



DI BLASI
Consultoria Financeira

**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA DOS SERVIDORES
DO MUNICÍPIO DE CACHOEIRA DO PIRIÁ**
Julho 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	1,79%	804	0,01%	Art 7º , IV "a"	R\$ 177.463,15	B	Fundo de Investim	0,20%
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FI EM C	4	18,27%	576	0,02%	Art 7º , I, "b"	R\$ 1.812.296,13	A	Fundo de Investim	0,50%
35.292.588/0001-89	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETOF	3	0,00%	590	0,00%	Art 7º , IV "a"	R\$ 0,00	B	Fundo de Investim	0,20%
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	1	18,73%	1,018	0,02%	Art 7º , I, "b"	R\$ 1.858.352,45	M	Fundo de Investim	0,20%
07.861.554/0001-22	BB PREV RF IMA-B FI	1	15,05%	252	0,13%	Art 7º , IV "a"	R\$ 1.493.619,49	M	Fundo de Investim	0,30%
07.111.384/0001-69	BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	0	10,05%	575	0,02%	Art 7º , I, "b"	R\$ 997.409,26	M	Fundo de Investim	0,20%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	0	18,80%	1,139	0,03%	Art 7º , I, "b"	R\$ 1.864.948,43	B	Fundo de Investim	0,20%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONC	0	17,31%	781	0,03%	Art 7º , IV "a"	R\$ 1.717.332,49	B	Fundo de Investim	0,20%

R\$ 9.921.421,40

Retorno do mês

Nome Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EI	R\$ 74.000,80	R\$ 195.721,75	R\$ 92.448,57	R\$ 177.463,15	R\$ 189,17	0,0701%	CDI
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FI EI	R\$ 1.816.831,94			R\$ 1.812.296,13	R\$ -4.535,81	-0,2497%	IMA-GERAL
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RE	R\$ 0	R\$ 0		R\$ 0	R\$ -	0,0000%	IPCA
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 1.856.802,77			R\$ 1.858.352,45	R\$ 1.549,68	0,0834%	IDKA 2
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 1.499.404,36			R\$ 1.493.619,49	R\$ -5.784,87	-0,3859%	IMA-B
BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 1.002.408,60			R\$ 997.409,26	R\$ -4.999,34	-0,4988%	IRF-M
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC F	R\$ 1.861.888,56			R\$ 1.864.948,43	R\$ 3.059,87	0,1643%	IRF-M 1
BB PREV RF REFERENCIADO DI L	R\$ 1.710.606,97			R\$ 1.717.332,49	R\$ 6.725,52	0,3931%	CDI
Total	9,821,944.00	195,721.75	92,448.57	9,921,421.40	-3,795.78	-0,0379%	

Enquadramentos

FI 100% títulos TN – 7º, I, b

 % Carteira: : **65,85%**

 Saldo do grupo: **R\$ 6.533.006,27**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 1.864.948,43	678,786.41	0,03%	1,375,720.34	18,80%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,03%	Enquadrado
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 1.858.352,45	633,229.29	0,02%	1,647,705.90	18,73%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,02%	Enquadrado
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.812.296,13	1,197,295.59	0,02%	1,903,955.40	18,27%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,02%	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 997.409,26	165,867.62	0,01%	1,606,073.67	10,05%	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,01%	Enquadrado

FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a

 % Carteira: : **34,15%**

 Saldo do grupo: **R\$ 3.388.415,13**

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	P. Liq.	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 177.463,15	83,101.21	0,01%	1,891,886.28	1,79%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,01%	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 1.493.619,49	260,600.36	0,12%	1,836,023.36	15,05%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,12%	Enquadrado
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.717.332,49	733,487.21	0,04%	1,355,289.66	17,31%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,04%	Enquadrado
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FI EM COTAS DE FI	R\$ 0,00	0.00	0,00%	1,514,993.96	0,00%	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 15,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 0,00%	Enquadrado

Enquadramento por Benchmark

CDI

 % Carteira: **19,10%**

 Saldo do grupo: **R\$ 1.894.795,64**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	R\$ 177.463,15	83,101.21	0.01	1.79	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\$ 1.717.332,49	733,487.21	0.04	17.31	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IDKA 2

 % Carteira: **18,73%**

 Saldo do grupo: **R\$ 1.858.352,45**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 1.858.352,45	633,229.29	0.02	18.73	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IMA-B

 % Carteira: **15,05%**

 Saldo do grupo: **R\$ 1.493.619,49**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 1.493.619,49	260,600.36	0.12	15.05	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IMA-GERAL

 % Carteira: **18,27%**

 Saldo do grupo: **R\$ 1.812.296,13**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FI EM COTAS DE FI	R\$ 1.812.296,13	1,197,295.59	0.02	18.27	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IPCA

