



DI BLASI
Consultoria Financeira

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE BREVES - IPMB

Relatório

Janeiro 2021

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 RF FLUXO FI EM COTAS DE	0	99,32%	769	0,00%	Art 7º , IV "a"	R\$ 82.524,70	B	Fundo de Investim	0,20%
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUI	0	0,68%	301	0,00%	Art 7º , IV "a"	R\$ 566,61	B	Fundo de Investim	0,80%

R\$ 83.091,31

Retorno do mês

Nome Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS DE FI	R\$ 278.053,97	R\$ 997.000,00	R\$ 1.192.588,42	R\$ 82.524,70	R\$ 59,15	0,0213%	CDI
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS	R\$ 79.474,05		R\$ 78.911,17	R\$ 566,61	R\$ 3,73	0,0047%	CDI
Total	357,528.02	997,000.00	1,271,499.59	83,091.31	62.88	0,021%	

Enquadramentos

FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a

% Carteira: : 100,00%

Saldo do grupo: R\$ 83.091,31

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq	% Carteira	Limites	Situação
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$ 566,61	300.88	0,00%	608,020,020.83	0,68%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Desenquadrado - limite
BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS DE FI	R\$ 82.524,70	39,002.10	0,00%	320,539,431.87	99,32%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Desenquadrado - politica

Enquadramento por Benchmark

CDI

% Carteira: **100,00%**

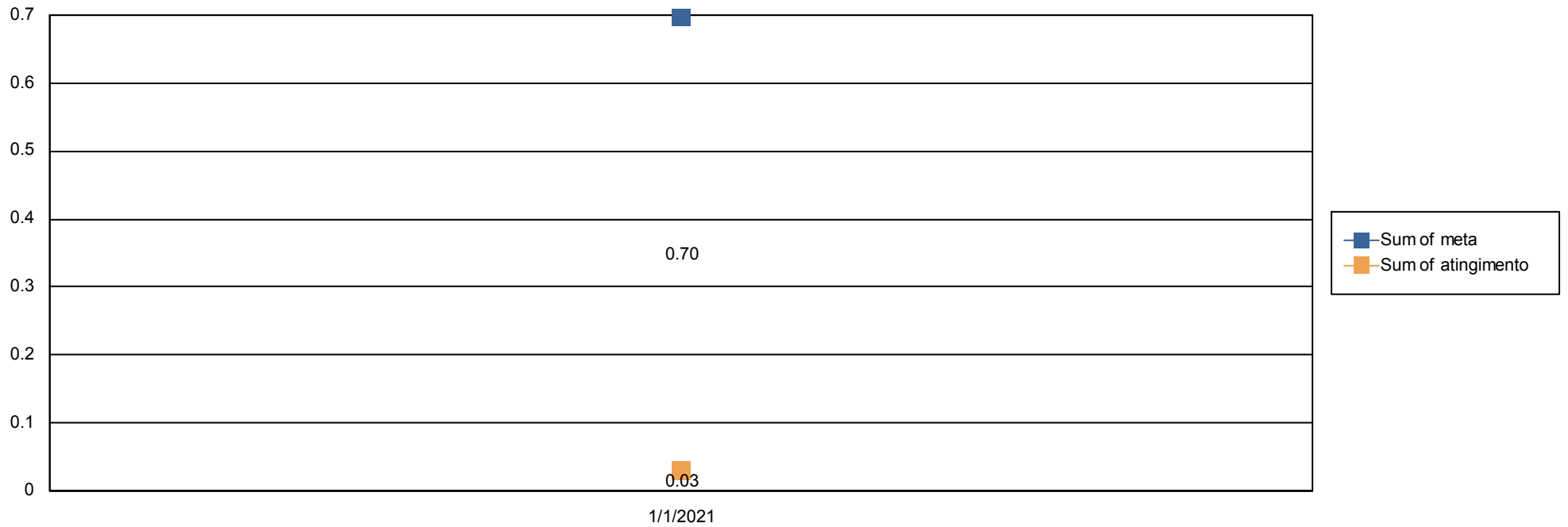
Saldo do grupo: **R\$ 83.091,31**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$ 566,61	300.88	0.00	0.68	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Desenquadrado - limite
BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS DE FI	R\$ 82.524,70	39,002.10	0.00	99.32	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Desenquadrado - polític

