INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE BREVES - IPMB

Março 2023

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

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	16,26%	935	0.16	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R$ 6.218.509,73	B	Fundo de Investimento	1,00%
03.543.447/0001-03	BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO F	1	14,68%	766	0.10	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R$ 5.614.332,96	A	Fundo de Investimento	0,20%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	0	14,73%	1,124	0.08	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R$ 5.634.672,08	B	Fundo de Investimento	0,20%
11.484.558/0001-06	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TIT. PUB	0	7,10%	236	0.45	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R$ 2.716.814,41	B	Fundo de Investimento	0,20%
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUI	0	12,32%	333	0.37	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	R$ 4.714.123,47	B	Fundo de Investimento	0,80%
14.386.926/0001-71	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULC	0	14,61%	935	0.08	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R$ 5.586.718,85	B	Fundo de Investimento	0,20%
10.740.670/0001-06	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	0	12,82%	1,184	0.07	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R$ 4.904.354,77	B	Fundo de Investimento	0,20%
23.215.097/0001-55	FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GE	0	7,48%	794	0.06	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	R$ 2.860.528,62	M	Fundo de Investimento	0,20%

R$ 38.250.054,89

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

Retorno do mês

Nome Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI E	R$ 5.149.790,17	R$ 3.500.000,00	R$ 2.500.000,00	R$ 6.218.509,73	R$ 68.719,56	0,7944%	CDI
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZ	R$ 3.521.319,54	R$ 4.000.000,00	R$ 2.000.000,00	R$ 5.614.332,96	R$ 93.013,42	1,2366%	IMA-B 5
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F	R$ 5.567.984,84	R$ 0	R$ 0	R$ 5.634.672,08	R$ 66.687,24	1,1976%	IRF-M 1
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TIT. PUB	R$ 2.684.554,58	R$ 0	R$ 0	R$ 2.716.814,41	R$ 32.259,83	1,2016%	IRF-M 1
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE	R$ 4.667.016,59	R$ 0	R$ 55,00	R$ 4.714.123,47	R$ 47.161,88	1,0105%	CDI
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TIT	R$ 3.540.053,02	R$ 2.000.000,00	R$ 0	R$ 5.586.718,85	R$ 46.665,83	0,8423%	IDKA 2
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB	R$ 4.845.899,05	R$ 0	R$ 0	R$ 4.904.354,77	R$ 58.455,72	1,2062%	IRF-M 1
FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL	R$ 1.640.342,60	R$ 1.200.000,00	R$ 0	R$ 2.860.528,62	R$ 20.186,02	0,7106%	IMA-GERAL
Total	31,616,960.39	10,700,000.00	4,500,055.00	38,250,054.89	433,149.50	1,0236%	

Enquadramentos

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

% Carteira: : **71,42%** Saldo do grupo:**R$ 27.317.421,69**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R$ 5.614.332,96	228,284.13	0,09976%	5,627,693,313.74	14,68%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,10%	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R$ 5.634.672,08	1,746,212.62	0,08341%	6,754,991,755.09	14,73%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,08%	Enquadrado
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TIT. PUB	R$ 2.716.814,41	889,940.81	0,45387%	598,582,459.51	7,10%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,45%	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LONGO PRAZO	R$ 5.586.718,85	1,956,643.08	0,07991%	6,990,840,946.14	14,61%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,08%	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R$ 4.904.354,77	1,582,834.70	0,06827%	7,183,936,024.67	12,82%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,07%	Enquadrado
FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	R$ 2.860.528,62	1,654,485.09	0,05637%	5,074,930,034.52	7,48%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,06%	Enquadrado

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

% Carteira: : **28,58%** Saldo do grupo:**R$ 10.932.633,20**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R$ 6.218.509,73	2,485,590.80	0,16161%	3,847,917,325.94	16,26%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,16%	Enquadrado
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R$ 4.714.123,47	2,134,097.62	0,36709%	1,284,184,437.60	12,32%	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,37%	Enquadrado

Enquadramento por Benchmark

CDI % Carteira: **28,58%** Saldo do grupo: **R$ 10.932.633,20**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R$ 4.714.123,47	2,134,097.62	0.37	12.32	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$ 6.218.509,73	2,485,590.80	0.16	16.26	Lim. Res.: 60,00% Lim. Pol.: 60,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IDKA 2 % Carteira: **14,61%** Saldo do grupo: **R$ 5.586.718,85**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LONGO PRAZO	R$ 5.586.718,85	1,956,643.08	0.08	14.61	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

