



DI BLASI
Consultoria Financeira

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE BARRETOS

January 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	2,99%	770	0,04%	Art 7º , IV "a"	R\$ 1.022.662,62	B	Fundo de Investim	0,20%
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	1	12,29%	935	0,05%	Art 7º, I, "b"	R\$ 4.200.665,82	M	Fundo de Investim	0,20%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	0	0,13%	1,210	0,00%	Art 7º, I, "b"	R\$ 45.128,27	B	Fundo de Investim	0,20%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONC	0	0,21%	571	0,00%	Art 7º , IV "a"	R\$ 72.005,87	B	Fundo de Investim	0,20%
15.486.093/0001-83	BB PREV RF TIT. PUB IPCA FI		14,85%	51	1,45%	Art 7º, I, "b"	R\$ 5.075.753,41	M	Fundo de Investim	0,15%
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUI	0	0,15%	300	0,00%	Art 7º , IV "a"	R\$ 50.330,07	B	Fundo de Investim	0,80%
10.740.670/0001-06	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	0	0,05%	1,342	0,00%	Art 7º, I, "b"	R\$ 15.399,80	B	Fundo de Investim	0,20%
03.737.206/0001-97	FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO	0	0,03%	631	0,00%	Art 7º , IV "a"	R\$ 11.703,56	B	Fundo de Investim	0,20%
11.902.276/0001-81	FI RECUPERAÇÃO BRASIL RF LONGO	730	0,81%	19	0,35%	Art 7º , IV "a"	R\$ 278.289,11	A	Fundo de Investim	1,25%
12.440.789/0001-80	LEMÉ MULTISSETORIAL IPCA - FI EM DI	1260	1,56%	71	0,73%	Art 7º , VII	R\$ 532.290,37	A	Fundo de Investim	1,50%
66.998.014/0001-54	NTN-B20450515	0	27,15%	1	98,44%	Art 7º, I, "a"	R\$ 9.282.321,49	A	Fundo de Investim	0,20%
22.375.276/0001-97	NTN-C 20310101	0	39,78%	1	104,18%	Art 7º, I, "a"	R\$ 13.599.765,29	A	Fundo de Investim	0,20%

R\$ 34.186.315,68

Retorno do mês

Nome Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS DE FI	R\$ 817.155,02	R\$ 230.070,44	R\$ 25.211,46	R\$ 1.022.662,62	R\$ 648,62	0,0794%	CDI
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 4.537.719,86	R\$ 425.821,19	R\$ 769.140,45	R\$ 4.200.665,82	R\$ 6.265,22	0,1381%	IDKA 2
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 45.114,10			R\$ 45.128,27	R\$ 14,17	0,0314%	IRF-M 1
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PR.	R\$ 130.865,54		R\$ 59.033,32	R\$ 72.005,87	R\$ 173,65	0,1327%	CDI
BB PREV RF TIT. PUB IPCA FI	R\$ 5.074.501,21			R\$ 5.075.753,41	R\$ 1.252,20	0,0247%	IPCA
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS I	R\$ 61.568,84	R\$ 567.229,55	R\$ 578.740,13	R\$ 50.330,07	R\$ 271,81	0,4415%	CDI
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R\$ 15.395,91			R\$ 15.399,80	R\$ 3,89	0,0253%	IRF-M 1
FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LON	R\$ 11.684,67			R\$ 11.703,56	R\$ 18,89	0,1617%	CDI
FI RECUPERAÇÃO BRASIL RF LONGO PRAZ	R\$ 279.287,80			R\$ 278.289,11	R\$ -998,69	-0,3576%	IMA-B
LEME MULTISETORIAL IPCA - FI EM DIREITC	R\$ 532.125,14			R\$ 532.290,37	R\$ 165,23	0,0311%	FIDC
NTN-B20450515	R\$ 9.429.268,86			R\$ 9.282.321,49	R\$ -146.947,37	-1,5584%	NTN-B
NTN-C 20310101	R\$ 13.054.380,75			R\$ 13.599.765,29	R\$ 545.384,54	4,1778%	NTN-C
Total	33,989,067.70	1,223,121.18	1,432,125.36	34,186,315.68	406,252.16	1,260%	

Enquadramentos

FI 100% títulos TN – 7º, I, b

 % Carteira: : **27,31%**

 Saldo do grupo: **R\$ 9.336.947,30**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq	% Carteira	Limites	Situação
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R\$ 15.399,80	5,892.01	0,00%	435,150,283.00	0,05%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado
BB PREV RF TIT. PUB IPCA FI	R\$ 5.075.753,41	2,052,272.52	1,44%	351,583,780.87	14,85%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 1,44%	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 45.128,27	16,554.86	0,00%	572,331,669.58	0,13%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 4.200.665,82	1,450,306.92	0,05%	200,599,633.08	12,29%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,05%	Enquadrado

FI em Direitos Creditórios – Cota Sênior – 7º, VII, a

 % Carteira: : **1,56%**

 Saldo do grupo: **R\$ 532.290,37**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq	% Carteira	Limites	Situação
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FI EM DIREITOS CREDITARIOS	R\$ 532.290,37	1,429,198.91	0,73%	72,706,030.51	1,56%	Lim. Res.: 5,00% Lim. Pol.: 5,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,73%	Enquadrado

FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a

 % Carteira: : **4,20%**

 Saldo do grupo: **R\$ 1.434.991,23**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq	% Carteira	Limites	Situação
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$ 50.330,07	26,726.54	0,01%	608,020,020.83	0,15%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,01%	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 11.703,56	3,124.73	0,00%	006,506,249.23	0,03%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado
BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.022.662,62	483,321.86	0,04%	320,539,431.87	2,99%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,04%	Enquadrado



FI RECUPERAÇÃO BRASIL RF LONGO PRAZO	R\$ 278.289,11	530,372.51	0,40%	69,517,296.53	0,81%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,40%	Enquadrado
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 72.005,87	31,231.30	0,00%	962,335,860.83	0,21%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado

Títulos Públicos de emissão do TN (Selic) 7º, I, a

% Carteira: :

66,93%

Saldo do grupo: **R\$ 22.882.086,78**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq	% Carteira	Limites	Situação
NTN-B20450515	R\$ 9.282.321,49	2,040.00	149,13%	0.00	27,15%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 0,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 928.232.149	Desenquadrado - particip
NTN-C 20310101	R\$ 13.599.765,29	1,491.00	528,98%	0.00	39,78%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 0,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 1.359.976.5	Desenquadrado - particip

Enquadramento por Benchmark

CDI

 % Carteira: **3,38%**

 Saldo do grupo: **R\$ 1.156.702,12**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$ 50.330,07	26,726.54	0.01	0.15	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 11.703,56	3,124.73	0.00	0.03	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\$ 1.022.662,62	483,321.86	0.04	2.99	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 72.005,87	31,231.30	0.00	0.21	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

FIDC

 % Carteira: **1,56%**

 Saldo do grupo: **R\$ 532.290,37**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FI EM DIREITOS CREDITORIOS	R\$ 532.290,37	1,429,198.91	0.73	1.56	Lim. Res.: 5,00% Lim. Pol.: 5,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 5,00%	Enquadrado

IDKA 2

 % Carteira: **12,29%**

 Saldo do grupo: **R\$ 4.200.665,82**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 4.200.665,82	1,450,306.92	0.05	12.29	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IMA-B

 % Carteira: **0,81%**

 Saldo do grupo: **R\$ 278.289,11**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FI RECUPERAÇÃO BRASIL RF LONGO PRAZO	R\$ 278.289,11	530,372.51	0.40	0.81	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IPCA

 % Carteira: **14,85%**

 Saldo do grupo: **R\$ 5.075.753,41**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF TIT. PUB IPCA FI	R\$ 5.075.753,41	2,052,272.52	1.44	14.85	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IRF-M 1

 % Carteira: **0,18%**

 Saldo do grupo: **R\$ 60.528,07**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R\$ 15.399,80	5,892.01	0.00	0.05	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\$ 45.128,27	16,554.86	0.00	0.13	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

NTN-B

 % Carteira: **27,15%**

 Saldo do grupo: **R\$ 9.282.321,49**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
NTN-B20450515	R\$ 9.282.321,49	2,040.00	232,149.13	27.15	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Desenquadrado - partici

NTN-C

 % Carteira: **39,78%**

 Saldo do grupo: **R\$ 13.599.765,29**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
------------	-------	-------------	-----	------------	---------	----------

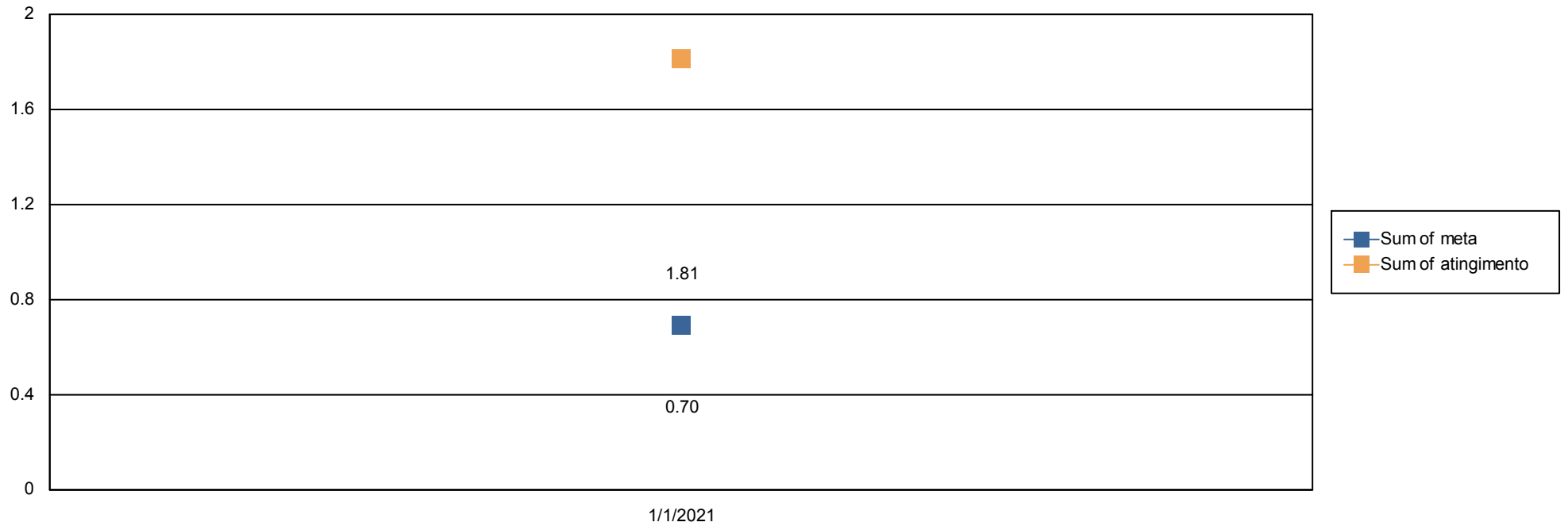


NTN-C 20310101	R\$ 13.599.765,29	1,491.00	,976,528.98	39.78	Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Desenquadrado - particij
----------------	-------------------	----------	-------------	-------	--	--------------------------

