



DI BLASI
Consultoria Financeira

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE BREVES - IPMB

Julho 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	12,24%	806	0,02%	Art 7º, IV "a"	R\$ 446.240,57	B	Fundo de Investim	0,20%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	0	20,09%	1,163	0,01%	Art 7º, I, "b"	R\$ 732.603,13	B	Fundo de Investim	0,20%
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUI	0	10,12%	301	0,05%	Art 7º, IV "a"	R\$ 368.973,77	B	Fundo de Investim	0,80%
14.386.926/0001-71	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULC	0	19,98%	1,048	0,01%	Art 7º, I, "b"	R\$ 728.490,44	B	Fundo de Investim	0,20%
10.740.670/0001-06	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	0	18,73%	1,289	0,01%	Art 7º, I, "b"	R\$ 683.080,78	B	Fundo de Investim	0,20%
23.215.097/0001-55	FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GEI	1	18,84%	985	0,00%	Art 7º, I, "b"	R\$ 686.841,27	M	Fundo de Investim	0,20%

R\$ 3.646.229,96

Retorno do mês

Nome Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS	R\$ 653.684,89	R\$ 995.546,31	R\$ 1.204.599,93	R\$ 446.240,57	R\$ 1.609,30	0,0975%	CDI
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F	R\$ 731.401,13			R\$ 732.603,13	R\$ 1.202,00	0,1643%	IRF-M 1
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE	R\$ 399.011,87	R\$ 27.524,59	R\$ 58.512,23	R\$ 368.973,77	R\$ 949,54	0,2226%	CDI
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TIT	R\$ 728.963,81			R\$ 728.490,44	R\$ -473,37	-0,0650%	IDKA 2
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB	R\$ 681.945,59			R\$ 683.080,78	R\$ 1.135,19	0,1664%	IRF-M 1
FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL	R\$ 692.210,20			R\$ 686.841,27	R\$ -5.368,93	-0,7757%	IMA-GERAL
Total	3,887,217.49	1,023,070.90	1,263,112.16	3,646,229.96	-946.27	-0,0193%	

Enquadramentos

FI 100% títulos TN – 7º, I, b

 % Carteira: : **77,64%**

 Saldo do grupo: **R\$ 2.831.015,62**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 732.603,13	266,646.01	0,01%	1,375,720.34	20,09%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,01%	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R\$ 683.080,78	259,177.73	0,01%	3,396,263.31	18,73%	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\$ 728.490,44	299,413.39	0,01%	2,628,715.86	19,98%	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\$ 686.841,27	453,839.88	0,00%	5,689,880.46	18,84%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado

FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a

 % Carteira: : **22,36%**

 Saldo do grupo: **R\$ 815.214,34**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$ 368.973,77	193,936.75	0,06%	1,379,498.92	10,12%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,06%	Enquadrado
BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS DE FI	R\$ 446.240,57	208,962.42	0,02%	3,891,886.28	12,24%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,02%	Enquadrado

Enquadramento por Benchmark

CDI

 % Carteira: **22,36%**

 Saldo do grupo: **R\$ 815.214,34**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$ 368.973,77	193,936.75	0.06	10.12	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado
BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS DE FI	R\$ 446.240,57	208,962.42	0.02	12.24	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IDKA 2

 % Carteira: **19,98%**

 Saldo do grupo: **R\$ 728.490,44**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LONGO PRAZO	R\$ 728.490,44	299,413.39	0.01	19.98	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IMA-GERAL

 % Carteira: **18,84%**

 Saldo do grupo: **R\$ 686.841,27**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	R\$ 686.841,27	453,839.88	0.00	18.84	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IRF-M 1

 % Carteira: **38,83%**

 Saldo do grupo: **R\$ 1.415.683,91**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 732.603,13	266,646.01	0.01	20.09	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

