



DI BLASI  
Consultoria Financeira

# **INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE BREVES - IPMB**

Relatório

Março 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          | 19,98%       | 779         | 0,01% | Art 7º , IV "a" | R\$ 199.948,75 | B     | Fundo de Investim | 0,20%     |
| 11.328.882/0001-35 | BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI   | 0          | 19,99%       | 1,201       | 0,00% | Art 7º, I, "b"  | R\$ 200.000,00 | B     | Fundo de Investim | 0,20%     |
| 14.508.643/0001-55 | FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUI     | 0          | 0,00%        | 301         | 0,00% | Art 7º , IV "a" | R\$ 0,00       | B     | Fundo de Investim | 0,80%     |
| 14.386.926/0001-71 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULC | 0          | 20,03%       | 1,018       | 0,00% | Art 7º, I, "b"  | R\$ 200.395,85 | B     | Fundo de Investim | 0,20%     |
| 10.740.670/0001-06 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF | 0          | 19,99%       | 1,344       | 0,00% | Art 7º, I, "b"  | R\$ 200.045,37 | B     | Fundo de Investim | 0,20%     |
| 23.215.097/0001-55 | FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GEI  | 1          | 20,01%       | 922         | 0,00% | Art 7º, I, "b"  | R\$ 200.205,82 | M     | Fundo de Investim | 0,20%     |

R\$ 1.000.595,79

### Retorno do mês

| Nome Fundo                       | Saldo Inicial  | Aplicações       | Resgates         | Saldo Final    | Rentabilidade | Efetivo | Bench.    |
|----------------------------------|----------------|------------------|------------------|----------------|---------------|---------|-----------|
| BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS     | R\$ 237.185,19 | R\$ 2.075.731,65 | R\$ 2.114.041,65 | R\$ 199.948,75 | R\$ 1.073,56  | 0,5398% | CDI       |
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F | R\$ 129.933,93 | R\$ 200.000,00   | R\$ 129.977,64   | R\$ 200.000,00 | R\$ 43,71     | 0,0218% | IRF-M 1   |
| FUNDO DE INVEST EM COTAS DE      | R\$ 712,97     | R\$ 101.336,94   | R\$ 102.058,11   | R\$ 0          | R\$ 8,20      | 0,0182% | CDI       |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TIT | R\$ 0          | R\$ 200.000,00   |                  | R\$ 200.395,85 | R\$ 395,85    | 0,1979% | IDKA 2    |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB | R\$ 0          | R\$ 200.000,00   |                  | R\$ 200.045,37 | R\$ 45,37     | 0,0226% | IRF-M 1   |
| FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL   | R\$ 0          | R\$ 200.000,00   |                  | R\$ 200.205,82 | R\$ 205,82    | 0,1029% | IMA-GERAL |
| Total                            | 367,832.09     | 2,977,068.59     | 2,346,077.40     | 1,000,595.79   | 1,772.51      | 0,3297% |           |

## Enquadramentos

**FI 100% títulos TN – 7º, I, b**

 % Carteira: : **80,02%**

 Saldo do grupo: **R\$ 800.647,04**

| Fundo                                                        | Saldo          | N. Cotas   | % PL  | P. Liq.      | % Carteira | Limites                                                                     | Situação   |
|--------------------------------------------------------------|----------------|------------|-------|--------------|------------|-----------------------------------------------------------------------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF                          | R\$ 200.045,37 | 76,517.09  | 0,00% | 1,758,898.12 | 19,99%     | Lim. Res.: 100,00%<br>Lim. Pol.: 15,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 0,00% | Enquadrado |
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI                            | R\$ 200.000,00 | 73,352.61  | 0,00% | 1,684,396.22 | 19,99%     | Lim. Res.: 100,00%<br>Lim. Pol.: 15,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 0,00% | Enquadrado |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LONGO PRAZO | R\$ 200.395,85 | 83,617.74  | 0,00% | 1,361,928.62 | 20,03%     | Lim. Res.: 100,00%<br>Lim. Pol.: 15,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 0,00% | Enquadrado |
| FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF         | R\$ 200.205,82 | 132,446.38 | 0,00% | 1,489,347.05 | 20,01%     | Lim. Res.: 100,00%<br>Lim. Pol.: 15,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 0,00% | Enquadrado |

**FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a**

 % Carteira: : **19,98%**

 Saldo do grupo: **R\$ 199.948,75**

| Fundo                                                                         | Saldo          | N. Cotas  | % PL  | P. Liq.      | % Carteira | Limites                                                                    | Situação   |
|-------------------------------------------------------------------------------|----------------|-----------|-------|--------------|------------|----------------------------------------------------------------------------|------------|
| BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS DE FI                                            | R\$ 199.948,75 | 94,354.35 | 0,01% | 3,075,266.03 | 19,98%     | Lim. Res.: 40,00%<br>Lim. Pol.: 15,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 0,01% | Enquadrado |
| FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | R\$ 0,00       | 0.00      | 0,00% | 3,878,506.99 | 0,00%      | Lim. Res.: 40,00%<br>Lim. Pol.: 15,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 0,00% | Enquadrado |

