



INSTITUTO DE PREVIDENCIA SOCIAL DOS SERVIDORES
PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO - IPREMON
COMITÊ DE INVESTIMENTO



ATA Nº 02/2021 COMITÊ DE INVESTIMENTO

Ata da Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos realizada no dia 05 de Fevereiro de 2021, às 11h:43min, na sede do Instituto de Previdência Social dos Servidores Público do Município de Monte Negro – IPREMON, situado a Avenida Governador Jorge Teixeira nº 2499.

Deu início a reunião ordinária do Comitê de Investimento, onde estiveram presentes os seguintes membros: Vinicius José de Oliveira Peres Almeida, Gestor do Comitê de Investimento, Marcio Juliano Borges Costa e Juliano Souza Guedes ambos pertencentes como membro do Comitê de Investimento, todos devidamente nomeados conforme portaria nº 468/GAB/2018 de 2018 de 13 de Junho de 2018. A convocação foi realizada mediante correspondência eletrônica enviada aos membros do Comitê de Investimento. Assumiu a presidência dos trabalhos o Sr. Vinicius José de Oliveira Peres Almeida, Gestor do Comitê de Investimento, trazendo como pauta dessa reunião o estudo da aplicação monetária do Instituto de Previdência Social dos Servidores Público do município de Monte Negro – IPREMON.

O ano de 2021 teve início com oscilações nos preços dos ativos em mercado. Depois de um final de ano em que os ativos de risco tiveram um desempenho positivo, o mês de janeiro ficou marcado pela correção dos preços na renda fixa e na renda variável (ações).

No cenário doméstico, a taxa de juro Selic se manteve em 2% ao ano. Contudo, a última Ata do COPOM (Comitê de Política Monetária) sinalizou a possibilidade de aumento nas taxas de juro ao longo deste ano. Tal movimento ocasionou oscilação nos preços, por conta dos ajustes em carteira disparados pelos gestores e analistas de mercado. A bolsa brasileira, representada pelo índice IBX, teve queda de -3,03% no mês. Os índices de renda fixa representados pelo IRF-M e pelo IMA-B tiveram retornos negativos de -0,8% e -0,85%, respectivamente.

No cenário externo, a bolsa norte-americana, representada pelo Índice S&P 500, também teve retorno negativo em janeiro de -1,11% O Real teve depreciação de 5,26%, com a cotação a R\$ 5,47 por dólar norte americano.

Para 2021 as projeções econômicas apontam para a recuperação das economias emergentes. O PIB tem estimativa de crescimento acima de 3% para 2021, com apostas num cenário de superação da Covid-19.

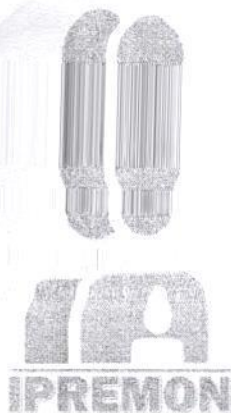
Em relação as expectativas de mercado para 2021, vide abaixo algumas estimativas:

ESTIMATIVAS DO RELATÓRIO FOCUS

PREVISÃO	2021
Produto Interno Bruto (PIB)	3,50%
Inflação	3,60%
Taxa básica de juros (Selic)	3,50%
Dólar	R\$ 5.01
Balança comercial (saldo)	US\$ 55 bilhões
Investimento estrangeiro direto	US\$ 60 bilhões

Fonte: Banco Central

1



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO - IPREMON

COMITÊ DE INVESTIMENTO



Índice de Referência (IPCA + 5,47% aa *) – Estimativa 2021	9,27% ao ano
Taxa de juro real máxima	

Índice de Referência (INPC + 4,00% aa) – Estimativa 2021	7,74% ao ano
--	--------------

A composição da dívida pública, incluindo os seus prazos de vencimento, a moeda que é emitida e os indexadores utilizados constituem fatores que contribuem para explicar a remuneração oferecida pelos títulos públicos federais.

O quadro a seguir captura o cenário de juros e indica que as taxas reais (descontada a inflação) estão acima de 3% ao ano nos títulos NTN-B (fundos IMA-B) nos vencimentos mais longos (vide terceira coluna da esquerda para a direita). A inflação projetada para o ano de 2021 está em 3,60%.

Prazo de Vencimento	Tipo de Fundo de Investimento	Taxa de juro REAL ao ano	Inflação projetada IPCA	Rentabilidade Total NOMINAL ao ano
15/05/2023	IMA-B	1,00%	3,60%	4,64%
15/08/2024	IMA-B 5	1,83%	3,60%	5,50%
15/08/2030	IMA-B 5+	3,09%	3,60%	6,80%
15/05/2055	IMA-B 5+	3,94%	3,60%	7,68%

Fonte: ANBIMA

De acordo com o quadro abaixo, os fundos da família IRF-M (Pré-Fixados) operam abaixo do índice de referência (meta atuarial) nos vencimentos para 2022 a 2024.