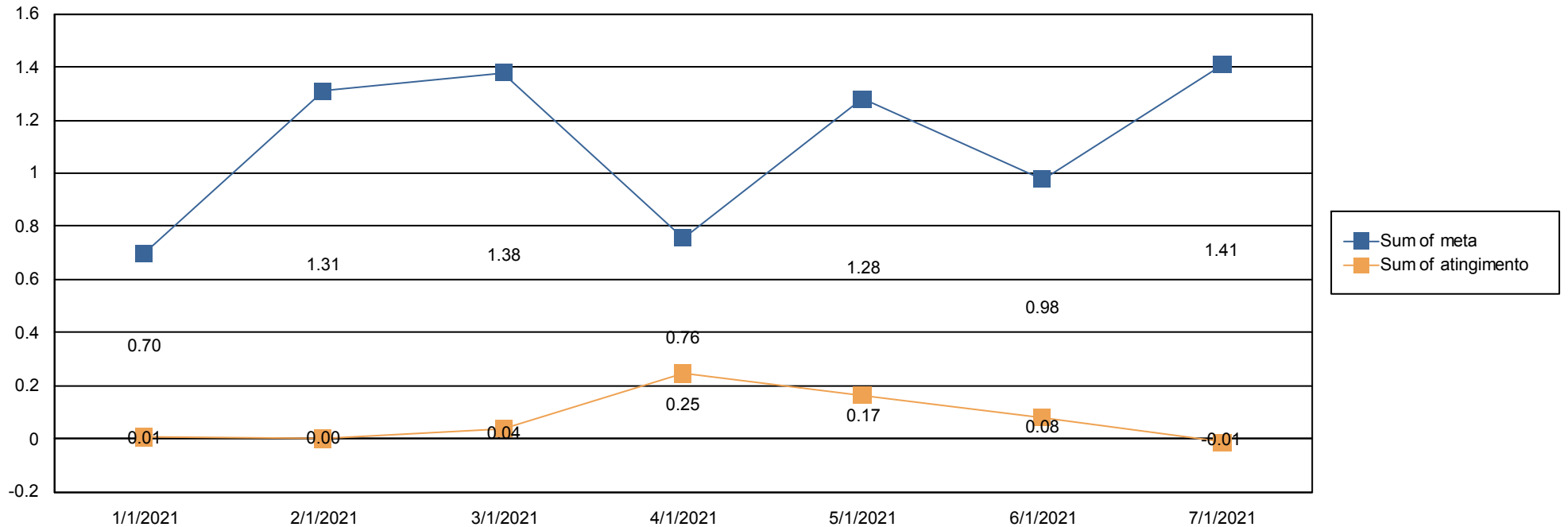


FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R\$ 683.080,78	259,177.73	0.01	18.73	Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado
-------------------------------------	----------------	------------	------	-------	---	------------