## Enquadramento por Benchmark

### CDI

 % Carteira: **19,98%**

 Saldo do grupo: **R\$ 199.948,75**

| Nome fundo                                                                       | Saldo          | Saldo cotas | %PL  | % Carteira | Limites                                                                     | Situação   |
|----------------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------|------|------------|-----------------------------------------------------------------------------|------------|
| BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS DE FI                                               | R\$ 199.948,75 | 94,354.35   | 0.01 | 19.98      | Lim. Res.: 40,00%<br>Lim. Pol.: 40,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 15,00% | Enquadrado |
| FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST<br>CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF | R\$ 0,00       | 0.00        | 0.00 | 0.00       | Lim. Res.: 40,00%<br>Lim. Pol.: 40,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 15,00% | Enquadrado |

### IDKA 2

 % Carteira: **20,03%**

 Saldo do grupo: **R\$ 200.395,85**

| Nome fundo                                                      | Saldo          | Saldo cotas | %PL  | % Carteira | Limites                                                                       | Situação   |
|-----------------------------------------------------------------|----------------|-------------|------|------------|-------------------------------------------------------------------------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF<br>LONGO PRAZO | R\$ 200.395,85 | 83,617.74   | 0.00 | 20.03      | Lim. Res.: 100,00%<br>Lim. Pol.: 100,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 15,00% | Enquadrado |

### IMA-GERAL

 % Carteira: **20,01%**

 Saldo do grupo: **R\$ 200.205,82**

| Nome fundo                                              | Saldo          | Saldo cotas | %PL  | % Carteira | Limites                                                                       | Situação   |
|---------------------------------------------------------|----------------|-------------|------|------------|-------------------------------------------------------------------------------|------------|
| FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA<br>RF | R\$ 200.205,82 | 132,446.38  | 0.00 | 20.01      | Lim. Res.: 100,00%<br>Lim. Pol.: 100,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 15,00% | Enquadrado |

### IRF-M 1

 % Carteira: **39,98%**

 Saldo do grupo: **R\$ 400.045,37**

| Nome fundo                          | Saldo          | Saldo cotas | %PL  | % Carteira | Limites                                                                       | Situação   |
|-------------------------------------|----------------|-------------|------|------------|-------------------------------------------------------------------------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF | R\$ 200.045,37 | 76,517.09   | 0.00 | 19.99      | Lim. Res.: 100,00%<br>Lim. Pol.: 100,00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 15,00% | Enquadrado |

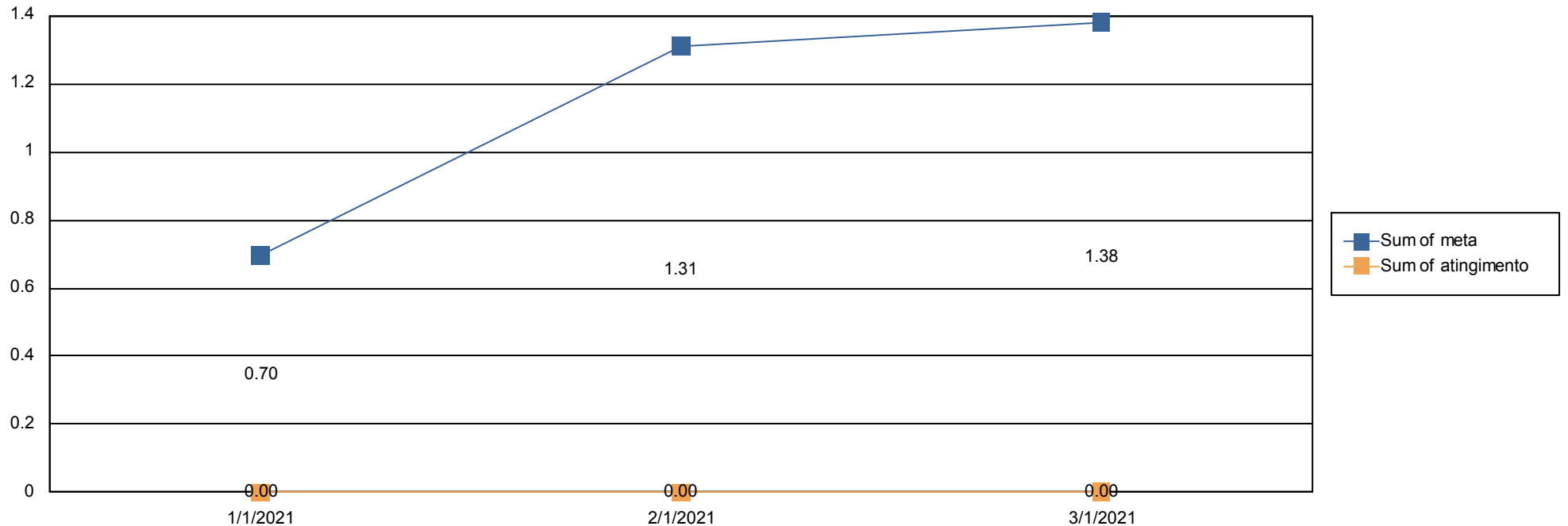


|                                   |                |           |      |       |                                                                               |            |
|-----------------------------------|----------------|-----------|------|-------|-------------------------------------------------------------------------------|------------|
| BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI | R\$ 200.000,00 | 73,352.61 | 0.00 | 19.99 | Lim. Res.: 100.00%<br>Lim. Pol.: 100.00%<br>Lim. CNPJ: 20%<br>Lim. PL: 15,00% | Enquadrado |
|-----------------------------------|----------------|-----------|------|-------|-------------------------------------------------------------------------------|------------|

