



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

Setembro 2022

## Visão geral da carteira

CNPJ	Nome	P. Resgate	Participação	N. Cotistas	Perc. PL	Legislação	Saldo	Risco	Tipo	Taxa Adm.
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM C	0	20,62%	892	0.12	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 4.133.652,45	B	Fundo de Investimento	1,00%
03.543.447/0001-03	BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO F	1	13,98%	785	0.04	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 2.801.871,49	A	Fundo de Investimento	0,20%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	0	19,16%	1,096	0.06	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 3.840.017,94	B	Fundo de Investimento	0,20%
11.484.558/0001-06	BRADERCO FI RF IRF-M 1 TIT. PUB	0	0,00%	235	0.00	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 0,00	B	Fundo de Investimento	0,20%
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUI	0	15,93%	326	0.41	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R\$ 3.194.106,70	B	Fundo de Investimento	0,80%
14.386.926/0001-71	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULC	0	12,17%	1,012	0.03	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 2.439.614,66	B	Fundo de Investimento	0,20%
10.740.670/0001-06	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	0	14,25%	1,174	0.05	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 2.856.796,25	B	Fundo de Investimento	0,20%
23.215.097/0001-55	FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GEI	0	3,89%	808	0.01	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R\$ 780.811,89	M	Fundo de Investimento	0,20%

Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"

**R\$ 20.046.871,38**

## Retorno do mês

Nome Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI	R\$ 3.495.472,74	R\$ 1.800.000,00	R\$ 1.204.689,43	R\$ 4.133.652,45	R\$ 42.869,14	0,8095%	CDI
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZ	R\$ 2.590.977,89	R\$ 200.000,00	R\$ 0	R\$ 2.801.871,49	R\$ 10.893,60	0,3903%	IMA-B 5
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F	R\$ 3.298.183,79	R\$ 1.000.000,00	R\$ 500.000,00	R\$ 3.840.017,94	R\$ 41.834,15	0,9732%	IRF-M 1
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE	R\$ 3.164.622,53	R\$ 0	R\$ 85,50	R\$ 3.194.106,70	R\$ 29.569,67	0,9343%	CDI
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITI	R\$ 2.427.234,64	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 2.439.614,66	R\$ 12.380,02	0,5100%	IDKA 2
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB	R\$ 2.826.052,97	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 2.856.796,25	R\$ 30.743,28	1,0878%	IRF-M 1
FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL	R\$ 771.236,99	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 780.811,89	R\$ 9.574,90	1,2414%	IMA-GERAL
<b>Total</b>	<b>18,573,781.55</b>	<b>3,000,000.00</b>	<b>1,704,774.93</b>	<b>20,046,871.38</b>	<b>177,864.76</b>	<b>0,8244%</b>	

## Enquadramentos

Res. 4.963/2021 - Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"

% Carteira: : **63,45%**

Saldo do grupo: **R\$ 12.719.112,23**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.801.871,49	121,754.30	0,04476%	6,260,416,458.58	13,98%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,04%	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 3.840.017,94	1,266,641.87	0,06324%	6,071,749,354.31	19,16%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,06%	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LONGO PRAZO	R\$ 2.439.614,66	912,797.94	0,02876%	8,482,726,221.67	12,17%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,03%	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R\$ 2.856.796,25	982,169.24	0,05274%	5,416,816,231.94	14,25%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,05%	Enquadrado
FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	R\$ 780.811,89	476,652.58	0,01335%	5,850,800,339.33	3,89%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,01%	Enquadrado

Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"

% Carteira: : **36,55%**

Saldo do grupo: **R\$ 7.327.759,15**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 4.133.652,45	1,751,837.54	0,11947%	3,459,949,589.95	20,62%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,12%	Desenquadrado - limite c
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$ 3.194.106,70	1,527,269.27	0,41324%	772,946,064.25	15,93%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,41%	Enquadrado

## Enquadramento por Benchmark

### CDI

% Carteira: **36,55%**

Saldo do grupo: **R\$ 7.327.759,15**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$ 3.194.106,70	1,527,269.27	0.41	15.93	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 4.133.652,45	1,751,837.54	0.12	20.62	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Desenquadrado - limite c

### IDKA 2

% Carteira: **12,17%**

Saldo do grupo: **R\$ 2.439.614,66**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LONGO PRAZO	R\$ 2.439.614,66	912,797.94	0.03	12.17	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

### IMA-B 5

% Carteira: **13,98%**

Saldo do grupo: **R\$ 2.801.871,49**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 2.801.871,49	121,754.30	0.04	13.98	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

