

Relatório de Acompanhamento e Controle de Riscos dos Investimentos

Período: Janeiro/2023.

Este relatório tem como objetivo apresentar os controles realizados pelo Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de Palmeirina, com base nas informações disponibilizadas pelo administrador do Fundo, referentes aos riscos de mercado, de crédito, de liquidez e legal, bem como do desempenho dos investimentos da Entidade em relação aos seus índices de referência. Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento do Instituto, bem como, pelas Resoluções do CMN.

Fundo: BB Previdenciário RF IRF-M1 Títulos Públicos - CNPJ Nº 11.328. 882/0001-35

Mês	Janeiro
V@R (95% de confiança) ¹	-0,15%
Volatilidade no ano ²	0,54%
Volatilidade nos últimos 12 meses ²	0,45%
% de retornos positivos no ano	86%
% de Vezes com Retorno Positivo nos últimos 12 meses	92%
Índice de Sharpe nos últimos 12 meses ³	-
Rentabilidade	1,06%
Patrimônio Líquido do Fundo R\$	6.562.900.517,46
Valor Aplicado pelo RPPS no Fundo R\$	4.053.840,41
Percentual de Participação do Patrimônio Líquido	0,06%
Grau de Risco	Muito Baixo

¹ V@r (value at risk) sintetiza a maior perda esperada dentro de um período de tempo e intervalo de confiança. A metodologia utilizada é a de simulação histórica para intervalo de 1 dia e nível de confiança de 95%.

² A volatilidade representa o grau de variação de retornos do fundo. Quanto maior o seu valor, maior a intensidade das variações diárias de retorno ao longo do tempo.

³ Índice que representa a relação entre risco e retorno. Busca demonstrar a compatibilidade do retorno do fundo com o risco ao que o investidor está exposto. Quanto maior, mais favorável essa relação. Índices com valores menores que zero não tem significado interpretativos.

Palmeirina, 23 de fevereiro de 2023.

Fernanda Ellen Claudino de Melo
Diretora Presidente



Relatório de Acompanhamento e Controle de Riscos dos Investimentos

Período: Fevereiro/2023.

Este relatório tem como objetivo apresentar os controles realizados pelo Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de Palmeirina, com base nas informações disponibilizadas pelo administrador do Fundo, referentes aos riscos de mercado, de crédito, de liquidez e legal, bem como do desempenho dos investimentos da Entidade em relação aos seus índices de referência. Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento do Instituto, bem como, pelas Resoluções do CMN.

Fundo: BB Previdenciário RF IRF-M1 Títulos Públicos - CNPJ Nº 11.328. 882/0001-35

Mês	Fevereiro
V@R (95% de confiança) ¹	-0,058%
Volatilidade no ano ²	0,59%
Volatilidade nos últimos 12 meses ²	0,44%
% de retornos positivos no ano	88%
% de Vezes com Retorno Positivo nos últimos 12 meses	93%
Índice de Sharpe nos últimos 12 meses ³	-
Rentabilidade	0,96%
Patrimônio Líquido do Fundo R\$	6.481.837.661,08
Valor Aplicado pelo RPPS no Fundo R\$	3.871.833,75
Percentual de Participação do Patrimônio Líquido	0,06%
Grau de Risco	Muito Baixo

¹ V@r (value at risk) sintetiza a maior perda esperada dentro de um período de tempo e intervalo de confiança. A metodologia utilizada é a de simulação histórica para intervalo de 1 dia e nível de confiança de 95%.

² A volatilidade representa o grau de variação de retornos do fundo. Quanto maior o seu valor, maior a intensidade das variações diárias de retorno ao longo do tempo.

³ Índice que representa a relação entre risco e retorno. Busca demonstrar a compatibilidade do retorno do fundo com o risco ao que o investidor está exposto. Quanto maior, mais favorável essa relação. Índices com valores menores que zero não tem significado interpretativos.

Palmeirina, 24 de março de 2023.