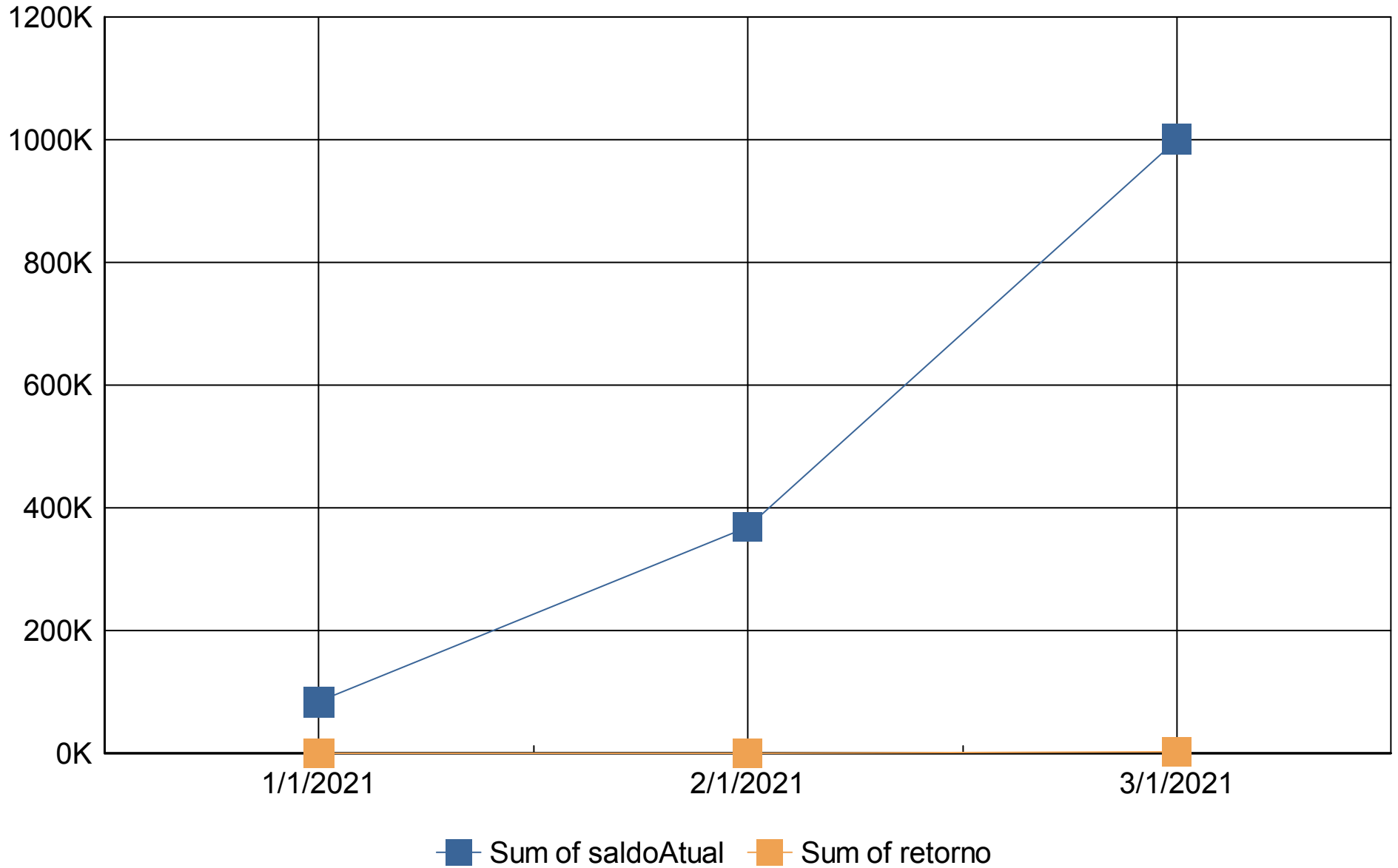
### Retorno acumulado no ano

| Período      | Saldo Anterior | Aplicações       | Resgates         | Saldo Atual      | Retorno R\$  | Retorno % | Meta    | Atingimento |
|--------------|----------------|------------------|------------------|------------------|--------------|-----------|---------|-------------|
| Janeiro      | R\$ 357.528,02 | R\$ 997.000,00   | R\$ 1.271.499,59 | R\$ 83.091,31    | R\$ 62,88    | 0,0467%   | 0,6959% | 0,0671%     |
| Fevereiro    | R\$ 83.091,31  | R\$ 1.278.517,86 | R\$ 993.797,28   | R\$ 367.832,09   | R\$ 20,20    | 0,0149%   | 1,3086% | 0,0114%     |
| Março        | R\$ 367.832,09 | R\$ 2.977.068,59 | R\$ 2.346.077,40 | R\$ 1.000.595,79 | R\$ 1.772,51 | 0,3297%   | 1,3789% | 0,2391%     |
| <b>Total</b> | R\$ 808.451,42 | 5,252,586.45     | 4,611,374.27     | 1,451,519.19     | 1,855.59     | 0,3914%   | 3,4203% | 11,4447%    |

