

# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE BREVES - IPMB

Relatório Competência

01/2020



## VISÃO GERAL

FUNDO	DISP. DE RESGATE	SALDO R\$	PARTICIPAÇÃO	QTDE. COTISTAS	% SOBRE PL DO FUNDO	PL DO FUNDO R\$	RESOLUÇÃO	GRAU DE RISCO	TAXA ADM.	TIPO
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	475,62	3,09 %	737	0,00 %	1.500.776.659,75	Art 7º, IV "a"	Baixo	1,00 %	Fundo de Investimento
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	14.898,34	96,90 %	1213	0,00 %	7.374.284.212,96	Art 7º, I, "b"	Baixo	0,10 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	D + 0	1,25	0,01 %	324	0,00 %	487.819.881,57	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,80 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	684	0,00 %	5.345.385.558,02	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D + 0	0,00	0,00 %	684	0,00 %	5.345.385.558,02	Art 7º, IV "a"	Baixo	0,20 %	Fundo de Investimento

**TOTAL SALDO:** R\$ 15.375,21

Relatório competência: 01/2020



## ENQUADRAMENTO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE PL FUNDO	LIMITE POR PARTICIPAÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
FI 100 TÍTULOS TN - Art 7º, I, "b"	100% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% DESENQUADRADO	100%	14.898,34	96,90 %
FI RENDA FIXA GERAL - Art 7º, IV "a"	40% ENQUADRADO	15% ENQUADRADO	20% ENQUADRADO	40%	476,87	3,10 %
<b>Valor total Renda Fixa: R\$ 15.375,21</b>						

RENDA VARIÁVEL - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE PL FUNDO	LIMITE POR PARTICIPAÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
<b>Valor total Renda Variável: R\$ 0,00</b>						

EXTERIOR - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE PL FUNDO	LIMITE POR PARTICIPAÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
<b>Valor total Exterior: R\$ 0,00</b>						

DISTRIBUIÇÃO POR PARÂMETRO DE RENTABILIDADE	TOTAL	% CARTEIRA
CDI	476,87	3,10
IRF-M1	14.898,34	96,90
	R\$ 15.375,21	

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	% CARTEIRA
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A   CNPJ: 30822936000169	15.373,96	99,99
CAIXA ECONOMICA FEDERAL   CNPJ: 360305000104	1,25	0,01
	R\$ 15.375,21	

Relatório competência: 01/2020



## RETORNOS

FUNDO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	EFETIVO %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 0,00	R\$ 948.959,84	R\$ 948.782,27	R\$ 475,62	R\$ 298,05	0,28561 %	0,28561 %
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 894,59	R\$ 14.000,00	R\$ 0,00	R\$ 14.898,34	R\$ 3,75	0,41936 %	0,41936 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	R\$ 66.775,49	R\$ 127.482,43	R\$ 194.317,92	R\$ 1,25	R\$ 61,25	0,30246 %	0,30246 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,37081 %	0,37081 %
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,37081 %	0,37081 %
TOTAIS	R\$ 67.670,08	R\$ 1.090.442,27	R\$ 1.143.100,19	R\$ 15.375,21	R\$ 363,05	0,4152 %	0,4152 %