Fernanda Ellen Claudino de Melo
Diretora Presidente



Relatório de Acompanhamento e Controle de Riscos dos Investimentos

Período: Março/2023.

Este relatório tem como objetivo apresentar os controles realizados pelo Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de Palmeirina, com base nas informações disponibilizadas pelo administrador do Fundo, referentes aos riscos de mercado, de crédito, de liquidez e legal, bem como do desempenho dos investimentos da Entidade em relação aos seus índices de referência. Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento do Instituto, bem como, pelas Resoluções do CMN.

Fundo: BB Previdenciário RF IRF-M1 Títulos Públicos - CNPJ Nº 11.328. 882/0001-35

Mês	Março
V@R (95% de confiança) ¹	-0,05%
Volatilidade no ano ²	0,57%
Volatilidade nos últimos 12 meses ²	0,42%
% de retornos positivos no ano	89%
% de Vezes com Retorno Positivo nos últimos 12 meses	94%
Índice de Sharpe nos últimos 12 meses ³	-
Rentabilidade	1,20%
Patrimônio Líquido do Fundo R\$	6.754.991.755,09
Valor Aplicado pelo RPPS no Fundo R\$	3.649.172,16
Percentual de Participação do Patrimônio Líquido	0,05%
Grau de Risco	Muito Baixo

¹ V@r (value at risk) sintetiza a maior perda esperada dentro de um período de tempo e intervalo de confiança. A metodologia utilizada é a de simulação histórica para intervalo de 1 dia e nível de confiança de 95%.

² A volatilidade representa o grau de variação de retornos do fundo. Quanto maior o seu valor, maior a intensidade das variações diárias de retorno ao longo do tempo.

³ Índice que representa a relação entre risco e retorno. Busca demonstrar a compatibilidade do retorno do fundo com o risco ao que o investidor está exposto. Quanto maior, mais favorável essa relação. Índices com valores menores que zero não tem significado interpretativos.

Palmeirina, 20 de abril de 2023.

Fernanda Ellen Claudino de Melo
Diretora Presidente



Relatório de Acompanhamento e Controle de Riscos dos Investimentos

Período: Abril/2023.

Este relatório tem como objetivo apresentar os controles realizados pelo Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de Palmeirina, com base nas informações disponibilizadas pelo administrador do Fundo, referentes aos riscos de mercado, de crédito, de liquidez e legal, bem como do desempenho dos investimentos da Entidade em relação aos seus índices de referência. Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento do Instituto, bem como, pelas Resoluções do CMN.

Fundo: BB Previdenciário RF IRF-M1 Títulos Públicos - CNPJ Nº 11.328.882/0001-35

Mês	Abril
V@R (95% de confiança) ¹	-0,05%
Volatilidade no ano ²	0,52%
Volatilidade nos últimos 12 meses ²	0,40%
% de retornos positivos no ano	91%
% de Vezes com Retorno Positivo nos últimos 12 meses	95%
Índice de Sharpe nos últimos 12 meses ³	-
Rentabilidade	0,83%
Patrimônio Líquido do Fundo R\$	6.489.955.274,11
Valor Aplicado pelo RPPS no Fundo R\$	3.415.968,12
Percentual de Participação do Patrimônio Líquido	0,05%
Grau de Risco	Muito Baixo

¹ V@r (value at risk) sintetiza a maior perda esperada dentro de um período de tempo e intervalo de confiança. A metodologia utilizada é a de simulação histórica para intervalo de 1 dia e nível de confiança de 95%.

² A volatilidade representa o grau de variação de retornos do fundo. Quanto maior o seu valor, maior a intensidade das variações diárias de retorno ao longo do tempo.

³ Índice que representa a relação entre risco e retorno. Busca demonstrar a compatibilidade do retorno do fundo com o risco ao que o investidor está exposto. Quanto maior, mais favorável essa relação. Índices com valores menores que zero não tem significado interpretativos.

Palmeirina, 23 de maio de 2023.