### IMA-GERAL

% Carteira: **3,89%**

Saldo do grupo: **R\$ 780.811,89**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	R\$ 780.811,89	476,652.58	0.01	3.89	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado



Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE BREVES - IPMB  
CNPJ: 04.316.287/0001-14

IRF-M 1

% Carteira: **33,41%**

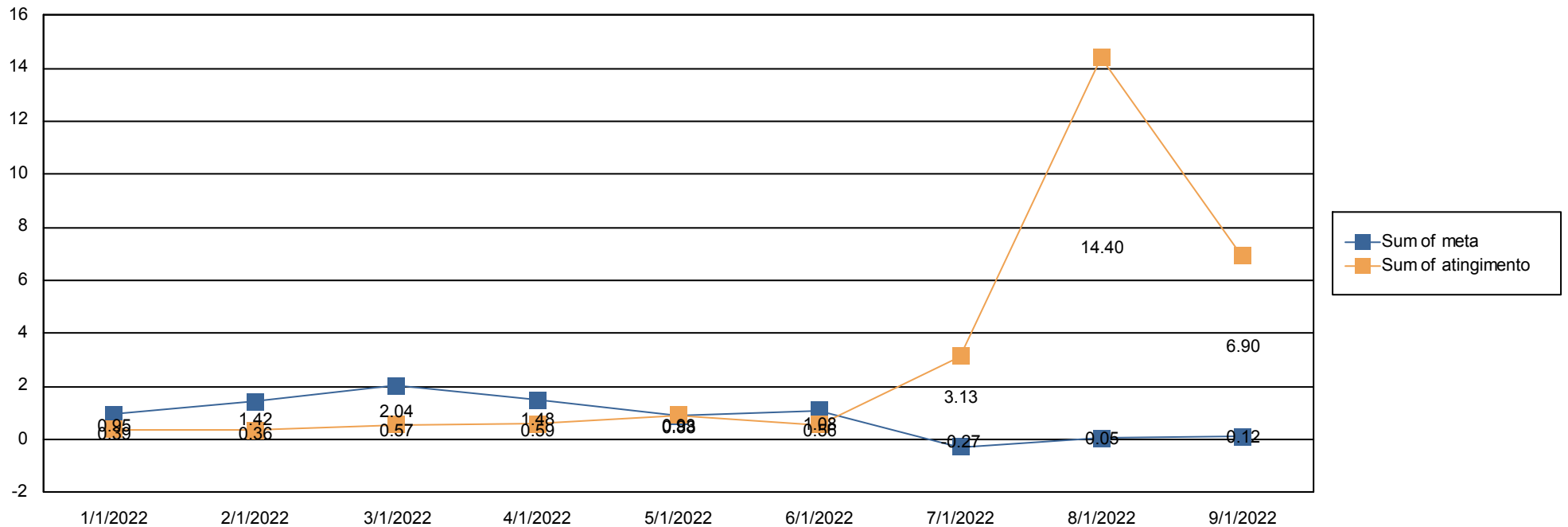
Saldo do grupo: **R\$ 6.696.814,19**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 3.840.017,94	1,266,641.87	0.06	19.16	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R\$ 2.856.796,25	982,169.24	0.05	14.25	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

