



DI BLASI
Consultoria Financeira

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE BARRETOS

Agosto 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 FLUXO RF SIMPLES FI EM C	0	4,90%	800	0,07%	Art 7º , IV "a"	R\$ 1.699.909,29	B	Fundo de Investim	0,20%
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	1	1,36%	1,012	0,00%	Art 7º, I, "b"	R\$ 472.951,53	M	Fundo de Investim	0,20%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	0	0,17%	1,152	0,00%	Art 7º, I, "b"	R\$ 59.100,84	B	Fundo de Investim	0,20%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONC	0	10,06%	747	0,07%	Art 7º , IV "a"	R\$ 3.489.100,51	B	Fundo de Investim	0,20%
15.486.093/0001-83	BB PREV RF TIT. PUB IPCA FI		14,50%	51	1,44%	Art 7º, I, "b"	R\$ 5.029.087,95	M	Fundo de Investim	0,15%
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUI	0	1,57%	303	0,09%	Art 7º , IV "a"	R\$ 542.743,46	B	Fundo de Investim	0,80%
10.740.670/0001-06	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	0	0,00%	1,276	0,00%	Art 7º, I, "b"	R\$ 0,00	B	Fundo de Investim	0,20%
03.737.206/0001-97	FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO	0	0,00%	766	0,00%	Art 7º , IV "a"	R\$ 0,00	B	Fundo de Investim	0,20%
11.902.276/0001-81	FI RECUPERAÇÃO BRASIL RF LONGO	730	0,14%	19	0,40%	Art 7º , IV "a"	R\$ 47.686,85	A	Fundo de Investim	1,25%
12.440.789/0001-80	LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FI EI	1260	1,50%	71	0,73%	Art 7º , VII	R\$ 521.088,13	A	Fundo de Investim	1,50%
66.998.014/0001-54	NTN-B20450515	0	25,22%	1	92,74%	Art 7º, I, "a"	R\$ 8.744.770,45	A	Fundo de Investim	0,20%
22.375.276/0001-97	NTN-C 20310101	0	40,58%	1	107,80%	Art 7º, I, "a"	R\$ 14.072.563,59	A	Fundo de Investim	0,20%

R\$ 34.679.002,60

Retorno do mês

Nome Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI	R\$ 1.562.487,70	R\$ 179.872,78	R\$ 47.503,03	R\$ 1.699.909,29	R\$ 5.051,84	0,2899%	CDI
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 472.108,97			R\$ 472.951,53	R\$ 842,56	0,1784%	IDKA 2
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F	R\$ 58.903,83			R\$ 59.100,84	R\$ 197,01	0,3344%	IRF-M 1
BB PREV RF REFERENCIADO DI L'	R\$ 3.038.147,12	R\$ 1.079.000,00	R\$ 642.948,31	R\$ 3.489.100,51	R\$ 14.901,70	0,3619%	CDI
BB PREV RF TIT. PUB IPCA FI	R\$ 5.014.313,54			R\$ 5.029.087,95	R\$ 14.774,41	0,2946%	IPCA
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE	R\$ 761.531,81	R\$ 27.474,80	R\$ 248.135,38	R\$ 542.743,46	R\$ 1.872,23	0,2372%	CDI
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB	R\$ 15.528,79		R\$ 15.560,41	R\$ 0	R\$ 31,62	0,2036%	IRF-M 1
FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIAL	R\$ 11.873,24		R\$ 11.914,39	R\$ 0	R\$ 41,15	0,3465%	CDI
FI RECUPERAÇÃO BRASIL RF LON	R\$ 48.509,46			R\$ 47.686,85	R\$ -822,61	-1,6958%	IMA-B
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - F	R\$ 522.347,45			R\$ 521.088,13	R\$ -1.259,32	-0,2411%	FIDC
NTN-B20450515	R\$ 9.008.450,60			R\$ 8.744.770,45	R\$ -263.680,15	-2,9271%	NTN-B
NTN-C 20310101	R\$ 14.587.657,14			R\$ 14.072.563,59	R\$ -515.093,55	-3,5311%	NTN-C
Total	35,101,859.65	1,286,347.58	966,061.52	34,679,002.60	-743,143.11	-2,0423%	

Enquadramentos

FI 100% títulos TN – 7º, I, b

 % Carteira: : **46,88%**

 Saldo do grupo: **R\$ 5.561.140,32**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R\$ 0,00	0.00	0,00%	3,686,891.77	0,00%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado
BB PREV RF TIT. PUB IPCA FI	R\$ 5.029.087,95	1,999,640.57	1,44%	3,351,389.30	14,50%	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\$ 59.100,84	21,439.26	0,00%	3,467,815.66	0,17%	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\$ 472.951,53	160,870.04	0,00%	3,752,148.95	1,36%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado

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

 % Carteira: : **4,39%**

 Saldo do grupo: **R\$ 521.088,13**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FI EM DIREITOS CREDITORIOS	R\$ 521.088,13	1,429,198.91	0,73%	1,175,905.32	1,50%	Lim. Res.: 5,00% Lim. Pol.: 5,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,73%	Enquadrado

FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a

 % Carteira: : **48,72%**

 Saldo do grupo: **R\$ 5.779.440,11**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$ 542.743,46	284,366.40	0,08%	3,843,877.92	1,57%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,08%	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 0,00	0.00	0,00%	3,234,050.26	0,00%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.699.909,29	793,654.87	0,08%	3,853,513.66	4,90%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,08%	Enquadrado



