%	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\$ 2.308.127,96	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 2.327.765,99	R\$ 19.638,03	0,8508%	IPCA
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 2.452.751,84	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 2.444.664,16	R\$ -8.087,68	-0,3298%	IDKA 2
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZ	R\$ 2.524.236,23	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 2.516.058,10	R\$ -8.178,13	-0,3240%	IMA-B 5
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 1.919.724,53	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 1.906.702,20	R\$ -13.022,33	-0,6784%	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\$ 4.620.969,33	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 4.663.675,11	R\$ 42.705,78	0,9241%	IRF-M 1
BB PREV RF REFERENCIADO DI LI	R\$ 2.547.040,71	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 2.572.211,32	R\$ 25.170,61	0,9882%	CDI
Total	16,501,463.14	212,036.74	231,790.42	16,541,289.43	59,579.97	0,3565%	



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: : **72,26%** Saldo do grupo: **R\$ 11.952.163,36**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.327.765,99	1,762,811.83	0,03827%	6,082,622,569.66	14,07%	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\$ 2.444.664,16	682,872.58	0,04197%	5,824,441,376.72	14,78%	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\$ 2.516.058,10	98,455.04	0,04790%	5,252,934,178.04	15,21%	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%	3,620,971,555.98	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\$ 4.663.675,11	1,346,576.39	0,06496%	7,179,042,508.92	28,19%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,06%	Enquadrado

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

% Carteira: : **27,74%** Saldo do grupo: **R\$ 4.589.126,07**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 110.212,55	41,207.67	0,00299%	3,689,670,141.46	0,67%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 1.906.702,20	286,378.25	0,21025%	906,861,937.86	11,53%	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\$ 2.572.211,32	855,039.65	0,01682%	15,296,039,303.73	15,55%	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: **16,22%**

Saldo do grupo: **R\$ 2.682.423,87**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 110.212,55	41,207.67	0.00	0.67	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\$ 2.572.211,32	855,039.65	0.02	15.55	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IDKA 2

% Carteira: **14,78%**

Saldo do grupo: **R\$ 2.444.664,16**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 2.444.664,16	682,872.58	0.04	14.78	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

IMA-B

% Carteira: **11,53%**

Saldo do grupo: **R\$ 1.906.702,20**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 1.906.702,20	286,378.25	0.21	11.53	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IMA-B 5

% Carteira: **15,21%**

Saldo do grupo: **R\$ 2.516.058,10**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.516.058,10	98,455.04	0.05	15.21	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: **14,07%**

Saldo do grupo: **R\$ 2.327.765,99**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.327.765,99	1,762,811.83	0.04	14.07	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: **28,19%**

Saldo do grupo: **R\$ 4.663.675,11**

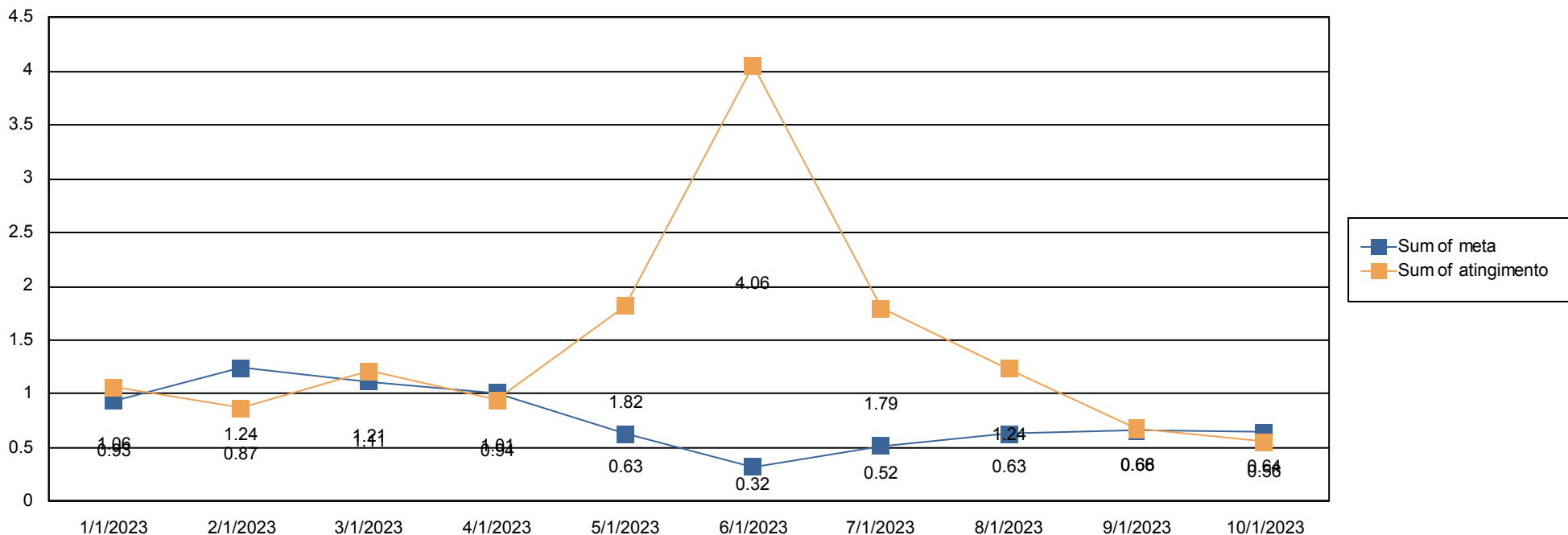
Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 4.663.675,11	1,346,576.39	0.06	28.19	Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado



Retorno acumulado no ano

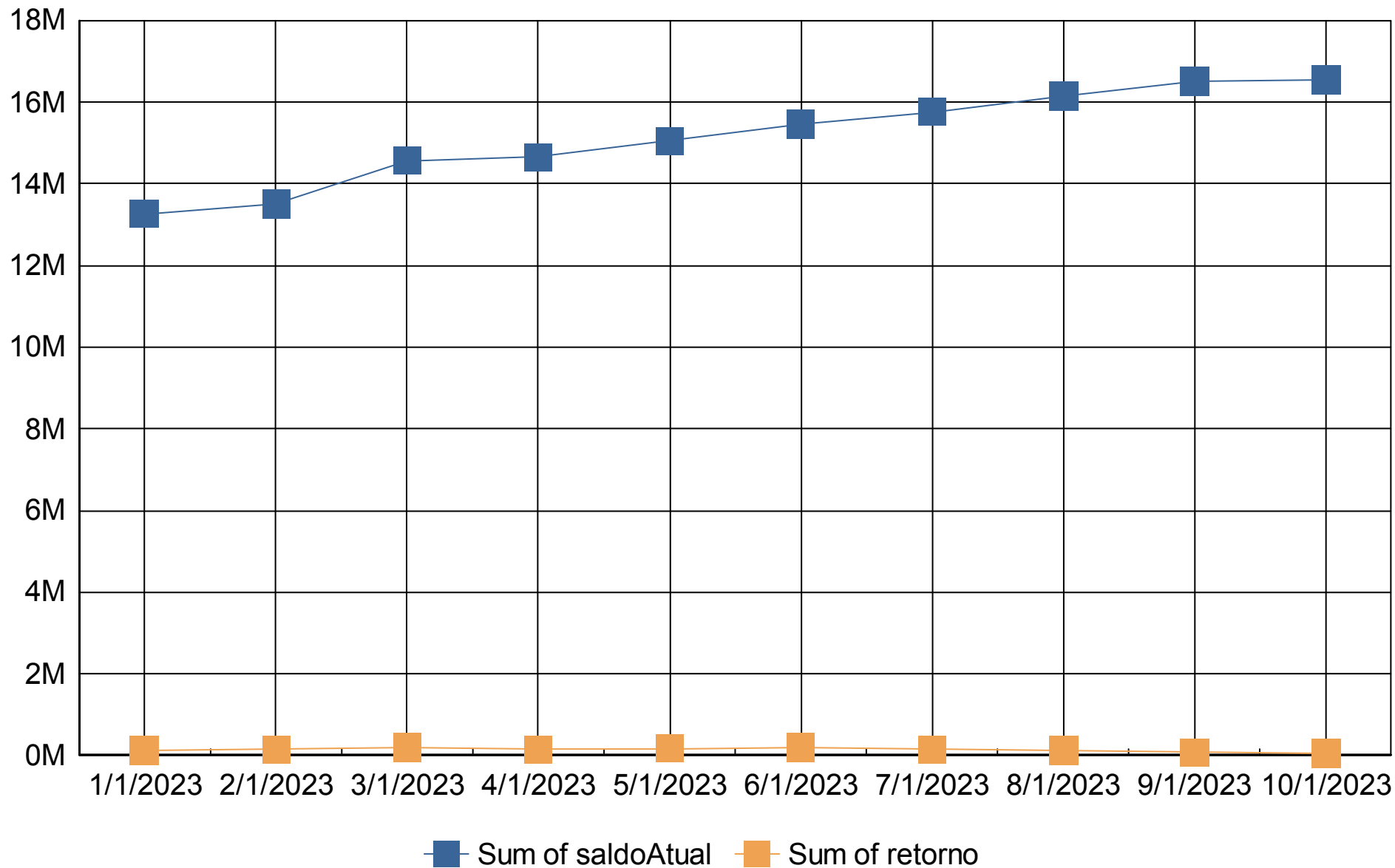
Período	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Retorno %	Meta	Atingimento
Janeiro	R\$ 13.092.685,74	R\$ 509.890,72	R\$ 466.914,26	R\$ 13.270.151,45	R\$ 134.489,25	0,9887%	0,9315	106,1411%
Fevereiro	R\$ 13.270.151,45	R\$ 390.433,59	R\$ 298.043,93	R\$ 13.510.229,57	R\$ 147.688,46	1,0811%	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%
Maió	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%	0,6604	67,7039%
Outubro	R\$ 16.501.463,14	R\$ 212.036,74	R\$ 231.790,42	R\$ 16.541.289,43	R\$ 59.579,97	0,3565%	0,6404	55,6649%
Total		6,538,919.39	4,511,093.44		1,420,777.74	9,7264%	7,9669%	122,0852%