 % Carteira: **0,00%**

 Saldo do grupo: **R\$ 0,00**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FI EM COTAS DE FI	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

IRF-M

 % Carteira: **10,05%**

 Saldo do grupo: **R\$ 997.409,26**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	R\$ 997.409,26	165,867.62	0.01	10.05	Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15.00%	Enquadrado

IRF-M 1

 % Carteira: **18,80%**

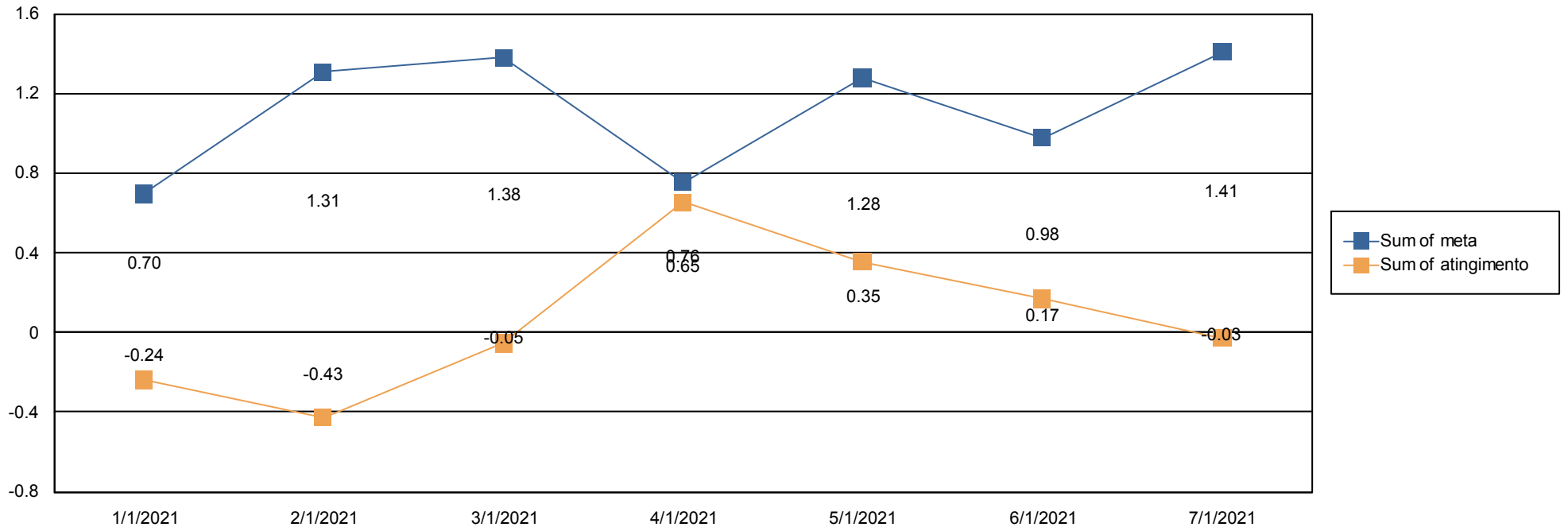
 Saldo do grupo: **R\$ 1.864.948,43**

Nome fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 1.864.948,43	678,786.41	0.03	18.80	Lim. Res.: 100.00% Lim. Pol.: 100.00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15.00%	Enquadrado