FI RECUPERAÇÃO BRASIL RF LONGO PRAZO	R\$ 47.686,85	530,372.51	0,40%	1,912,365.71	0,14%	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\$ 3.489.100,51	1,483,590.76	0,07%	3,526,156.09	10,06%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,07%	Enquadrado

Enquadramento por Benchmark

CDI

 % Carteira: **48,32%**

 Saldo do grupo: **R\$ 5.731.753,26**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$ 542.743,46	284,366.40	0.08	1.57	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\$ 0,00	0.00	0.00	0.00	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.699.909,29	793,654.87	0.08	4.90	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\$ 3.489.100,51	1,483,590.76	0.07	10.06	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

FIDC

 % Carteira: **4,39%**

 Saldo do grupo: **R\$ 521.088,13**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FI EM DIREITOS CREDITORIOS	R\$ 521.088,13	1,429,198.91	0.73	1.50	Lim. Res.: 5,00% Lim. Pol.: 5,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 5,00%	Enquadrado

IDKA 2

 % Carteira: **3,99%**

 Saldo do grupo: **R\$ 472.951,53**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 472.951,53	160,870.04	0.00	1.36	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IMA-B

 % Carteira: **0,40%**

 Saldo do grupo: **R\$ 47.686,85**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FI RECUPERAÇÃO BRASIL RF LONGO PRAZO	R\$ 47.686,85	530,372.51	0.40	0.14	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IPCA

 % Carteira: **42,40%**

 Saldo do grupo: **R\$ 5.029.087,95**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF TIT. PUB IPCA FI	R\$ 5.029.087,95	1,999,640.57	1.44	14.50	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IRF-M 1

 % Carteira: **0,50%**

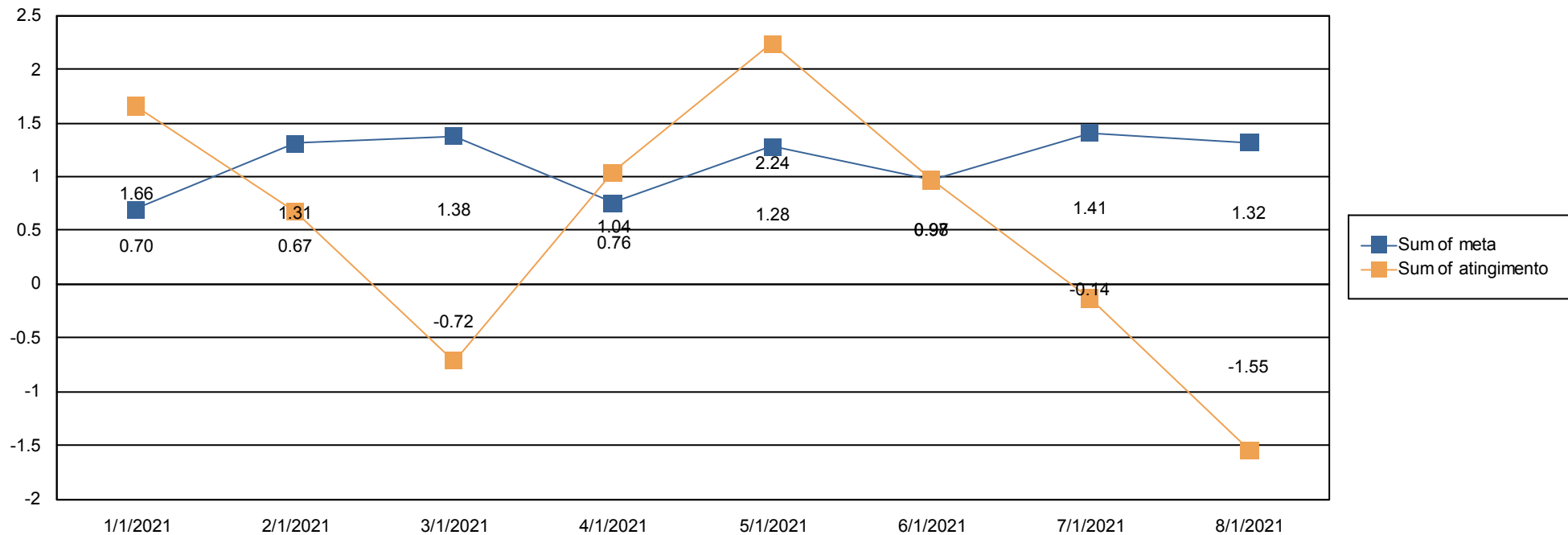
 Saldo do grupo: **R\$ 59.100,84**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TIT. PUB RF	R\$ 0,00	0.00	0.00	0.00	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\$ 59.100,84	21,439.26	0.00	0.17	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

