



DI BLASI  
Consultoria Financeira

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

Junho 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	16,82%	797	0,02%	Art 7º, IV "a"	R\$ 653.684,89	B	Fundo de Investim	0,20%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	0	18,82%	1,163	0,01%	Art 7º, I, "b"	R\$ 731.401,13	B	Fundo de Investim	0,20%
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUI	0	10,26%	304	0,03%	Art 7º, IV "a"	R\$ 399.011,87	B	Fundo de Investim	0,80%
14.386.926/0001-71	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULC	0	18,75%	1,047	0,01%	Art 7º, I, "b"	R\$ 728.963,81	B	Fundo de Investim	0,20%
10.740.670/0001-06	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	0	17,54%	1,306	0,00%	Art 7º, I, "b"	R\$ 681.945,59	B	Fundo de Investim	0,20%
23.215.097/0001-55	FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GE:	1	17,81%	980	0,00%	Art 7º, I, "b"	R\$ 692.210,20	M	Fundo de Investim	0,20%

R\$ 3.887.217,49

## Retorno do mês

Nome Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS	R\$ 373.153,68	R\$ 1.840.556,76	R\$ 1.563.616,77	R\$ 653.684,89	R\$ 3.591,22	0,1622%	CDI
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F	R\$ 380.849,29	R\$ 349.866,13		R\$ 731.401,13	R\$ 685,71	0,0938%	IRF-M 1
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE	R\$ 167.630,22	R\$ 230.987,64		R\$ 399.011,87	R\$ 394,01	0,0988%	CDI
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TIT	R\$ 430.156,63	R\$ 300.000,00		R\$ 728.963,81	R\$ -1.192,82	-0,1634%	IDKA 2
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB	R\$ 431.132,32	R\$ 250.000,00		R\$ 681.945,59	R\$ 813,27	0,1193%	IRF-M 1
FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL	R\$ 442.223,54	R\$ 250.000,00		R\$ 692.210,20	R\$ -13,34	-0,0020%	IMA-GERAL
Total	2,225,145.68	3,221,410.53	1,563,616.77	3,887,217.49	4,278.05	0,0785%	

## Enquadramentos

### FI 100% títulos TN – 7º, I, b

 % Carteira: : **72,92%**

 Saldo do grupo: **R\$ 2.834.520,73**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R\$ 681.945,59	259,177.73	0,01%	7,613,291.28	17,54%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,01%	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 731.401,13	266,646.01	0,01%	3,446,149.90	18,82%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,01%	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LONGO PRAZO	R\$ 728.963,81	299,413.39	0,01%	3,463,834.87	18,75%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,01%	Enquadrado
FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	R\$ 692.210,20	453,839.88	0,00%	3,908,177.46	17,81%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado

### FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a

 % Carteira: : **27,08%**

 Saldo do grupo: **R\$ 1.052.696,76**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS DE FI	R\$ 653.684,89	306,857.25	0,03%	7,212,680.54	16,82%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,03%	Enquadrado
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$ 399.011,87	210,262.22	0,07%	1,586,038.14	10,26%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,07%	Enquadrado

## Enquadramento por Benchmark

### CDI

 % Carteira: **27,08%**

 Saldo do grupo: **R\$ 1.052.696,76**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS DE FI	R\$ 653.684,89	306,857.25	0.03	16.82	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$ 399.011,87	210,262.22	0.07	10.26	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

### IDKA 2

 % Carteira: **18,75%**

 Saldo do grupo: **R\$ 728.963,81**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LONGO PRAZO	R\$ 728.963,81	299,413.39	0.01	18.75	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

### IMA-GERAL

 % Carteira: **17,81%**

 Saldo do grupo: **R\$ 692.210,20**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	R\$ 692.210,20	453,839.88	0.00	17.81	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

### IRF-M 1

 % Carteira: **36,36%**

 Saldo do grupo: **R\$ 1.413.346,72**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R\$ 681.945,59	259,177.73	0.01	17.54	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