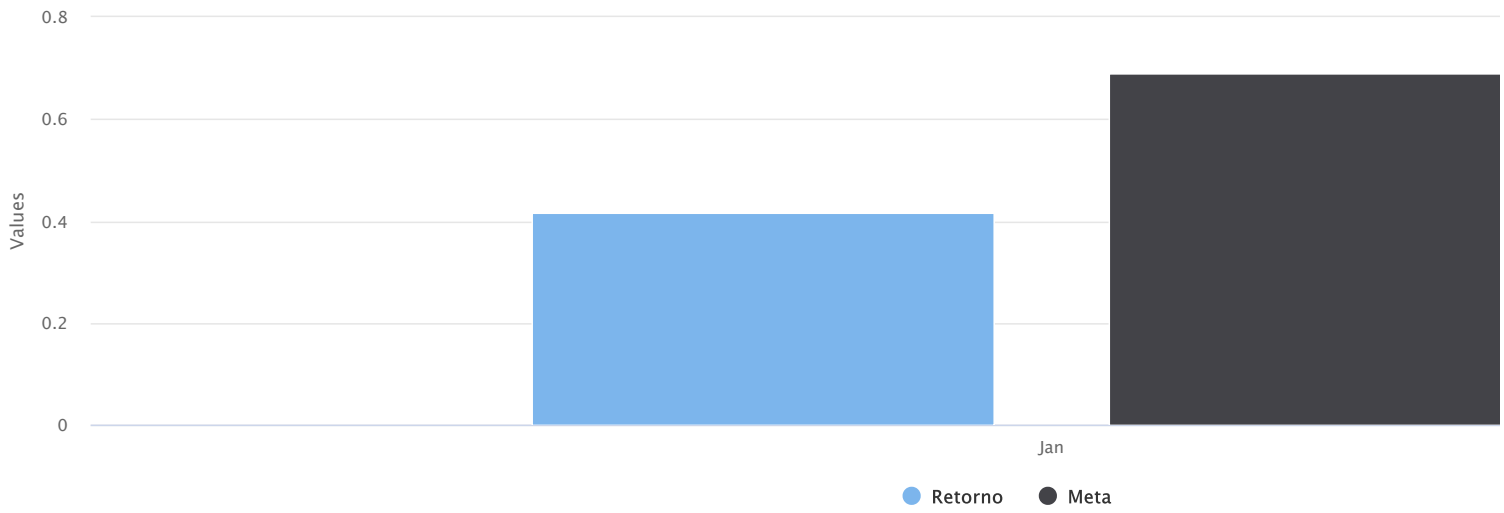
## RETORNOS ACUMULADO

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	META %	ATINGIMENTO %
JANEIRO	R\$ 67.670,08	R\$ 1.090.442,27	R\$ 1.143.100,19	R\$ 15.375,21	R\$ 363,05	0,4152 %	0,69 %	60,25 %
TOTAIS		R\$ 1.090.442,27	R\$ 1.143.100,19		R\$ 363,05	0,42	0,69	60,25

Relatório competência: 01/2020



Gráfico – Retorno acumulado no ano





## EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO X RENTABILIDADE MONETÁRIA

MESES	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO
SALDO (R\$)	15.375,21	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
RETORNO (R\$)	363,05	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

### REFERENTE AO SALDO (R\$)

R\$ 15 375.21

Jan

Relatório competência: 01/2020



REFERENTE AO RETORNO (R\$)

R\$ 363.050000000008

Jan

Relatório competência: 01/2020





## MEDIDA 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.

FUNDO	BENCHMARK	VAR 12 MESES	SHARPE	VOLATILIDADE 3 MESES	VOLATILIDADE 6 MESES	VOLATILIDADE 12 MESES
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,62 %	-3,77 %	0,12 %	0,20 %	0,29%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	IRF-M1	0,94 %	2,12 %	0,44 %	0,43 %	0,43%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CDI	0,64 %	-2,89 %	0,12 %	0,20 %	0,29%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	0,91 %	-1,02 %	0,40 %	0,36 %	0,42%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	0,91 %	-1,02 %	0,40 %	0,36 %	0,42%

Relatório competência: 01/2020



## PROVISÃO DE RISCO - INDICATIVO

FUNDO	CNPJ	BENCHMARK	SALDO (R\$)	VAR 12 MESES	VOLATILIDADE 12 MESES	VAR% BASE 1 DIA CONFIANÇA 95% 252 DU* (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	13.077.415/0001-05	CDI	475,62	0,02 %	0,04 %	0,10
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	11.328.882/0001-35	IRF-M1	14.898,34	0,13 %	0,26 %	19,37
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	14.508.643/0001-55	CDI	1,25	0,25 %	0,11 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CDI	0,00	0,98 %	0,45 %	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	CDI	0,00	0,98 %	0,45 %	0,00