Fernanda Ellen Claudino de Melo
Diretora Presidente



Relatório de Acompanhamento e Controle de Riscos dos Investimentos

Período: Maio/2023.

Este relatório tem como objetivo apresentar os controles realizados pelo Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de Palmeirina, com base nas informações disponibilizadas pelo administrador do Fundo, referentes aos riscos de mercado, de crédito, de liquidez e legal, bem como do desempenho dos investimentos da Entidade em relação aos seus índices de referência. Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento do Instituto, bem como, pelas Resoluções do CMN.

Fundo: BB Previdenciário RF IRF-M1 Títulos Públicos - CNPJ Nº 11.328. 882/0001-35

Mês	Maio
V@R (95% de confiança) ¹	-0,393%
Volatilidade no ano ²	0,47%
Volatilidade nos últimos 12 meses ²	0,39%
% de retornos positivos no ano	93%
% de Vezes com Retorno Positivo nos últimos 12 meses	96%
Índice de Sharpe nos últimos 12 meses ³	-
Rentabilidade	1,12%
Patrimônio Líquido do Fundo R\$	6.724.495.811,47
Valor Aplicado pelo RPPS no Fundo R\$	2.921.925,98
Percentual de Participação do Patrimônio Líquido	0,04%
Grau de Risco	Muito Baixo

¹ V@r (value at risk) sintetiza a maior perda esperada dentro de um período de tempo e intervalo de confiança. A metodologia utilizada é a de simulação histórica para intervalo de 1 dia e nível de confiança de 95%.

² A volatilidade representa o grau de variação de retornos do fundo. Quanto maior o seu valor, maior a intensidade das variações diárias de retorno ao longo do tempo.

³ Índice que representa a relação entre risco e retorno. Busca demonstrar a compatibilidade do retorno do fundo com o risco ao que o investidor está exposto. Quanto maior, mais favorável essa relação. Índices com valores menores que zero não tem significado interpretativos.

Palmeirina, 21 de junho de 2023.

Fernanda Ellen Claudino de Melo
Diretora Presidente



Relatório de Acompanhamento e Controle de Riscos dos Investimentos

Período: Junho/2023.

Este relatório tem como objetivo apresentar os controles realizados pelo Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de Palmeirina, com base nas informações disponibilizadas pelo administrador do Fundo, referentes aos riscos de mercado, de crédito, de liquidez e legal, bem como do desempenho dos investimentos da Entidade em relação aos seus índices de referência. Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento do Instituto, bem como, pelas Resoluções do CMN.

Fundo: BB Previdenciário RF IRF-M1 Títulos Públicos - CNPJ Nº 11.328.882/0001-35

Mês	Junho
V@R (95% de confiança) ¹	-0,0393%
Volatilidade no ano ²	0,44%
Volatilidade nos últimos 12 meses ²	0,38%
% de retornos positivos no ano	94%
% de Vezes com Retorno Positivo nos últimos 12 meses	96%
Índice de Sharpe nos últimos 12 meses ³	-
Rentabilidade	1,16%
Patrimônio Líquido do Fundo R\$	6.781.214.720,11
Valor Aplicado pelo RPPS no Fundo R\$	2.663.215,75
Percentual de Participação do Patrimônio Líquido	0,04%
Grau de Risco	Muito Baixo

¹ V@r (value at risk) sintetiza a maior perda esperada dentro de um período de tempo e intervalo de confiança. A metodologia utilizada é a de simulação histórica para intervalo de 1 dia e nível de confiança de 95%.

² A volatilidade representa o grau de variação de retornos do fundo. Quanto maior o seu valor, maior a intensidade das variações diárias de retorno ao longo do tempo.

³ Índice que representa a relação entre risco e retorno. Busca demonstrar a compatibilidade do retorno do fundo com o risco ao que o investidor está exposto. Quanto maior, mais favorável essa relação. Índices com valores menores que zero não tem significado interpretativos.

Palmeirina, 25 de julho de 2023.