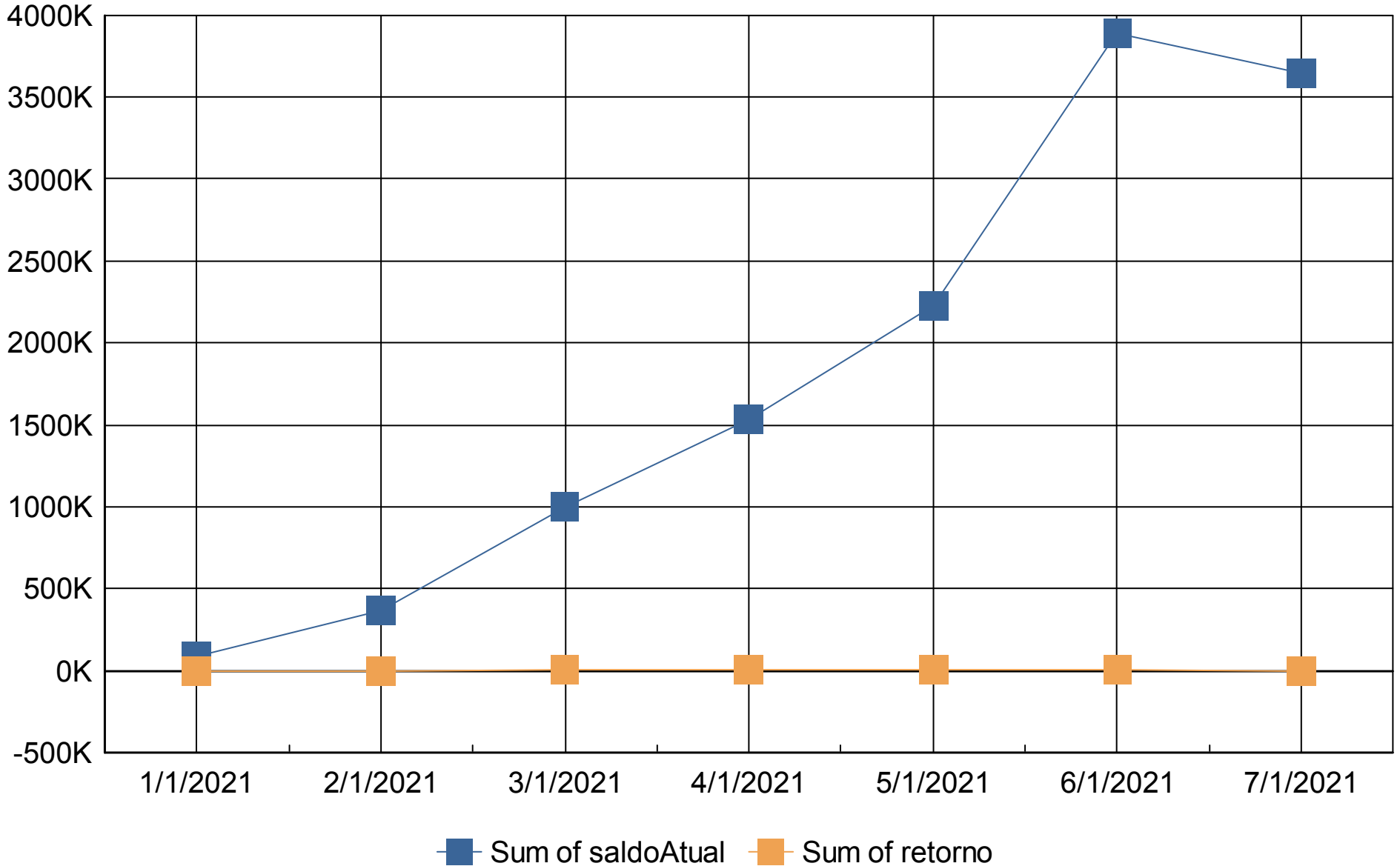
Retorno acumulado no ano

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%
Julho	R\$ 3.887.217,49	R\$ 1.023.070,90	R\$ 1.263.112,16	R\$ 3.646.229,96	-R\$ 946,27	-0,0193%	1,4091	-1,3676%
Total	R\$ 9.449.839,87	12,873,446.68	9,601,680.01	12,738,541.81	16,935.27	0,5171%	8,0675%	6,4099%