RISCO DE MERCADO	
<b>Saldo Total:</b>	R\$ 15.375,21
<b>Provisão para perda e investimentos:</b>	R\$ 19,47
<b>% Provisão de Perda:</b>	0,127%

Relatório competência: 01/2020



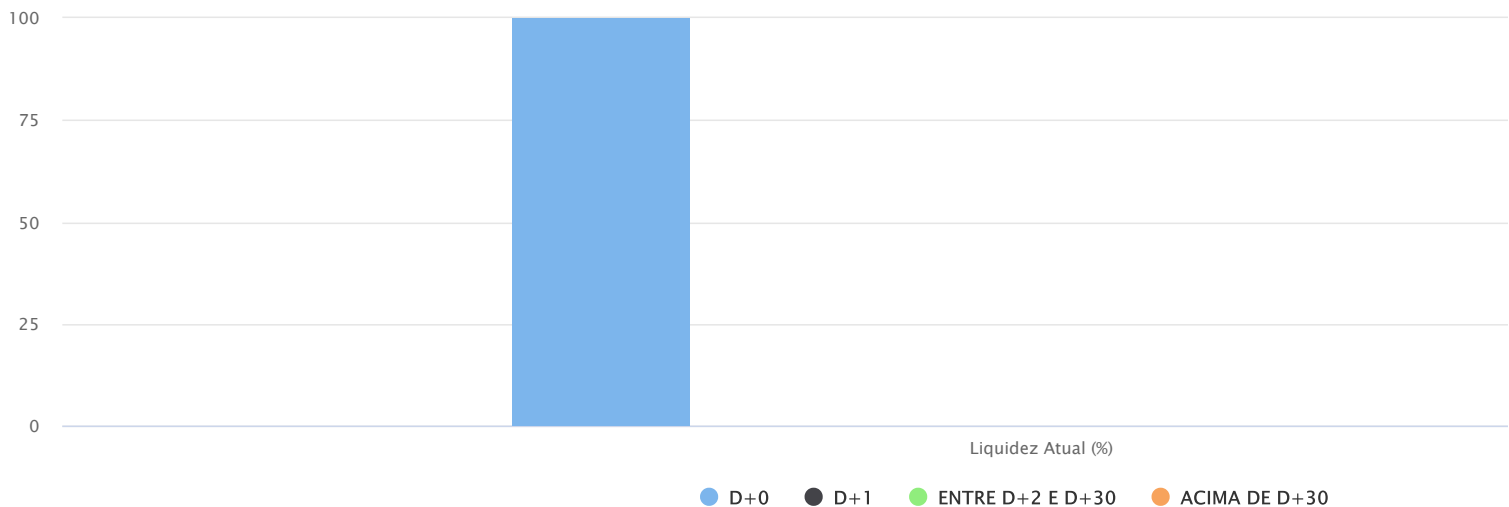
## RISCO DE LIQUIDEZ

FUNDO	DISP. DE RESGATE	SALDO R\$	PARTICIPAÇÃO	QTDE. COTISTAS	% SOBRE PL DO FUNDO	PL DO FUNDO R\$	RESOLUÇÃO	GRAU DE RISCO
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D + 0	475,62	3,09 %	737	0,00 %	1.500.776.659,75	Art 7º, IV "a"	Baixo
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D + 0	14.898,34	96,90 %	1213	0,00 %	7.374.284.212,96	Art 7º, I, "b"	Baixo
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	D + 0	1,25	0,01 %	324	0,00 %	487.819.881,57	Art 7º, IV "a"	Baixo