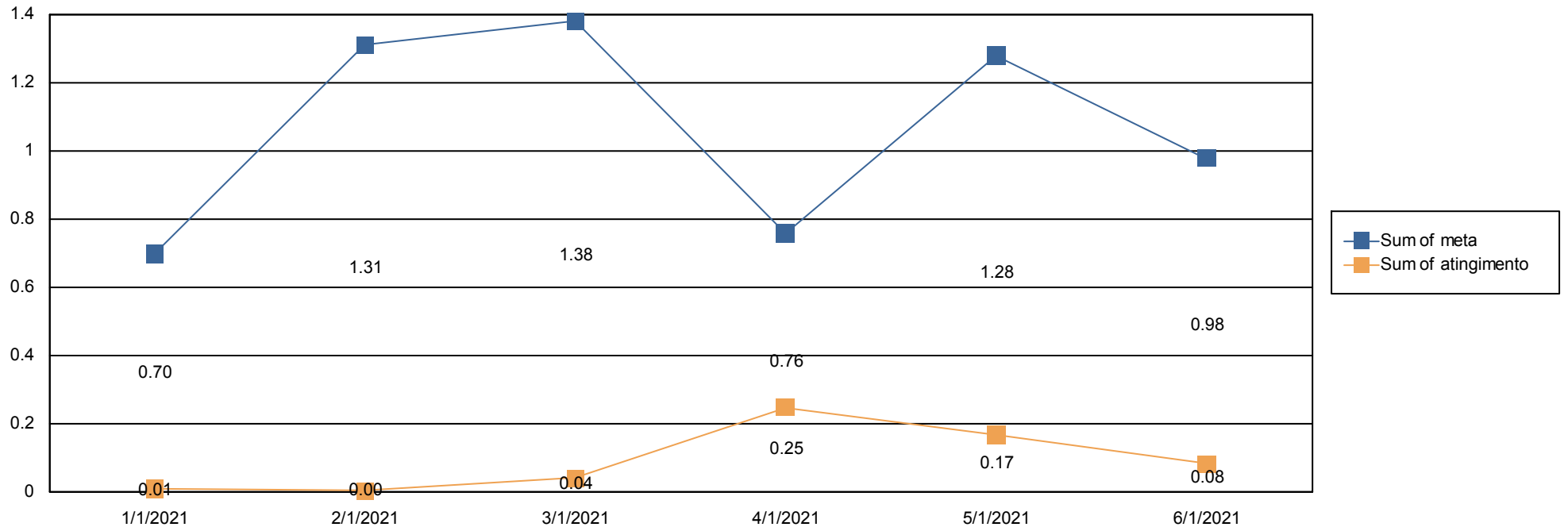


BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 731.401,13	266,646.01	0.01	18.82	Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado
-----------------------------------	----------------	------------	------	-------	---	------------