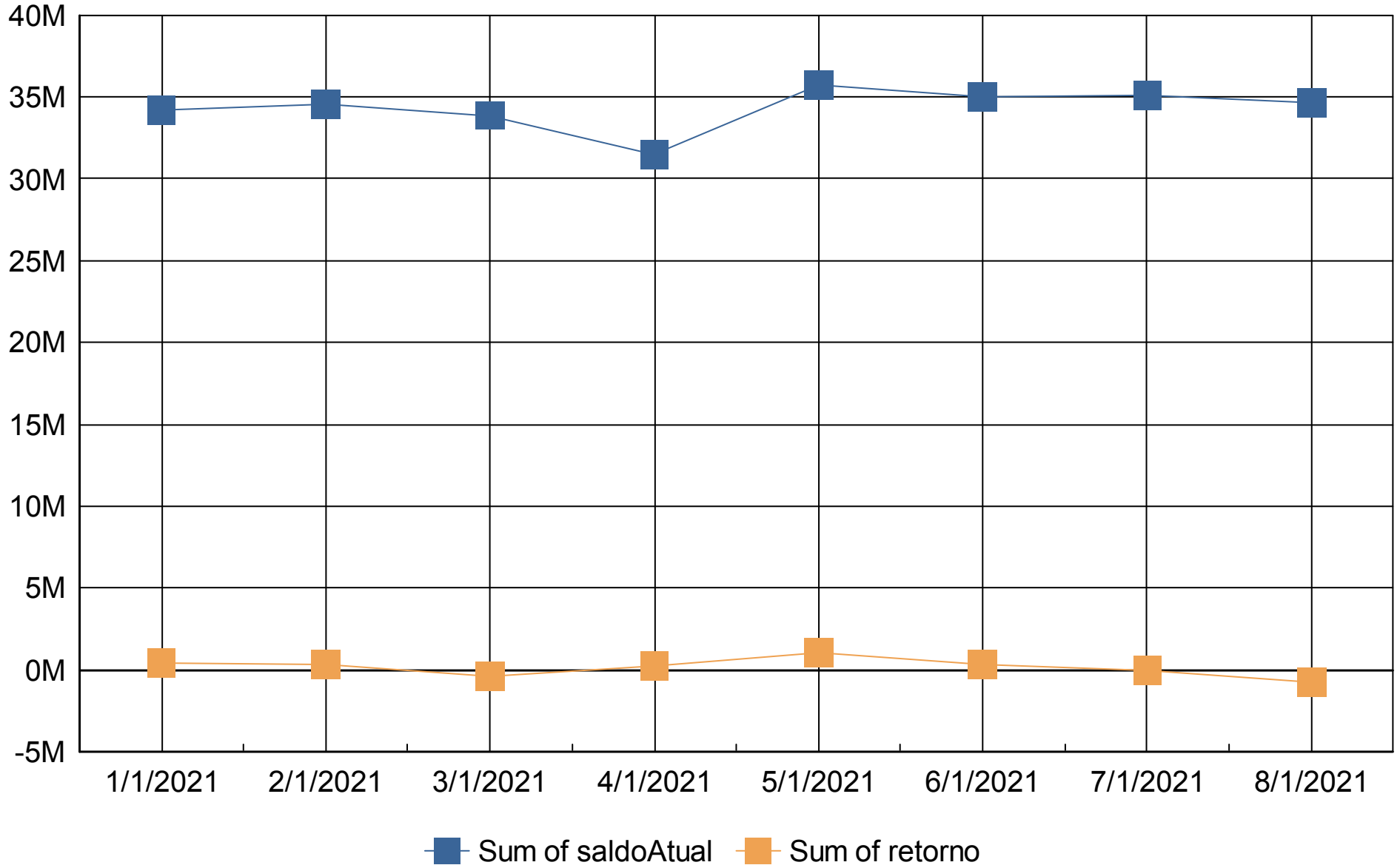
Retorno acumulado no ano

Período	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Retorno %	Meta	Atingimento
Janeiro	R\$ 33.989.067,70	R\$ 1.223.121,18	R\$ 1.432.125,36	R\$ 34.186.315,68	R\$ 406.252,16	1,1537%	0,6959	165,7890%
Fevereiro	R\$ 34.186.315,68	R\$ 4.545.377,68	R\$ 4.552.999,37	R\$ 34.520.687,84	R\$ 341.993,85	0,8830%	1,3086	67,4753%
Março	R\$ 34.520.687,84	R\$ 5.337.042,76	R\$ 5.580.692,73	R\$ 33.882.109,82	-R\$ 394.928,05	-0,9908%	1,3789	-71,8576%
Abril	R\$ 33.882.109,82	R\$ 1.092.280,22	R\$ 3.765.284,78	R\$ 31.484.678,22	R\$ 275.572,96	0,7879%	0,7562	104,1957%
Mai	R\$ 31.484.678,22	R\$ 4.542.099,47	R\$ 1.290.130,75	R\$ 35.767.337,78	R\$ 1.030.690,84	2,8609%	1,2785	223,7702%
Junho	R\$ 35.767.337,78	R\$ 1.100.876,77	R\$ 2.195.592,84	R\$ 35.022.032,81	R\$ 349.411,10	0,9477%	0,9772	96,9842%
Julho	R\$ 35.022.032,81	R\$ 2.326.689,53	R\$ 2.174.991,17	R\$ 35.101.859,65	-R\$ 71.871,52	-0,1924%	1,4091	-13,6565%
Agosto	R\$ 35.101.859,65	R\$ 1.286.347,58	R\$ 966.061,52	R\$ 34.679.002,60	-R\$ 743.143,11	-2,0423%	1,3187	-154,8695%
Total	R\$ 273.954.089,50	21,453,835.19	21,957,878.52	274,644,024.40	1,193,978.23	3,3791%	9,4926%	35,5974%