**TOTAL SALDO: R\$ 15.375,21**

PRAZO DE RESGATE	QUANTIDADE DE FUNDOS	LIQUIDEZ ATUAL
D+0	5	100%
D+1	0	0%
ENTRE D+2 E D+30	0	0%
ACIMA DE D+30	0	0%

### Gráfico



Relatório competência: 01/2020



## RISCO DE CRÉDITO

RENDA FIXA - ARTIGOS	LIMITE DA RESOLUÇÃO	LIMITE POLÍTICA	TOTAL	% CARTEIRA
Art 7º, I, "b"	100 %	100 %	14.898,34	96,90
Art 7º, IV "a"	40 %	40 %	476,87	3,10
			15.375,21	

RISCO DE CRÉDITO	% CARTEIRA
100% Títulos Públicos e 0% Títulos Privados	98,45%
50% Títulos Públicos e 50% Títulos Privados	1,55%
0% Títulos Públicos e 100% Títulos Privados	0,00%

Relatório competência: 01/2020



## CAPITAL PROTEGIDO

TIPO DE PRODUTO E PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO	TIPO DE PRODUTO PERCENTUAL DO CAPITAL
INVESTIDO PROTEGIDO	INVESTIDO PROTEGIDO (Até)
Títulos Públicos Federais/ Carteira Própria	100%
Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa 100% Títulos Públicos Federais (previsto no regulamento do fundo)	100%
Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa (50% de títulos públicos federais)	50%
Fundos de Investimentos Crédito Privado	0%
FIDC	0%
Fundos de Ações	0%
Fundos de Índices - ETF	0%
Fundos Multimercados	0%
Fundos Imobiliários	0%
Fundos de Participação	0%

PERCENTUAL MÍNIMO DE ALOCAÇÃO DA CARTEIRA TOTAL DO RPPS EM PRODUTOS COM CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO: 80% do Patrimônio Líquido do RPPS, apurado concomitantemente na data de fechamento dos dados para envio do DAIR ao Ministério da Previdência Social - MPS.