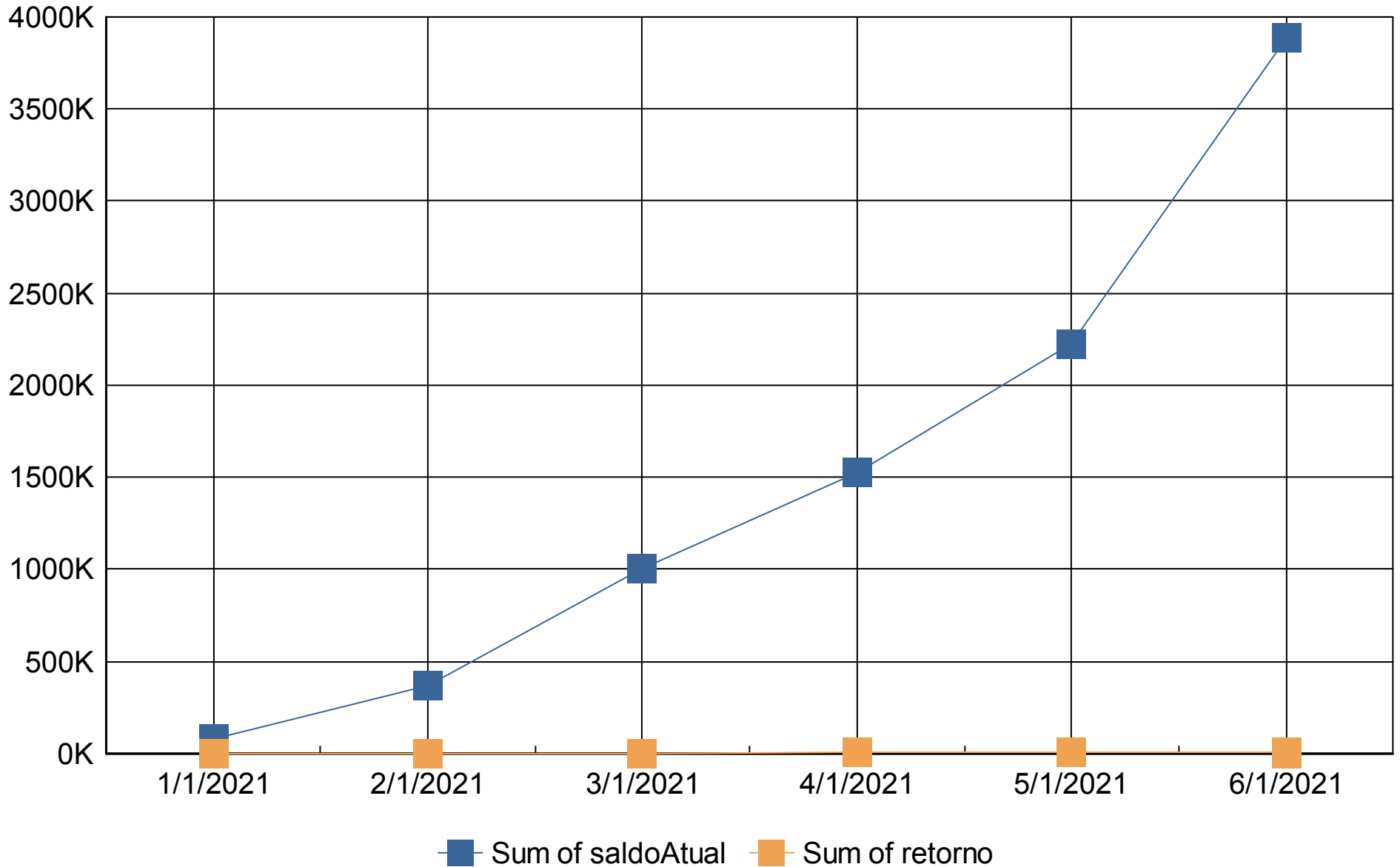
### Retorno acumulado no ano

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	0,0046%	0,6959	0,6671%
Fevereiro	R\$ 83.091,31	R\$ 1.278.517,86	R\$ 993.797,28	R\$ 367.832,09	R\$ 20,20	0,0015%	1,3086	0,1134%
Março	R\$ 367.832,09	R\$ 2.977.068,59	R\$ 2.346.077,40	R\$ 1.000.595,79	R\$ 1.772,51	0,0530%	1,3789	3,8430%
Abril	R\$ 1.000.595,79	R\$ 1.947.896,72	R\$ 1.425.565,25	R\$ 1.528.429,49	R\$ 5.502,23	0,1866%	0,7562	24,6775%
Mai	R\$ 1.528.429,49	R\$ 1.428.482,08	R\$ 738.011,56	R\$ 2.225.145,68	R\$ 6.245,67	0,2112%	1,2785	16,5211%
Junho	R\$ 2.225.145,68	R\$ 3.221.410,53	R\$ 1.563.616,77	R\$ 3.887.217,49	R\$ 4.278,05	0,0785%	0,9772	8,0379%
<b>Total</b>	<b>R\$ 5.562.622,38</b>	<b>11,850,375.78</b>	<b>8,338,567.85</b>	<b>9,092,311.85</b>	<b>17,881.54</b>	<b>0,5365%</b>	<b>6,5658%</b>	<b>8,1709%</b>