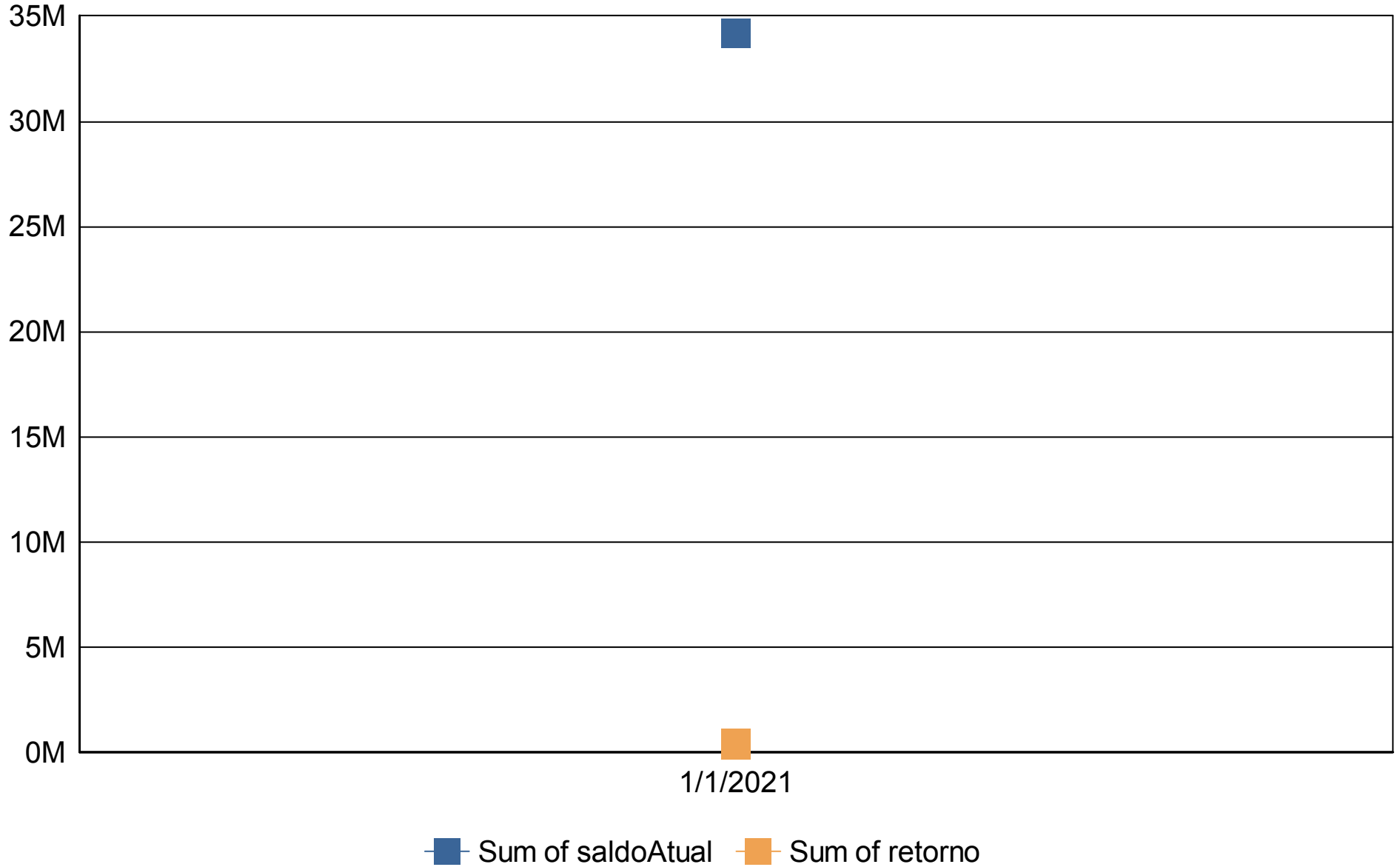
Retorno acumulado no ano

Período	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Retorno %	Meta	Atingimento
January	R\$ 33.989.067,70	R\$ 1.223.121,18	R\$ 1.432.125,36	R\$ 34.186.315,68	R\$ 406.252,16	1,2604%	0,6959%	181,1251%