Fernanda Ellen Claudino de Melo
Diretora Presidente



Relatório de Acompanhamento e Controle de Riscos dos Investimentos

Período: Julho/2023.

Este relatório tem como objetivo apresentar os controles realizados pelo Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de Palmeirina, com base nas informações disponibilizadas pelo administrador do Fundo, referentes aos riscos de mercado, de crédito, de liquidez e legal, bem como do desempenho dos investimentos da Entidade em relação aos seus índices de referência. Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento do Instituto, bem como, pelas Resoluções do CMN.

Fundo: BB Previdenciário RF IRF-M1 Títulos Públicos - CNPJ Nº 11.328.882/0001-35

Mês	Julho
V@R (95% de confiança) ¹	-0,0280%
Volatilidade no ano ²	0,42%
Volatilidade nos últimos 12 meses ²	0,36%
% de retornos positivos no ano	95%
% de Vezes com Retorno Positivo nos últimos 12 meses	97%
Índice de Sharpe nos últimos 12 meses ³	-
Rentabilidade	1,06%
Patrimônio Líquido do Fundo R\$	7.147.233.323,14
Valor Aplicado pelo RPPS no Fundo R\$	2.099.803,91
Percentual de Participação do Patrimônio Líquido	0,03%
Grau de Risco	Muito Baixo

¹ V@r (value at risk) sintetiza a maior perda esperada dentro de um período de tempo e intervalo de confiança. A metodologia utilizada é a de simulação histórica para intervalo de 1 dia e nível de confiança de 95%.

² A volatilidade representa o grau de variação de retornos do fundo. Quanto maior o seu valor, maior a intensidade das variações diárias de retorno ao longo do tempo.

³ Índice que representa a relação entre risco e retorno. Busca demonstrar a compatibilidade do retorno do fundo com o risco ao que o investidor está exposto. Quanto maior, mais favorável essa relação. Índices com valores menores que zero não tem significado interpretativos.

Palmeirina, 23 de agosto de 2023.

Fernanda Ellen Claudino de Melo
Diretora Presidente



Relatório de Acompanhamento e Controle de Riscos dos Investimentos

Período: Agosto/2023.

Este relatório tem como objetivo apresentar os controles realizados pelo Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de Palmeirina, com base nas informações disponibilizadas pelo administrador do Fundo, referentes aos riscos de mercado, de crédito, de liquidez e legal, bem como do desempenho dos investimentos da Entidade em relação aos seus índices de referência. Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento do Instituto, bem como, pelas Resoluções do CMN.

Fundo: BB Previdenciário RF IRF-M1 Títulos Públicos - CNPJ Nº 11.328. 882/0001-35

Mês	Agosto
V@R (95% de confiança) ¹	-0,02%
Volatilidade no ano ²	0,42%
Volatilidade nos últimos 12 meses ²	0,37%
% de retornos positivos no ano	96%
% de Vezes com Retorno Positivo nos últimos 12 meses	97%
Índice de Sharpe nos últimos 12 meses ³	-
Rentabilidade	1,12%
Patrimônio Líquido do Fundo R\$	6.785.029.538.03
Valor Aplicado pelo RPPS no Fundo R\$	1.830.734,46
Percentual de Participação do Patrimônio Líquido	0,03%
Grau de Risco	Muito Baixo

¹ V@r (value at risk) sintetiza a maior perda esperada dentro de um período de tempo e intervalo de confiança. A metodologia utilizada é a de simulação histórica para intervalo de 1 dia e nível de confiança de 95%.

² A volatilidade representa o grau de variação de retornos do fundo. Quanto maior o seu valor, maior a intensidade das variações diárias de retorno ao longo do tempo.

³ Índice que representa a relação entre risco e retorno. Busca demonstrar a compatibilidade do retorno do fundo com o risco ao que o investidor está exposto. Quanto maior, mais favorável essa relação. Índices com valores menores que zero não tem significado interpretativos.

Palmeirina, 18 de setembro de 2023.