### Meta x Atingimento

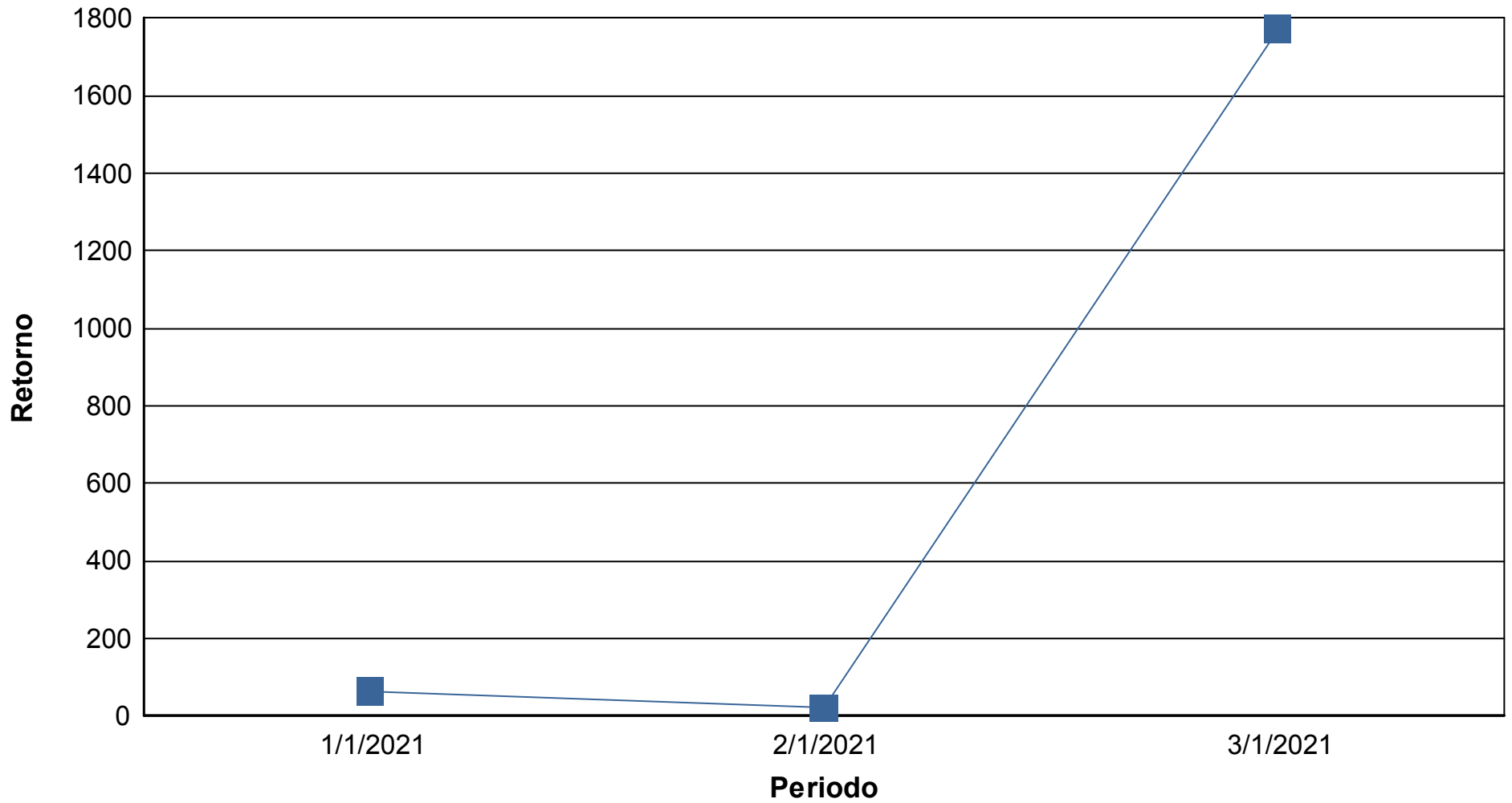


### Evolução do patrimônio



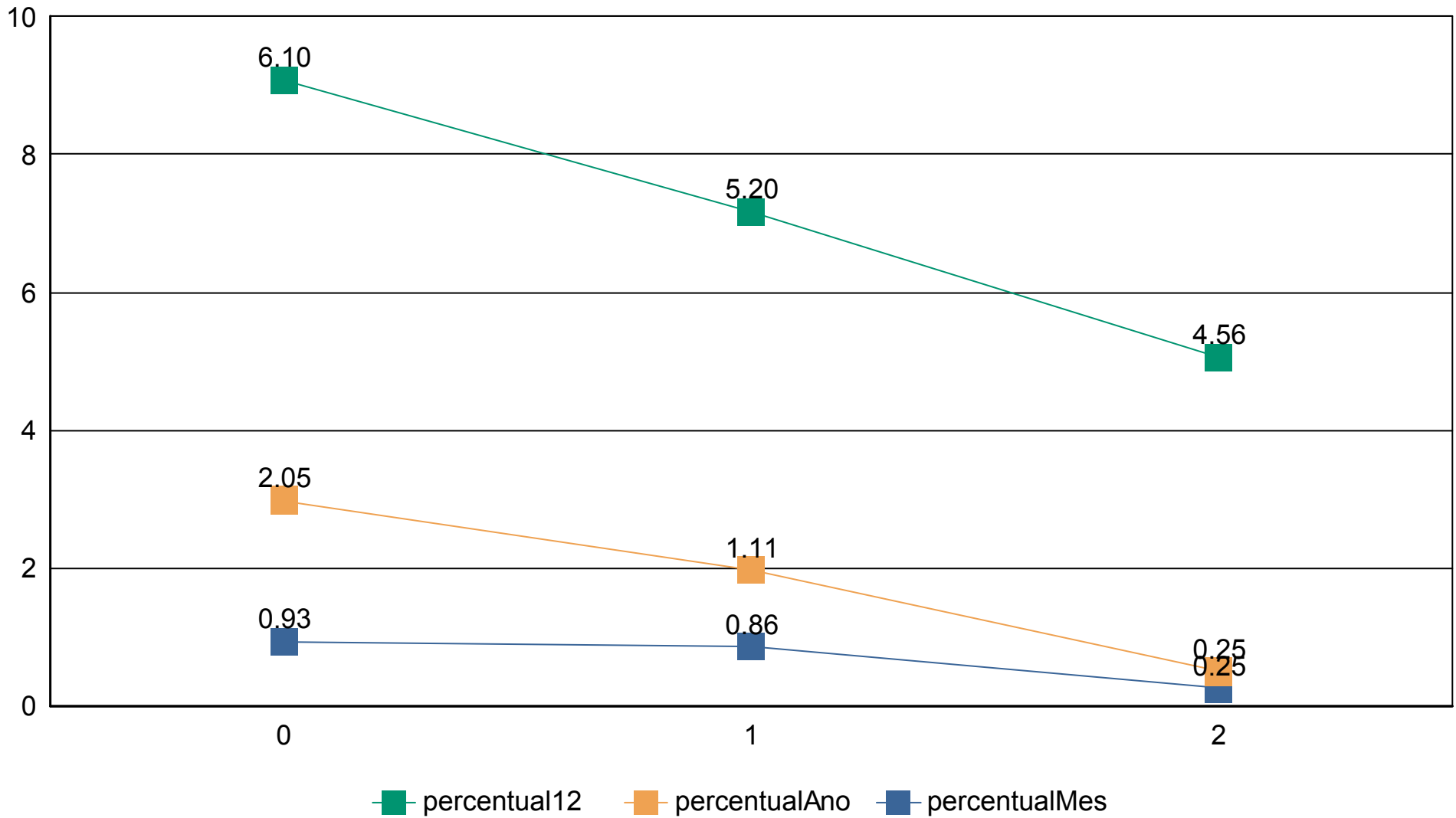


### Retorno Mensal

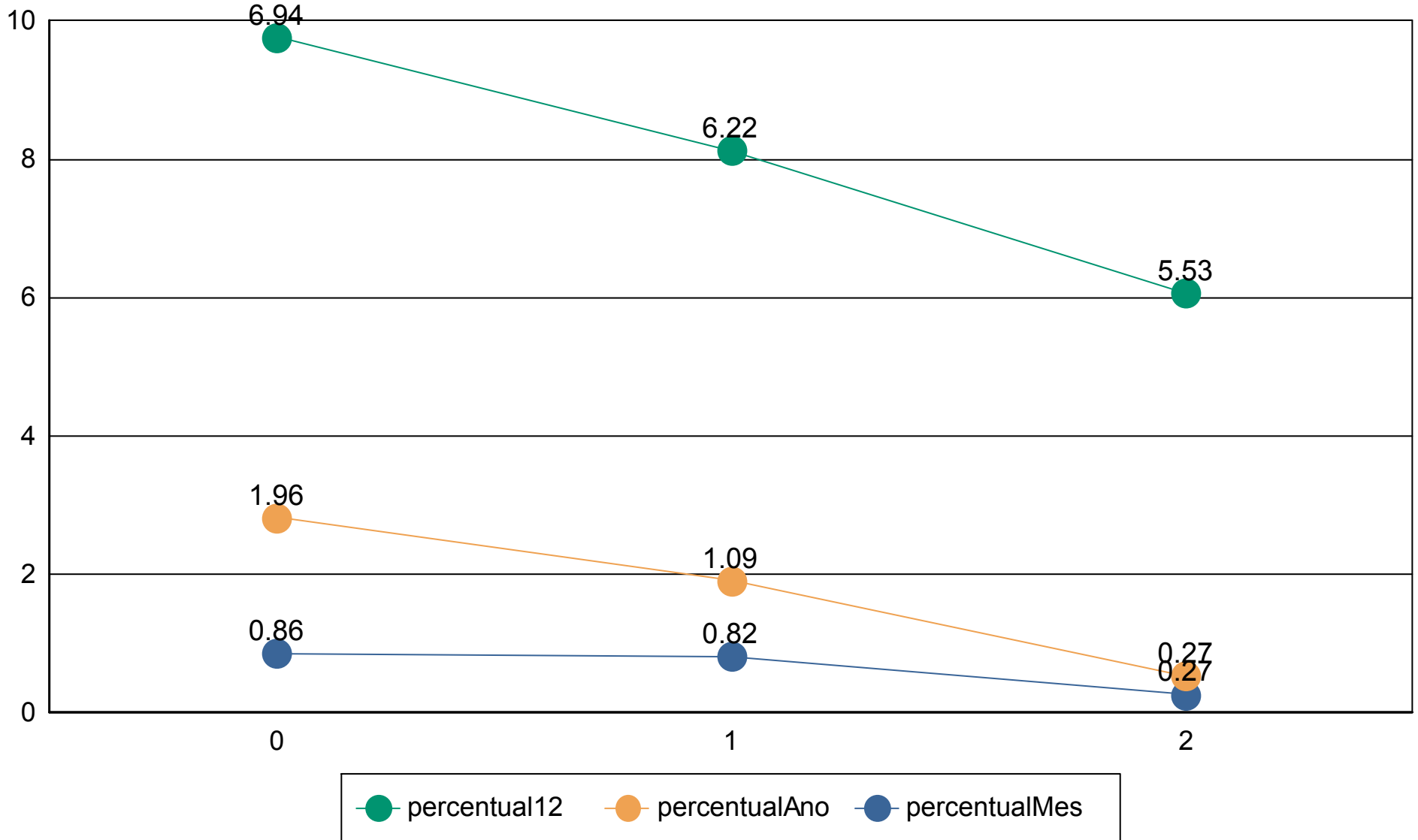




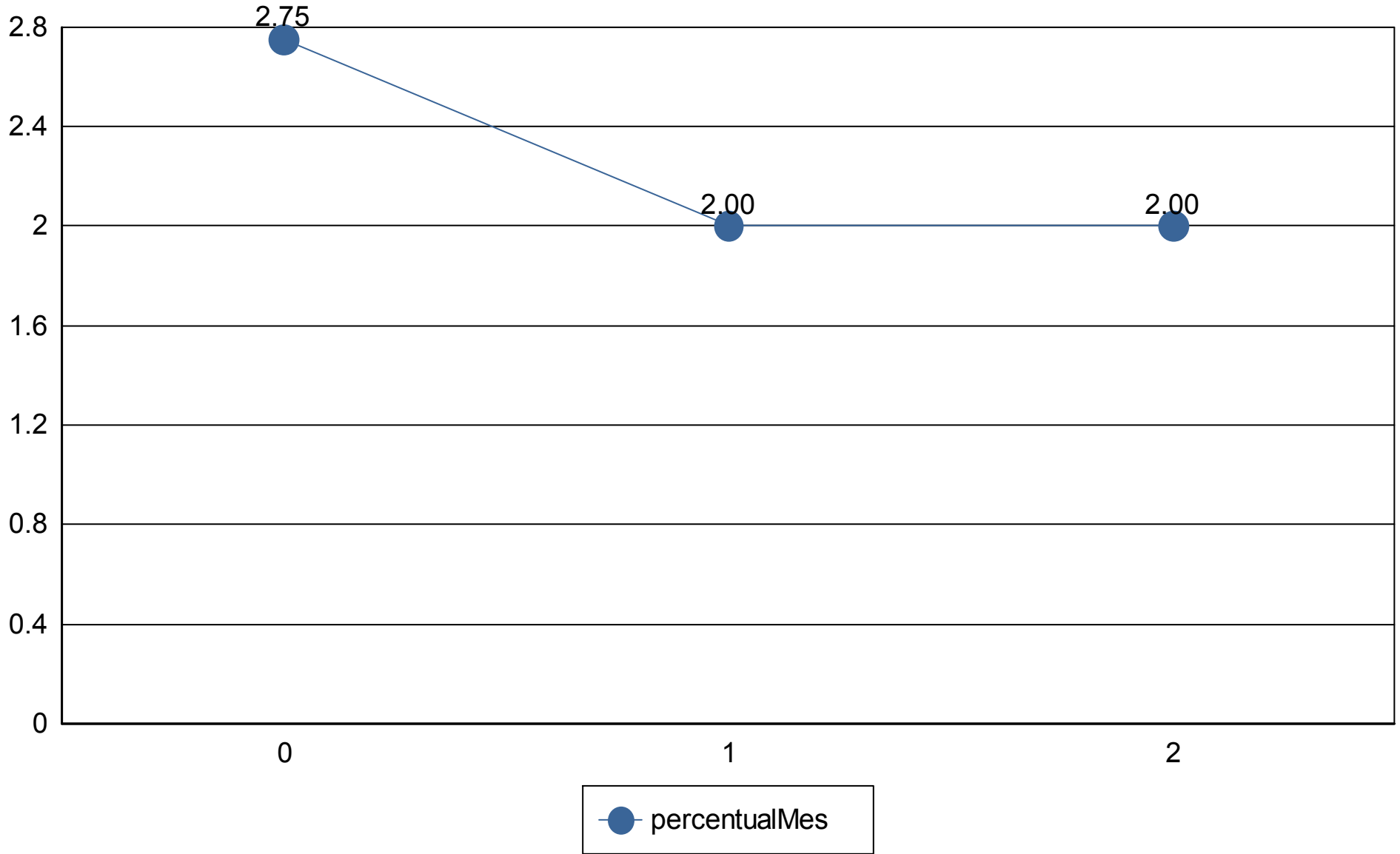
## Índices Econômicos - IPCA



## 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 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         |
|--------------------|------------------------------------------------------|-----------|----------------|--------------|--------------|---------------|---------------|
| 10.740.670/0001-06 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF                  | IRF-M 1   | 30,58%         | 0,00%        | 0,11%        | 2,59%         | 9,26%         |
| 11.328.882/0001-35 | BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI                    | IRF-M 1   | 31,45%         | 0,00%        | 0,09%        | 2,67%         | 8,39%         |
| 13.077.415/0001-05 | BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS DE FI                   | CDI       | 34,14%         | 0,00%        | 0,61%        | 1,64%         | 4,09%         |
| 14.386.926/0001-71 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LON | IDKA 2    | 25,79%         | 0,00%        | 2,29%        | 14,23%        | 39,70%        |
| 14.508.643/0001-55 | FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAI     | CDI       | 32,04%         | 0,00%        | 0,78%        | 1,85%         | 5,36%         |
| 23.215.097/0001-55 | FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA    | IMA-GERAL | 32,91%         | 0,00%        | 2,10%        | 10,00%        | 19,04%        |
|                    |                                                      |           | <b>186,89%</b> | <b>0,01%</b> | <b>5,98%</b> | <b>32,98%</b> | <b>85,85%</b> |