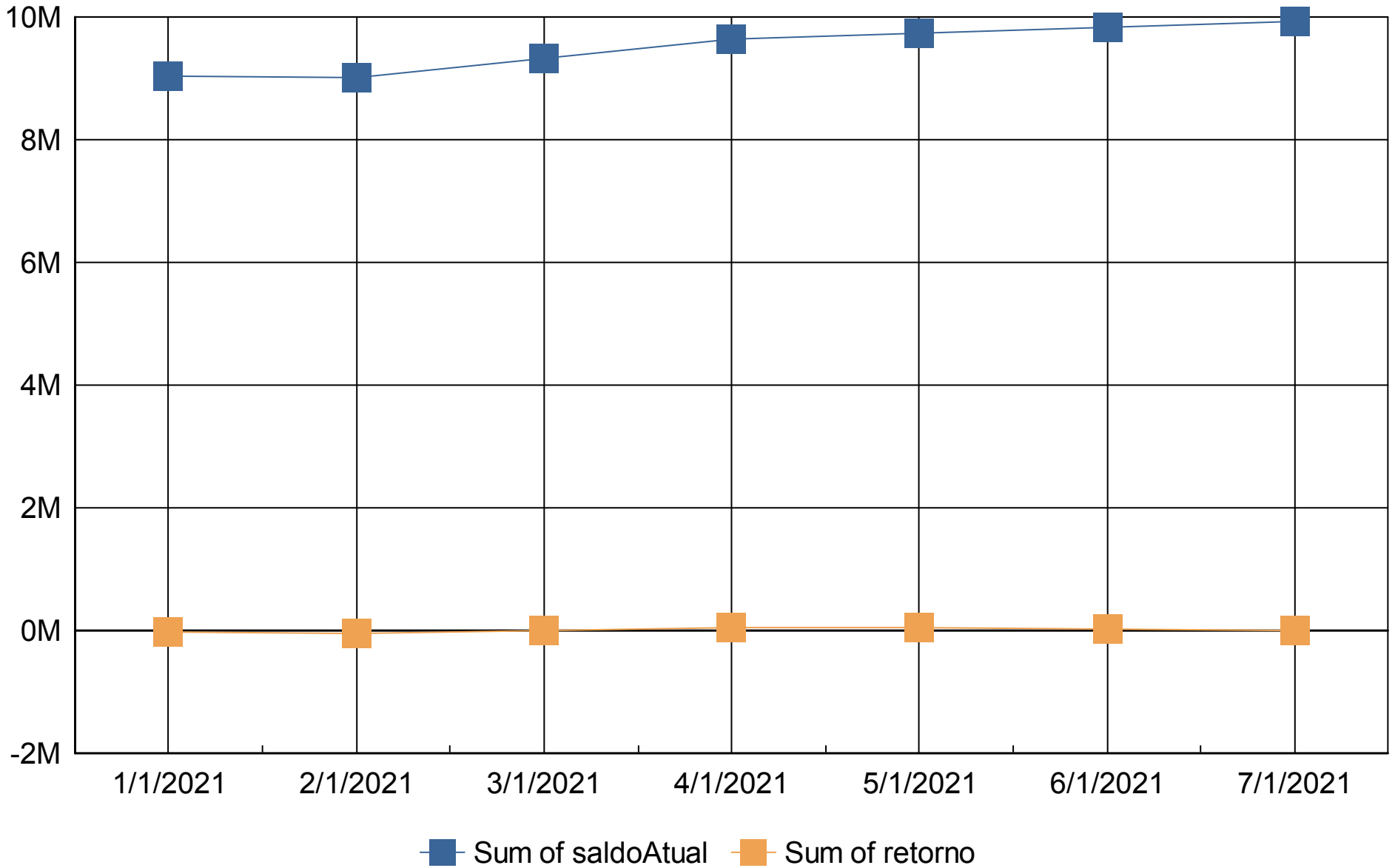
Retorno acumulado no ano

Período	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Retorno %	Meta	Atingimento
Janeiro	R\$ 8.383.564,82	R\$ 704.328,75	R\$ 42.147,41	R\$ 9.030.727,04	-R\$ 15.019,12	-0,1653%	0,6959	-23,7484%
Fevereiro	R\$ 9.030.727,04	R\$ 97.783,24	R\$ 71.071,07	R\$ 9.006.529,34	-R\$ 50.909,87	-0,5577%	1,3086	-42,6182%
Março	R\$ 9.006.529,34	R\$ 1.902.098,78	R\$ 1.578.004,67	R\$ 9.322.440,83	-R\$ 8.182,62	-0,0750%	1,3789	-5,4399%
Abril	R\$ 9.322.440,83	R\$ 552.573,08	R\$ 302.249,18	R\$ 9.621.509,79	R\$ 48.745,06	0,4936%	0,7562	65,2764%
Mai	R\$ 9.621.509,79	R\$ 282.138,98	R\$ 218.429,35	R\$ 9.730.103,03	R\$ 44.883,61	0,4532%	1,2785	35,4480%
Junho	R\$ 9.730.103,03	R\$ 499.353,13	R\$ 424.471,66	R\$ 9.821.944,00	R\$ 16.959,50	0,1658%	0,9772	16,9659%
Julho	R\$ 9.821.944,00	R\$ 195.721,75	R\$ 92.448,57	R\$ 9.921.421,40	-R\$ 3.795,78	-0,0379%	1,4091	-2,6890%
Total	R\$ 64.916.818,85	4,233,997.71	2,728,821.91	66,454,675.43	32,680.78	0,2730%	8,0675%	3,3841%