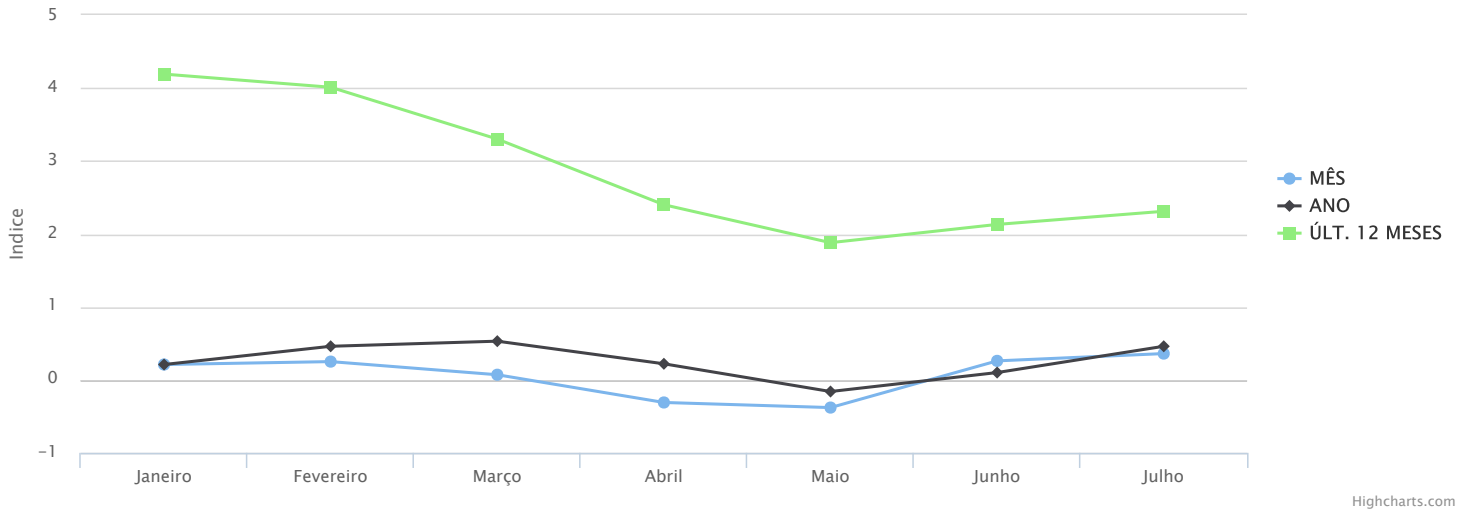
Relatório competência: 01/2020



# ÍNDICES ECONÔMICOS

## IPCA

2020



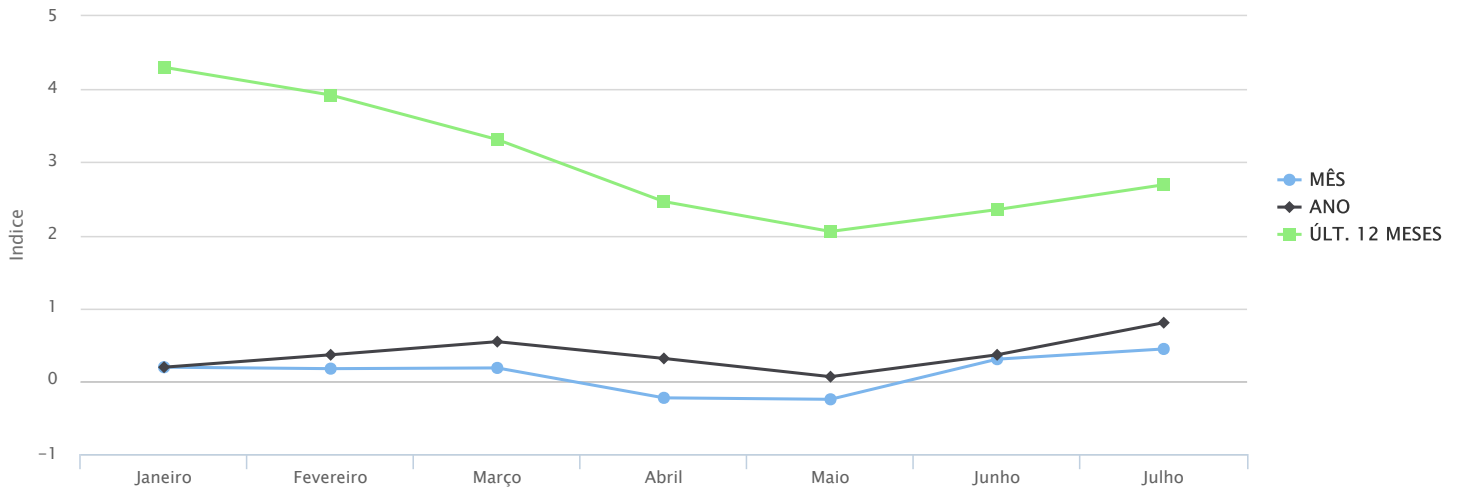
Highcharts.com

2020	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
MÊS	0.2100	0.2500	0.0700	-0.3100	-0.3800	0.2600	0.3600					
ANO	0.2100	0.4600	0.5300	0.2200	-0.1600	0.1000	0.4600					
ULT. 12 M	4.1900	4.0100	3.3000	2.4000	1.8800	2.1300	2.3100					