Meta x Atingimento

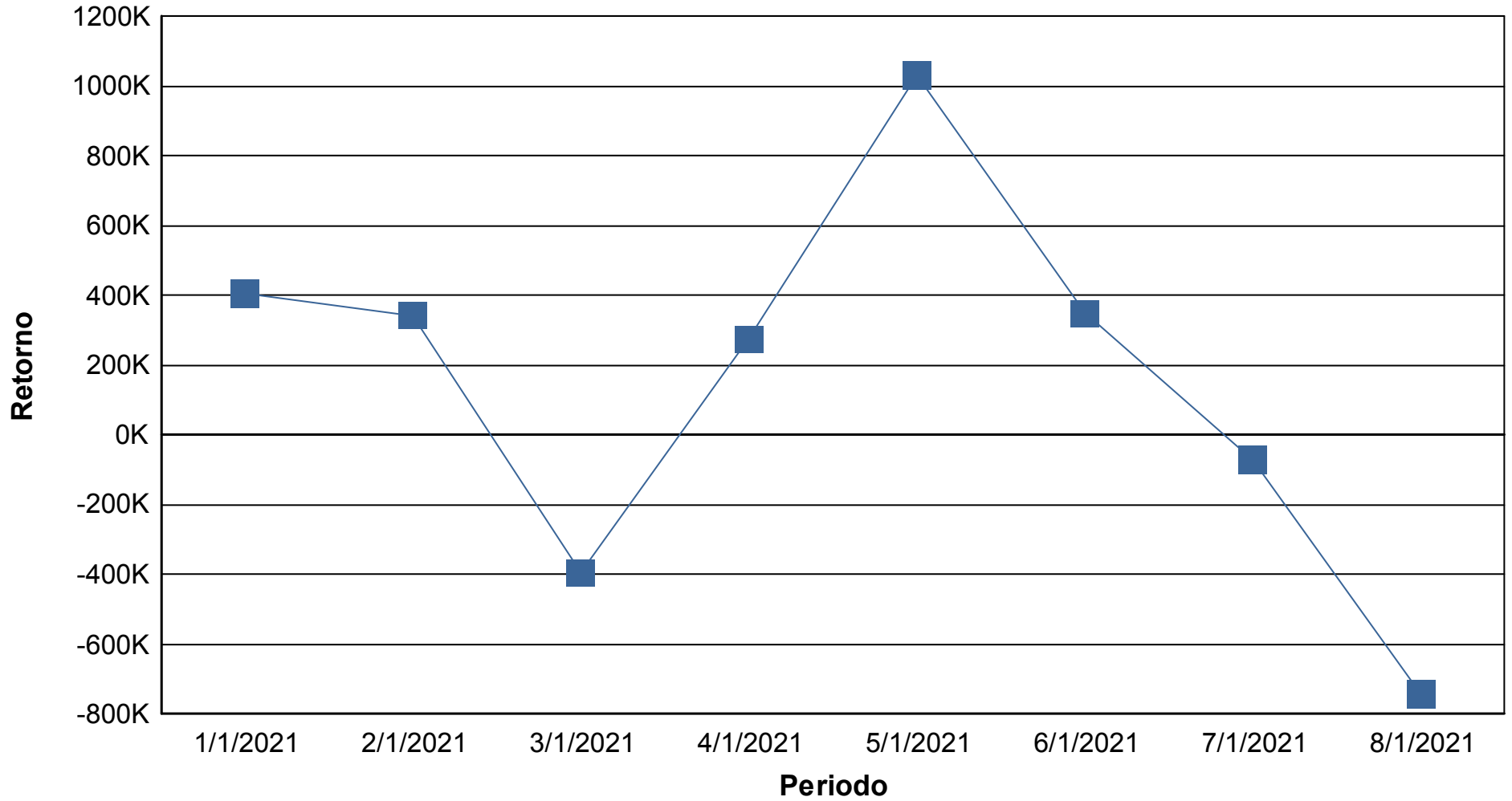


Evolução do patrimônio

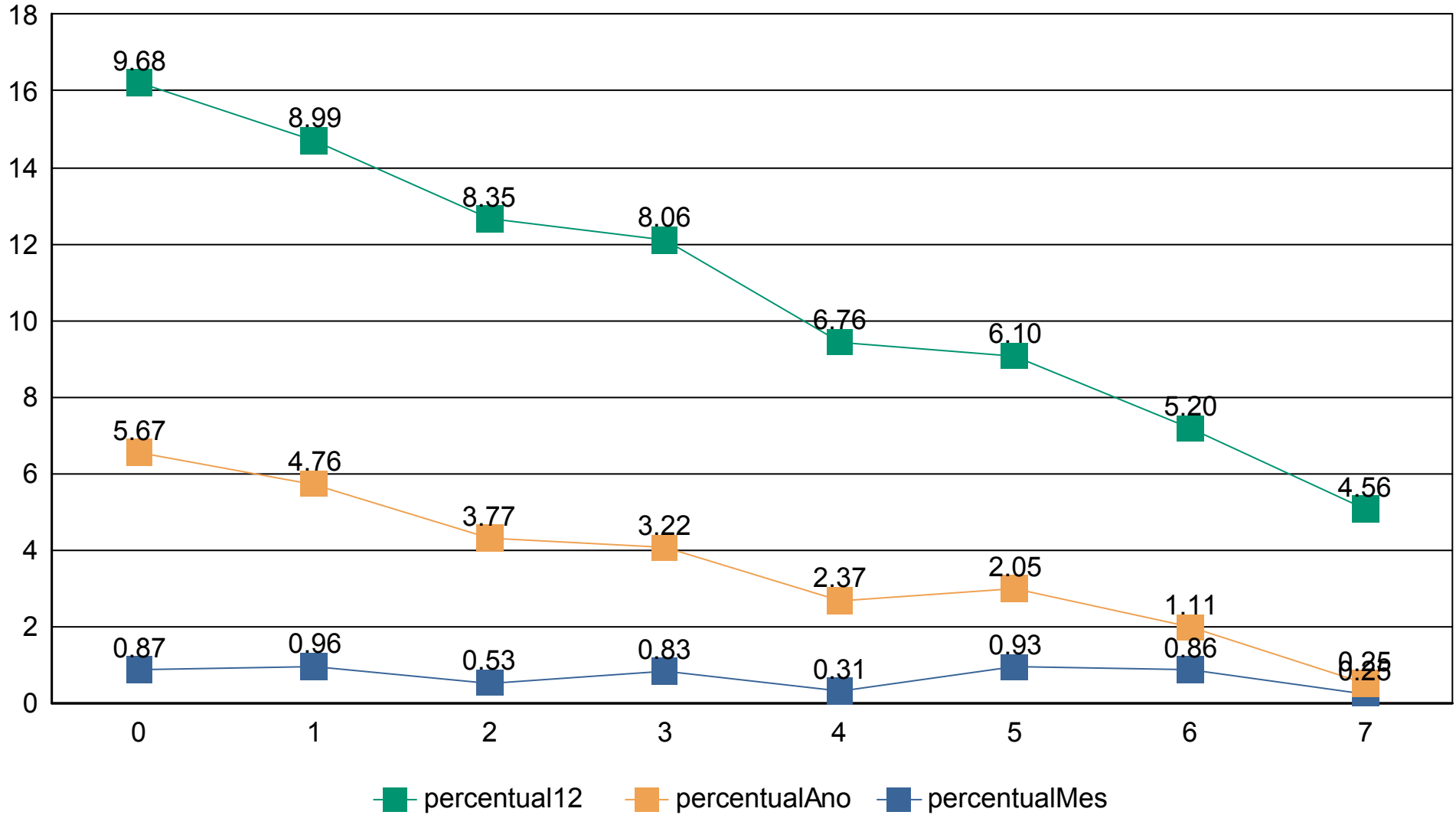




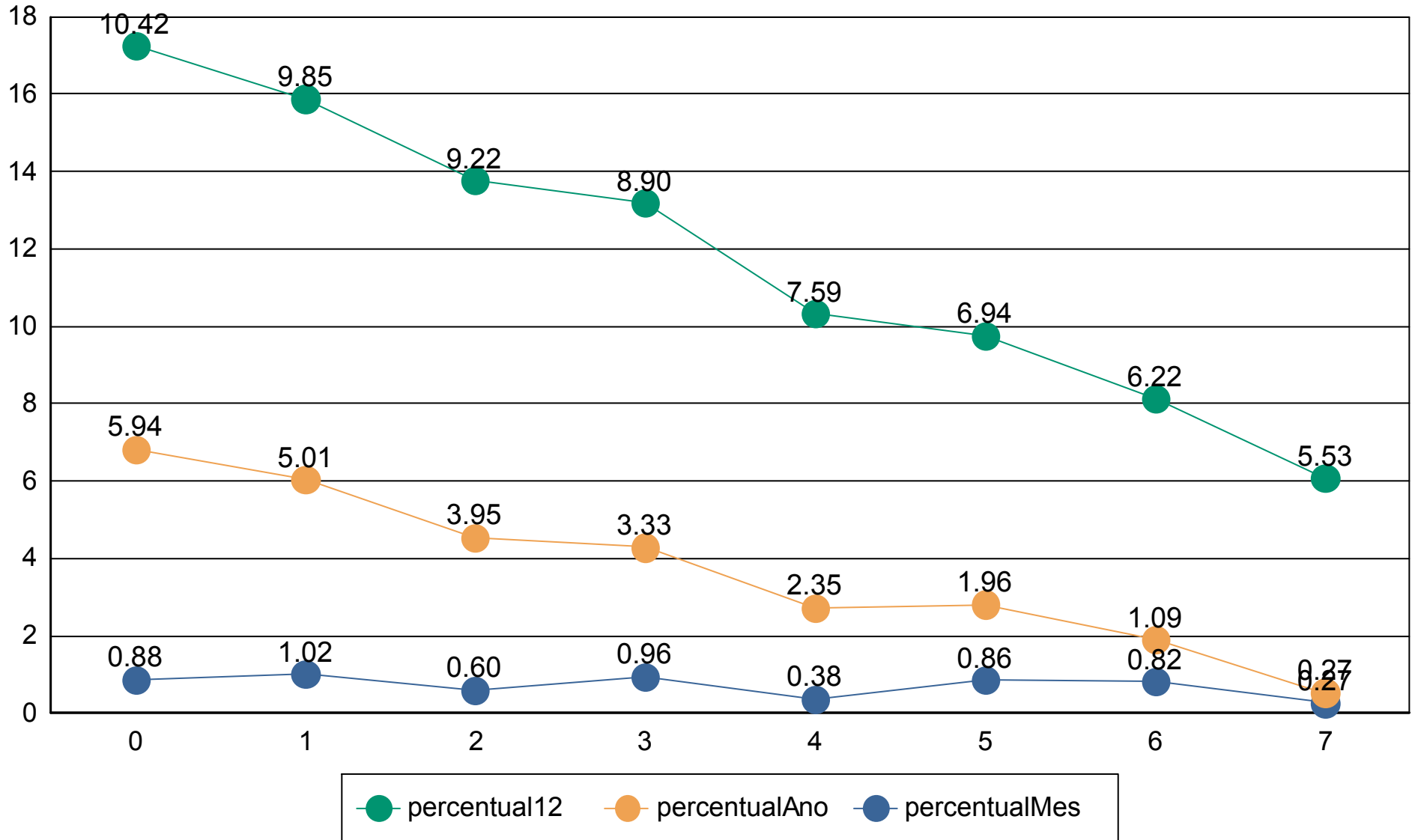
Retorno Mensal



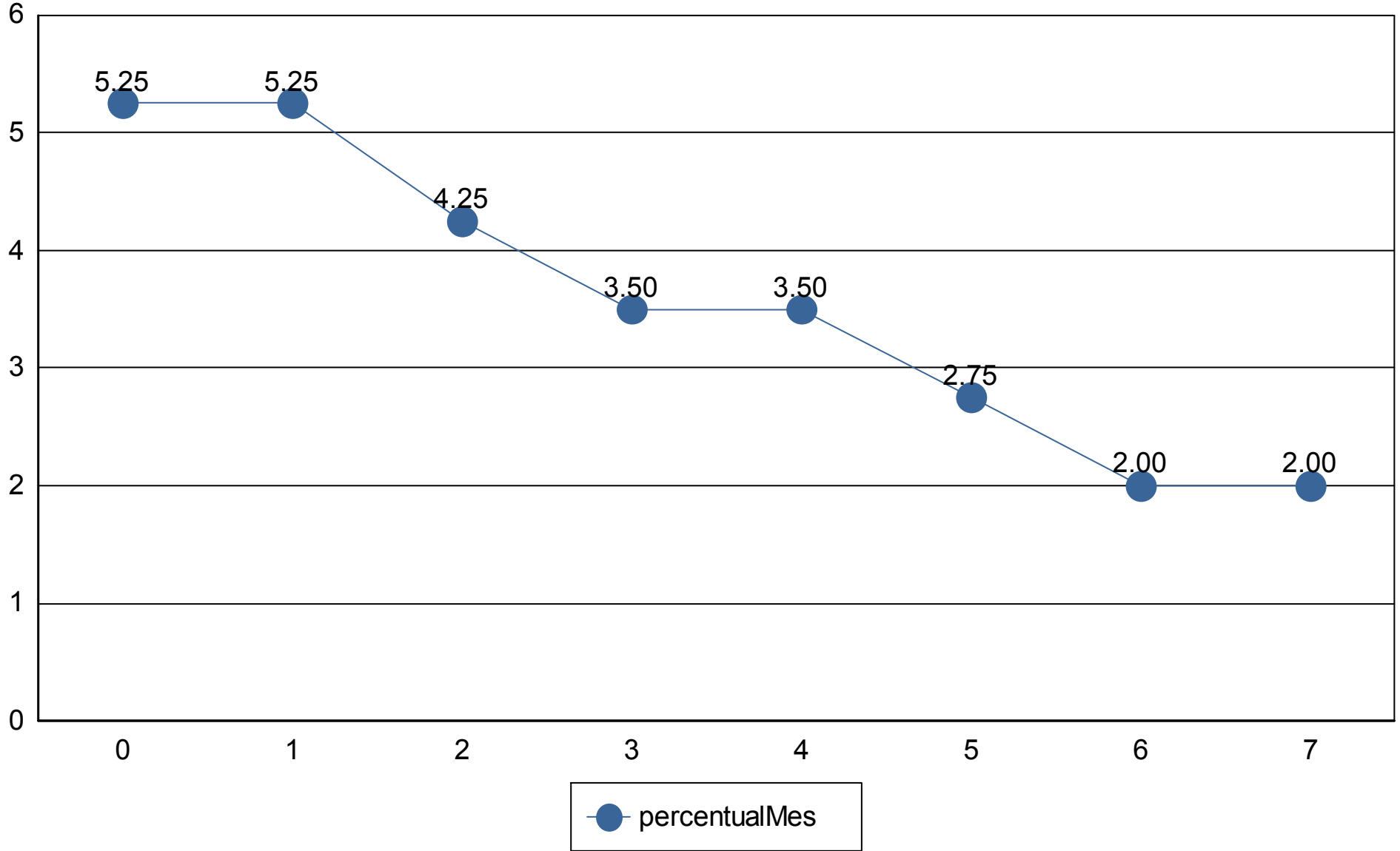
Índices Econômicos - IPCA



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	29,62%	0,00%	2,12%	4,59%	8,43%
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAI	CDI	27,46%	0,00%	2,33%	4,90%	8,14%
03.737.206/0001-97	FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	26,64%	0,00%	3,85%	7,43%	12,91%
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	CDI	26,01%	0,00%	2,21%	4,60%	7,35%
11.902.276/0001-81	FI RECUPERAÇÃO BRASIL RF LONGO PRAZO	IMA-B	-35,53%	5,01%	1,78%	3,49%	622,17%
15.486.093/0001-83	BB PREV RF TIT. PUB IPCA FI	IPCA	20,24%	0,01%	1,39%	8,38%	26,70%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	IRF-M 1	28,17%	0,00%	2,06%	4,41%	8,14%
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	IDKA 2	24,21%	0,00%	1,12%	7,38%	25,87%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI	CDI	26,42%	0,00%	3,44%	7,12%	13,11%
			173,23%	5,02%	20,29%	52,29%	732,82%