Fernanda Ellen Claudino de Melo
Diretora Presidente



Relatório de Acompanhamento e Controle de Riscos dos Investimentos

Período: Setembro/2023.

Este relatório tem como objetivo apresentar os controles realizados pelo Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de Palmeirina, com base nas informações disponibilizadas pelo administrador do Fundo, referentes aos riscos de mercado, de crédito, de liquidez e legal, bem como do desempenho dos investimentos da Entidade em relação aos seus índices de referência. Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento do Instituto, bem como, pelas Resoluções do CMN.

Fundo: BB Previdenciário RF IRF-M1 Títulos Públicos - CNPJ Nº 11.328.882/0001-35

Mês	Setembro
V@R (95% de confiança) ¹	-0,01%
Volatilidade no ano ²	0,40%
Volatilidade nos últimos 12 meses ²	0,36%
% de retornos positivos no ano	96%
% de Vezes com Retorno Positivo nos últimos 12 meses	97%
Índice de Sharpe nos últimos 12 meses ³	-
Rentabilidade	0,90%
Patrimônio Líquido do Fundo R\$	7.028.296.292,55
Valor Aplicado pelo RPPS no Fundo R\$	1.482.481,23
Percentual de Participação do Patrimônio Líquido	0,02%
Grau de Risco	Muito Baixo

¹ V@r (value at risk) sintetiza a maior perda esperada dentro de um período de tempo e intervalo de confiança. A metodologia utilizada é a de simulação histórica para intervalo de 1 dia e nível de confiança de 95%.

² A volatilidade representa o grau de variação de retornos do fundo. Quanto maior o seu valor, maior a intensidade das variações diárias de retorno ao longo do tempo.

³ Índice que representa a relação entre risco e retorno. Busca demonstrar a compatibilidade do retorno do fundo com o risco ao que o investidor está exposto. Quanto maior, mais favorável essa relação. Índices com valores menores que zero não tem significado interpretativos.

Palmeirina, 23 de outubro de 2023.

Fernanda Ellen Claudino de Melo
Diretora Presidente



Relatório de Acompanhamento e Controle de Riscos dos Investimentos

Período: Outubro/2023.

Este relatório tem como objetivo apresentar os controles realizados pelo Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de Palmeirina, com base nas informações disponibilizadas pelo administrador do Fundo, referentes aos riscos de mercado, de crédito, de liquidez e legal, bem como do desempenho dos investimentos da Entidade em relação aos seus índices de referência. Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento do Instituto, bem como, pelas Resoluções do CMN.

Fundo: BB Previdenciário RF IRF-M1 Títulos Públicos - CNPJ Nº 11.328.882/0001-35

Mês	Outubro
V@R (95% de confiança) ¹	-0,02%
Volatilidade no ano ²	0,38%
Volatilidade nos últimos 12 meses ²	0,37%
% de retornos positivos no ano	97%
% de Vezes com Retorno Positivo nos últimos 12 meses	97%
Índice de Sharpe nos últimos 12 meses ³	-
Rentabilidade	0,92%
Patrimônio Líquido do Fundo R\$	7.179.042.508,92
Valor Aplicado pelo RPPS no Fundo R\$	1.139.283,21
Percentual de Participação do Patrimônio Líquido	0,02%
Grau de Risco	Muito Baixo

¹ V@r (value at risk) sintetiza a maior perda esperada dentro de um período de tempo e intervalo de confiança. A metodologia utilizada é a de simulação histórica para intervalo de 1 dia e nível de confiança de 95%.

² A volatilidade representa o grau de variação de retornos do fundo. Quanto maior o seu valor, maior a intensidade das variações diárias de retorno ao longo do tempo.

³ Índice que representa a relação entre risco e retorno. Busca demonstrar a compatibilidade do retorno do fundo com o risco ao que o investidor está exposto. Quanto maior, mais favorável essa relação. Índices com valores menores que zero não tem significado interpretativos.

Palmeirina, 21 de novembro de 2023.