Meta x Atingimento

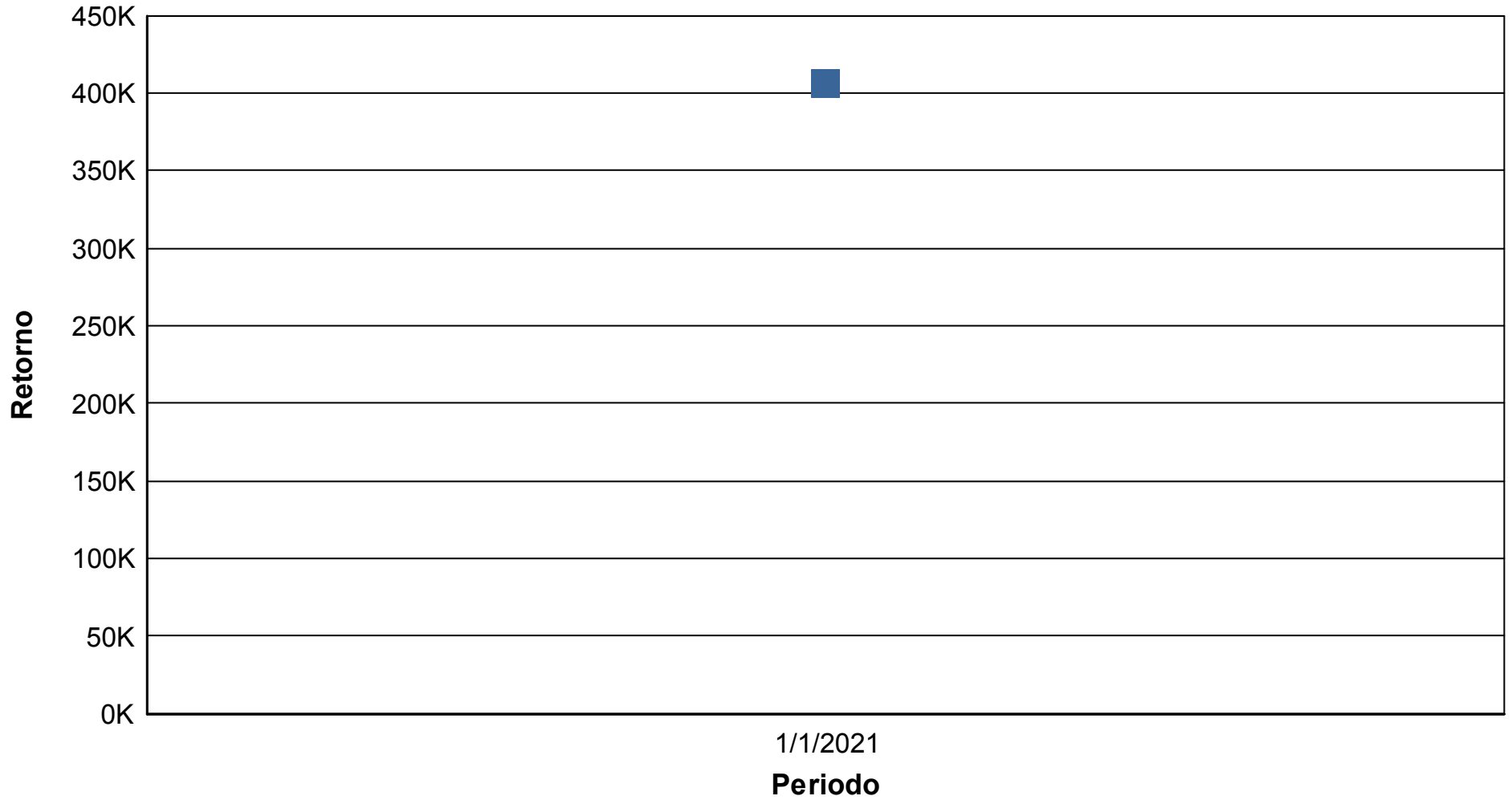


Evolução do patrimônio

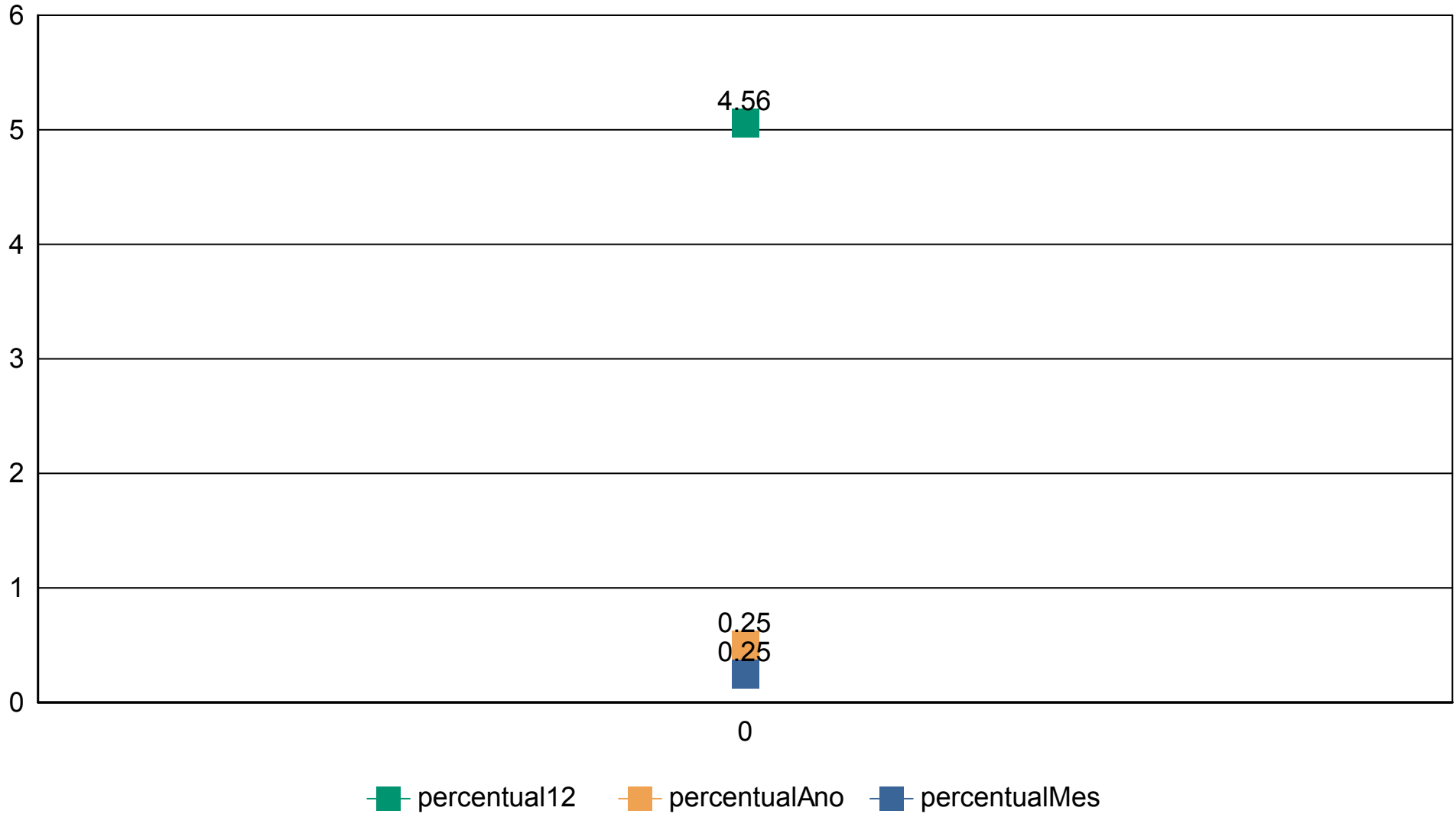




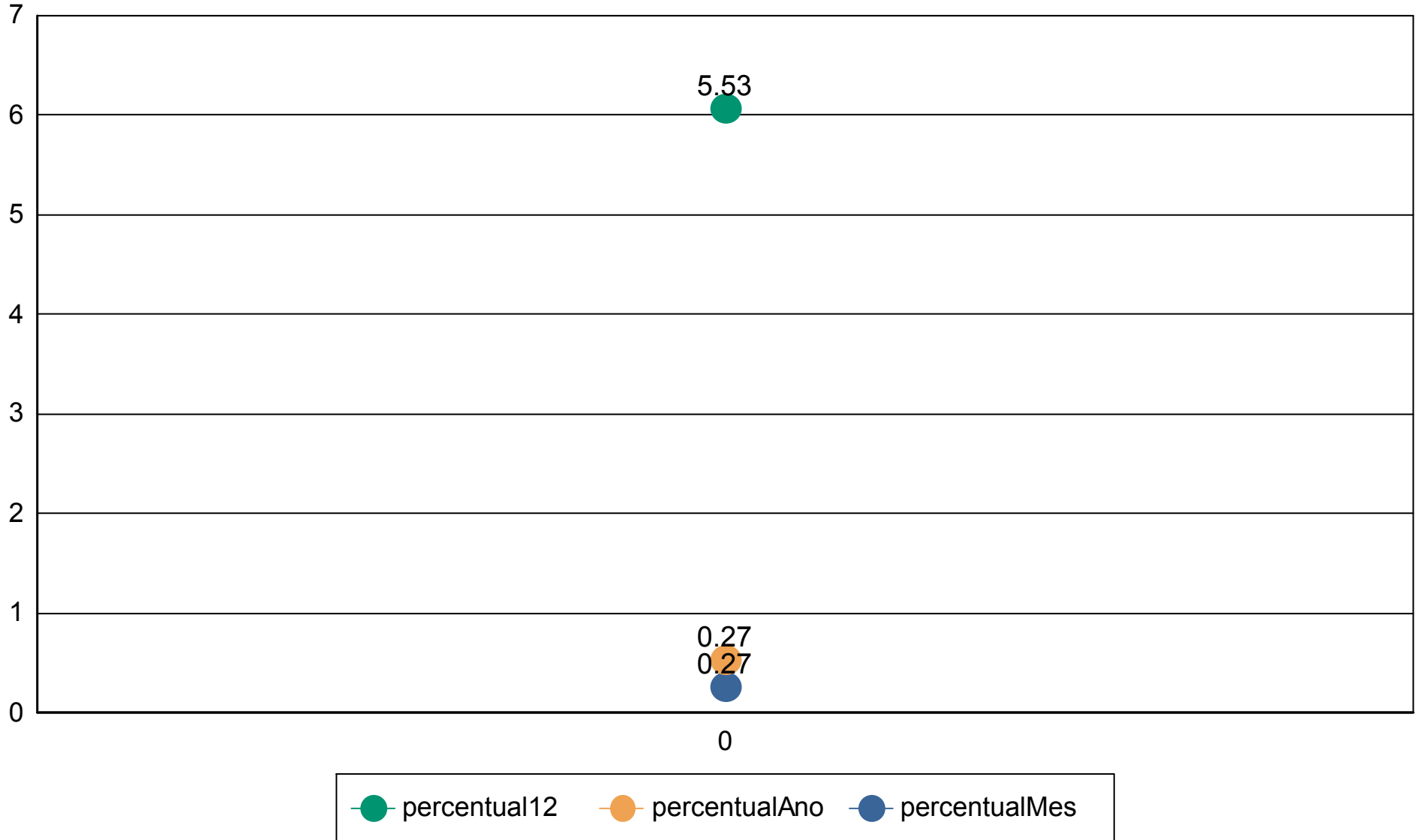
Retorno Mensal



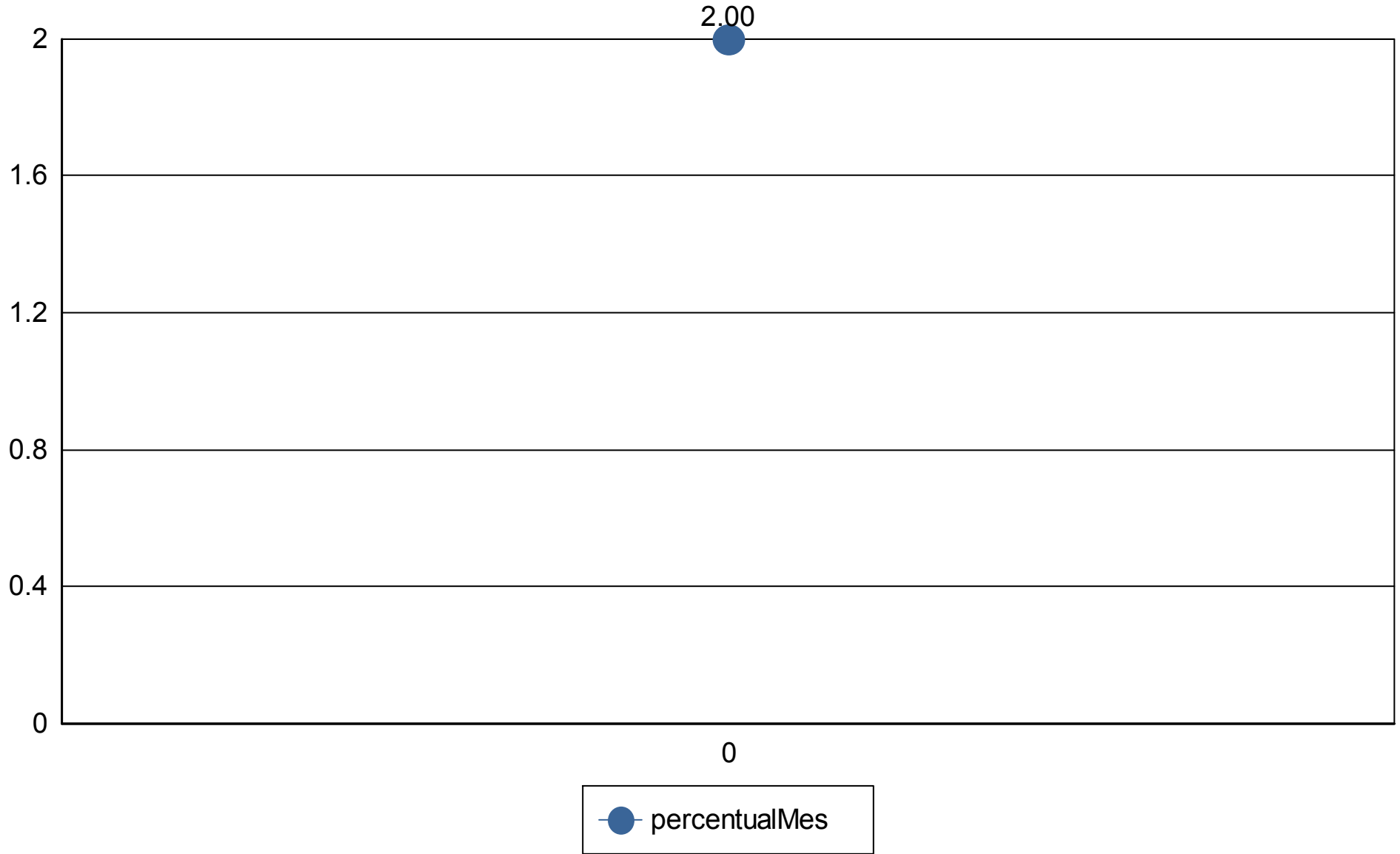
Índices Econômicos - IPCA



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	29,82%	0,00%	1,41%	3,88%	13,43%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	IRF-M 1	30,44%	0,00%	1,55%	3,56%	12,53%
03.737.206/0001-97	FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	28,66%	0,00%	2,17%	3,90%	9,59%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI	CDI	27,37%	0,00%	1,70%	3,55%	10,09%
13.077.415/0001-05	BB PREV RF FLUXO FI EM COTAS DE FI	CDI	32,30%	0,00%	0,73%	1,39%	5,56%
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAI	CDI	30,77%	0,00%	0,69%	1,84%	6,82%
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	IDKA 2	21,27%	0,01%	7,88%	18,87%	44,07%
15.486.093/0001-83	BB PREV RF TIT. PUB IPCA FI	IPCA	21,68%	0,01%	9,61%	17,40%	44,70%
11.902.276/0001-81	FI RECUPERAÇÃO BRASIL RF LONGO PRAZO	IMA-B	8,26%	0,30%	68,69%	86,65%	126,56%
			230,56%	0,32%	94,43%	141,04%	273,36%