Meta x Atingimento

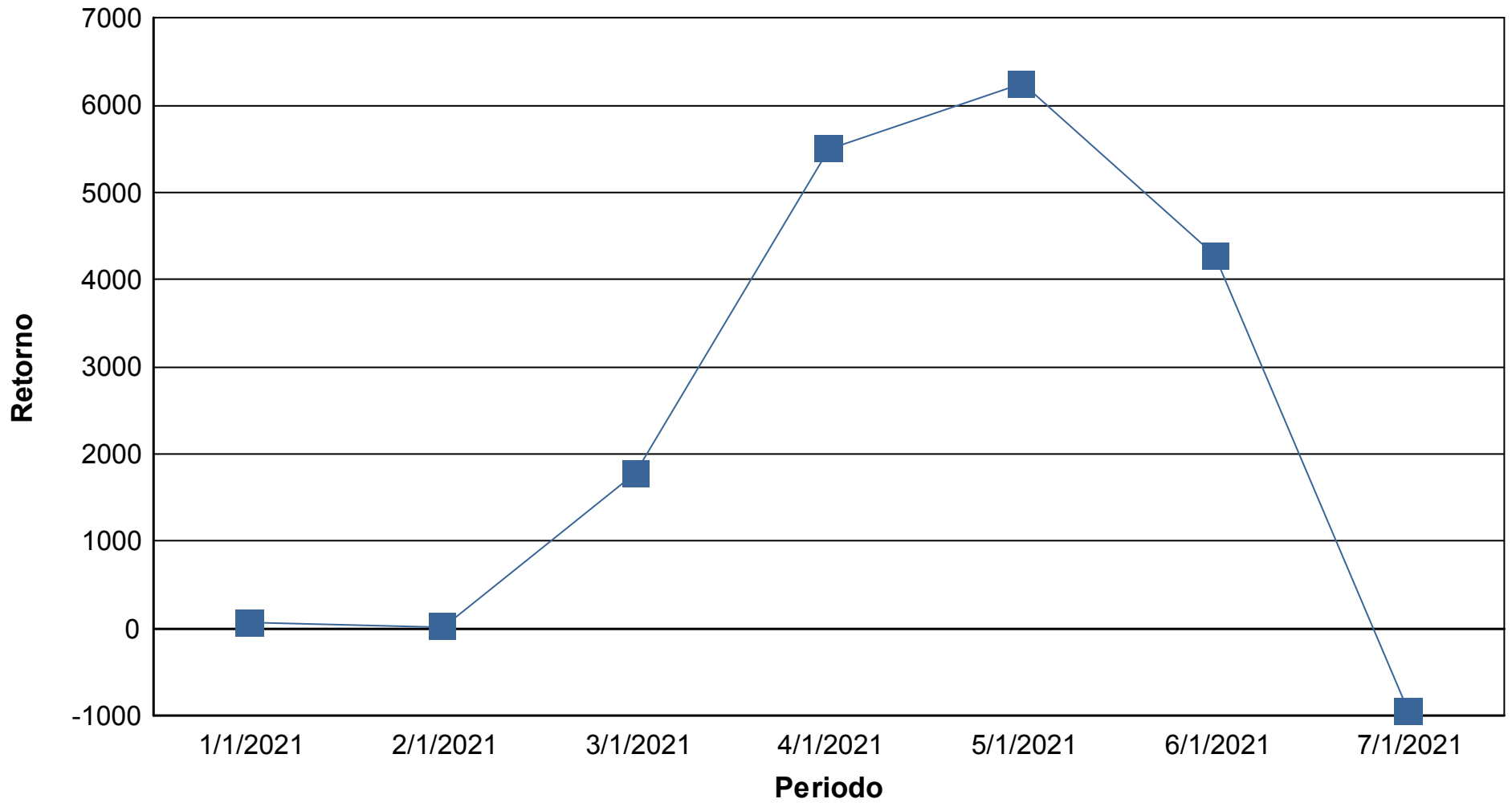


Evolução do patrimônio

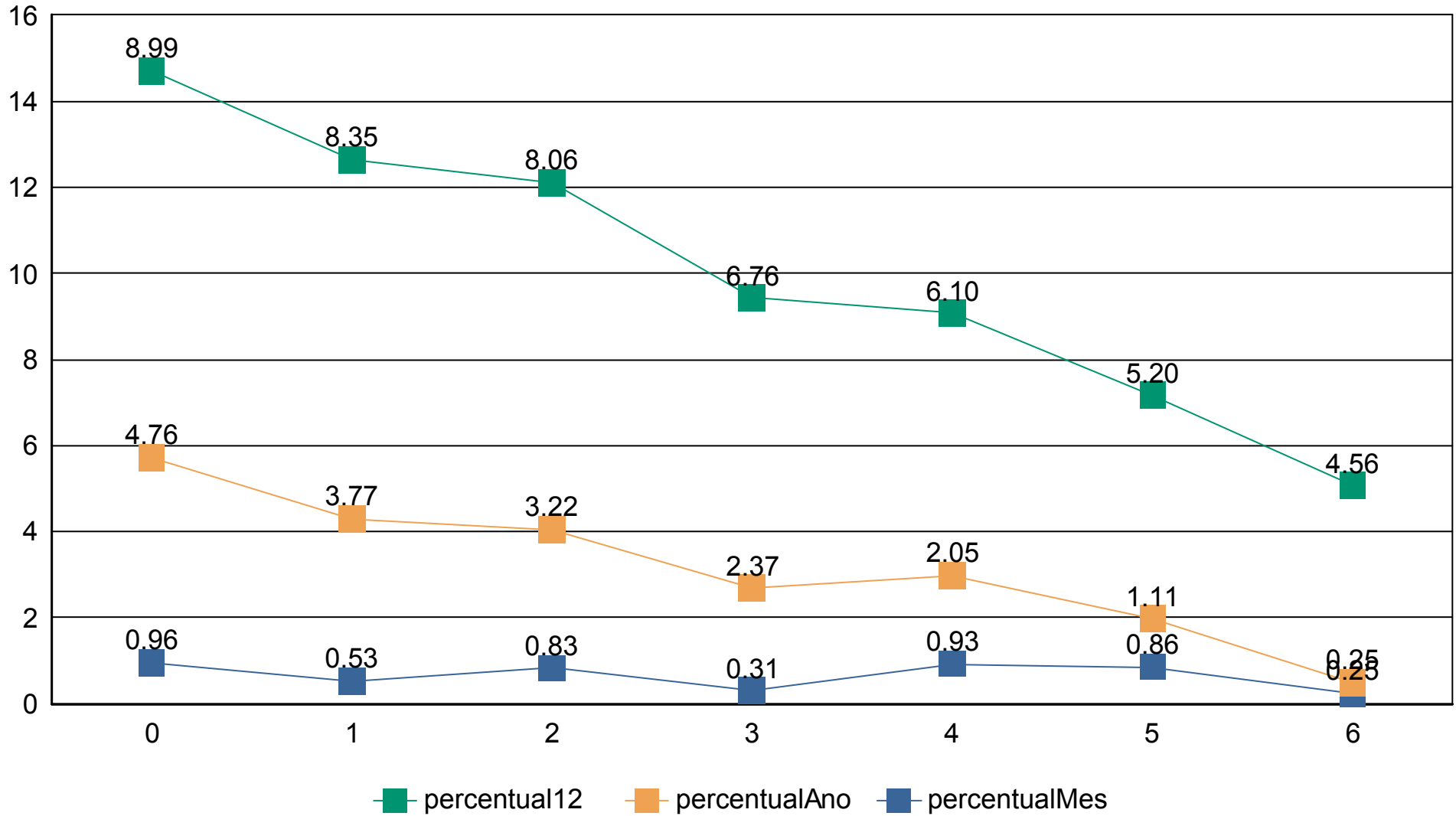




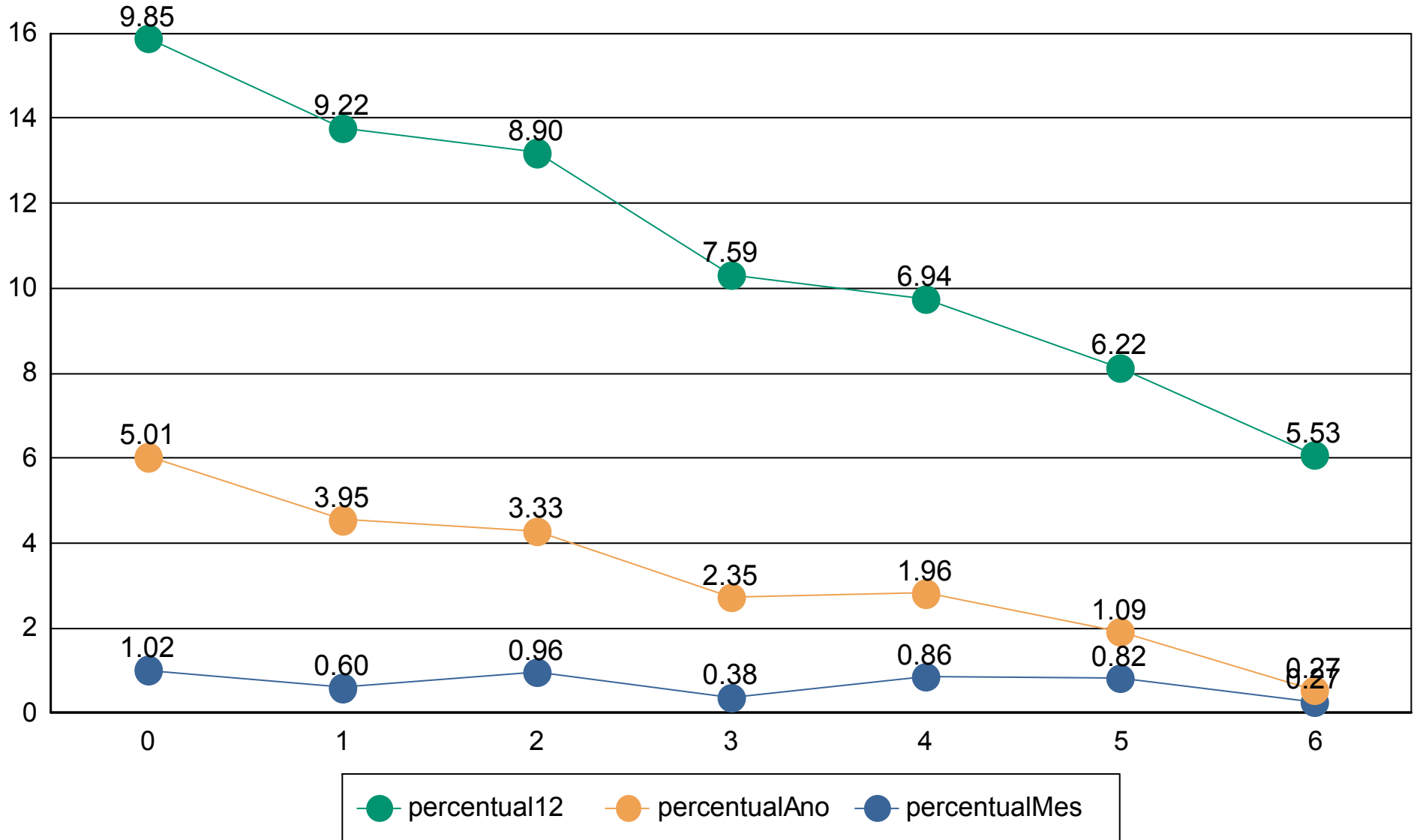
Retorno Mensal



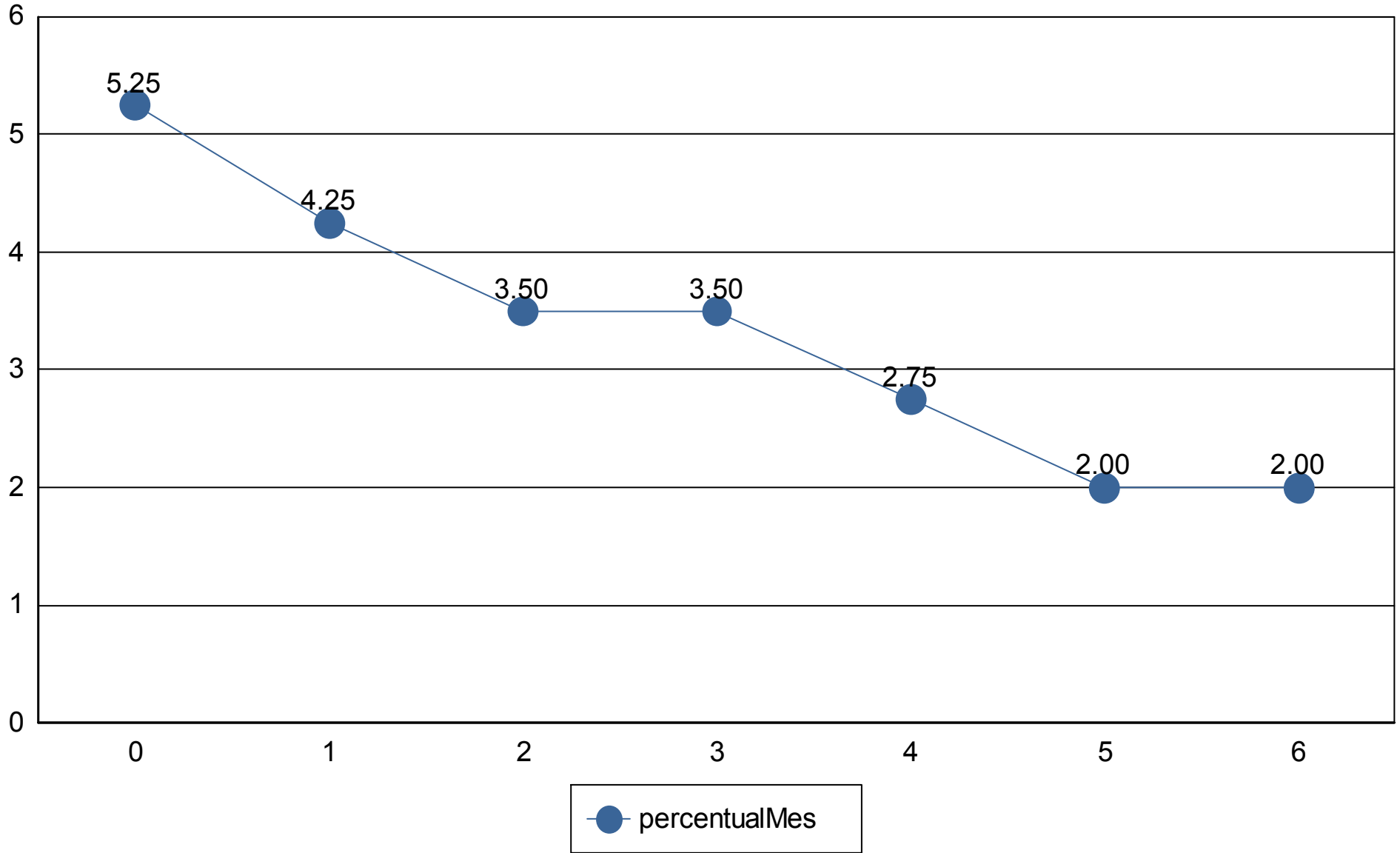
Índices Econômicos - IPCA



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
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAI	CDI	28,19%	0,00%	1,97%	4,05%	6,91%
13.077.415/0001-05	BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS DE FI	CDI	27,18%	0,00%	1,89%	3,74%	6,00%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	IRF-M 1	26,77%	0,00%	1,39%	3,59%	7,40%
10.740.670/0001-06	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	IRF-M 1	27,74%	0,00%	1,43%	3,77%	7,88%
14.386.926/0001-71	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LON	IDKA 2	23,74%	0,00%	1,53%	10,64%	28,29%
23.215.097/0001-55	FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	IMA-GERAL	7,30%	0,00%	3,62%	5,73%	15,44%
			140,92%	0,01%	11,82%	31,52%	71,91%