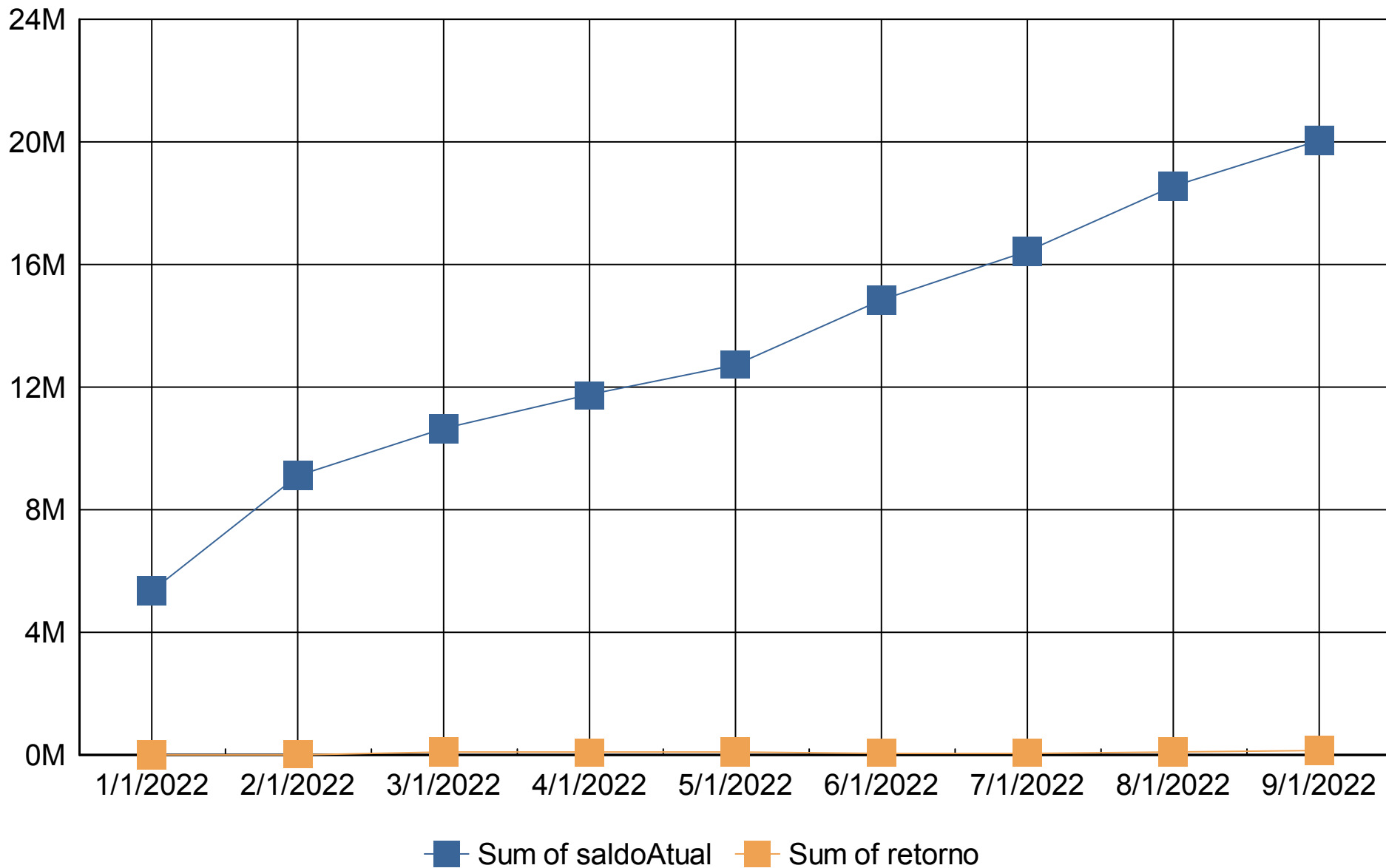
## Retorno acumulado no ano

Período	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Retorno %	Meta	Atingimento
Janeiro	R\$ 4.766.505,56	R\$ 600.000,00	R\$ 49,00	R\$ 5.386.302,75	R\$ 19.846,19	0,3698%	0,9528	38,8136%
Fevereiro	R\$ 5.386.302,75	R\$ 3.700.000,00	R\$ 0,00	R\$ 9.132.394,99	R\$ 46.092,24	0,5073%	1,4247	35,6055%
Março	R\$ 9.132.394,99	R\$ 1.400.000,00	R\$ 98,00	R\$ 10.654.094,38	R\$ 121.797,39	1,1564%	2,0373	56,7618%
Abril	R\$ 10.654.094,38	R\$ 1.000.000,00	R\$ 49,00	R\$ 11.754.972,19	R\$ 100.926,81	0,8660%	1,4750	58,7132%
Mai	R\$ 11.754.972,19	R\$ 900.000,00	R\$ 49,00	R\$ 12.759.173,67	R\$ 104.250,48	0,8238%	0,8825	93,3474%
Junho	R\$ 12.759.173,67	R\$ 2.000.000,00	R\$ 49,00	R\$ 14.848.569,56	R\$ 89.444,89	0,6060%	1,0834	55,9377%
Julho	R\$ 14.848.569,56	R\$ 1.500.000,00	R\$ 49,00	R\$ 16.443.416,90	R\$ 94.896,34	0,5805%	-0,2722	313,2463%
Agosto	R\$ 16.443.416,90	R\$ 2.000.000,00	R\$ 49,00	R\$ 18.573.781,55	R\$ 130.413,65	0,7071%	0,0491	1.440,1250%
Setembro	R\$ 18.573.781,55	R\$ 3.000.000,00	R\$ 1.704.774,93	R\$ 20.046.871,38	R\$ 177.864,76	0,8244%	0,1194	690,4930%
<b>Total</b>		16,100,000.00	1,705,166.93		885,532.75	6,6266%	7,9999%	82,8330%