IMA-B 5 % Carteira: **14,68%** Saldo do grupo: **R$ 5.614.332,96**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R$ 5.614.332,96	228,284.13	0.10	14.68	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

IMA-GERAL % Carteira: **7,48%** Saldo do grupo: **R$ 2.860.528,62**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	R$ 2.860.528,62	1,654,485.09	0.06	7.48	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado

IRF-M 1 % Carteira: **34,66%** Saldo do grupo:**R$ 13.255.841,26**

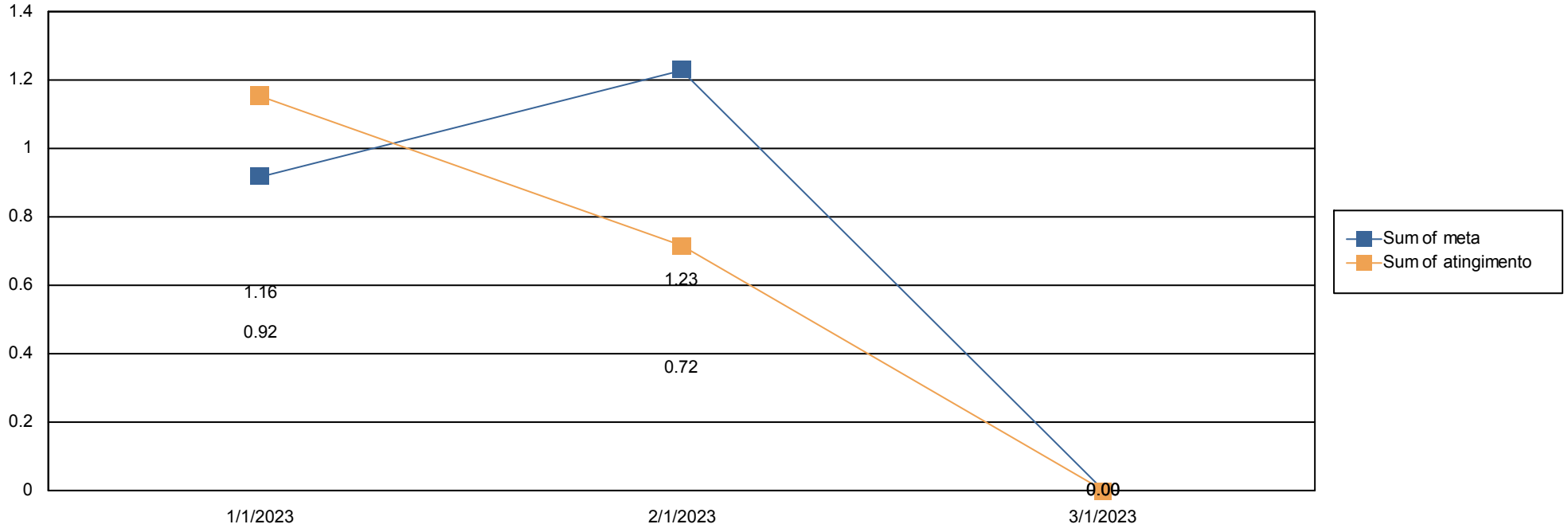
Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R$ 5.634.672,08	1,746,212.62	0.08	14.73	Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R$ 4.904.354,77	1,582,834.70	0.07	12.82	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 100,00%	Enquadrado
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TIT. PUB	R$ 2.716.814,41	889,940.81	0.45	7.10	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