Meta x Atingimento



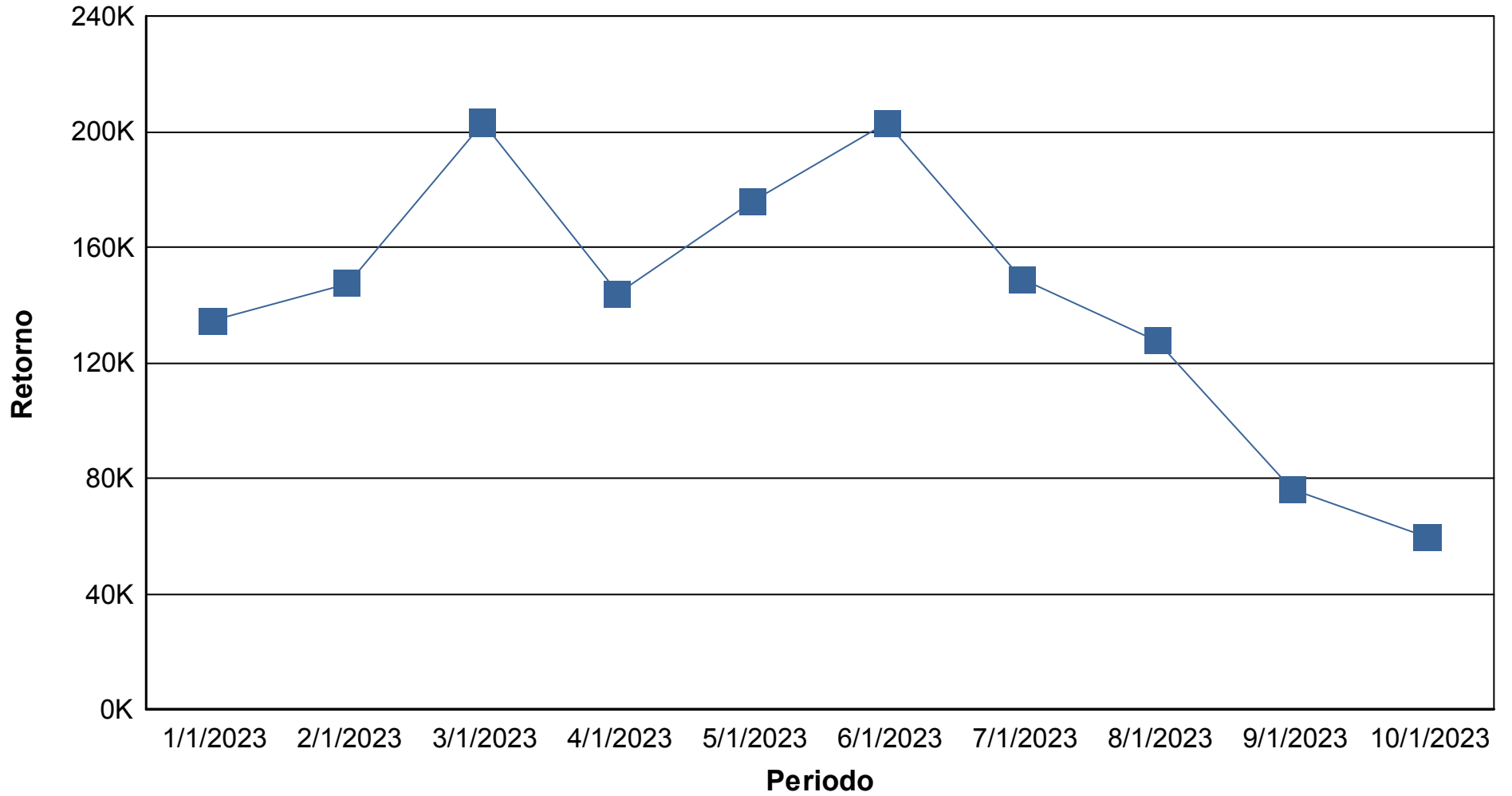


Evolução do patrimônio



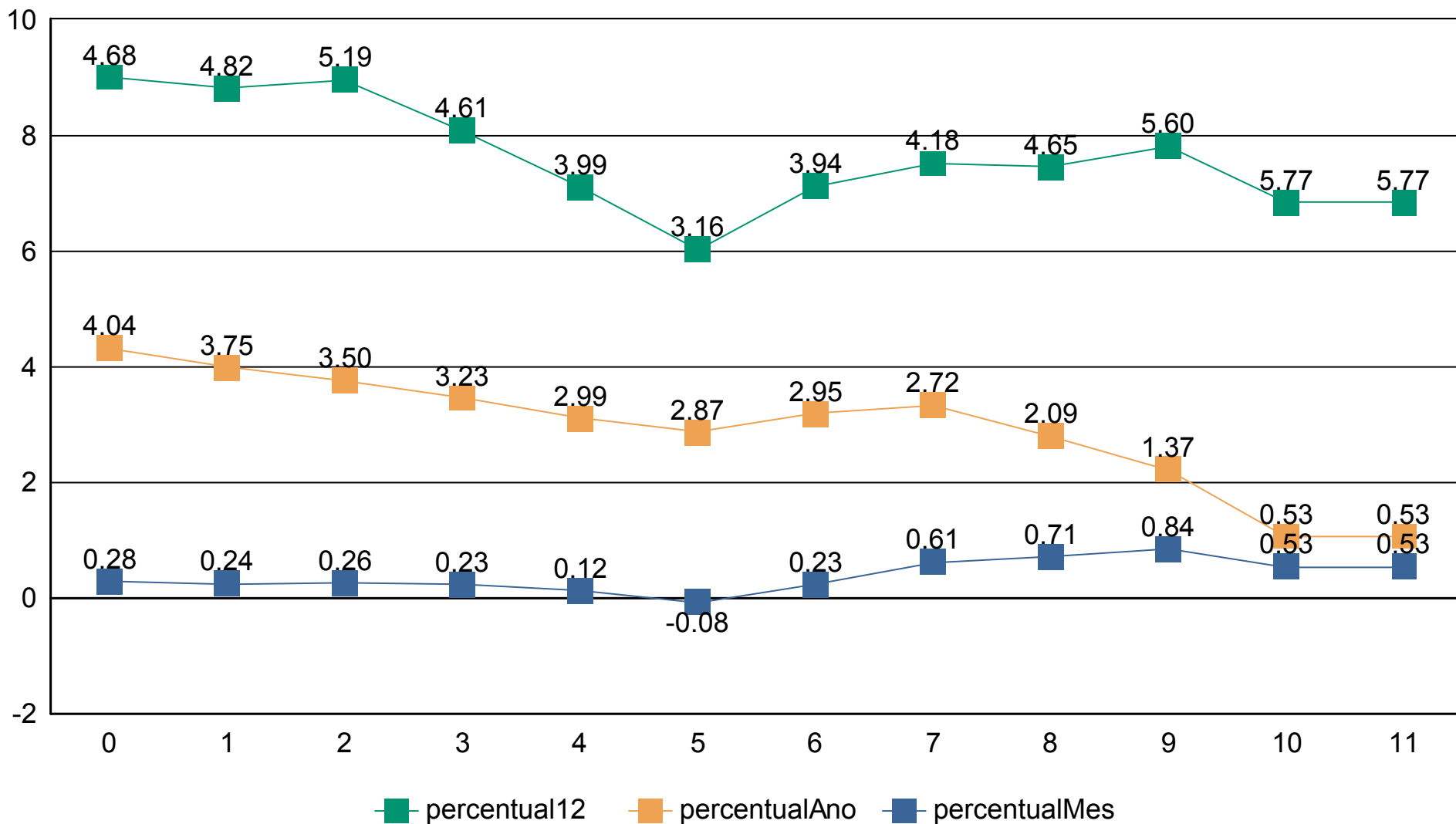


Retorno Mensal



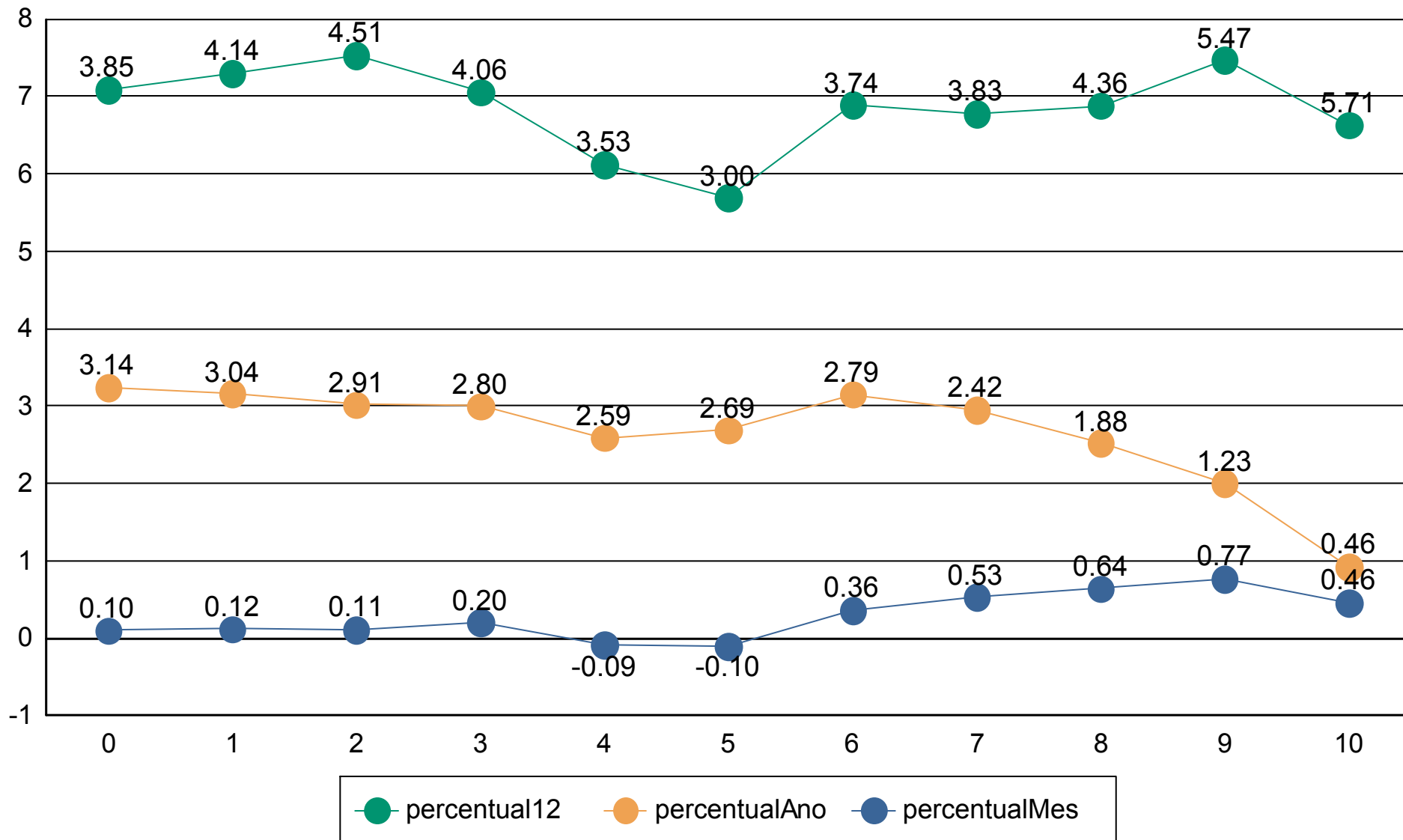