## Meta x Atingimento

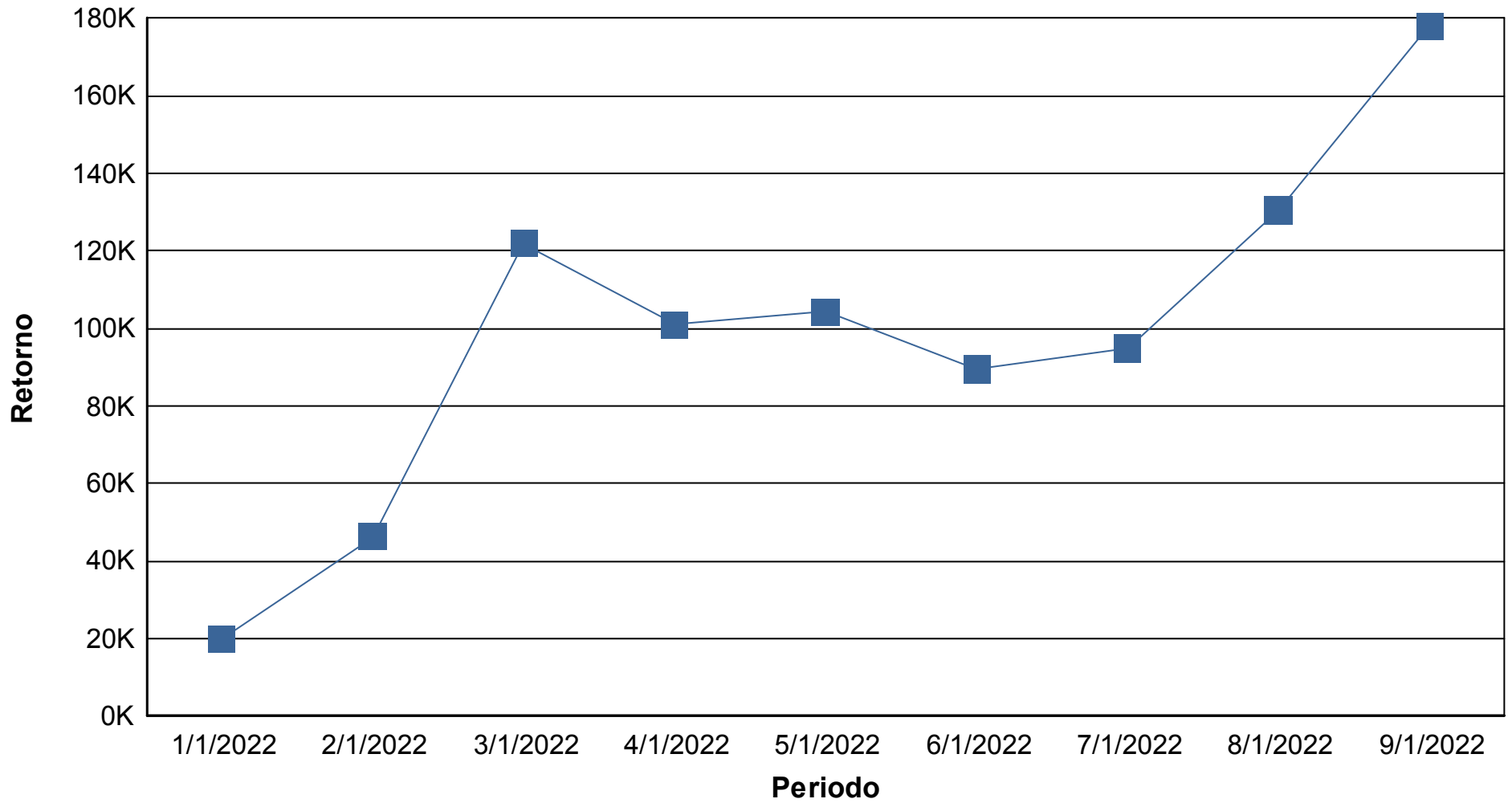


### Evolução do patrimônio

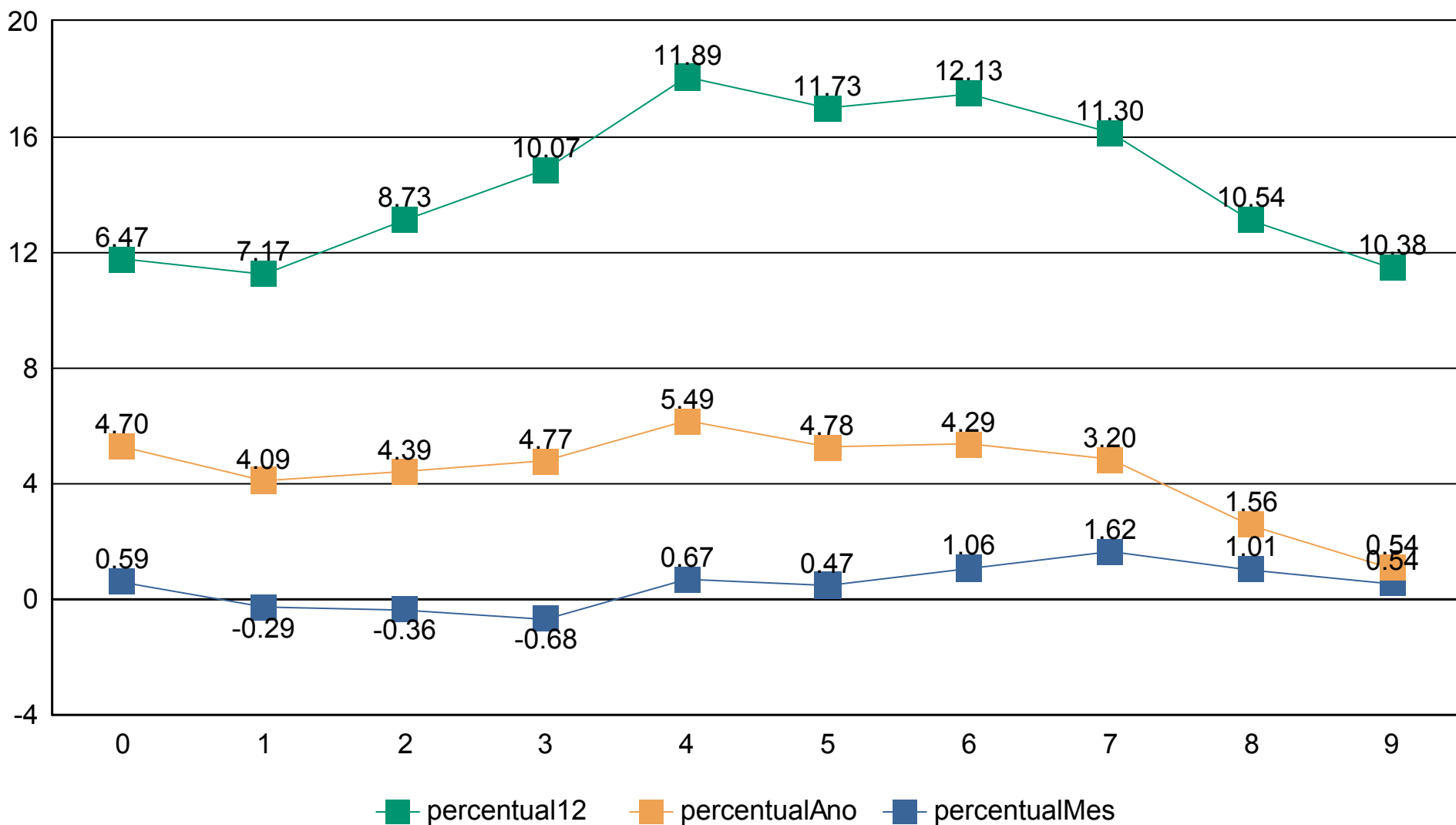




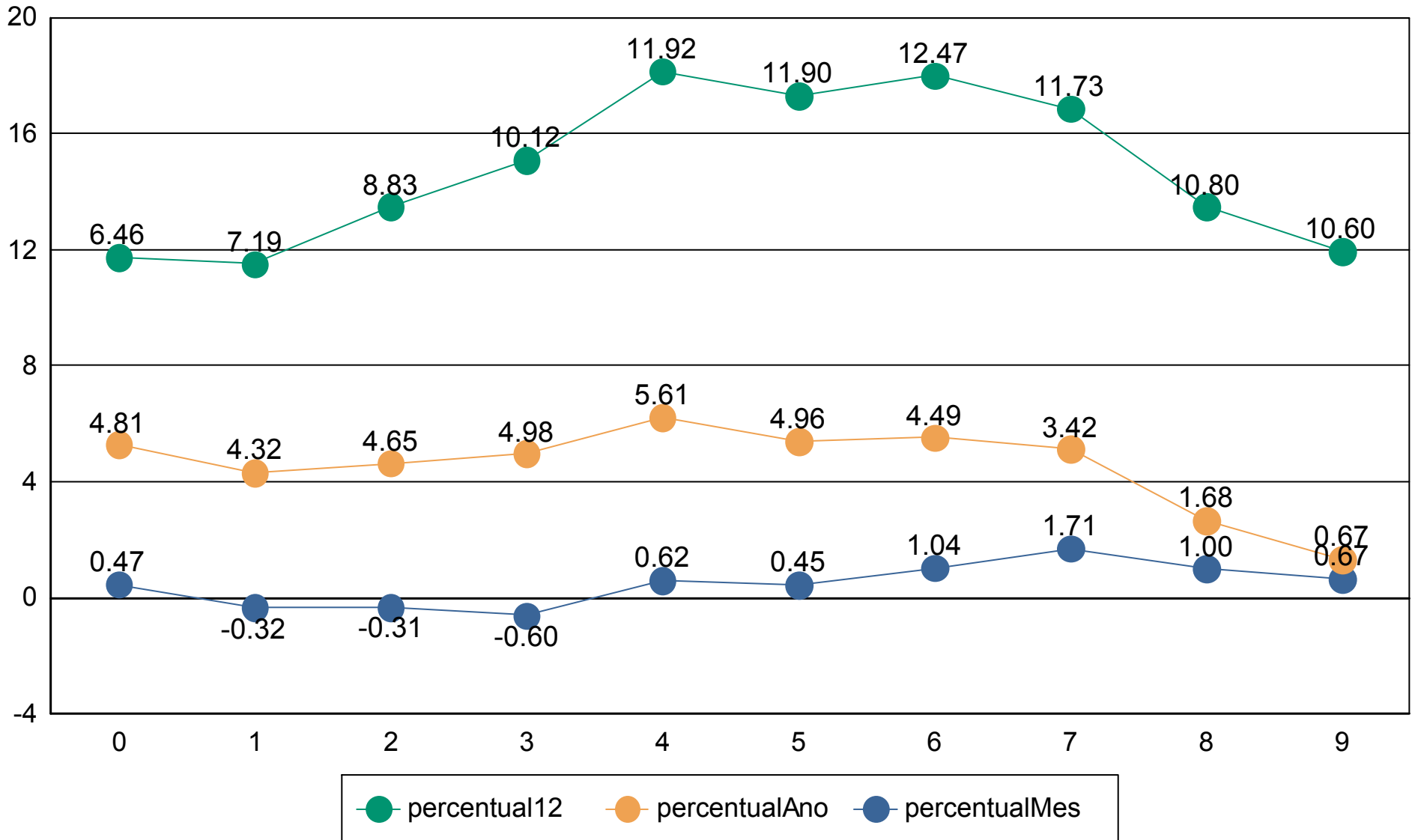
## Retorno Mensal



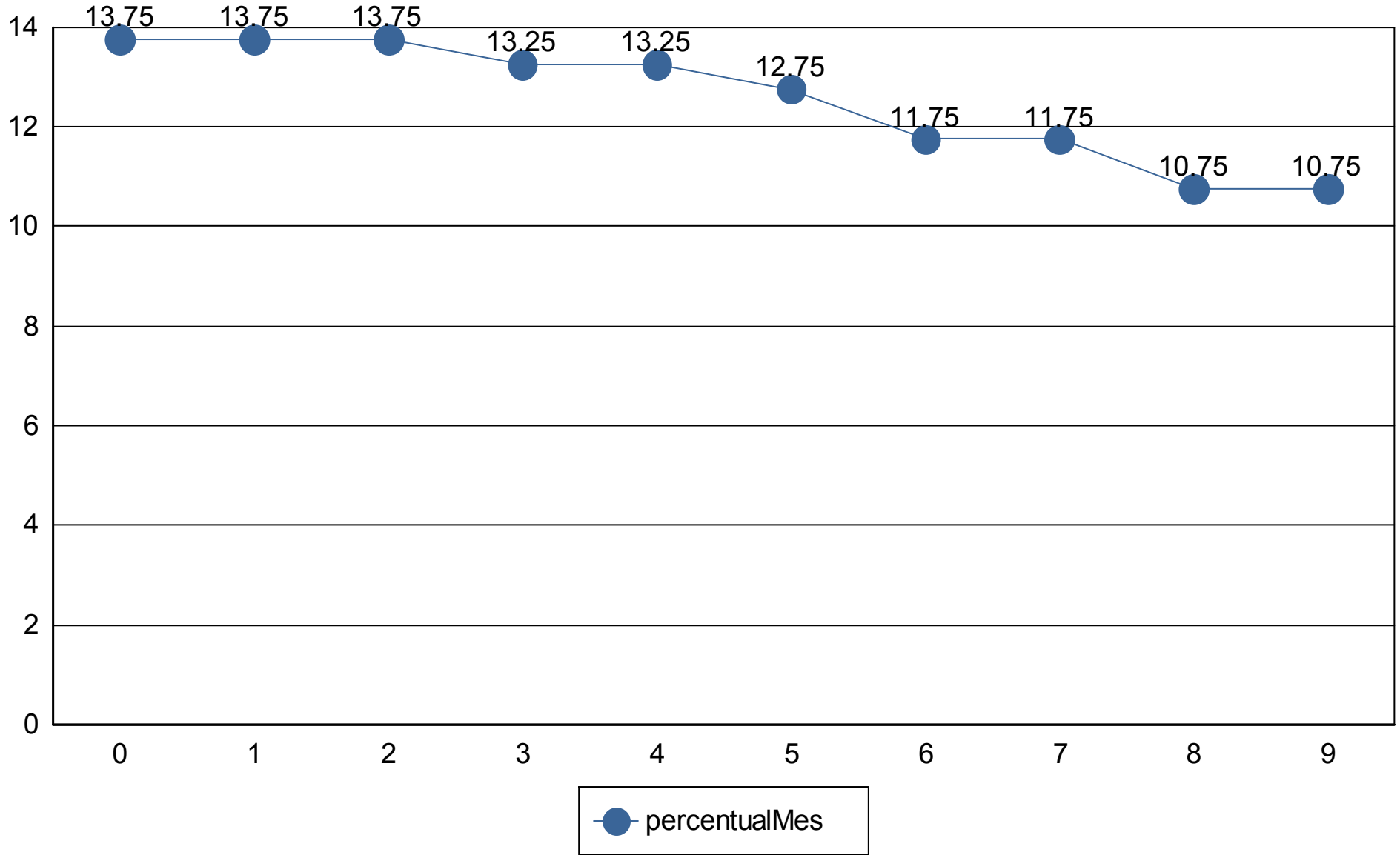
## Índices Econômicos - IPCA



## 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	25,16%	0,00%	8,55%	20,91%	44,62%
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	CDI	25,12%	0,00%	9,11%	22,27%	47,35%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	IRF-M 1	23,55%	0,00%	10,02%	23,51%	49,46%
10.740.670/0001-06	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	IRF-M 1	23,52%	0,00%	10,06%	23,47%	49,51%
14.386.926/0001-71	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LON	IDKA 2	19,41%	0,01%	2,36%	5,11%	53,33%
23.215.097/0001-55	FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	IMA-GERAL	23,87%	0,00%	11,84%	21,27%	48,18%
03.543.447/0001-03	BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	IMA-B 5	19,80%	0,01%	2,06%	6,19%	55,30%
			<b>160,42%</b>	<b>0,03%</b>	<b>53,99%</b>	<b>122,73%</b>	<b>347,75%</b>