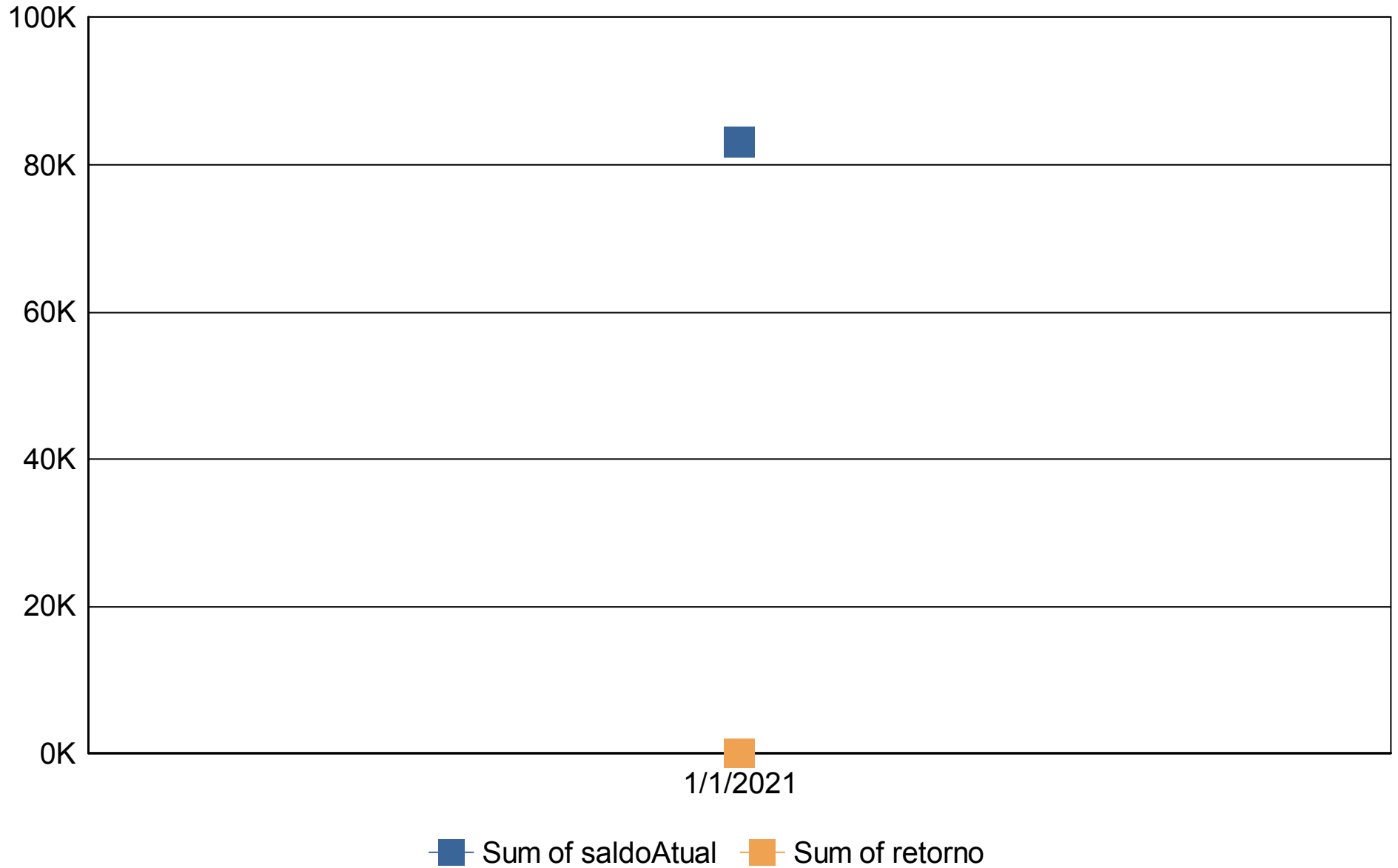
Retorno acumulado no ano

Período	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Retorno %	Meta	Atingimento
January	R\$ 357.528,02	R\$ 997.000,00	R\$ 1.271.499,59	R\$ 83.091,31	R\$ 62,88	0,0212%	0,6959%	3,0406%