Índices Econômicos - IPCA



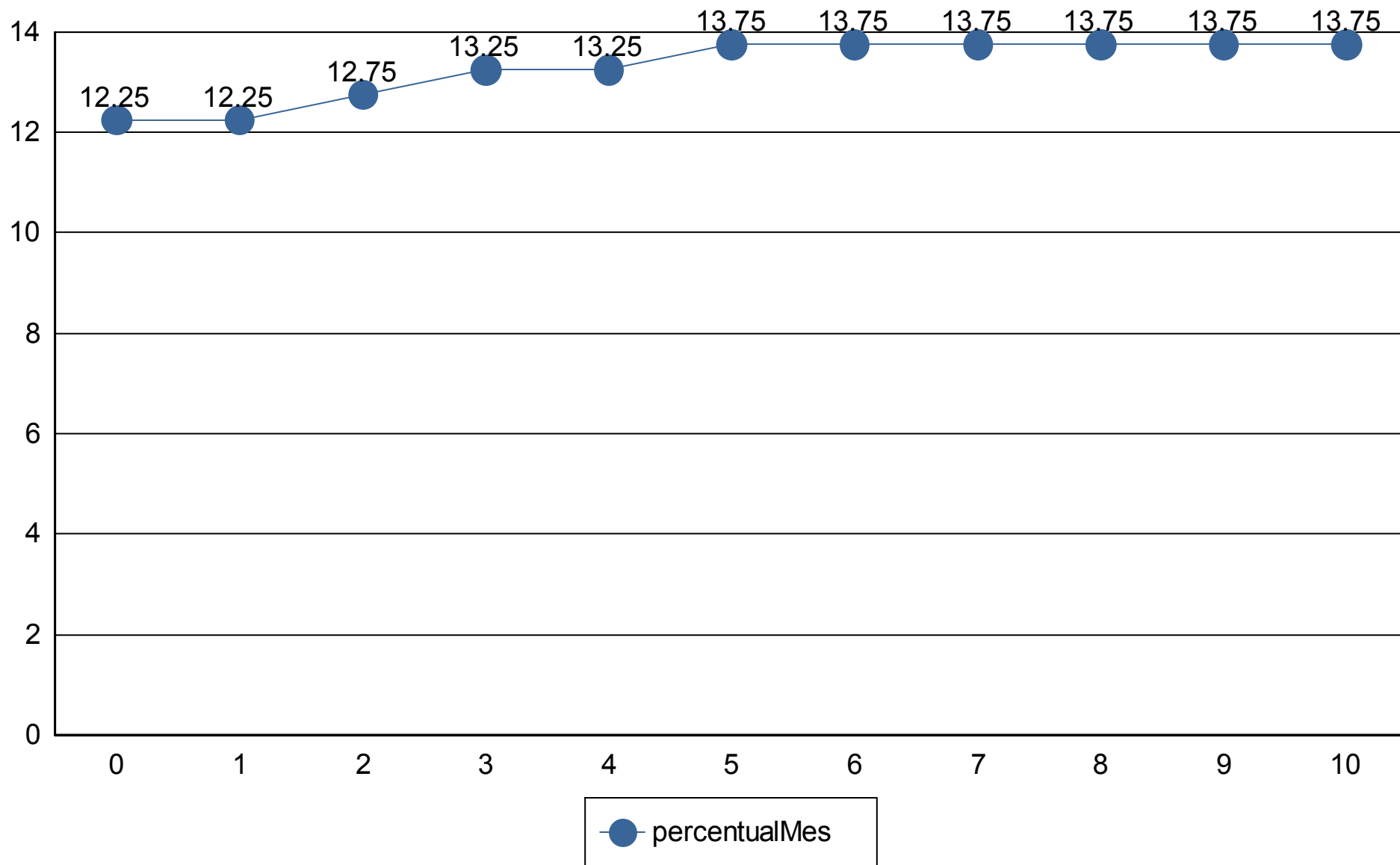


Índices Econômicos - INPC





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

Provisão de risco - Mercado