## Provisão de risco - Mercado

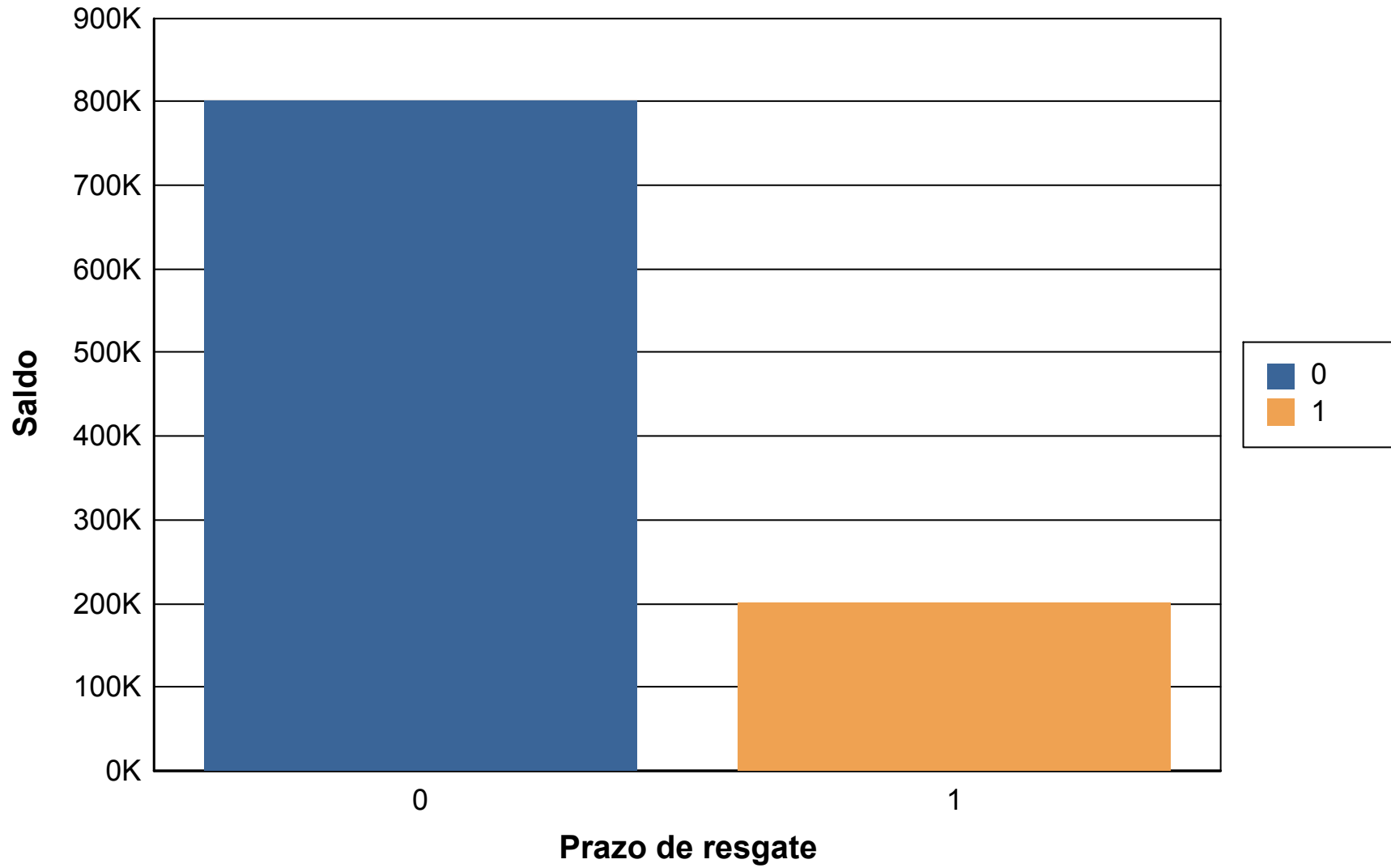
| CNPJ               | Nome do fundo                                         | Benchmark | Saldo          | VAR12 | VOL12  | VAR% BASE 1 |
|--------------------|-------------------------------------------------------|-----------|----------------|-------|--------|-------------|
| 13.077.415/0001-05 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVEST    | CDI       | R\$ 199.948,75 | 0,00% | 4,09%  | R\$ 0,05    |
| 11.328.882/0001-35 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO   | IRF-M 1   | R\$ 200.000,00 | 0,00% | 8,39%  | R\$ 0,39    |
| 14.508.643/0001-55 | FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA/   | CDI       | R\$ 0,00       | 0,00% | 5,36%  | R\$ 0,00    |
| 14.386.926/0001-71 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITUI | IDKA 2    | R\$ 200.395,85 | 0,00% | 39,70% | R\$ 9,39    |
| 10.740.670/0001-06 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS F  | IRF-M 1   | R\$ 200.045,37 | 0,00% | 9,26%  | R\$ 0,37    |