Meta x Atingimento

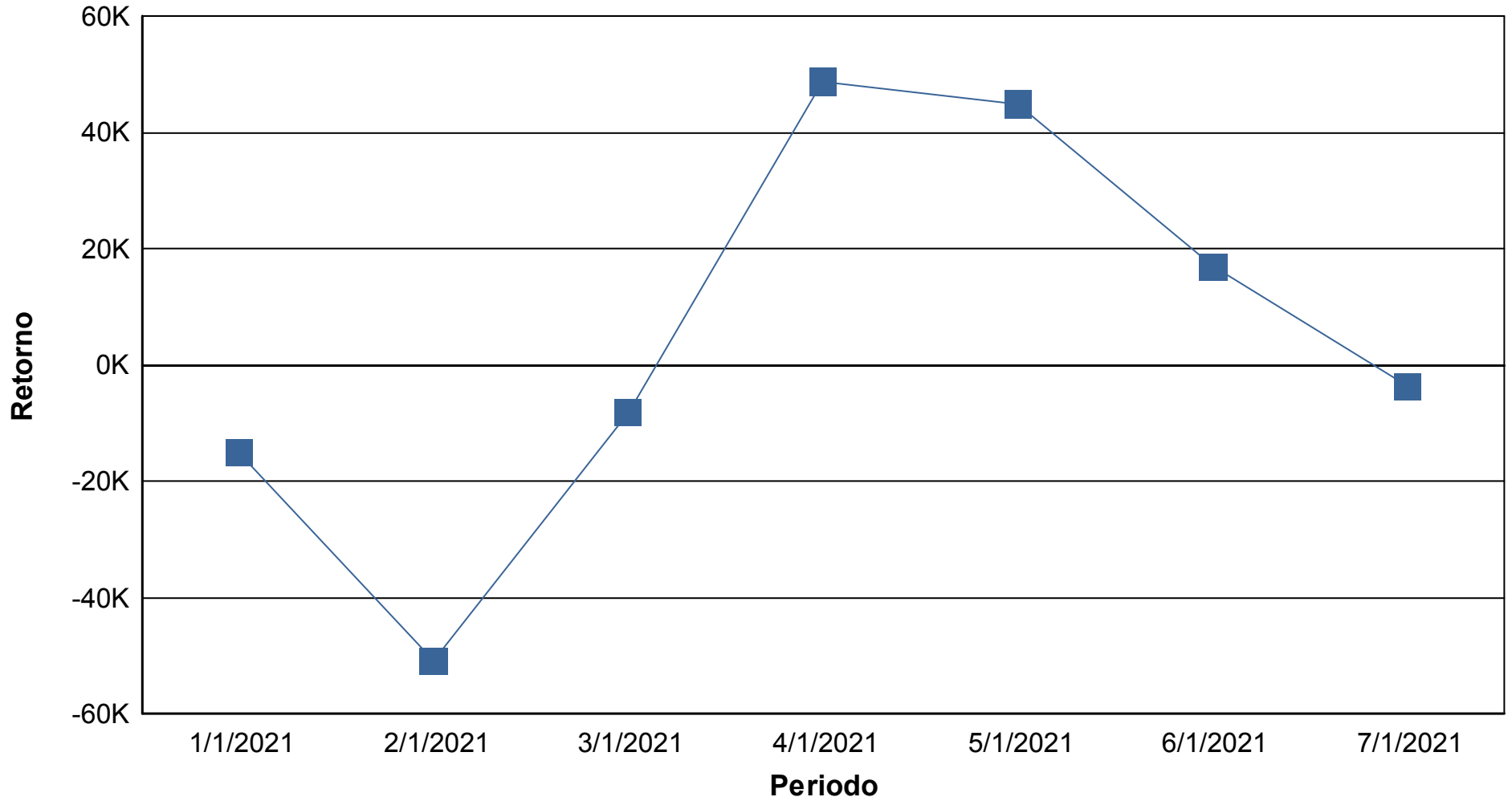


Evolução do patrimônio

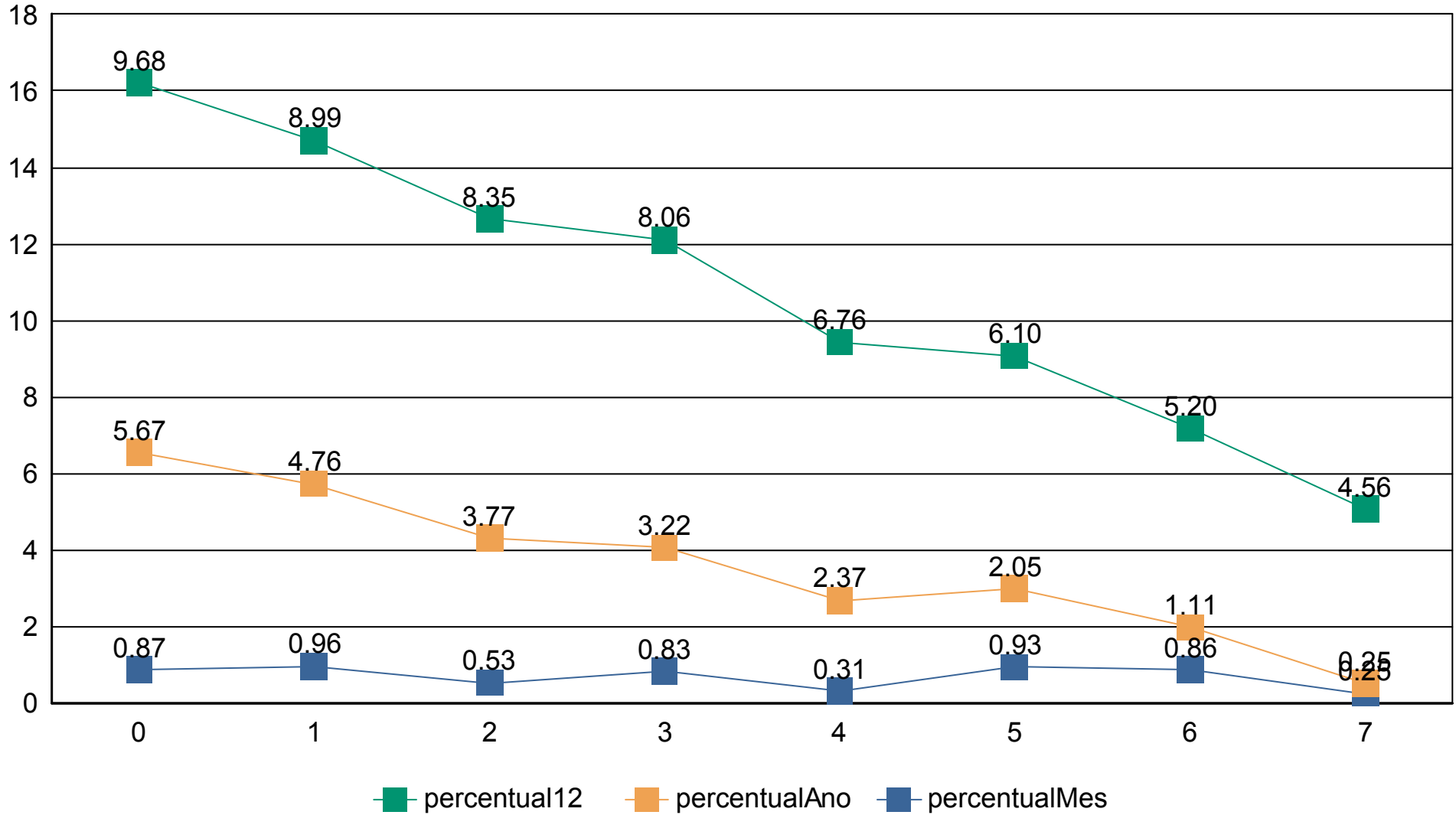




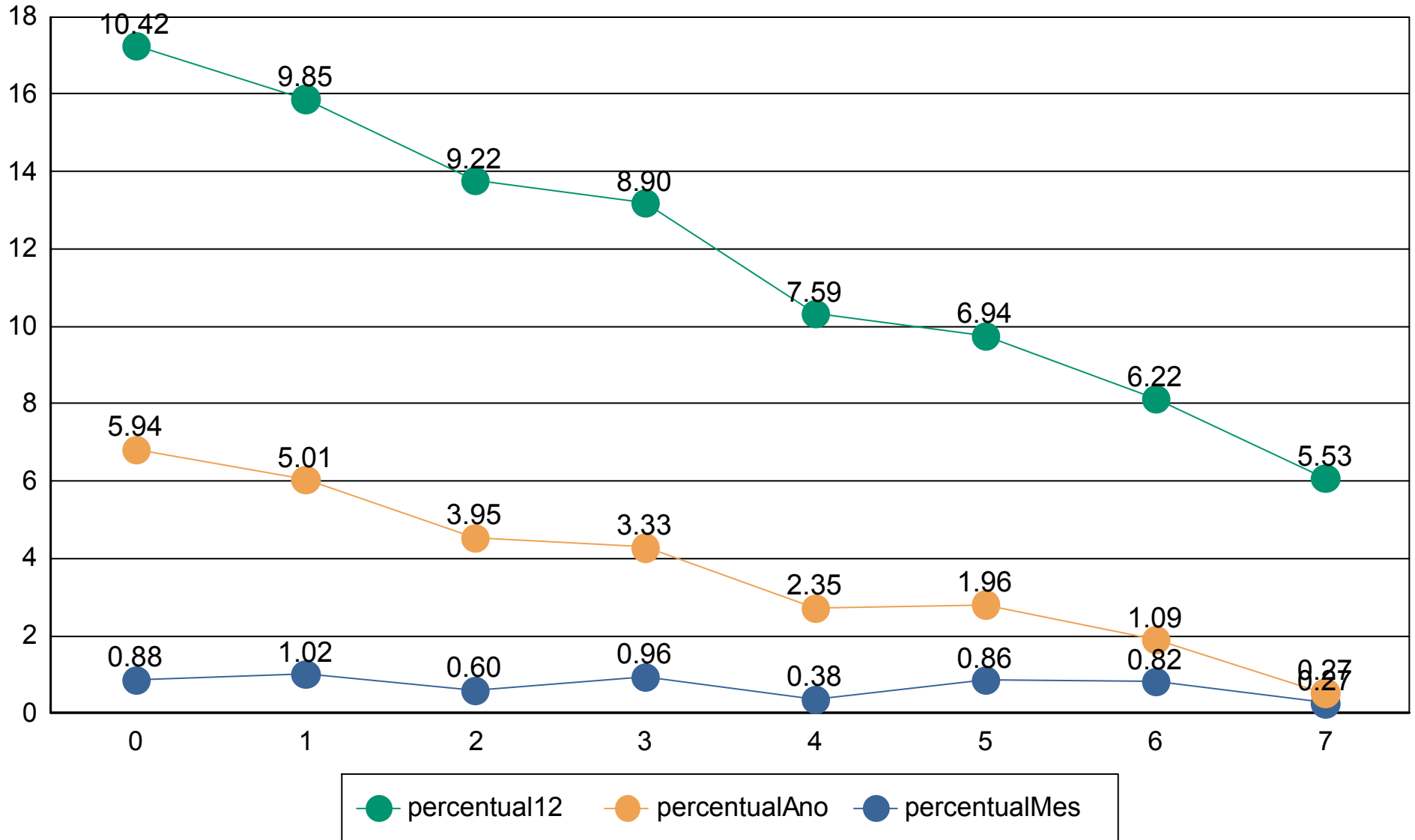
Retorno Mensal



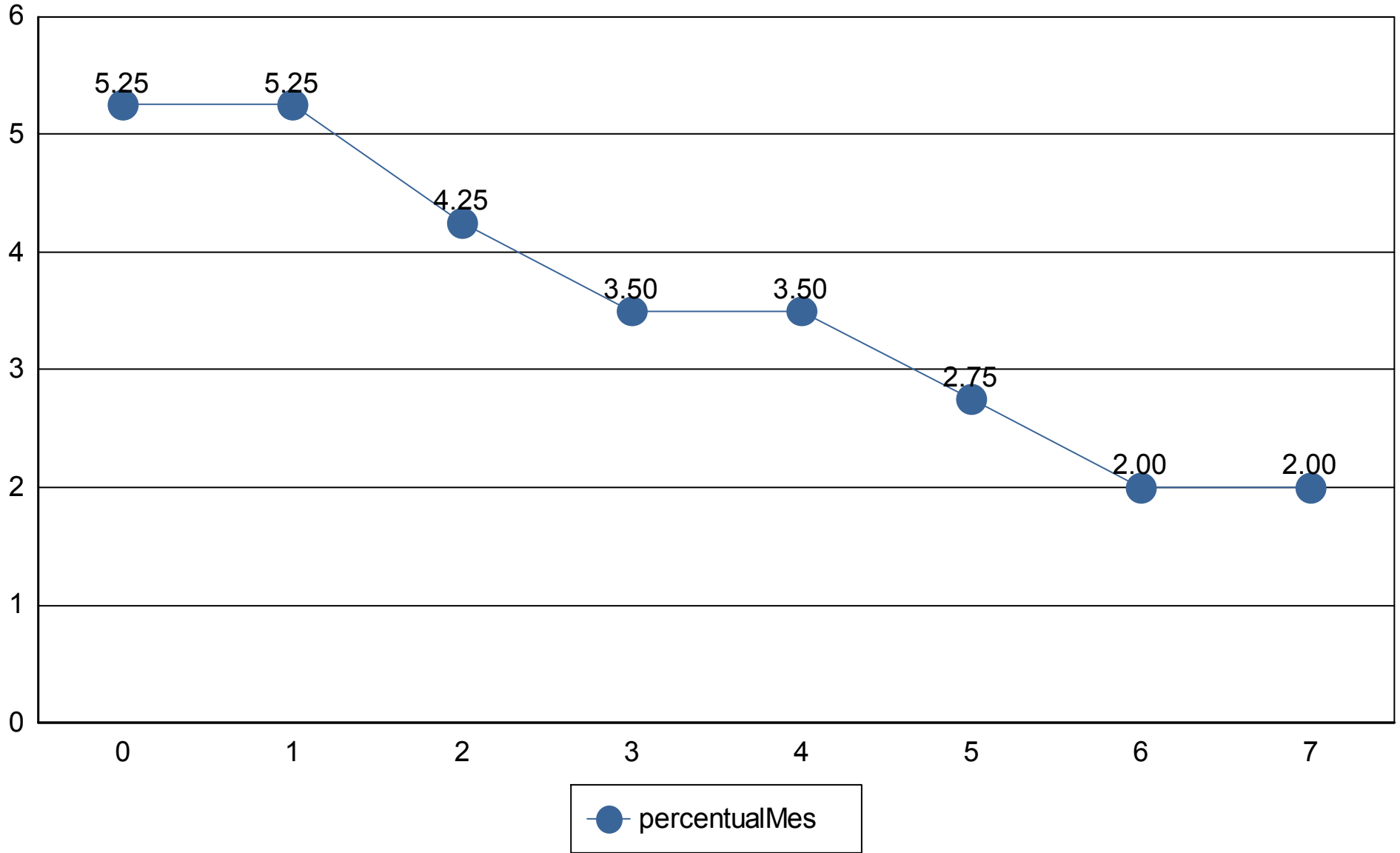
Índices Econômicos - IPCA



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
13.077.415/0001-05	BB PREV FLUXO RF SIMPLES FI EM COTAS DE FI	CDI	27,18%	0,00%	1,89%	3,74%	6,00%
07.861.554/0001-22	BB PREV RF IMA-B FI	IMA-B	7,80%	0,03%	1,84%	9,46%	35,54%