CNPJ	Nome do fundo	Benchmark	Saldo	VAR12	VOL12	VAR% BASE 1

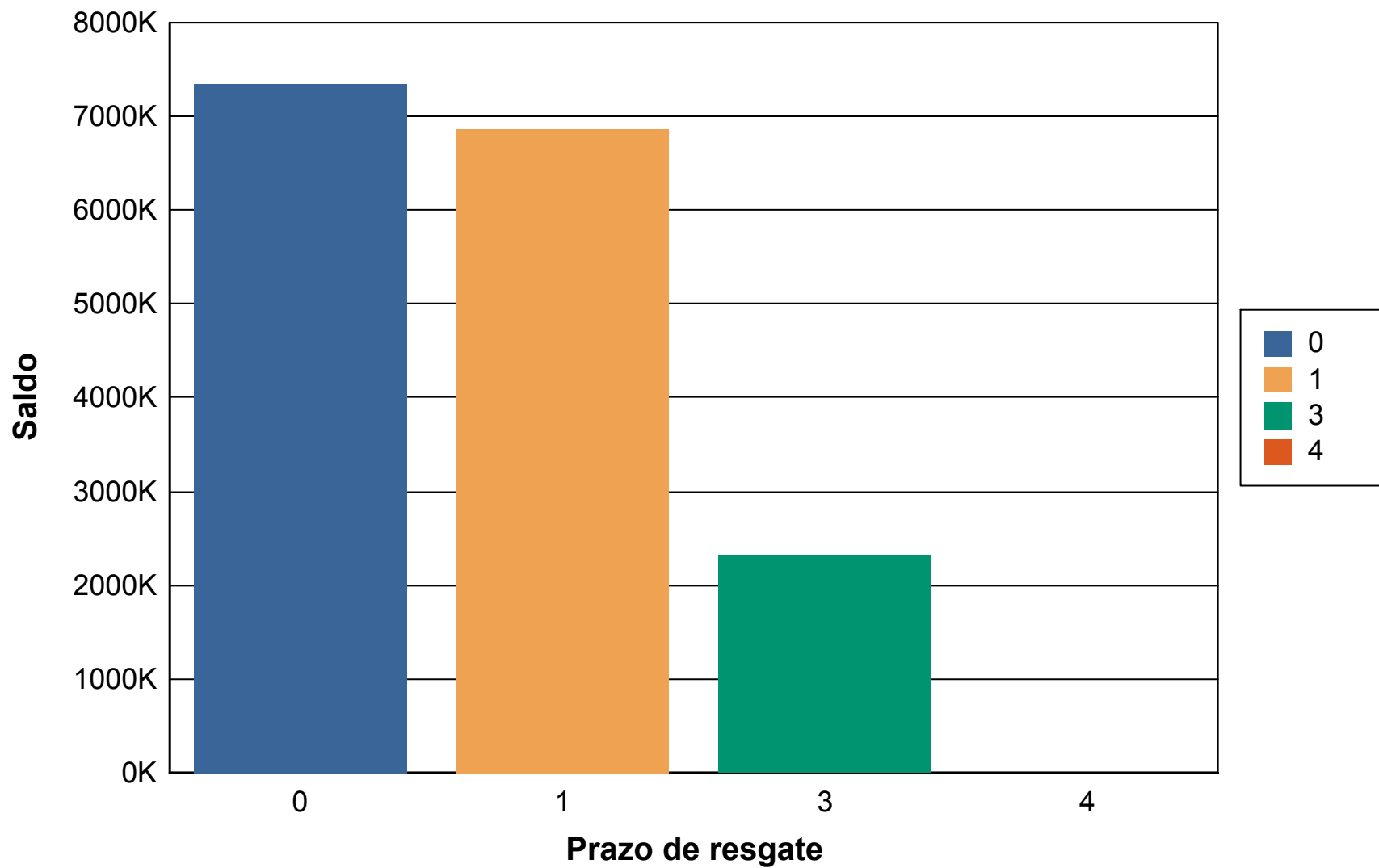
Saldo Total:	
Provisão para perda e Investimentos	
% Provisão de perda	
% Aceitavel perda	2%
Limite de utilização	