Meta x Atingimento

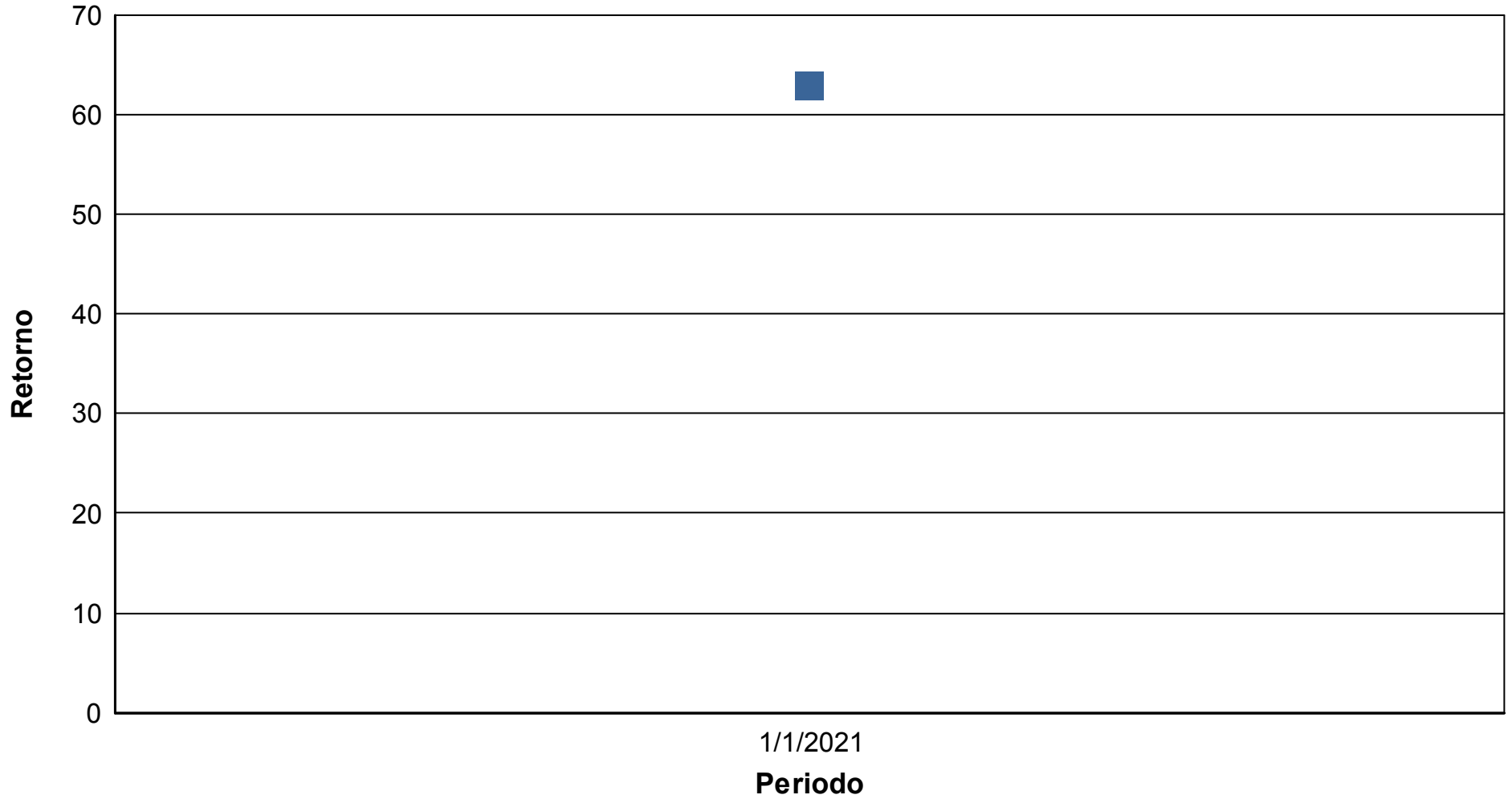


Evolução do patrimônio

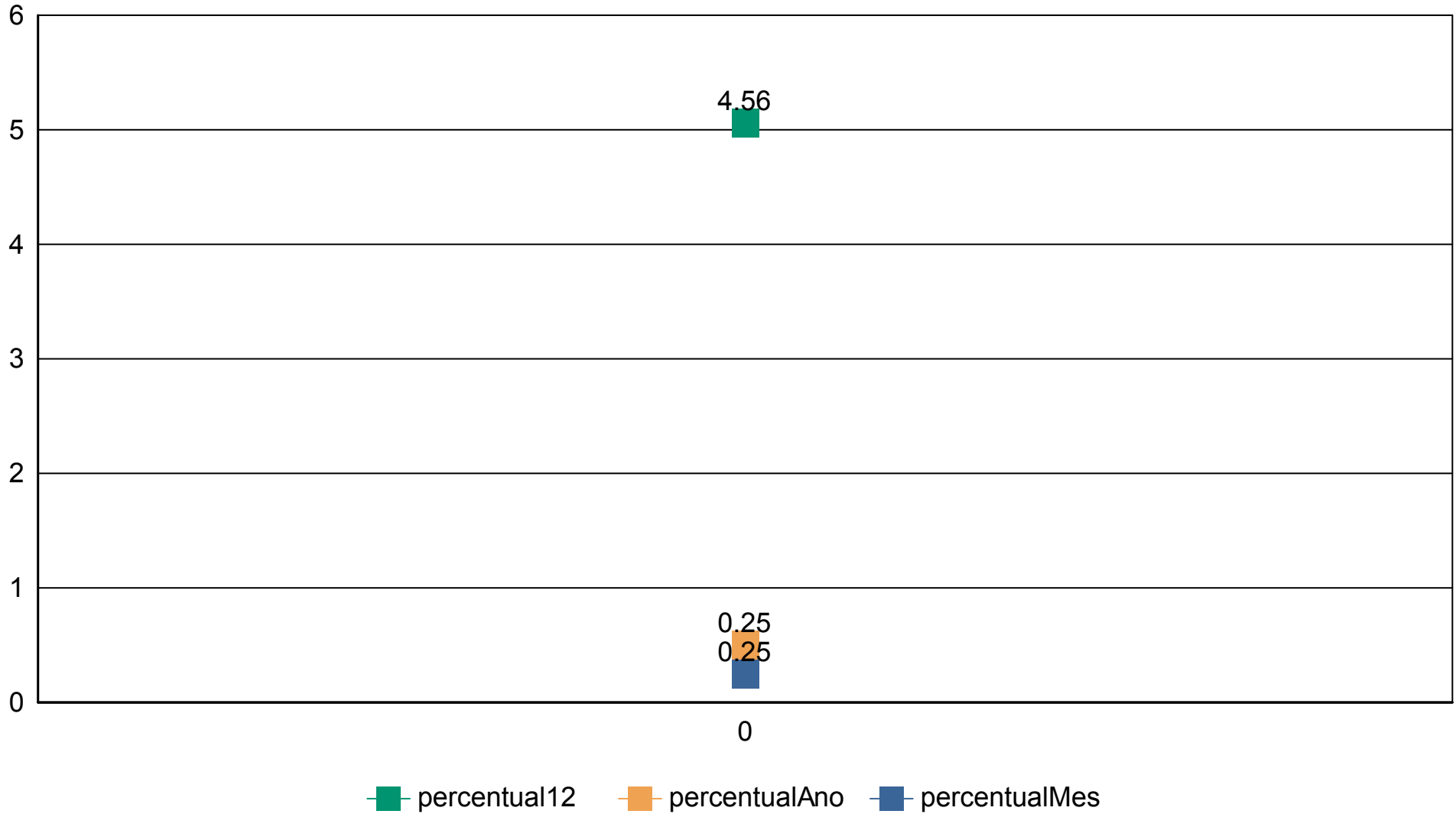