Fernanda Ellen Claudino de Melo
Diretora Presidente



Relatório de Acompanhamento e Controle de Riscos dos Investimentos

Período: Novembro/2023.

Este relatório tem como objetivo apresentar os controles realizados pelo Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de Palmeirina, com base nas informações disponibilizadas pelo administrador do Fundo, referentes aos riscos de mercado, de crédito, de liquidez e legal, bem como do desempenho dos investimentos da Entidade em relação aos seus índices de referência. Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento do Instituto, bem como, pelas Resoluções do CMN.

Fundo: BB Previdenciário RF IRF-M1 Títulos Públicos - CNPJ Nº 11.328.882/0001-35

Mês	Novembro
V@R (95% de confiança) ¹	-0,0113%
Volatilidade no ano ²	0,37%
Volatilidade nos últimos 12 meses ²	0,36%
% de retornos positivos no ano	97%
% de Vezes com Retorno Positivo nos últimos 12 meses	97%
Índice de Sharpe nos últimos 12 meses ³	-
Rentabilidade	0,97%
Patrimônio Líquido do Fundo R\$	7.431.410.946,33
Valor Aplicado pelo RPPS no Fundo R\$	837.459,81
Percentual de Participação do Patrimônio Líquido	0,01%
Grau de Risco	Muito Baixo

¹ V@r (value at risk) sintetiza a maior perda esperada dentro de um período de tempo e intervalo de confiança. A metodologia utilizada é a de simulação histórica para intervalo de 1 dia e nível de confiança de 95%.

² A volatilidade representa o grau de variação de retornos do fundo. Quanto maior o seu valor, maior a intensidade das variações diárias de retorno ao longo do tempo.

³ Índice que representa a relação entre risco e retorno. Busca demonstrar a compatibilidade do retorno do fundo com o risco ao que o investidor está exposto. Quanto maior, mais favorável essa relação. Índices com valores menores que zero não tem significado interpretativos.

Palmeirina, 18 de dezembro de 2023.

Fernanda Ellen Claudino de Melo
Diretora Presidente



Relatório de Acompanhamento e Controle de Riscos dos Investimentos

Período: Dezembro/2023.

Este relatório tem como objetivo apresentar os controles realizados pelo Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de Palmeirina, com base nas informações disponibilizadas pelo administrador do Fundo, referentes aos riscos de mercado, de crédito, de liquidez e legal, bem como do desempenho dos investimentos da Entidade em relação aos seus índices de referência. Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento do Instituto, bem como, pelas Resoluções do CMN.

Fundo: BB Previdenciário RF IRF-M1 Títulos Públicos - CNPJ Nº 11.328.882/0001-35

Mês	Dezembro
V@R (95% de confiança) ¹	-0,01%
Volatilidade no ano ²	0,36%
Volatilidade nos últimos 12 meses ²	0,35%
% de retornos positivos no ano	97%
% de Vezes com Retorno Positivo nos últimos 12 meses	97%
Índice de Sharpe nos últimos 12 meses ³	-
Rentabilidade	0,89%
Patrimônio Líquido do Fundo R\$	7.852.193.725,16
Valor Aplicado pelo RPPS no Fundo R\$	378.642,85
Percentual de Participação do Patrimônio Líquido	0,00
Grau de Risco	Muito Baixo

¹ V@r (value at risk) sintetiza a maior perda esperada dentro de um período de tempo e intervalo de confiança. A metodologia utilizada é a de simulação histórica para intervalo de 1 dia e nível de confiança de 95%.

² A volatilidade representa o grau de variação de retornos do fundo. Quanto maior o seu valor, maior a intensidade das variações diárias de retorno ao longo do tempo.

³ Índice que representa a relação entre risco e retorno. Busca demonstrar a compatibilidade do retorno do fundo com o risco ao que o investidor está exposto. Quanto maior, mais favorável essa relação. Índices com valores menores que zero não tem significado interpretativos.

Palmeirina, 15 de janeiro de 2024.

Fernanda Ellen Claudino de Melo
Diretora Presidente