Provisão de risco - Mercado

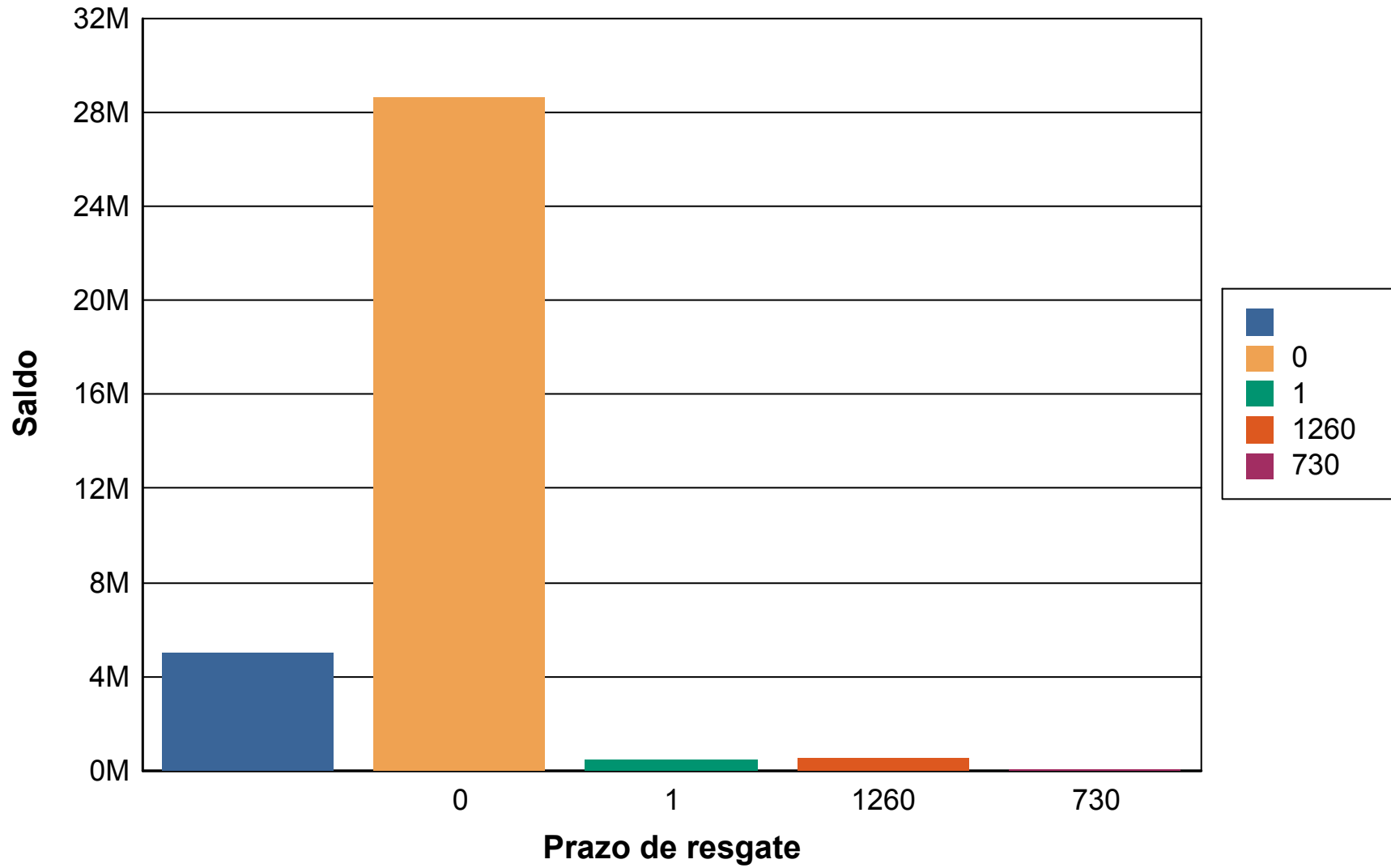
CNPJ	Nome do fundo	Benchmark	Saldo	VAR12	VOL12	VAR% BASE 1
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO C	CDI	R\$ 1.699.909,29	0,00%	7,35%	R\$ 1,32
13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICO	IDKA 2	R\$ 472.951,53	0,00%	25,87%	R\$ 15,15
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO	IRF-M 1	R\$ 59.100,84	0,00%	8,14%	R\$ 0,07
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I	IPCA	R\$ 5.029.087,95	0,01%	26,70%	R\$ 277,67
14.508.643/0001-55	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST CAIX/	CDI	R\$ 542.743,46	0,00%	8,14%	R\$ 0,35
10.740.670/0001-06	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS F	IRF-M 1	R\$ 0,00	0,00%	8,43%	R\$ 0,00
03.737.206/0001-97	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFE	CDI	R\$ 0,00	0,00%	12,91%	R\$ 0,00
11.902.276/0001-81	FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRASIL RENDA F	IMA-B	R\$ 47.686,85	5,01%	622,17%	R\$ 2.388,62

Saldo Total:	R\$ 7.851.479,92
Provisão para perda e Investimentos	R\$ 2.683,17
% Provisão de perda	0,03%
% Aceitavel perda	2%
Limite de utilização	1,71%