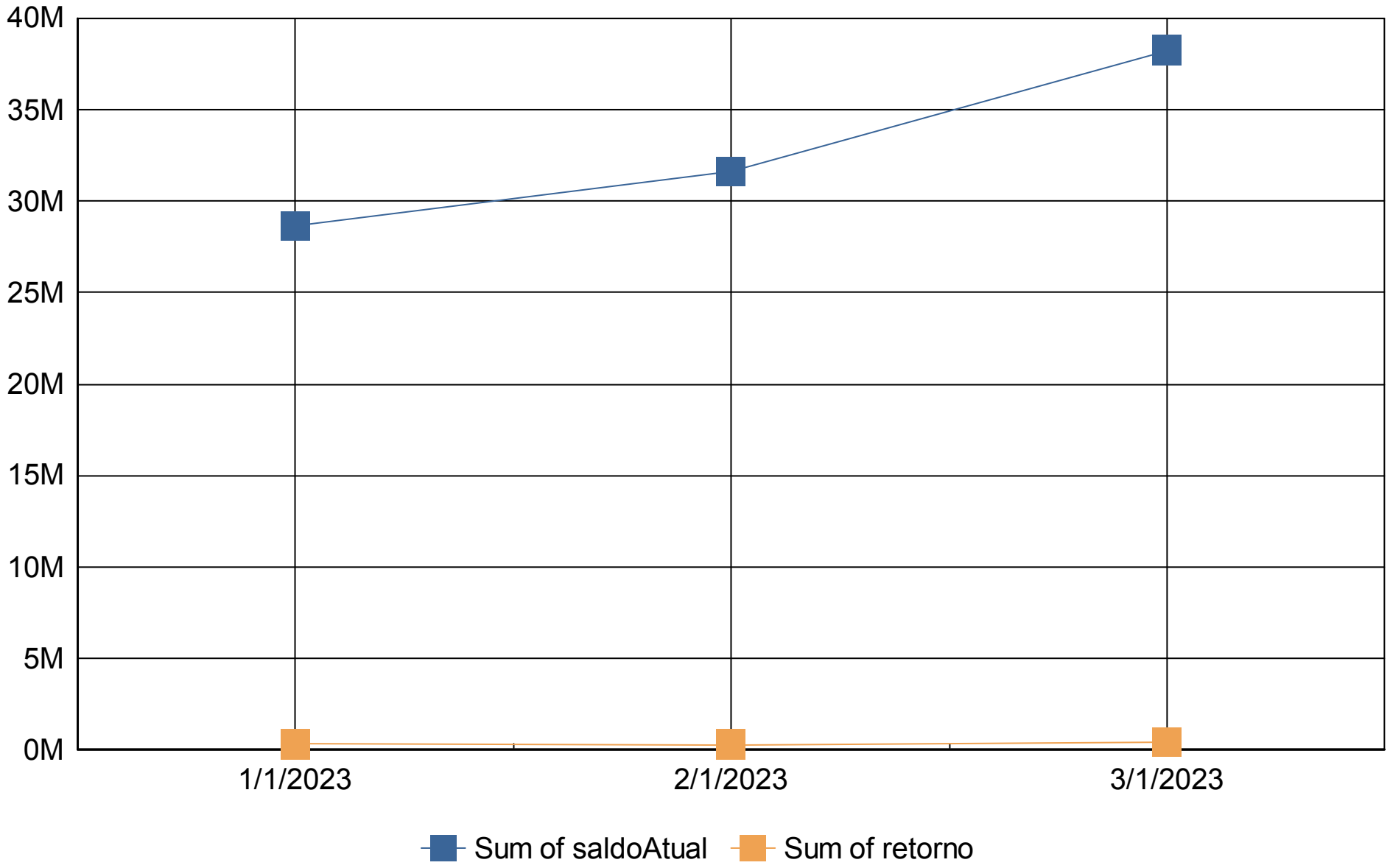
Retorno acumulado no ano

Período	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R$	Retorno %	Meta	Atingimento
Janeiro	R$ 27.809.569,87	R$ 2.500.000,00	R$ 2.000.055,00	R$ 28.631.712,07	R$ 322.197,20	1,0630%	0,9196	115,5961%
Fevereiro	R$ 28.631.712,07	R$ 6.570.052,18	R$ 3.895.081,09	R$ 31.616.960,39	R$ 310.277,23	0,8814%	1,2308	71,6140%
Março	R$ 31.616.960,39	R$ 10.700.000,00	R$ 4.500.055,00	R$ 38.250.054,89	R$ 433.149,50	1,0236%	0,0000	0,0000%
Total		19,770,052.18	10,395,191.09		1,065,623.93	2,9974%	2,1617%	138,6582%