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\$ 110.165,01	0,67%	1,004	0,00%	R\$ 3.689.670.141,46	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\$ 2.327.765,99	14,07%	699	0,04%	R\$ 6.082.622.569,66	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 3
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULO	R\$ 2.444.664,16	14,78%	883	0,04%	R\$ 5.824.441.376,72	ixa 100% TP/E	Médio	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO	R\$ 2.516.058,10	15,21%	794	0,05%	R\$ 5.252.934.178,04	ixa 100% TP/E	Alto	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO I	R\$ 1.906.702,20	11,53%	246	0,21%	R\$ 906.861.937,86	da Fixa (CVM)	Médio	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS	R\$ 0,00	0,00%	641	0,00%	R\$ 3.620.971.555,98	ixa 100% TP/E	Médio	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS	R\$ 4.663.675,11	28,19%	1,143	0,06%	R\$ 7.179.042.508,92	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIAD	R\$ 2.572.211,32	15,55%	1,134	0,02%	R\$ 15.296.039.303,73	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
0	R\$ 7.346.051,44	4	44,41%
1	R\$ 6.867.424,46	3	41,52%
3	R\$ 2.327.765,99	1	14,07%
4	R\$ 0,00	1	0,00%





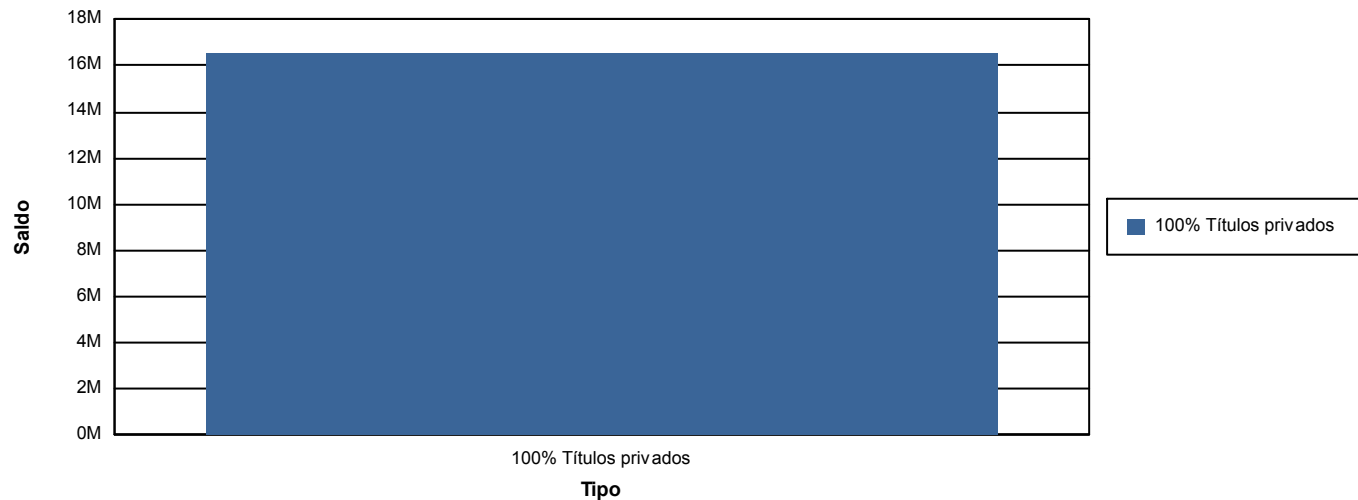
Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE CACHOEIRA DO PIRIÁ
CNPJ: 02.148.931/0001-67

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\$ 11.952.163,36	72,26
Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	60,00%	60,00%	R\$ 4.589.078,53	27,74

	Saldo	% Carteira
100% títulos públicos	0.00	0.00
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	0.00	0.00
100% títulos privados	16,541,241.89	100.00

Distribuição dos saldos





Rentabilidade Média

RENDA FIXA

Fundo	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FI EM COTAS DE FI	R\$ 0,00	0,0000%	0,6404%	0,0000%
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 110.212,55	0,3974%	0,6404%	62,0527%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.327.765,99	0,8508%	0,6404%	132,8577%
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 2.444.664,16	-0,3297%	0,6404%	-51,4895%
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.516.058,10	-0,3240%	0,6404%	-50,5909%
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 1.906.702,20	-0,6783%	0,6404%	-105,9250%
BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 0,00	0,0000%	0,6404%	0,0000%
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 4.663.675,11	0,9242%	0,6404%	144,3119%
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.572.211,32	0,9882%	0,6404%	154,3144%

Total	Saldo Atual	Retorno %	Meta	Atingimento
	R\$ 16.541.289,43	0,3565%	0,6404%	55,6649%

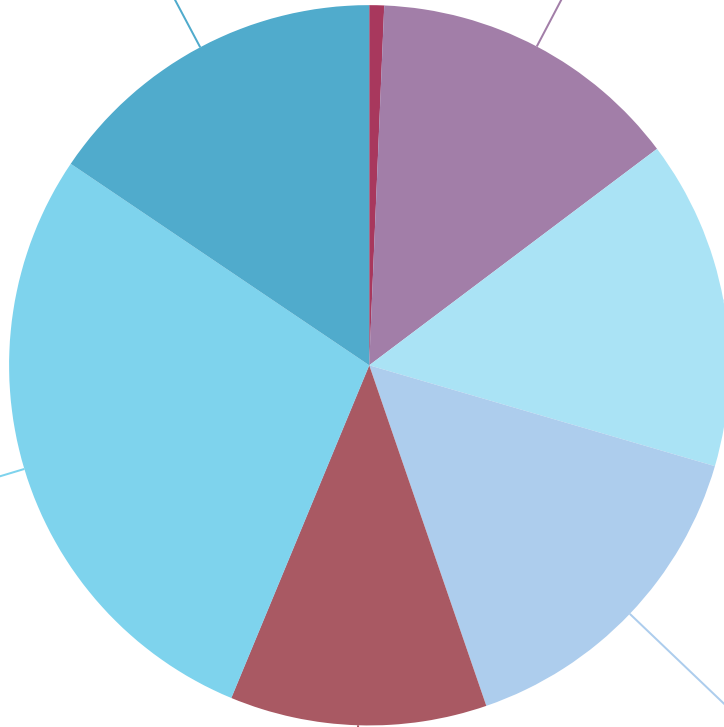
Total: R\$ R\$ 16.541.289,43

A rentabilidade média da carteira é de 0,3565%, enquanto que a meta atuarial foi de 0,6404%, sendo assim, atingindo 55,6649% da meta Atuarial

Carteira Atual

BB PREV RF...