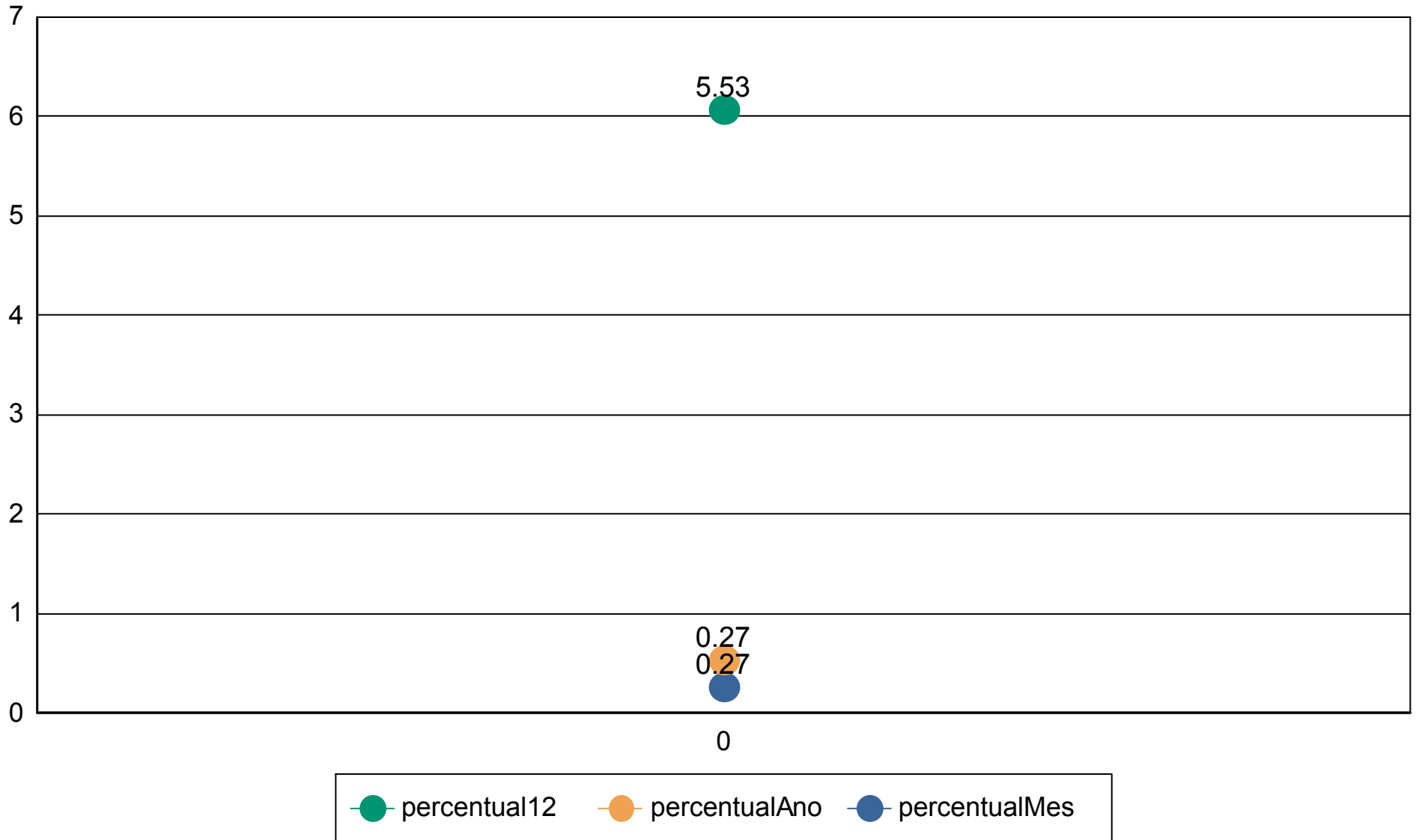
Retorno Mensal



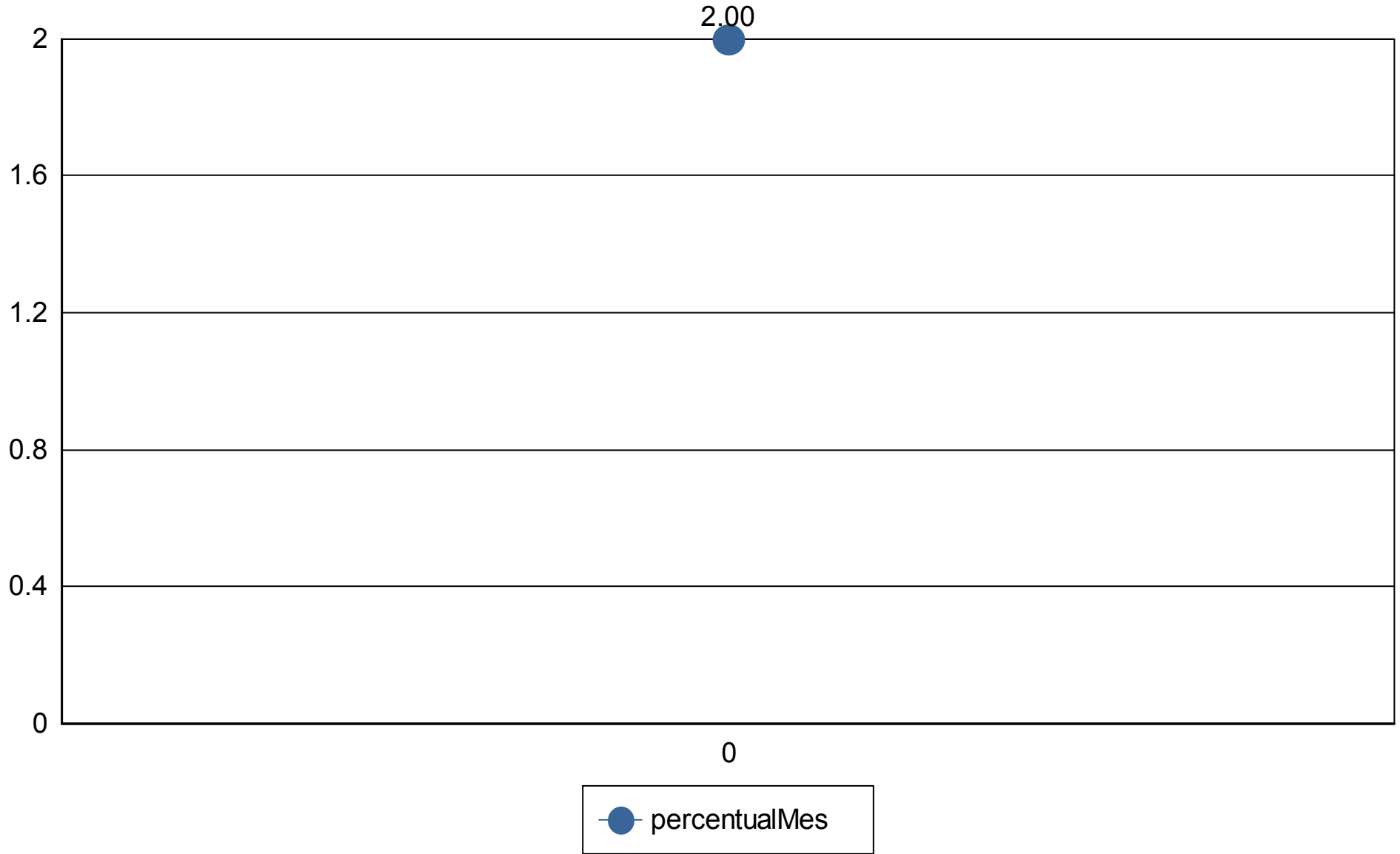
Índices Econômicos - IPCA



Índices Econômicos - INPC



Índices Econômicos - SELIC



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 RF FLUXO FI EM COTAS DE FI	CDI	32,30%	0,00%	0,73%	1,39%	5,56%
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAI	CDI	30,77%	0,00%	0,69%	1,84%	6,82%
			63,07%	0,00%	1,42%	3,22%	12,38%