Provisão de risco - Mercado

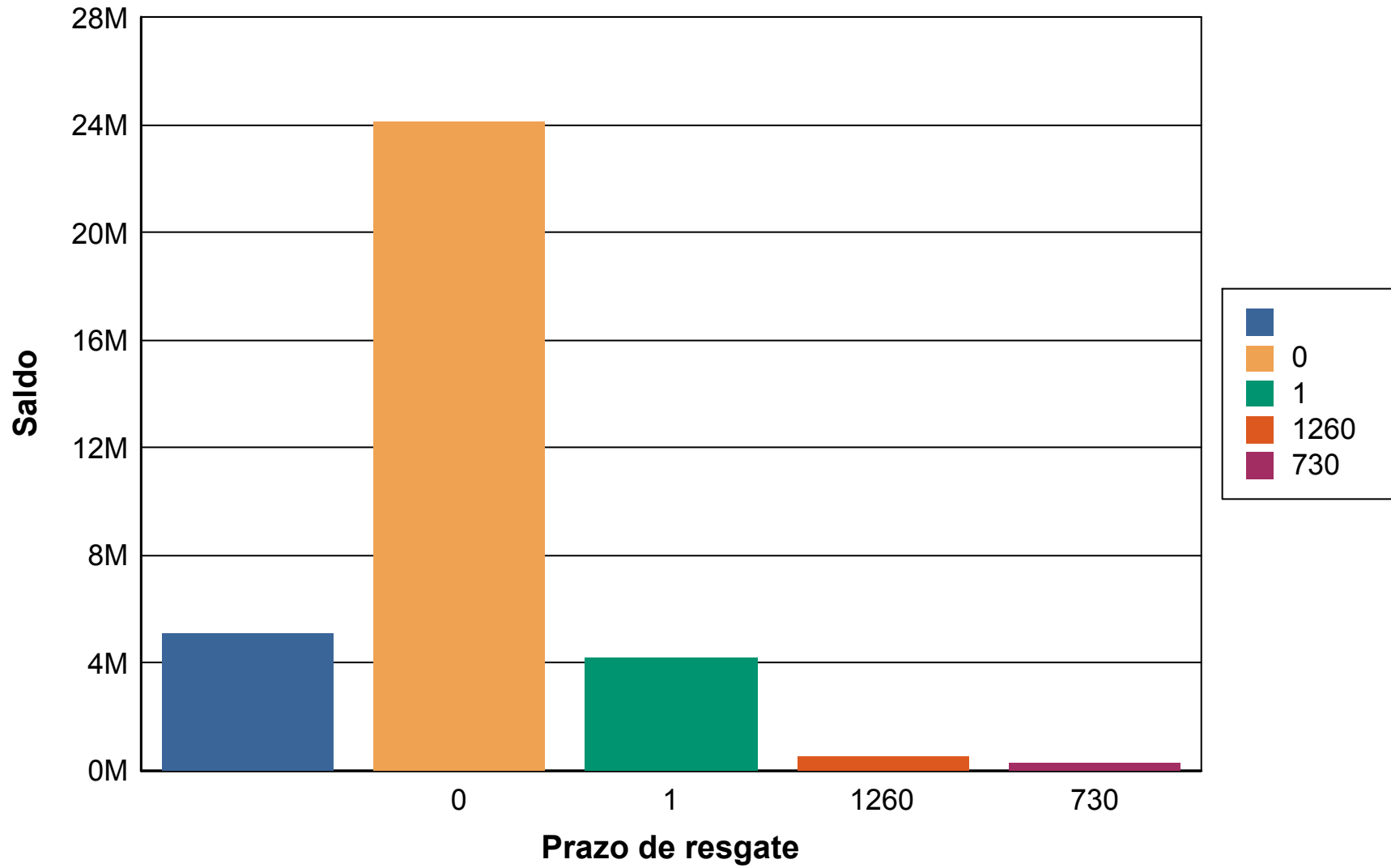
CNPJ	Nome do fundo	Benchmark	Saldo	VAR12	VOL12	VAR% BASE 1
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVEST	CDI	R\$ 1.022.662,62	0,00%	5,56%	R\$ 0,51
13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICO	IDKA 2	R\$ 4.200.665,82	0,01%	44,07%	R\$ 331,53
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO	IRF-M 1	R\$ 45.128,27	0,00%	12,53%	R\$ 0,12
13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO	CDI	R\$ 72.005,87	0,00%	10,09%	R\$ 0,06
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I	IPCA	R\$ 5.075.753,41	0,01%	44,70%	R\$ 629,40
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA	CDI	R\$ 50.330,07	0,00%	6,82%	R\$ 0,02
10.740.670/0001-06	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS F	IRF-M 1	R\$ 15.399,80	0,00%	13,43%	R\$ 0,04
03.737.206/0001-97	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFE	CDI	R\$ 11.703,56	0,00%	9,59%	R\$ 0,01