Provisão de risco - Mercado

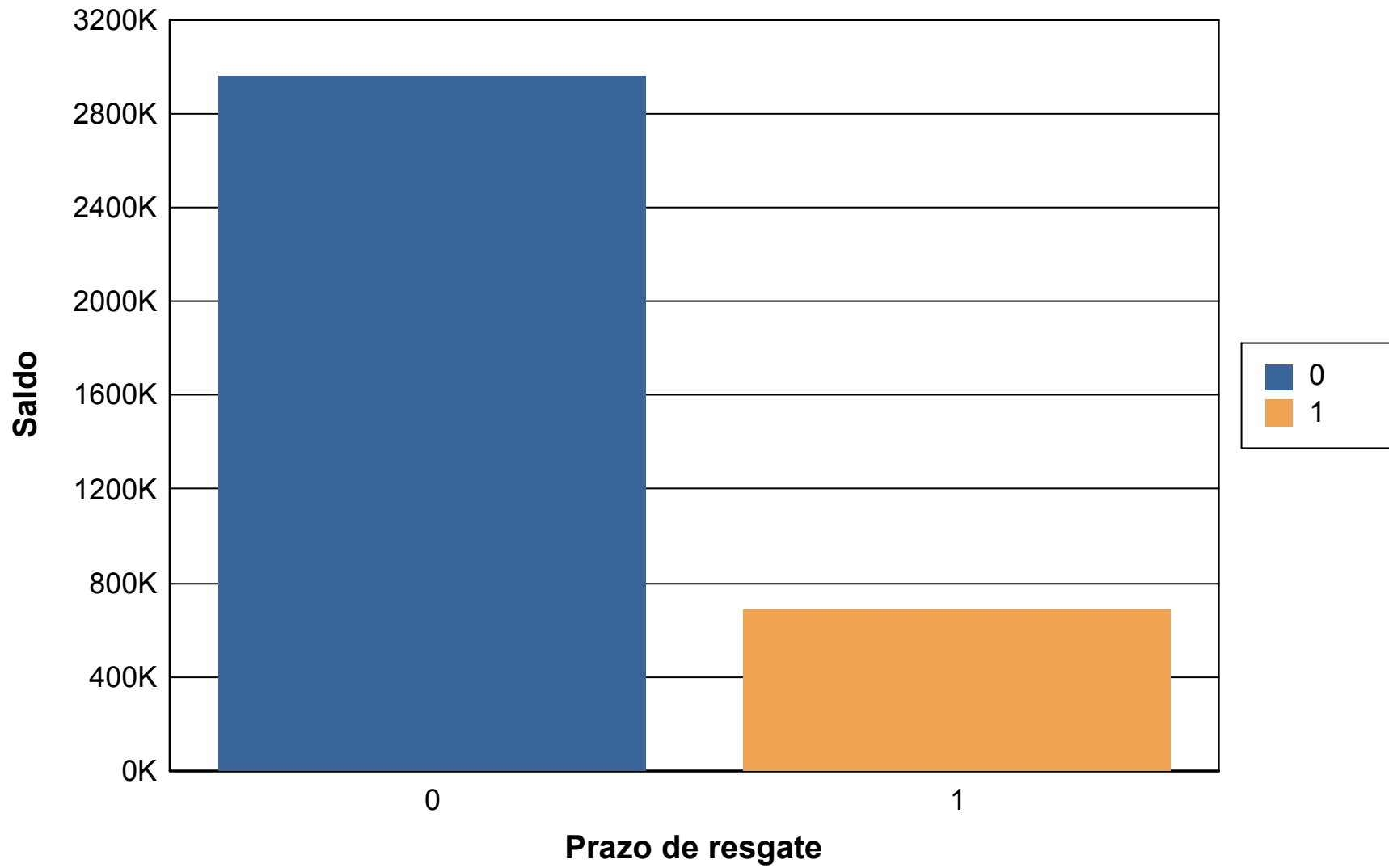
CNPJ	Nome do fundo	Benchmark	Saldo	VAR12	VOL12	VAR% BASE 1
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVEST	CDI	R\$ 446.240,57	0,00%	6,00%	R\$ 0,23
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO	IRF-M 1	R\$ 732.603,13	0,00%	7,40%	R\$ 0,64
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA	CDI	R\$ 368.973,77	0,00%	6,91%	R\$ 0,14
14.386.926/0001-71	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITUI	IDKA 2	R\$ 728.490,44	0,00%	28,29%	R\$ 28,79
10.740.670/0001-06	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS F	IRF-M 1	R\$ 683.080,78	0,00%	7,88%	R\$ 0,56