### INPC

2020

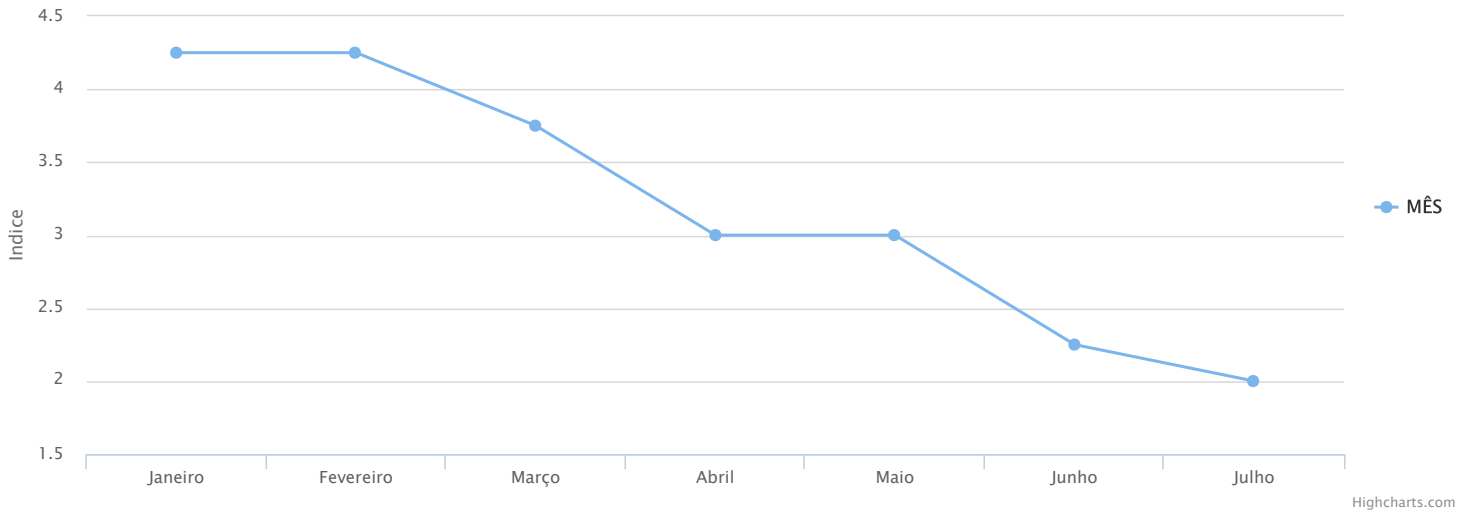


Highcharts.com

2020	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maior	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
MÊS	0.1900	0.1700	0.1800	-0.2300	-0.2500	0.3000	0.4400					
ANO	0.1900	0.3600	0.5400	0.3100	0.0600	0.3600	0.8000					
ULT. 12 M	4.3000	3.9200	3.3100	2.4600	2.0500	2.3500	2.6900					



SELIC  
2020



Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
4.25	4.25	3.75	3.00	3.00	2.25	2.00					





## CADPREV

<b>Renda Fixa</b>	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: CDI
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CNPJ: 13.077.415/0001-05	Saldo em 01/2020: R\$ 475,62
Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CNPJ: 30.822.936/0001-69	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 31/12/2016
Valor da Cota: R\$ 2,086017000	Quantidade de Cotas: 228,0039	PL do Fundo: R\$ 1.500.776.659,75
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 3,09%	Limite do Fundo: 40%

<b>Renda Fixa</b>	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: IRF-M1
Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	CNPJ: 11.328.882/0001-35	Saldo em 01/2020: R\$ 14.898,34
Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	CNPJ: 30.822.936/0001-69	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI 100 TÍTULOS TN Art 7º, I, "b"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 31/05/2017
Valor da Cota: R\$ 2,644833000	Quantidade de Cotas: 5.632,9984	PL do Fundo: R\$ 7.374.284.212,96
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 96,90%	Limite do Fundo: 100%

<b>Renda Fixa</b>	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: CDI
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA	CNPJ: 14.508.643/0001-55	Saldo em 01/2020: R\$ 1,25
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 29/09/2017
Valor da Cota: R\$ 1,852086000	Quantidade de Cotas: 0,6749	PL do Fundo: R\$ 487.819.881,57
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,01%	Limite do Fundo: 40%

<b>Renda Fixa</b>	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: CDI
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CNPJ: 37.372.060/0019-7	Saldo em 01/2020: R\$ 0,00
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 31/12/2016
Valor da Cota: R\$ 3,664761000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 5.345.385.558,02
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 40%