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	IRF-M 1	26,77%	0,00%	1,39%	3,59%	7,40%
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	IDKA 2	24,53%	0,00%	0,43%	9,56%	28,15%
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FI	CDI	27,35%	0,00%	2,93%	6,06%	11,43%
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FI EM COTAS DE FI	IMA-GERAL	4,39%	0,01%	1,00%	5,14%	15,64%
07.111.384/0001-69	BB PREV RF IRF-M TIT. PUB FI	IRF-M	-19,20%	0,01%	1,99%	4,35%	11,21%
35.292.588/0001-89	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FI EM CO	IPCA	7,36%	0,01%	0,45%	6,35%	19,73%
			106,16%	0,06%	11,90%	48,24%	135,10%

Provisão de risco - Mercado

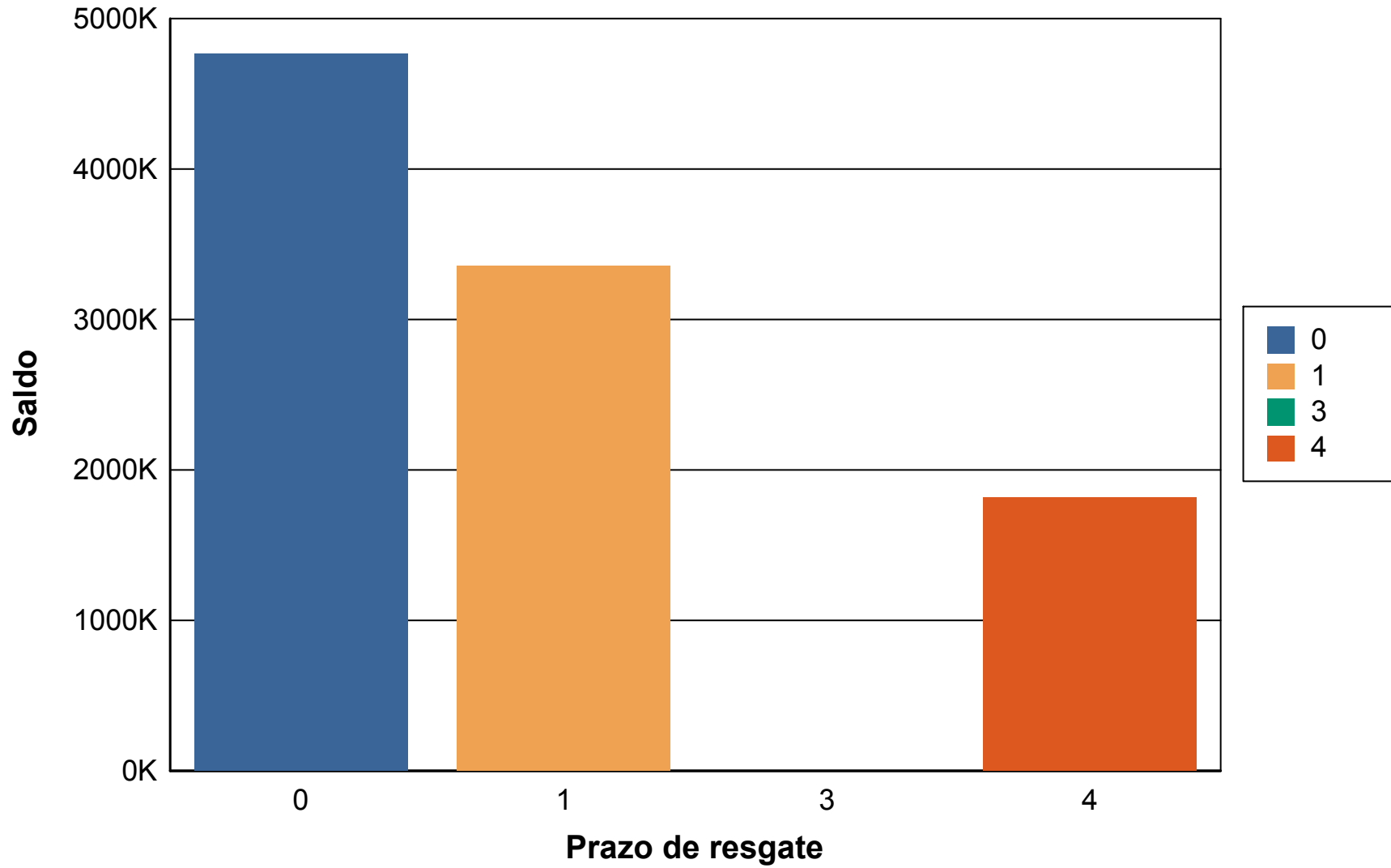
CNPJ	Nome do fundo	Benchmark	Saldo	VAR12	VOL12	VAR% BASE 1
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO C	CDI	R\$ 177.463,15	0,00%	6,00%	R\$ 0,09
25.078.994/0001-90	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO	IMA-GERAL	R\$ 1.812.296,13	0,01%	15,64%	R\$ 146,81
13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	IDKA 2	R\$ 1.858.352,45	0,00%	28,15%	R\$ 59,46
07.861.554/0001-22	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTI	IMA-B	R\$ 1.493.619,49	0,03%	35,54%	R\$ 465,42
07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	IRF-M	R\$ 997.409,26	0,01%	11,21%	R\$ 72,08
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICO	IRF-M 1	R\$ 1.864.948,43	0,00%	7,40%	R\$ 1,63
13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO	CDI	R\$ 1.717.332,49	0,00%	11,43%	R\$ 1,60