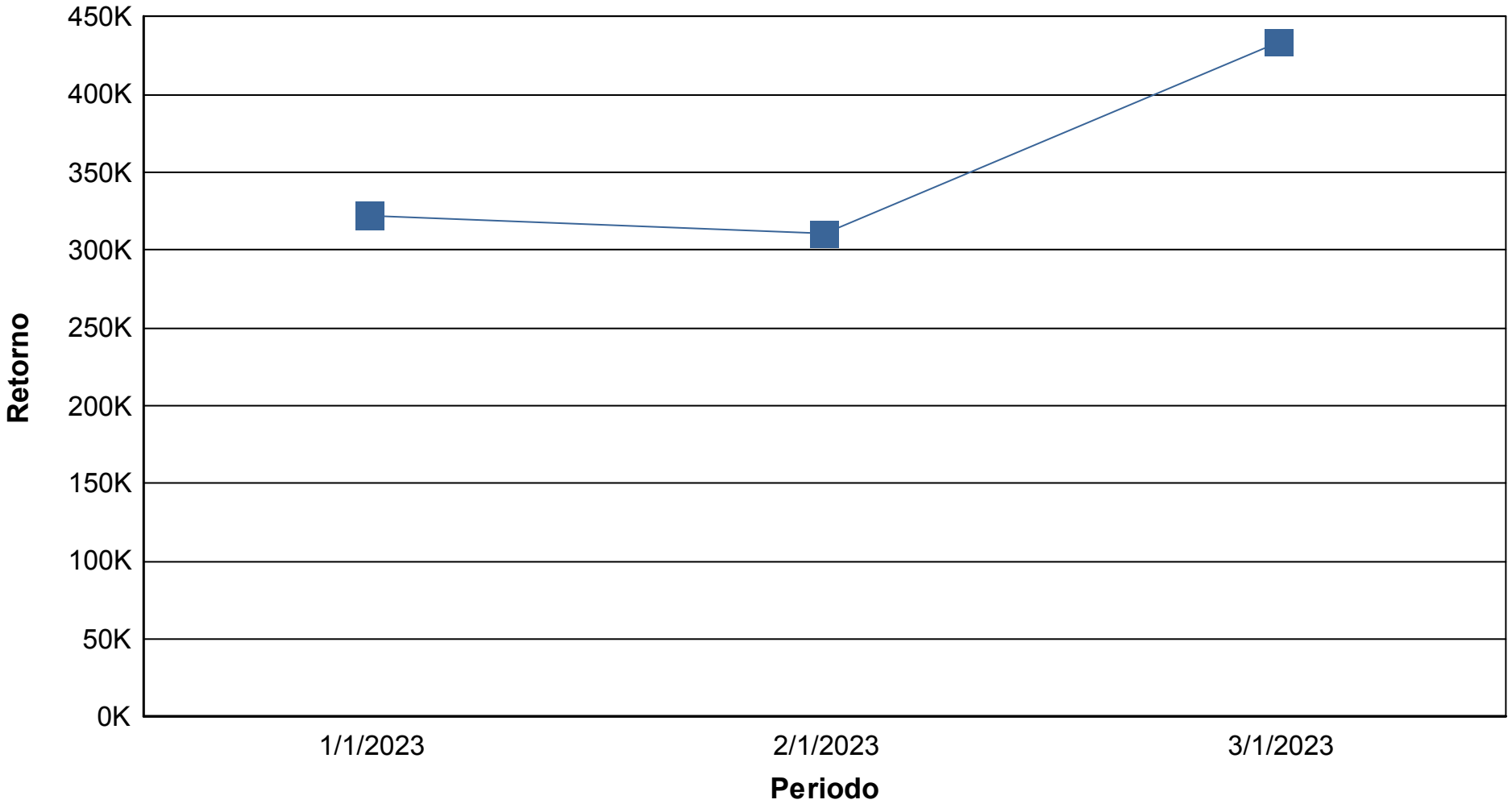
Meta x Atingimento



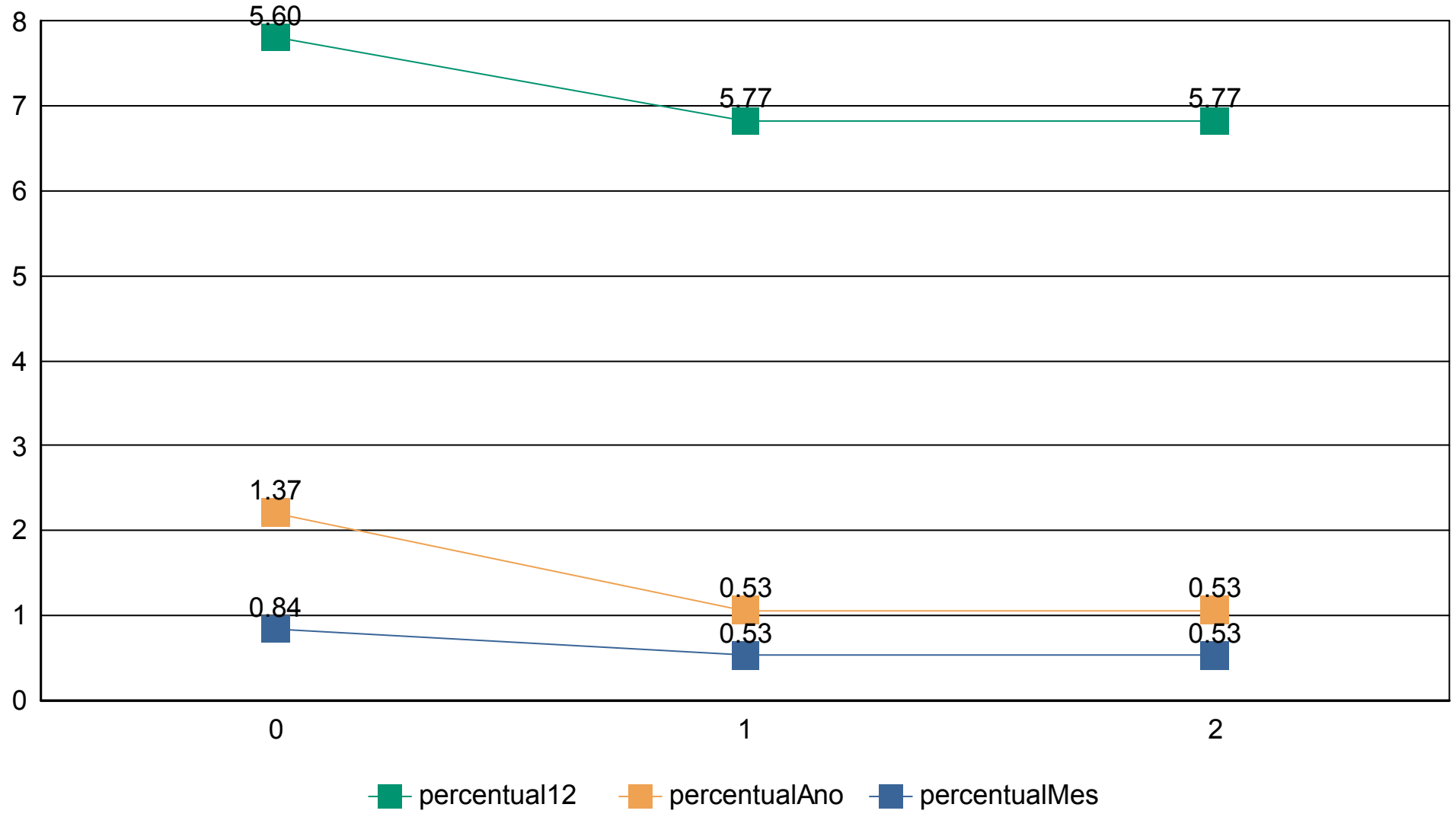
Evolução do patrimônio



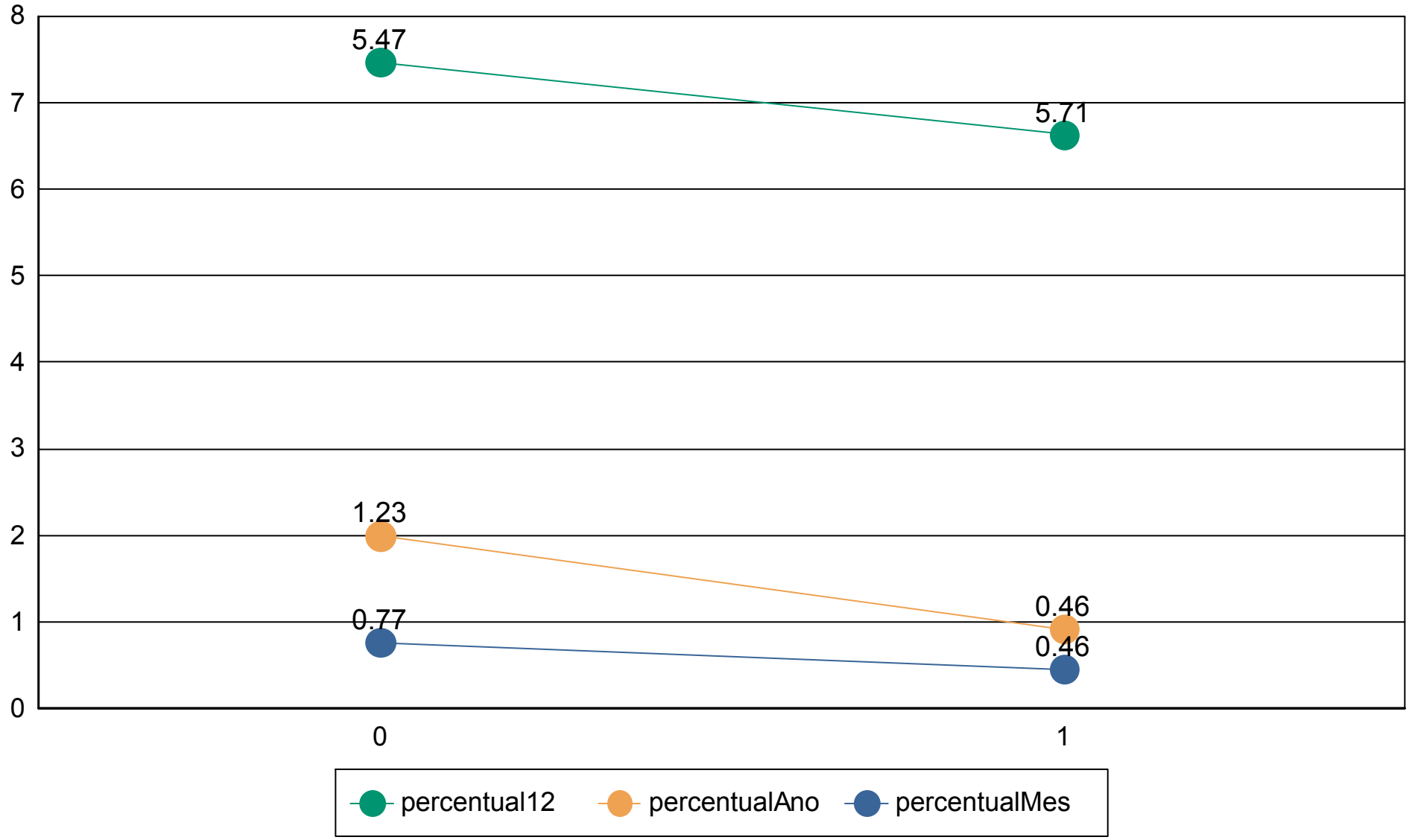
Retorno Mensal



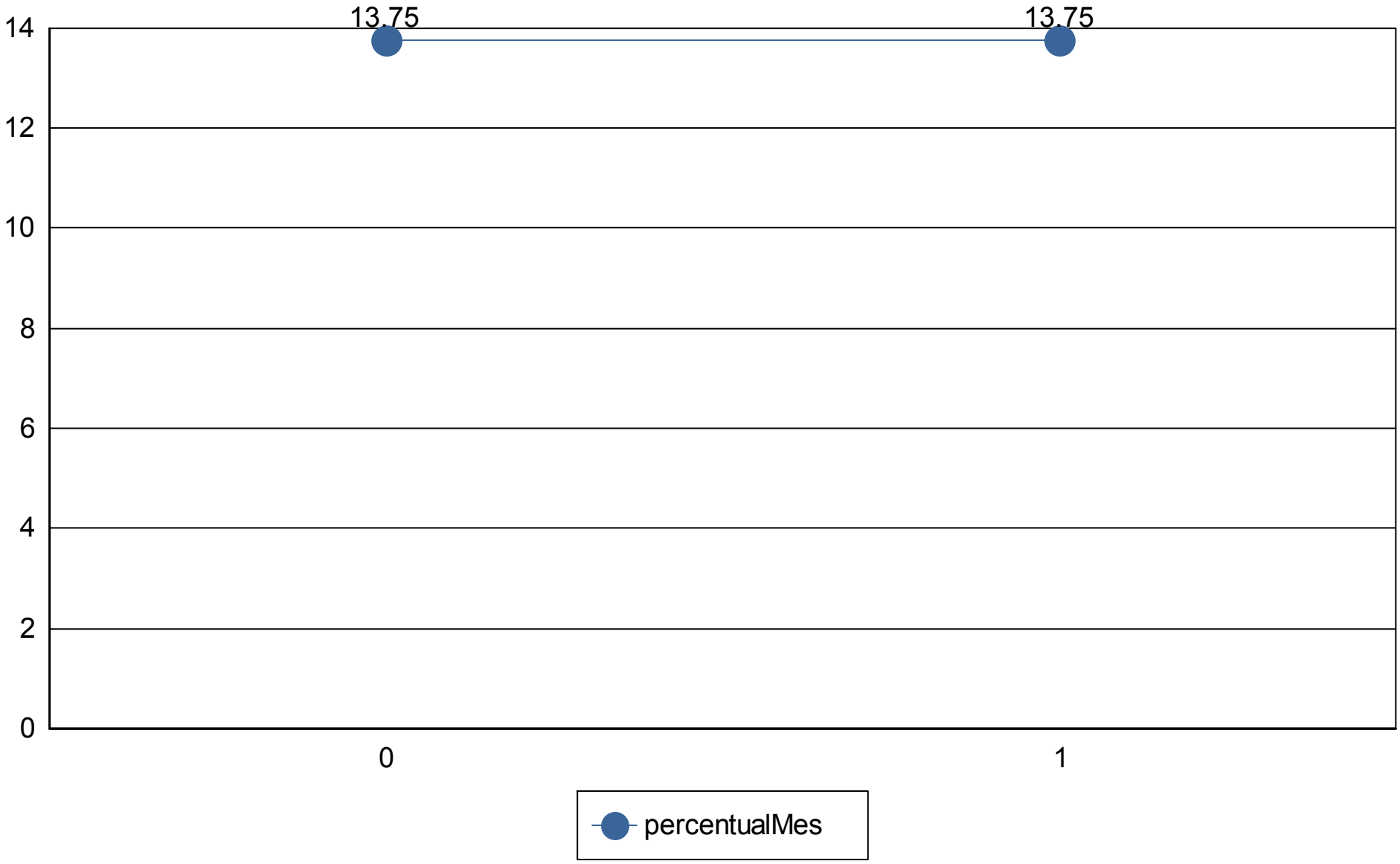
Índices Econômicos - IPCA



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 emitentes de valores mobiliários (ações, debêntures, notas promissórias, entre outros).
Indice Sharpe: O índice de Sharpe é uma medida que permite a classicação 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	25,76%	0,00%	7,87%	20,74%	53,13%
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	CDI	25,61%	0,00%	8,48%	22,33%	56,83%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	IRF-M 1	25,35%	0,00%	9,53%	24,10%	60,53%
10.740.670/0001-06	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	IRF-M 1	25,38%	0,00%	9,60%	24,56%	60,99%
14.386.926/0001-71	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LON	IDKA 2	29,14%	0,01%	12,34%	25,26%	39,96%
23.215.097/0001-55	FI EM COTAS DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	IMA-GERAL	26,31%	0,00%	9,52%	21,41%	53,43%
03.543.447/0001-03	BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	IMA-B 5	29,66%	0,00%	12,35%	24,21%	41,28%
11.484.558/0001-06	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TIT. PUB	IRF-M 1	25,30%	0,00%	9,59%	24,33%	60,98%
			212,51%	**0,01%**	**79,29%**	**186,94%**	**427,14%**