BB PREV RF...



BB PREV RF...

BB PREV RF...

BB PREV RF...

BB PREV RF...

Comparativo com a Meta Atuarial

Mês	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
JANEIRO	0,9887%	0,9315%	106,1411%
FEVEREIRO	1,0811%	1,2428%	86,9913%
MARÇO	1,3499%	1,1122%	121,3708%
ABRIL	0,9540%	1,0118%	94,2918%
MAIO	1,1469%	0,6303%	181,9665%
JUNHO	1,2943%	0,3191%	405,5942%
JULHO	0,9321%	0,5199%	179,2791%
AGOSTO	0,7794%	0,6303%	123,6582%
SETEMBRO	0,4471%	0,6604%	67,7039%
OUTUBRO	0,3565%	0,6404%	55,6649%

	Efetivo %	Meta %	Atingimento %
Total	9,7264%	7,9669%	122,0852%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 9,7264% enquanto que a meta acumulada no período é de 7,9669%, sendo assim o RPPS atingiu 122,0852% 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\$ 110.212,55	0,000065%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 2.327.765,99	0,003116%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 2.444.664,16	0,004409%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 2.516.058,10	0,003643%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 1.906.702,20	0,018199%

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 4.663.675,11	0,000136%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 2.572.211,32	0,000102%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 0,00	0,006857%

	Saldo	VAR 12M
Geral	R\$ 16.541.289,43	0,004566%

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	26,015899%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	21,632779%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	20,959336%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	20,745467%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	14,174531%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	25,637037%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	25,922066%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	20,091896%

	Sharpe
Geral	21,897376%

O fundo BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI teve o melhor Índice Sharpe positivo, portanto foi o fundo que teve melhor desempenho analisando a relação risco/retorno.



Cliente

Agência 1735-3
Conta 1013-8 I P A S M CACHOEIRA PIRIA
Mês/ano referência OUTUBRO/2023

BB Previd Fluxo RF - CNPJ: 13.077.415/0001-05

Data	Histórico	Valor	Valor IRPrej. Comp.	Valor IOF	Quantidade cotas	Valor cota	Saldo cotas
29/09/2023	SALDO ANTERIOR	128.612,54			48.521,191184		
03/10/2023	RESGATE	6,80			2,563169	2,652966371	48.518,628015
	Aplicação 20/09/2023	6,80			2,563169		
06/10/2023	RESGATE	1.317,67			496,024389	2,656462119	48.022,603626
	Aplicação 20/09/2023	1.317,67			496,024389		
11/10/2023	RESGATE	12.402,57			4.662,814957	2,659888954	43.359,788669
	Aplicação 20/09/2023	12.402,57			4.662,814957		
19/10/2023	RESGATE	222,90			83,625119	2,665467060	43.276,163550
	Aplicação 20/09/2023	222,90			83,625119		
20/10/2023	APLICAÇÃO	14.052,66			5.269,873841	2,666602735	48.546,037391
24/10/2023	APLICAÇÃO	197.780,46			74.107,314001	2,668838598	122.653,351392
25/10/2023	RESGATE	5.088,11			1.905,695560	2,669949024	120.747,655832
	Aplicação 20/09/2023	5.088,11			1.905,695560		
26/10/2023	RESGATE	10,00			3,743793	2,671087622	120.743,912039
	Aplicação 20/09/2023	10,00			3,743793		
27/10/2023	RESGATE	212.702,37			79.597,410439	2,672227260	41.146,501600
	Aplicação 20/09/2023	66.089,63			24.732,041233		
	Aplicação 29/09/2023	44.451,65			16.634,682964		
	Aplicação 20/10/2023	14.082,30			5.269,873841		
	Aplicação 24/10/2023	88.078,79			32.960,812401		
30/10/2023	RESGATE	40,00			14,962175	2,673408111	41.131,539425
	Aplicação 24/10/2023	40,00			14,962175		
31/10/2023	APLICAÇÃO	203,62			76,132037	2,674563924	41.207,671462
31/10/2023	SALDO ATUAL	110.212,55			41.207,671462		41.207,671462

Resumo do mês

SALDO ANTERIOR	128.612,54
APLICAÇÕES (+)	212.036,74
RESGATES (-)	231.790,42
RENDIMENTO BRUTO (+)	1.353,69
IMPOSTO DE RENDA (-)	0,00
IOF (-)	0,00
RENDIMENTO LÍQUIDO	1.353,69
SALDO ATUAL =	110.212,55

Valor da Cota

29/09/2023	2,650646850
31/10/2023	2,674563924

Rentabilidade

No mês	0,9023
No ano	10,1026
Últimos 12 meses	12,2807

Transação efetuada com sucesso por: JE744615 SANTIAGO ABDON LOPES DE ALMEIDA.