Nome do Fundo	Saldo	% Part.	N. Cotistas	% PL	PL do Fundo	Legislação	Grau risco	Prazo Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE	R\$ 1.699.909,29	4,90%	800	0,07%	R\$ 2.324.569.385,24	Art 7º , IV "a"	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULO	R\$ 472.951,53	1,36%	1,012	0,00%	R\$ 9.646.954.322,65	Art 7º, I, "b"	Médio	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULC	R\$ 59.100,84	0,17%	1,152	0,00%	R\$ 7.487.800.935,00	Art 7º, I, "b"	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIAD	R\$ 3.489.100,51	10,06%	747	0,07%	R\$ 4.872.642.722,30	Art 7º , IV "a"	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBL	R\$ 5.029.087,95	14,50%	51	1,44%	R\$ 348.977.302,98	Art 7º, I, "b"	Médio	D+
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDOS DE IN	R\$ 542.743,46	1,57%	303	0,09%	R\$ 581.323.060,83	Art 7º , IV "a"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1	R\$ 0,00	0,00%	1,276	0,00%	R\$ 7.095.344.390,16	Art 7º, I, "b"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA	R\$ 0,00	0,00%	766	0,00%	R\$ 6.589.280.215,43	Art 7º , IV "a"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO RECUPERAÇÃO BRAÇ	R\$ 47.686,85	0,14%	19	0,40%	R\$ 11.864.755,79	Art 7º , IV "a"	Alto	D+ 730
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVE	R\$ 521.088,13	1,50%	71	0,73%	R\$ 71.347.917,59	Art 7º , VII	Alto	D+ 1260
NTN-B20450515	R\$ 8.744.770,45	25,22%	1	92,74%	R\$ 9.429.268,86	Art 7º, I, "a"	Alto	D+ 0
NTN-C 20310101	R\$ 14.072.563,59	40,58%	1	107,80%	R\$ 13.054.380,75	Art 7º, I, "a"	Alto	D+ 0

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
	R\$ 5.029.087,95	1	14,50%
0	R\$ 28.608.188,14	8	82,49%
1	R\$ 472.951,53	1	1,36%
1260	R\$ 521.088,13	1	1,50%
730	R\$ 47.686,85	1	0,14%

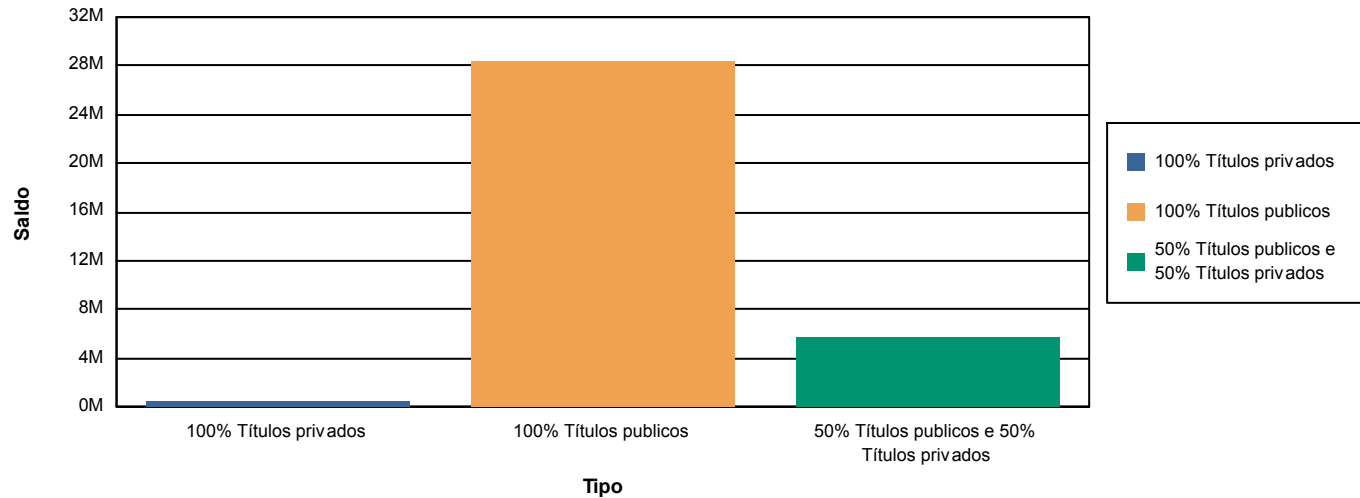


Risco Crédito

Legislação	Limite	Limite Política	Saldo	% Carteira
Títulos Públicos de emissão do TN (Selic) 7º, I, a	100,00%	100,00%	R\$ 22.817.334,04	65,80
FI 100% títulos TN – 7º, I, b	100,00%	100,00%	R\$ 5.561.140,32	16,04
FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a	40,00%	40,00%	R\$ 5.779.440,11	16,67
FI em Direitos Creditórios – Cota Sênior – 7º, VII, a	5,00%	5,00%	R\$ 521.088,13	1,50

	Saldo	% Carteira
100% títulos públicos	31,268,194.42	90.16
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	2,889,720.06	8.33
100% títulos privados	521,088.13	1.50

Distribuição dos saldos





DI BLASI
Consultoria Financeira

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICIPIO DE BARRETOS
CNPJ: 66.998.014/0001-54

Carlos Eduardo Di Blasi

Assinatura