Provisão de risco - Mercado

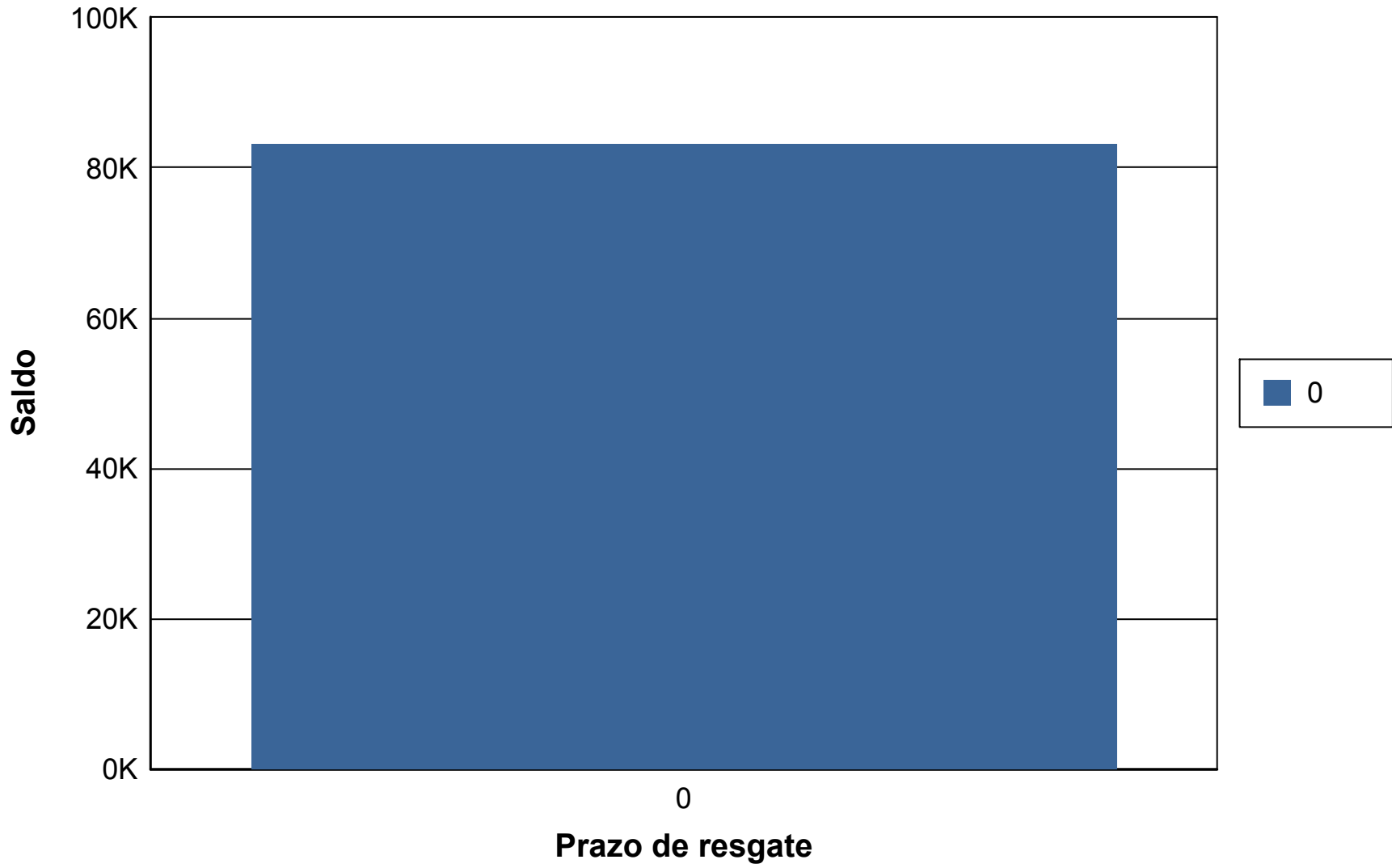
CNPJ	Nome do fundo	Benchmark	Saldo	VAR12	VOL12	VAR% BASE 1
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVEST	CDI	R\$ 82.524,70	0,00%	5,56%	R\$ 0,04