Saldo Total:	R\$ 10.493.649,42
Provisão para perda e Investimentos	R\$ 961,70
% Provisão de perda	0,01%
% Aceitavel perda	2%
Limite de utilização	0,46%



Nome do Fundo	Saldo	% Part.	N. Cotistas	% PL	PL do Fundo	Legislação	Grau risco	Prazo Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDC	R\$ 1.022.662,62	2,99%	770	0,04%	R\$ 2.849.785.990,61	Art 7º , IV "a"	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULO	R\$ 4.200.665,82	12,29%	935	0,05%	R\$ 8.237.289.291,28	Art 7º, I, "b"	Médio	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULC	R\$ 45.128,27	0,13%	1,210	0,00%	R\$ 8.234.435.809,83	Art 7º, I, "b"	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIAD	R\$ 72.005,87	0,21%	571	0,00%	R\$ 2.458.136.963,19	Art 7º , IV "a"	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBL	R\$ 5.075.753,41	14,85%	51	1,45%	R\$ 350.847.551,67	Art 7º, I, "b"	Médio	D+
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE IN	R\$ 50.330,07	0,15%	300	0,00%	R\$ 1.193.304.951,88	Art 7º , IV "a"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1	R\$ 15.399,80	0,05%	1,342	0,00%	R\$ 16.497.362.164,50	Art 7º, I, "b"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA	R\$ 11.703,56	0,03%	631	0,00%	R\$ 4.158.521.330,86	Art 7º , IV "a"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRAS	R\$ 278.289,11	0,81%	19	0,35%	R\$ 79.234.165,95	Art 7º , IV "a"	Alto	D+ 730
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTI	R\$ 532.290,37	1,56%	71	0,73%	R\$ 72.511.057,44	Art 7º , VII	Alto	D+ 1260
NTN-B20450515	R\$ 9.282.321,49	27,15%	1	98,44%	R\$ 9.429.268,86	Art 7º, I, "a"	Alto	D+ 0
NTN-C 20310101	R\$ 13.599.765,29	39,78%	1	104,18%	R\$ 13.054.380,75	Art 7º, I, "a"	Alto	D+ 0

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
	R\$ 5.075.753,41	1	14,85%
0	R\$ 24.099.316,97	8	70,49%
1	R\$ 4.200.665,82	1	12,29%
1260	R\$ 532.290,37	1	1,56%
730	R\$ 278.289,11	1	0,81%

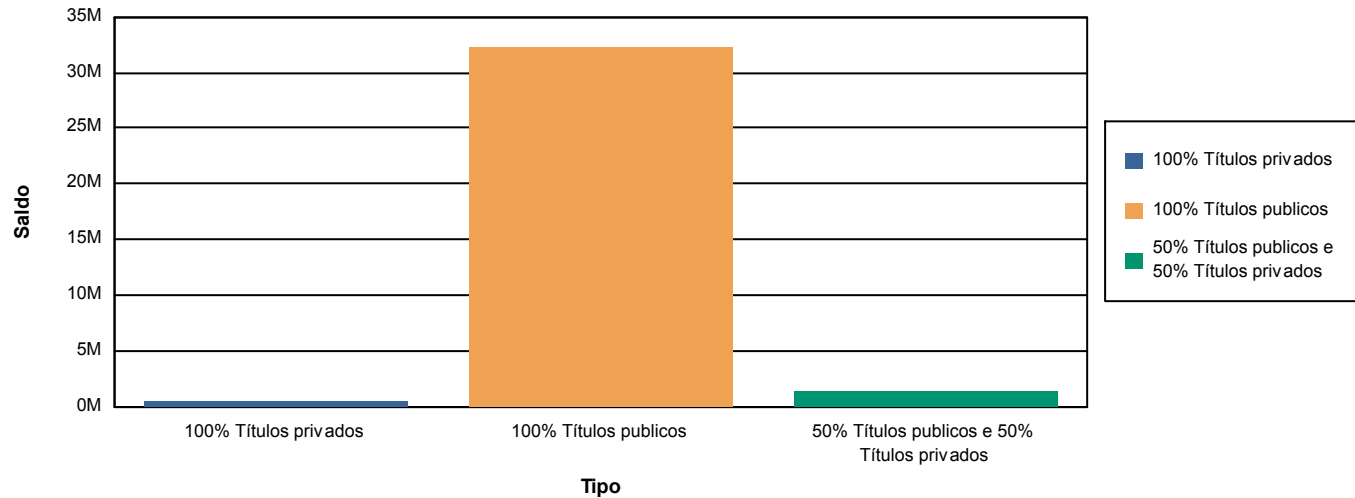


Risco Crédito

Legislação	Limite	Limite Política	Saldo	% Carteira
FI 100% títulos TN – 7º, I, b	100,00%	100,00%	R\$ 32.219.034,08	94,25
FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a	40,00%	40,00%	R\$ 1.434.991,23	4,20
FI em Direitos Creditórios – Cota Sênior – 7º, VII, a	5,00%	5,00%	R\$ 532.290,37	1,56

	Saldo	% Carteira
100% títulos públicos	32,936,529.70	96.34
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	717,495.62	2.10
100% títulos privados	532,290.37	1.56

Distribuição dos saldos



Kenzo Eduardo de Blasi

Assinatura