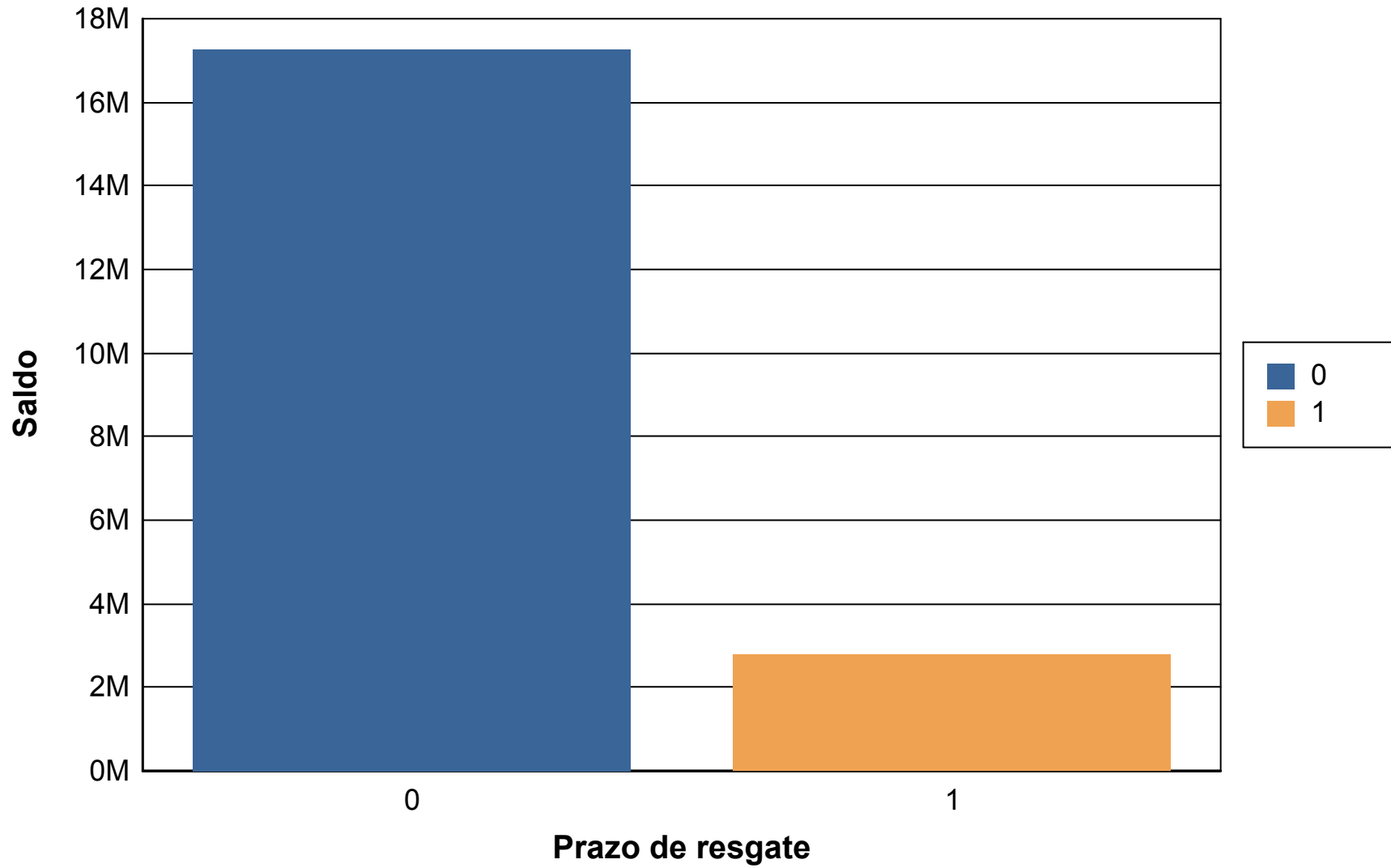
## Provisão de risco - Mercado

CNPJ	Nome do fundo	Benchmark	Saldo	VAR12	VOL12	VAR% BASE 1
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO C	CDI	R\$ 4.133.652,45	0,00%	47,35%	R\$ 16,66
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO	IRF-M 1	R\$ 3.840.017,94	0,00%	49,46%	R\$ 67,63
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA	CDI	R\$ 3.194.106,70	0,00%	44,62%	R\$ 11,41
14.386.926/0001-71	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITUL	IDKA 2	R\$ 2.439.614,66	0,01%	53,33%	R\$ 278,56
10.740.670/0001-06	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS F	IRF-M 1	R\$ 2.856.796,25	0,00%	49,51%	R\$ 51,38
23.215.097/0001-55	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVE	IMA-GERAL	R\$ 780.811,89	0,00%	48,18%	R\$ 20,80

Saldo Total:	<b>R\$ 17.244.999,89</b>
Provisão para perda e Investimentos	<b>R\$ 446,45</b>
% Provisão de perda	0,00%
% Aceitavel perda	2%
Limite de utilização	<b>0,13%</b>

Nome do Fundo	Saldo	% Part.	N. Cotistas	% PL	PL do Fundo	Legislação	Grau risco	Prazo Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE	R\$ 4.133.652,45	20,62%	892	0,12%	R\$ 3.459.949.589,95	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO	R\$ 2.801.871,49	13,98%	785	0,04%	R\$ 6.260.416.458,58	ixa 100% TP/E	Alto	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULC	R\$ 3.840.017,94	19,16%	1,096	0,06%	R\$ 6.071.749.354,31	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FI	R\$ 0,00	0,00%	235	0,00%	R\$ 538.088.084,67	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE IN	R\$ 3.194.106,70	15,93%	326	0,41%	R\$ 772.946.064,25	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IF	R\$ 2.439.614,66	12,17%	1,012	0,03%	R\$ 8.482.726.221,67	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1	R\$ 2.856.796,25	14,25%	1,174	0,05%	R\$ 5.416.816.231,94	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDC	R\$ 780.811,89	3,89%	808	0,01%	R\$ 5.850.800.339,33	ixa 100% TP/E	Médio	D+ 0

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
0	R\$ 17.244.999,89	7	86,02%
1	R\$ 2.801.871,49	1	13,98%



## Risco Crédito

Legislação	Limite	Limite Política	Saldo	% Carteira
Res. 4.963/2021 - Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	100,00%	100,00%	R\$ 12.719.112,23	63,45
Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	60,00%	60,00%	R\$ 7.327.759,15	36,55

	Saldo	% Carteira
100% títulos públicos	0.00	0.00
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	0.00	0.00
100% títulos privados	<b>20,046,871.38</b>	100.00

### Distribuição dos saldos