|                                     |                       |
|-------------------------------------|-----------------------|
| Saldo Total:                        | <b>R\$ 800.389,97</b> |
| Provisão para perda e Investimentos | <b>R\$ 10,20</b>      |
| % Provisão de perda                 | 0,00%                 |
| % Aceitavel perda                   | 2%                    |
| Limite de utilização                | <b>0,06%</b>          |



| Nome do Fundo                              | Saldo          | % Part. | N. Cotistas | % PL  | PL do Fundo           | Legislação     | Grau risco | Prazo Resgate |
|--------------------------------------------|----------------|---------|-------------|-------|-----------------------|----------------|------------|---------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDC   | R\$ 199.948,75 | 19,98%  | 779         | 0,01% | R\$ 2.849.785.990,61  | Art 7º, IV "a" | Baixo      | D+ 0          |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULC | R\$ 200.000,00 | 19,99%  | 1,201       | 0,00% | R\$ 8.234.435.809,83  | Art 7º, I, "b" | Baixo      | D+ 0          |
| FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE IN   | R\$ 0,00       | 0,00%   | 301         | 0,00% | R\$ 1.193.304.951,88  | Art 7º, IV "a" | Baixo      | D+ 0          |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IF | R\$ 200.395,85 | 20,03%  | 1,018       | 0,00% | R\$ 10.619.179.611,85 | Art 7º, I, "b" | Baixo      | D+ 0          |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 | R\$ 200.045,37 | 19,99%  | 1,344       | 0,00% | R\$ 16.497.362.164,50 | Art 7º, I, "b" | Baixo      | D+ 0          |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDC    | R\$ 200.205,82 | 20,01%  | 922         | 0,00% | R\$ 14.709.432.867,08 | Art 7º, I, "b" | Médio      | D+ 1          |

| Prazo Resgate | Saldo          | N. Fundo | % Carteira |
|---------------|----------------|----------|------------|
| 0             | R\$ 800.389,97 | 5        | 79,99%     |
| 1             | R\$ 200.205,82 | 1        | 20,01%     |

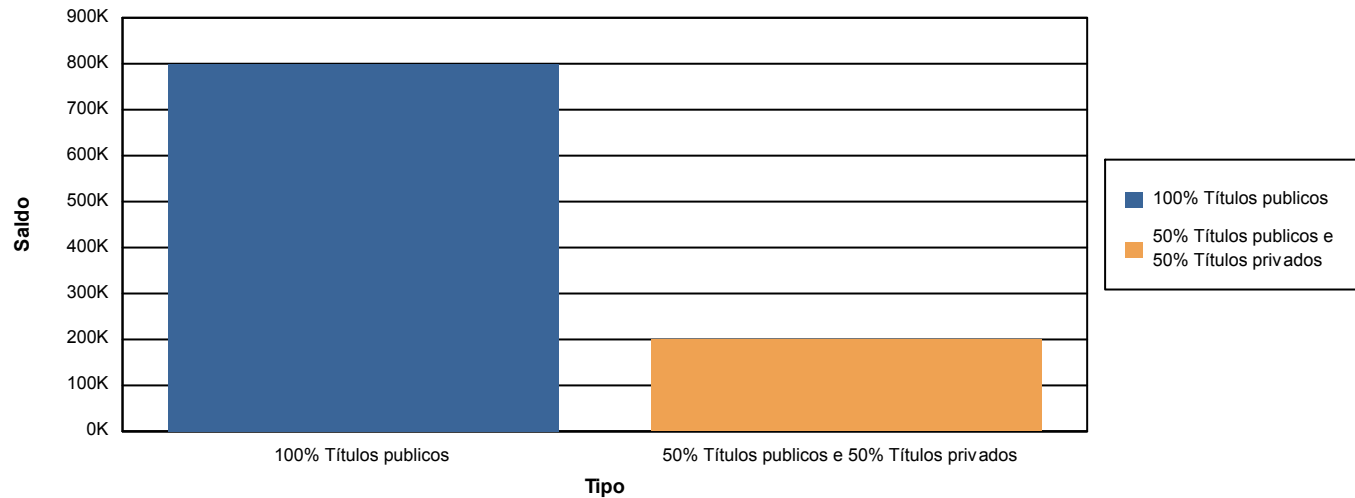


## Risco Crédito

| Legislação                        | Limite  | Limite Política | Saldo          | % Carteira |
|-----------------------------------|---------|-----------------|----------------|------------|
| FI 100% títulos TN – 7º, I, b     | 100,00% | 100,00%         | R\$ 800.647,04 | 80,02      |
| FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a | 40,00%  | 40,00%          | R\$ 199.948,75 | 19,98      |

|                                             | Saldo      | % Carteira |
|---------------------------------------------|------------|------------|
| 100% títulos públicos                       | 900,621.42 | 90.01      |
| 50% Títulos públicos e 50% Títulos privados | 99,974.38  | 9.99       |
| 100% títulos privados                       | 0.00       | 0.00       |

### Distribuição dos saldos



*Kenzo Eduardo de Blasi*

Assinatura