### Meta x Atingimento

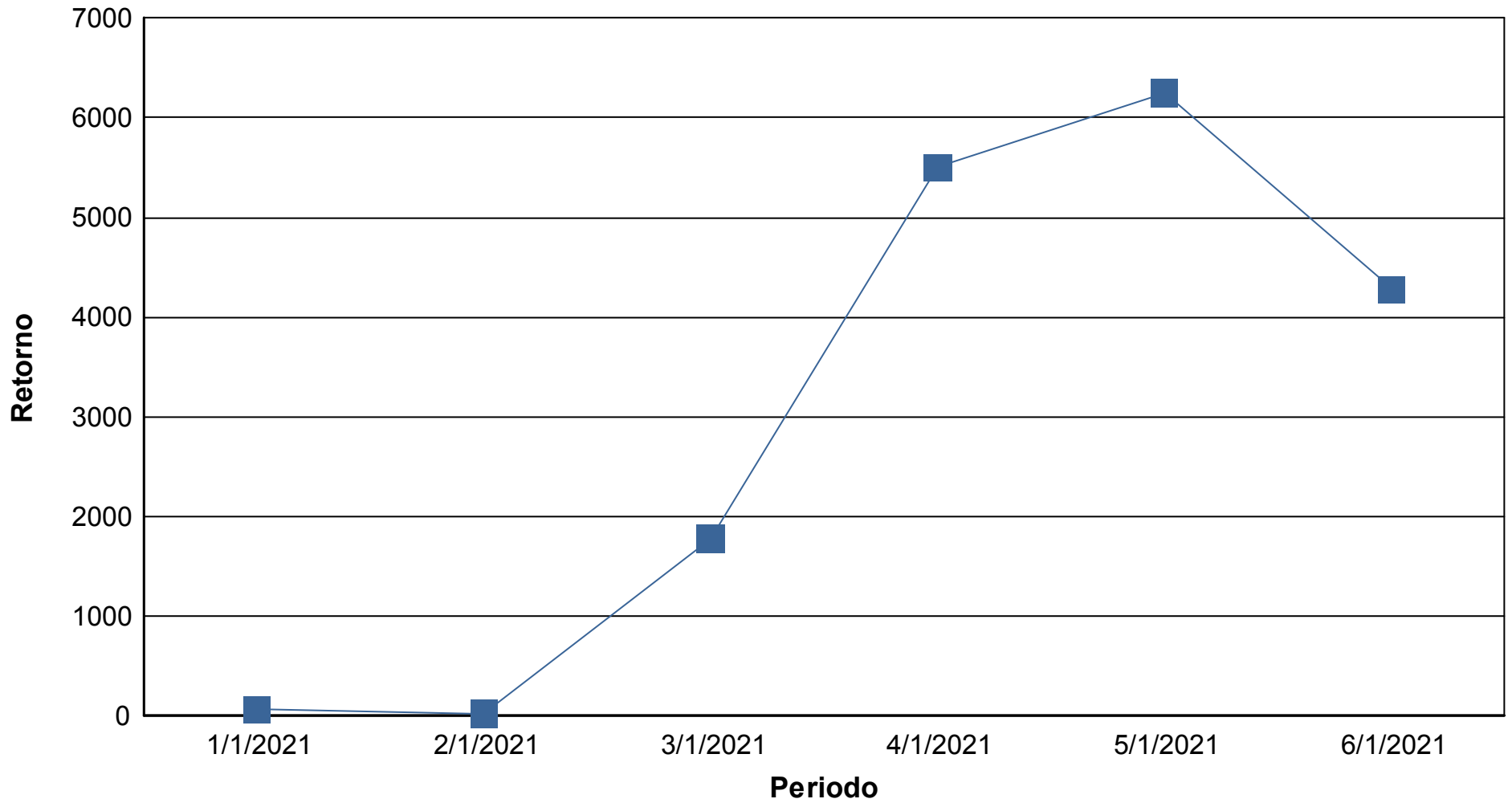


### Evolução do patrimônio



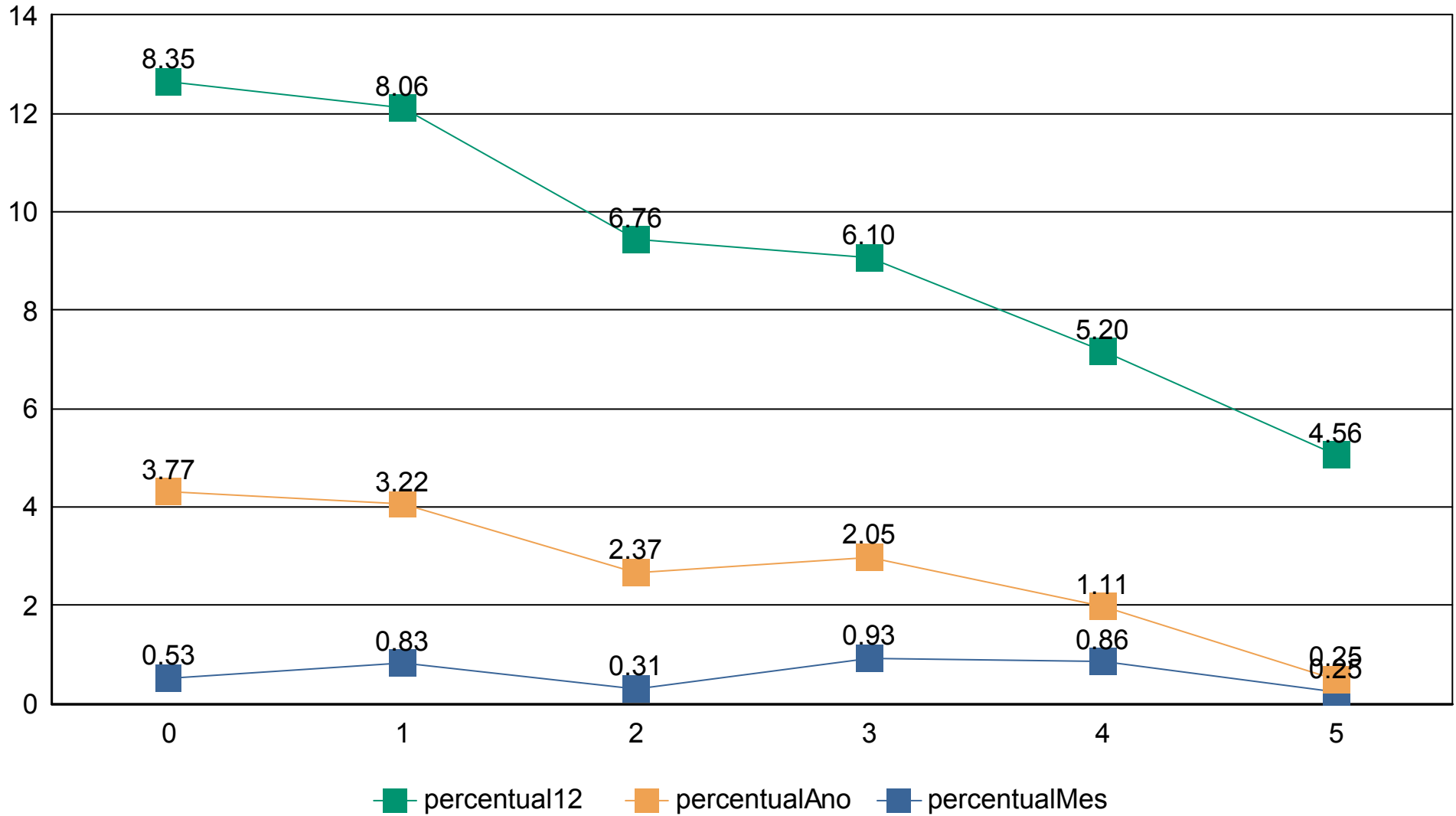


### Retorno Mensal

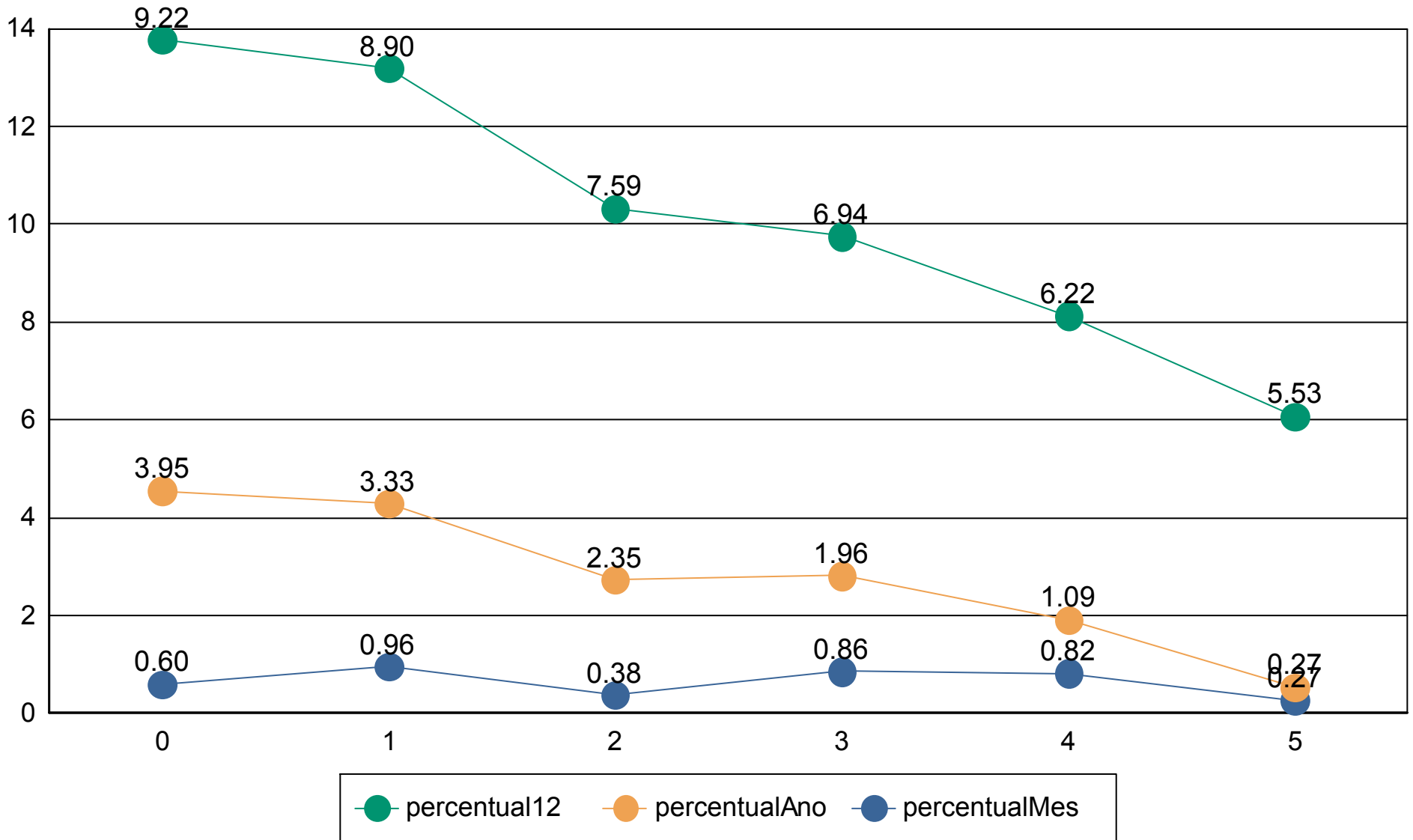




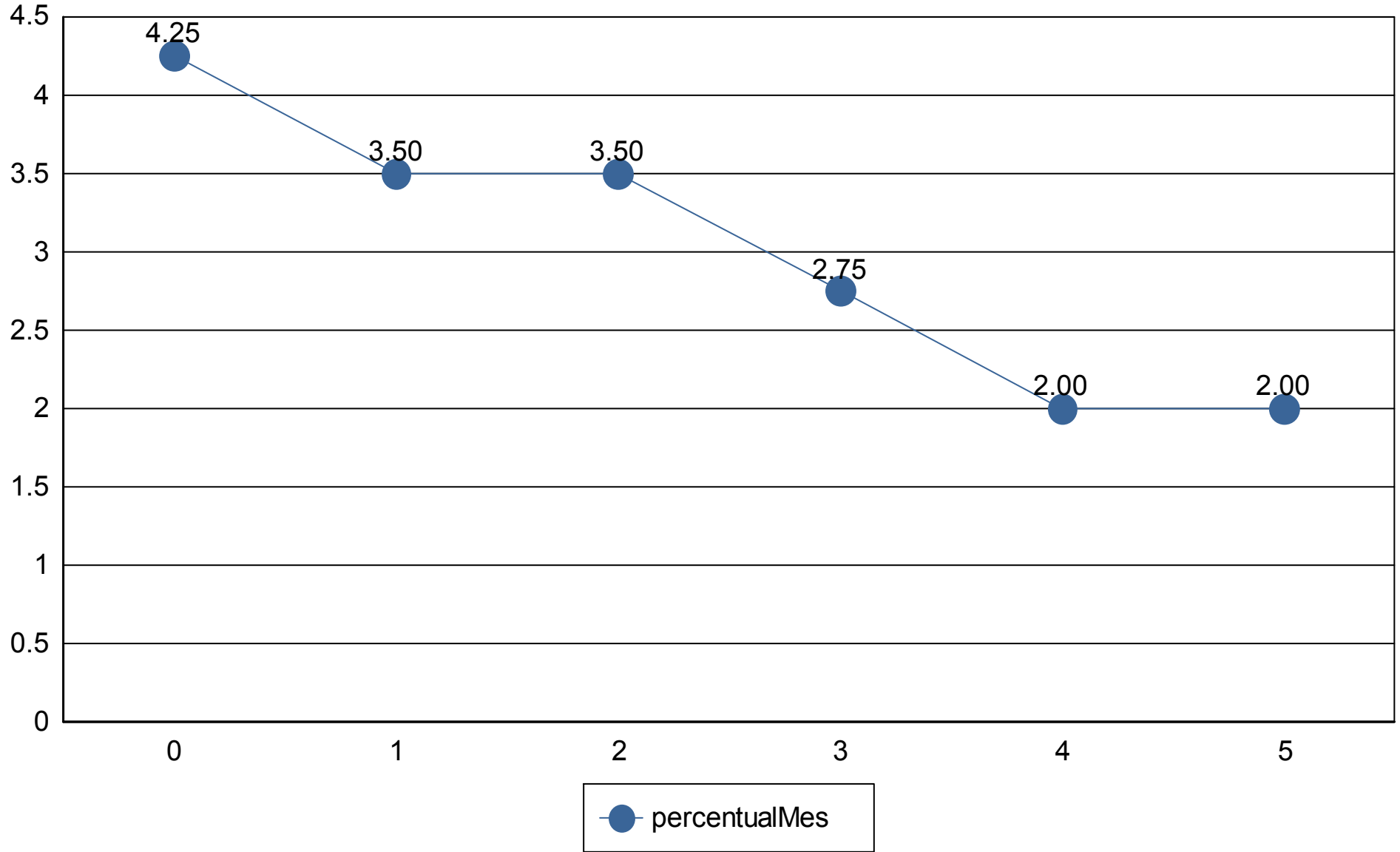
## Índices Econômicos - IPCA



## 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	29,61%	0,00%	1,47%	3,19%	7,73%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	IRF-M 1	29,30%	0,00%	1,46%	2,98%	7,09%
13.077.415/0001-05	BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS DE FI	CDI	29,29%	0,00%	1,69%	2,91%	4,97%
14.386.926/0001-71	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LON	IDKA 2	25,63%	0,00%	3,67%	10,71%	30,73%
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAI	CDI	29,53%	0,00%	1,76%	3,30%	6,02%
23.215.097/0001-55	FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	IMA-GERAL	21,43%	0,00%	1,13%	5,72%	15,65%
			<b>164,79%</b>	<b>0,01%</b>	<b>11,19%</b>	<b>28,82%</b>	<b>72,20%</b>