Saldo Total:	R\$ 82.524,70
Provisão para perda e Investimentos	R\$ 0,04
% Provisão de perda	0,00%
% Aceitável perda	2%
Limite de utilização	0,00%



Nome do Fundo	Saldo	% Part.	N. Cotistas	% PL	PL do Fundo	Legislação	Grau risco	Prazo Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDC	R\$ 82.524,70	99,32%	769	0,00%	R\$ 2.849.785.990,61	Art 7º , IV "a"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE IN	R\$ 566,61	0,68%	301	0,00%	R\$ 1.193.304.951,88	Art 7º , IV "a"	Baixo	D+ 0

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
0	R\$ 83.091,31	2	100,00%

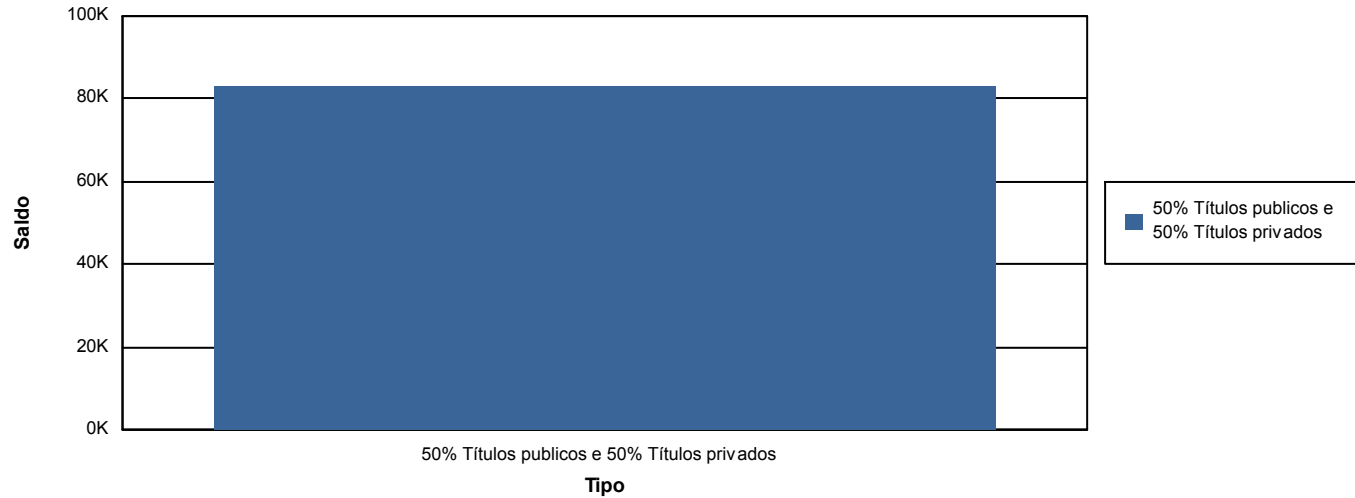


Risco Crédito

Legislação	Limite	Limite Política	Saldo	% Carteira
FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a	40,00%	40,00%	R\$ 83.091,31	100,00

	Saldo	% Carteira
100% titulos públicos	41,545.66	50.00
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	41,545.66	50.00
100% titulos privados	0.00	0.00

Distribuição dos saldos



Kenzo Eduardo Di Blasi

Assinatura