<b>Renda Fixa</b>	Tipo: Fundo de Investimento	Benchmark: CDI
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CNPJ: 37.372.060/0019-7	Saldo em 01/2020: R\$ 0,00
Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL	CNPJ: 00.360.305/0001-04	Performance: 0,00%
Resolução 3.922/2010: FI RENDA FIXA GERAL Art 7º, IV "a"	Disponibilidade: D + 0	Adesão: 31/08/2017
Valor da Cota: R\$ 3,664761000	Quantidade de Cotas: 0,0000	PL do Fundo: R\$ 5.345.385.558,02
% do PL do Fundo: 0,00%	Limite Cumulativo: 0,00%	Limite do Fundo: 40%

**TOTAL: R\$ 15.375,21**

Relatório competência: 01/2020



## CARTEIRA SUGERIDA ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL CONSERVADOR

CARTEIRA ATUAL			MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
ÍNDICE	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CRED PRIVADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
GERAL	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IPCA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IMA-B	0,00	0,00	1.537,52	1.537,52	10,00
IMA-B 5	0,00	0,00	1.537,52	1.537,52	10,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IDKA 2	0,00	0,00	1.537,52	1.537,52	10,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	3.075,04	3.075,04	20,00
IRF-M1	14.898,34	96,90	-12.592,06	2.306,28	15,00
IRF-M1+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
POUPANÇA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SELIC/CDI	476,87	3,10	1.060,65	1.537,52	10,00
ALOCAÇÃO ATIVA	0,00	0,00	3.843,80	3.843,80	25,00
TOTAL:	15.375,21	100,00		15.375,21	100,00

MOVIMENTAÇÕES ACIMA SÃO SUGESTÕES PARA O SEGMENTO DE RENDA FIXA, EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS COMPOSTOS EXCLUSIVAMENTE POR TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS, PARA ALOCAÇÃO EM INSTITUIÇÕES RECONHECIDAMENTE DE PRIMEIRA LINHA, EM PRODUTOS QUE JÁ INTEGRAM A CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS.

Relatório competência: 01/2020



## ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL MODERADO

CARTEIRA ATUAL			MOVIMENTAÇÕES	CARTEIRA SUGERIDA	
ÍNDICE	SALDO ATUAL	% CAPITAL	APLICAR / RESGATAR	SALDO FINAL	% CAPITAL
FIDC	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CRED PRIVADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
MULTIMERCADO	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
GERAL	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IPCA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IMA-B	0,00	0,00	1.537,52	1.537,52	10,00
IMA-B 5	0,00	0,00	1.537,52	1.537,52	10,00
IMA-B 5+	0,00	0,00	1.537,52	1.537,52	10,00
IDKA 2	0,00	0,00	768,76	768,76	5,00
IDKA 20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IRF-M	0,00	0,00	3.075,04	3.075,04	20,00
IRF-M1	14.898,34	96,90	-12.592,06	2.306,28	15,00
IRF-M1+	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
AÇÕES	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
POUPANÇA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SELIC/CDI	476,87	3,10	291,89	768,76	5,00
ALOCÇÃO ATIVA	0,00	0,00	3.843,80	3.843,80	25,00
TOTAL:	15.375,21	100,00		15.375,21	100,00

MOVIMENTAÇÕES ACIMA SÃO SUGESTÕES PARA O SEGMENTO DE RENDA FIXA, EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS COMPOSTOS EXCLUSIVAMENTE POR TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS, PARA ALOCAÇÃO EM INSTITUIÇÕES RECONHECIDAMENTE DE PRIMEIRA LINHA, EM PRODUTOS QUE JÁ INTEGRAM A CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS.

DI BLASI CONSULTORIA FINANCEIRA LTDA  
CNPJ 03.866.812/0001-02  
CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS HABILITADA PELA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS - CVM

Relatório competência: 01/2020