## Provisão de risco - Mercado

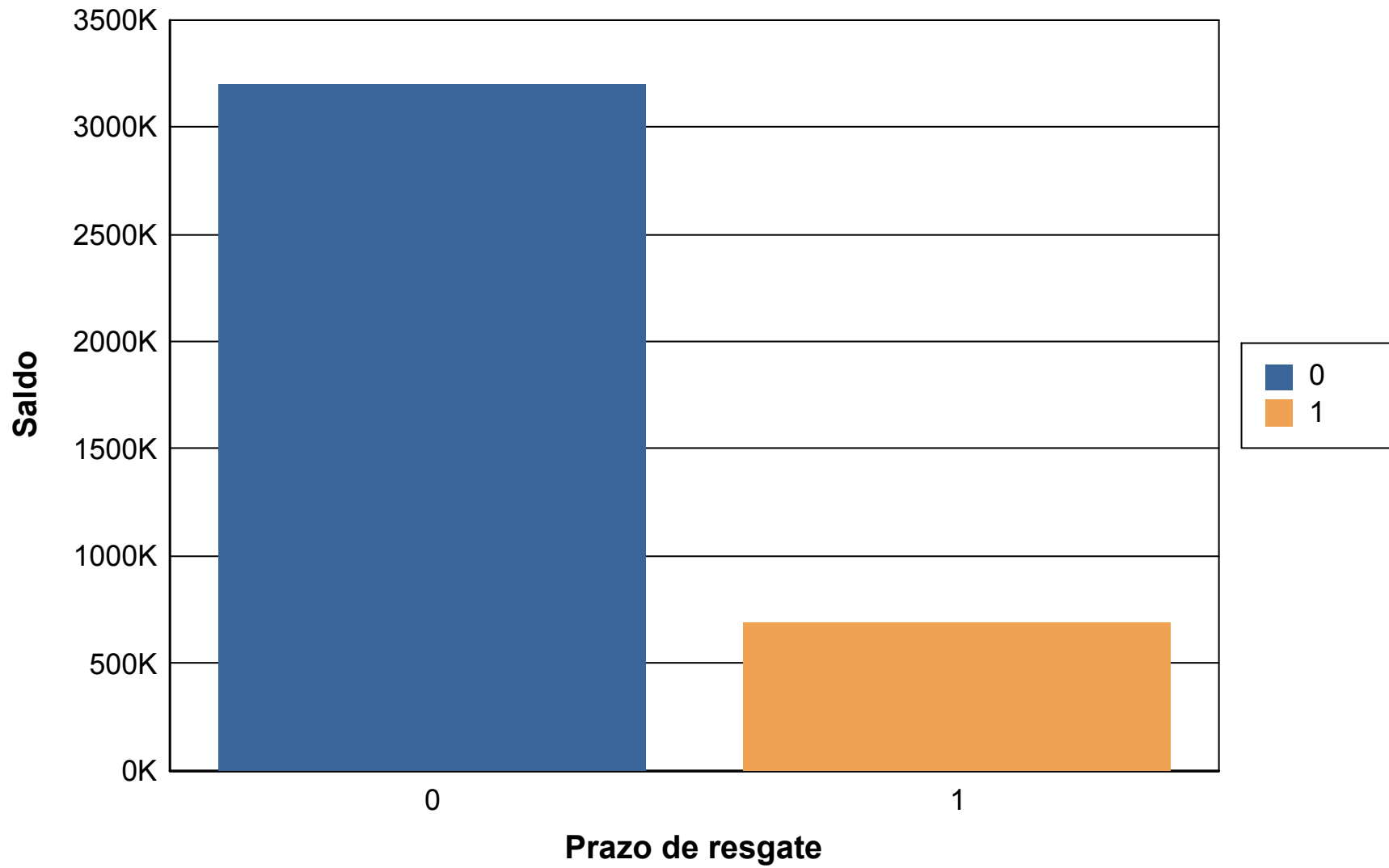
CNPJ	Nome do fundo	Benchmark	Saldo	VAR12	VOL12	VAR% BASE 1
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVEST	CDI	R\$ 653.684,89	0,00%	4,97%	R\$ 0,22
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO	IRF-M 1	R\$ 731.401,13	0,00%	7,09%	R\$ 0,69
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA	CDI	R\$ 399.011,87	0,00%	6,02%	R\$ 0,09
14.386.926/0001-71	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITUI	IDKA 2	R\$ 728.963,81	0,00%	30,73%	R\$ 27,72
10.740.670/0001-06	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS F	IRF-M 1	R\$ 681.945,59	0,00%	7,73%	R\$ 0,60