Saldo Total:	R\$ 9.921.421,40
Provisão para perda e Investimentos	R\$ 747,08
% Provisão de perda	0,01%
% Aceitavel perda	2%
Limite de utilização	0,38%



Nome do Fundo	Saldo	% Part.	N. Cotistas	% PL	PL do Fundo	Legislação	Grau risco	Prazo Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLE	R\$ 177.463,15	1,79%	804	0,01%	R\$ 2.426.969.840,99	Art 7º , IV "a"	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO AT	R\$ 1.812.296,13	18,27%	576	0,02%	R\$ 8.542.618.759,65	Art 7º, I, "b"	Alto	D+ 4
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO AT	R\$ 0,00	0,00%	590	0,00%	R\$ 4.514.432.008,56	Art 7º , IV "a"	Baixo	D+ 3
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULO	R\$ 1.858.352,45	18,73%	1,018	0,02%	R\$ 9.342.430.517,43	Art 7º, I, "b"	Médio	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO I	R\$ 1.493.619,49	15,05%	252	0,13%	R\$ 1.160.268.699,87	Art 7º , IV "a"	Médio	D+ 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS	R\$ 997.409,26	10,05%	575	0,02%	R\$ 5.408.321.815,86	Art 7º, I, "b"	Médio	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULC	R\$ 1.864.948,43	18,80%	1,139	0,03%	R\$ 6.886.684.706,17	Art 7º, I, "b"	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIAD	R\$ 1.717.332,49	17,31%	781	0,03%	R\$ 5.765.338.704,87	Art 7º , IV "a"	Baixo	D+ 0

Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
0	R\$ 4.757.153,33	4	47,95%
1	R\$ 3.351.971,94	2	33,79%
3	R\$ 0,00	1	0,00%
4	R\$ 1.812.296,13	1	18,27%



Risco Crédito

Legislação	Limite	Limite Política	Saldo	% Carteira
FI 100% títulos TN – 7º, I, b	100,00%	100,00%	R\$ 6.533.006,27	65,85
FI Renda Fixa – Geral – 7º, IV, a	40,00%	40,00%	R\$ 3.388.415,13	34,15

	Saldo	% Carteira
100% títulos públicos	8,227,213.84	82.92
50% Títulos públicos e 50% Títulos privados	1,694,207.57	17.08
100% títulos privados	0.00	0.00

Distribuição dos saldos