Serviço de Atendimento ao Consumidor - SAC 0800 729 0722

Ouvidoria BB 0800 729 5678
Para deficientes auditivos 0800 729 0088



Cliente

Agência 1735-3
Conta 21683-6 I P A S M CACHOEIRA PIRIA
Mês/ano referência OUTUBRO/2023

PREVID RF IMA-B 5 - CNPJ: 3.543.447/0001-03

Data	Histórico	Valor	Valor IRPrej. Comp.	Valor IOF	Quantidade cotas	Valor cota	Saldo cotas
29/09/2023	SALDO ANTERIOR	2.524.236,23			98.455,039758		
31/10/2023	SALDO ATUAL	2.516.058,10			98.455,039758		98.455,039758

Resumo do mês

SALDO ANTERIOR	2.524.236,23
APLICAÇÕES (+)	0,00
RESGATES (-)	0,00
RENDIMENTO BRUTO (-)	-8.178,13
IMPOSTO DE RENDA (-)	0,00
IOF (-)	0,00
RENDIMENTO LÍQUIDO	-8.178,13
SALDO ATUAL =	2.516.058,10

Valor da Cota

29/09/2023	25,638466394
31/10/2023	25,555401837

Rentabilidade

No mês	-0,3239
No ano	8,4018
Últimos 12 meses	8,9902

BB Previd RF IMA-B - CNPJ: 7.861.554/0001-22

Data	Histórico	Valor	Valor IRPrej. Comp.	Valor IOF	Quantidade cotas	Valor cota	Saldo cotas
29/09/2023	SALDO ANTERIOR	1.919.724,53			286.378,247732		
31/10/2023	SALDO ATUAL	1.906.702,20			286.378,247732		286.378,247732

Resumo do mês

SALDO ANTERIOR	1.919.724,53
APLICAÇÕES (+)	0,00
RESGATES (-)	0,00
RENDIMENTO BRUTO (-)	-13.022,33
IMPOSTO DE RENDA (-)	0,00
IOF (-)	0,00
RENDIMENTO LÍQUIDO	-13.022,33
SALDO ATUAL =	1.906.702,20

Valor da Cota

29/09/2023	6,703457918
31/10/2023	6,657985438

Rentabilidade

No mês	-0,6783
No ano	9,8251
Últimos 12 meses	8,7336

BB Previd RF IRF-M1 - CNPJ: 11.328.882/0001-35

Data	Histórico	Valor	Valor IRPrej. Comp.	Valor IOF	Quantidade cotas	Valor cota	Saldo cotas
29/09/2023	SALDO ANTERIOR	4.620.969,33			1.346.576,389551		
31/10/2023	SALDO ATUAL	4.663.675,11			1.346.576,389551		1.346.576,389551

Resumo do mês

SALDO ANTERIOR	4.620.969,33
APLICAÇÕES (+)	0,00
RESGATES (-)	0,00
RENDIMENTO BRUTO (+)	42.705,78
IMPOSTO DE RENDA (-)	0,00
IOF (-)	0,00
RENDIMENTO LÍQUIDO	42.705,78

SALDO ATUAL = 4.663.675,11

Valor da Cota

29/09/2023	3,431642917
31/10/2023	3,463357253

Rentabilidade

No mês	0,9241
No ano	10,8198
Últimos 12 meses	13,1269

BB PREVID RF IDKA 2 - CNPJ: 13.322.205/0001-35

Data	Histórico	Valor	Valor IRPrej. Comp.	Valor IOF	Quantidade cotas	Valor cota	Saldo cotas
29/09/2023	SALDO ANTERIOR	2.452.751,84			682.872,579938		
31/10/2023	SALDO ATUAL	2.444.664,16			682.872,579938		682.872,579938

Resumo do mês

SALDO ANTERIOR	2.452.751,84
APLICAÇÕES (+)	0,00
RESGATES (-)	0,00
RENDIMENTO BRUTO (-)	-8.087,68
IMPOSTO DE RENDA (-)	0,00
IOF (-)	0,00
RENDIMENTO LÍQUIDO	-8.087,68
SALDO ATUAL =	2.444.664,16

Valor da Cota

29/09/2023	3,591814795
31/10/2023	3,579971182

Rentabilidade

No mês	-0,3297
No ano	8,2338
Últimos 12 meses	8,8368

BB Previd RF Perfil - CNPJ: 13.077.418/0001-49

Data	Histórico	Valor	Valor IRPrej. Comp.	Valor IOF	Quantidade cotas	Valor cota	Saldo cotas
29/09/2023	SALDO ANTERIOR	2.547.040,71			855.039,647900		
31/10/2023	SALDO ATUAL	2.572.211,32			855.039,647900		855.039,647900

Resumo do mês

SALDO ANTERIOR	2.547.040,71
APLICAÇÕES (+)	0,00
RESGATES (-)	0,00
RENDIMENTO BRUTO (+)	25.170,61
IMPOSTO DE RENDA (-)	0,00
IOF (-)	0,00
RENDIMENTO LÍQUIDO	25.170,61
SALDO ATUAL =	2.572.211,32

Valor da Cota

29/09/2023	2,978856849
31/10/2023	3,008294795

Rentabilidade

No mês	0,9882
No ano	10,9531
Últimos 12 meses	13,3453

BB Prev RF Ret Total - CNPJ: 35.292.588/0001-89

Data	Histórico	Valor	Valor IRPrej. Comp.	Valor IOF	Quantidade cotas	Valor cota	Saldo cotas
29/09/2023	SALDO ANTERIOR	2.308.127,96			1.762.811,834907		
31/10/2023	SALDO ATUAL	2.327.765,99			1.762.811,834907		1.762.811,834907

Resumo do mês

SALDO ANTERIOR	2.308.127,96
APLICAÇÕES (+)	0,00
RESGATES (-)	0,00
RENDIMENTO BRUTO (+)	19.638,03
IMPOSTO DE RENDA (-)	0,00
IOF (-)	0,00

RENDIMENTO LÍQUIDO 19.638,03
SALDO ATUAL = 2.327.765,99

Valor da Cota

29/09/2023 1,309344488
31/10/2023 1,320484661

Rentabilidade

No mês 0,8508
No ano 12,6738
Últimos 12 meses 13,4080

Transação efetuada com sucesso por: JE744615 SANTIAGO ABDON LOPES DE ALMEIDA.

Serviço de Atendimento ao Consumidor - SAC 0800 729 0722

Ouvidoria BB 0800 729 5678
Para deficientes auditivos 0800 729 0088