Saldo Total:	R\$ 2.959.388,69
Provisão para perda e Investimentos	R\$ 30,36
% Provisão de perda	0,00%
% Aceitavel perda	2%
Limite de utilização	0,05%



Nome do Fundo	Saldo	% Part.	N. Cotistas	% PL	PL do Fundo	Legislação	Grau risco	Prazo Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDC	R\$ 446.240,57	12,24%	806	0,02%	R\$ 2.481.798.746,42	Art 7º, IV "a"	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULC	R\$ 732.603,13	20,09%	1,163	0,01%	R\$ 7.957.016.412,49	Art 7º, I, "b"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE IN	R\$ 368.973,77	10,12%	301	0,05%	R\$ 745.999.071,23	Art 7º, IV "a"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IF	R\$ 728.490,44	19,98%	1,048	0,01%	R\$ 11.173.039.069,76	Art 7º, I, "b"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1	R\$ 683.080,78	18,73%	1,289	0,01%	R\$ 7.419.078.207,52	Art 7º, I, "b"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDC	R\$ 686.841,27	18,84%	985	0,00%	R\$ 15.539.192.844,11	Art 7º, I, "b"	Médio	D+ 1

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
0	R\$ 2.959.388,69	5	81,16%
1	R\$ 686.841,27	1	18,84%

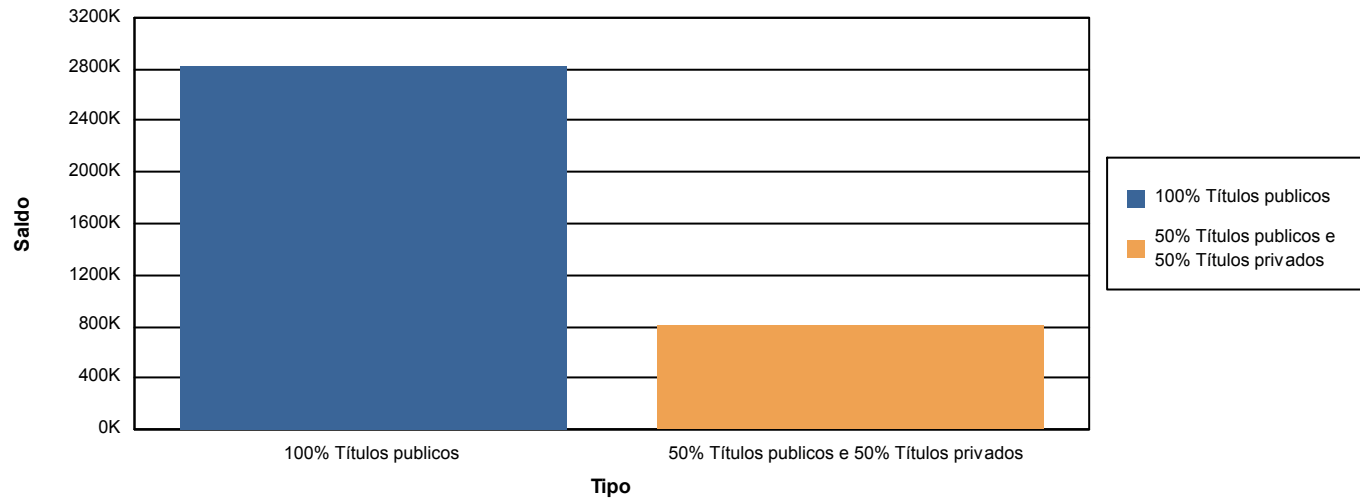


Risco Crédito

Legislação	Limite	Limite Política	Saldo	% Carteira
FI 100% títulos TN – 7º, I, b	100,00%	100,00%	R\$ 2.831.015,62	77,64
FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a	40,00%	40,00%	R\$ 815.214,34	22,36

	Saldo	% Carteira
100% títulos públicos	3,238,622.79	88.82
50% Títulos públicos e 50% Títulos privados	407,607.17	11.18
100% títulos privados	0.00	0.00

Distribuição dos saldos



Kenzo Eduardo Di Blasi

Assinatura