Saldo Total:	<b>R\$ 3.195.007,29</b>
Provisão para perda e Investimentos	<b>R\$ 29,33</b>
% Provisão de perda	0,00%
% Aceitavel perda	2%
Limite de utilização	<b>0,05%</b>



Nome do Fundo	Saldo	% Part.	N. Cotistas	% PL	PL do Fundo	Legislação	Grau risco	Prazo Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDC	R\$ 653.684,89	16,82%	797	0,02%	R\$ 2.849.785.990,61	Art 7º, IV "a"	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULC	R\$ 731.401,13	18,82%	1,163	0,01%	R\$ 8.234.435.809,83	Art 7º, I, "b"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE IN	R\$ 399.011,87	10,26%	304	0,03%	R\$ 1.193.304.951,88	Art 7º, IV "a"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IF	R\$ 728.963,81	18,75%	1,047	0,01%	R\$ 10.619.179.611,85	Art 7º, I, "b"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1	R\$ 681.945,59	17,54%	1,306	0,00%	R\$ 16.497.362.164,50	Art 7º, I, "b"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDC	R\$ 692.210,20	17,81%	980	0,00%	R\$ 14.709.432.867,08	Art 7º, I, "b"	Médio	D+ 1

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
0	R\$ 3.195.007,29	5	82,19%
1	R\$ 692.210,20	1	17,81%

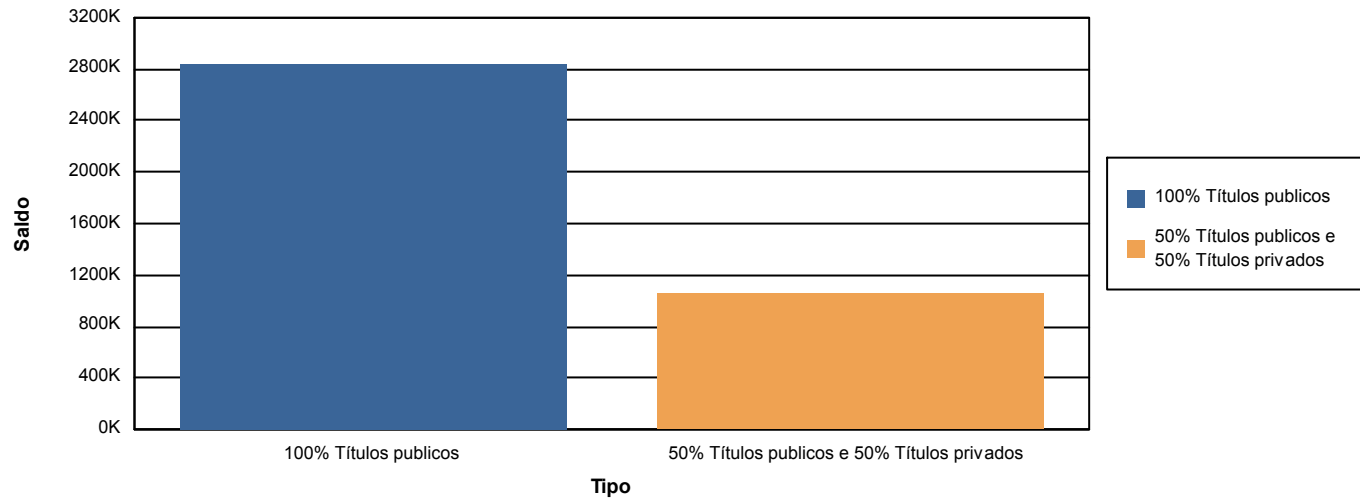


## Risco Crédito

Legislação	Limite	Limite Política	Saldo	% Carteira
FI 100% títulos TN – 7º, I, b	100,00%	100,00%	R\$ 2.834.520,73	72,92
FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a	40,00%	40,00%	R\$ 1.052.696,76	27,08

	Saldo	% Carteira
100% títulos públicos	3,360,869.11	86.46
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	526,348.38	13.54
100% títulos privados	0.00	0.00

### Distribuição dos saldos



*Kenzo Eduardo Di Blasi*

Assinatura