Provisão de risco - Mercado

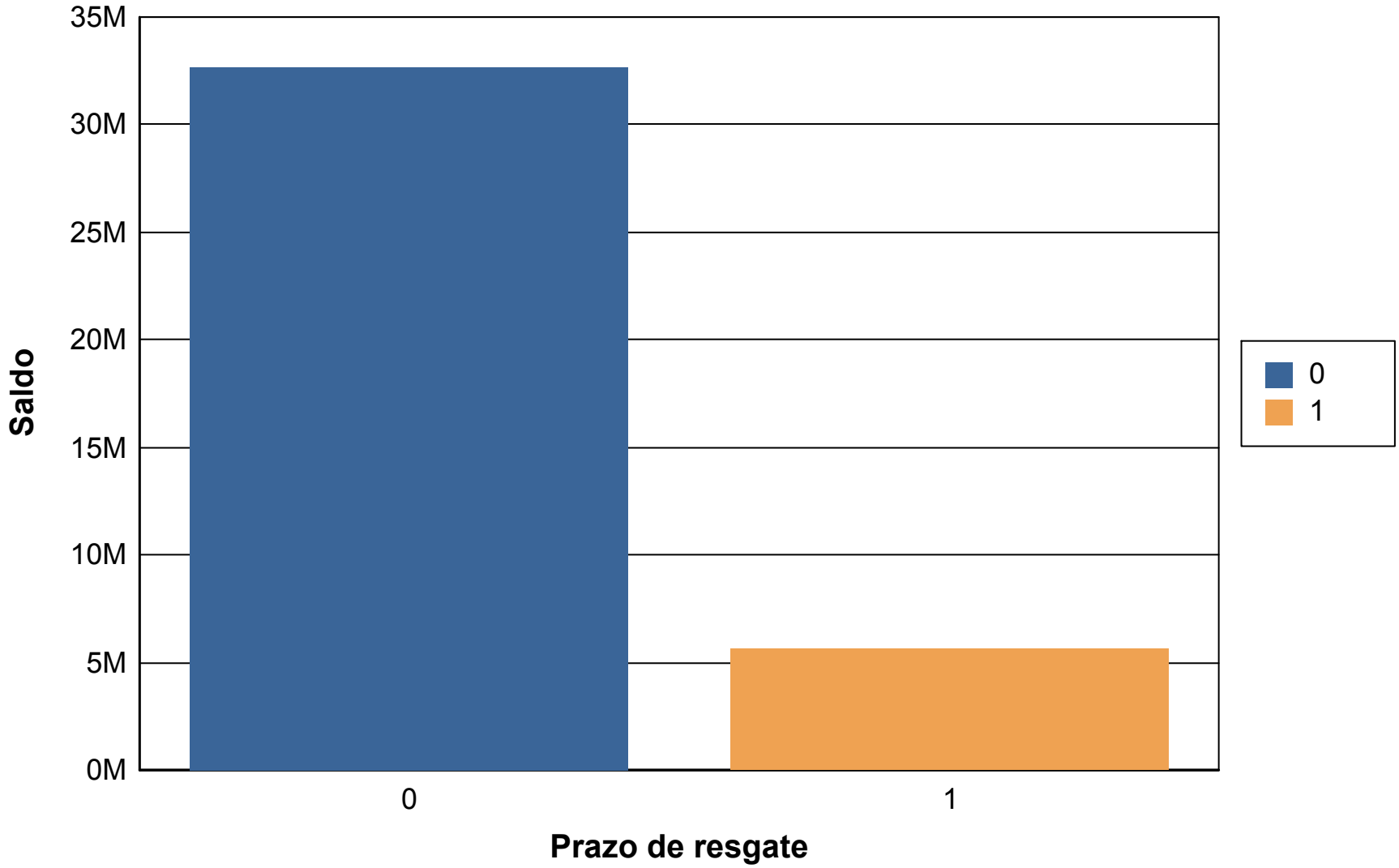
CNPJ	Nome do fundo	Benchmark	Saldo	VAR12	VOL12	VAR% BASE 1
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO D	CDI	R$ 6.218.509,73	0,00%	56,83%	R$ 5,60
03.543.447/0001-03	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FU	IMA-B 5	R$ 5.614.332,96	0,00%	41,28%	R$ 277,09
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO	IRF-M 1	R$ 5.634.672,08	0,00%	60,53%	R$ 10,72
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA	CDI	R$ 4.714.123,47	0,00%	53,13%	R$ 3,27
14.386.926/0001-71	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITU	IDKA 2	R$ 5.586.718,85	0,01%	39,96%	R$ 350,20
10.740.670/0001-06	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS F	IRF-M 1	R$ 4.904.354,77	0,00%	60,99%	R$ 9,25
23.215.097/0001-55	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVES	IMA-GERAL	R$ 2.860.528,62	0,00%	53,43%	R$ 42,18

Saldo Total:	**R$ 35.533.240,48**
Provisão para perda e Investimentos	**R$ 698,32**
% Provisão de perda	0,00%
% Aceitavel perda	2%
Limite de utilização	0,10%

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

Nome do Fundo	Saldo	% Part.	N. Cotistas	% PL	PL do Fundo	Legislação	Grau risco	Prazo Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE	R$ 6.218.509,73	16,26%	935	0,16%	R$ 3.847.917.325,94	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONG(	R$ 5.614.332,96	14,68%	766	0,10%	R$ 5.627.693.313,74	ixa 100% TP/E	Alto	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULC	R$ 5.634.672,08	14,73%	1,124	0,08%	R$ 6.754.991.755,09	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FI	R$ 2.716.814,41	7,10%	236	0,45%	R$ 598.582.459,51	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE IN	R$ 4.714.123,47	12,32%	333	0,37%	R$ 1.284.184.437,60	da Fixa (CVM)	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IF	R$ 5.586.718,85	14,61%	935	0,08%	R$ 6.990.840.946,14	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1	R$ 4.904.354,77	12,82%	1,184	0,07%	R$ 7.183.936.024,67	ixa 100% TP/E	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDC	R$ 2.860.528,62	7,48%	794	0,06%	R$ 5.074.930.034,52	ixa 100% TP/E	Médio	D+ 0

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
0	**R$ 32.635.721,93**	**7**	**85,32%**
1	**R$ 5.614.332,96**	**1**	**14,68%**


35M
30M
25M
20M
15M
10M
5M
0M
Saldo
0
1
Prazo de resgate
0
1

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$ 27.317.421,69	71,42
Res. 4.963/2021 - Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	60,00%	60,00%	R$ 10.932.633,20	28,58

	Saldo	% Carteira
100% titulos públicos	0.00	0.00
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	0.00	0.00
100% titulos privados	**38,250,054.89**	100.00