Vencimento	Tipo de Fundo de Investimento	Rentabilidade Total ao ano
2022	IRF-M 1	4,74%
2023	IRF-M	5,54%
2024	IRF-M 1 +	6,28%

Fonte: ANBIMA

Neste cenário, a alocação dos recursos está com o seguinte indicativo:

a) **RENDA FIXA:** deve estar centrada **TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS**. Fundos da família IRF-M estão com taxas de juros médias aproximadas entre 4,74% e 6,28% ao ano. Fundos da família IRF-M, IRF-M 1+ e IMA-B 5+ capturam taxas de juro mais elevadas, apesar de estarem sujeitos a oscilações. Os fundos CDI (referenciados) e IRF-M1 (hum) estão rodando bem abaixo do índice de referência, apesar de apresentarem estabilidade de retornos.

b) **RENDA VARIÁVEL (AÇÕES):** o mercado de renda variável pode apresentar uma janela de oportunidades para compras de ações, desde que efetuadas de forma ordenada, com estratégias distintas, formando diversificação de carteira. Importante manter posição no segmento, pois a taxa de juros SELIC deve se manter em patamar baixo ao longo do próximo ano. Fundos Multimercados (com renda variável) também surgem como boa alternativa. As expectativas, doravante, ficam por conta do controle da pandemia e da retomada da atividade econômica.

c) **EXTERIOR:** Em cenário de taxa de câmbio elevada, aplicações no segmento



INSTITUTO DE PREVIDENCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO - IPREMON COMITÊ DE INVESTIMENTO



RELATÓRIO DE MERCADO

- Relatório da DI BLASI Consultoria Financeira conforme fonte:
<https://liasys.net/relatorio-dinamico/100> (Anexo)

CONSIDERAÇÕES FINAIS

Finalizando a reunião, foi dada a oportunidade para quaisquer outros esclarecimentos, e não havendo mais nada a tratar, o Gestor do Comitê de Investimento agradeceu a todos pela presença e declarou encerrada a reunião do Comitê de Investimento do Instituto de Previdência Social dos Servidores Públicos do Município de Monte Negro – IPREMON. Para constar eu, Vinicius José de Oliveira Peres Almeida, lavrei a presente ata, e depois de lida e aprovada será assinadas por todos os presentes.

Monte Negro 08 de Fevereiro de 2021

Marcio Juliano Borges Costa
Membro do Comitê de Investimento

Juliano Souza Guedes
Membro do Comitê de Investimento


Vinicius José de Oliveira Peres Almeida
Gestor do Comitê de Investimento



RELATÓRIO DE COMPETÊNCIA (ANEXO)



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES
PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO**
January 2021





DI BLASI
Consultoria Financeira

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO
CNPJ: 84.645.928/0001-13

Visão geral da carteira

CNPJ	Nome do Fundo	Tipo	Grau de Risco	Benchmark	Saldo	N. Cotistas	Prazo Resgate
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLI	Fundo de Investimento	B	CDI	R\$ 81.572,75	757	0
13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLI	Fundo de Investimento	B	CDI	R\$ 15.173,62	757	0
07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF	Fundo de Investimento	M	IRF-M	R\$ 3.652.920,29	697	0
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF	Fundo de Investimento	B	IRF-M 1	R\$ 3.148.113,29	1.213	0
24.022.566/0001-82	BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENT	Fundo de Investimento	A	IDKA 2	R\$ 1.239.087,03	121	1
11.484.558/0001-06	BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENT	Fundo de Investimento	B	IRF-M 1	R\$ 1.623.639,23	262	
14.386.926/0001-71	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BR	Fundo de Investimento	B	IDKA 2	R\$ 3.481.616,26	1.003	0
10.577.503/0001-88	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BR	Fundo de Investimento	M	IMA-B 5+	R\$ 1.211.996,70	320	0
11.080.913/0001-10	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BR	Fundo de Investimento	M	IMA-B 5	R\$ 1.170.019,78	978	0
10.740.658/0001-93	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BR	Fundo de Investimento	M	IMA-B	R\$ 1.098.380,27	899	0
10.740.670/0001-06	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BR	Fundo de Investimento	B	IRF-M 1	R\$ 3.201.885,69	1.348	0
10.577.519/0001-90	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BR	Fundo de Investimento	M	IRF-M 1+	R\$ 756.091,68	374	1
23.215.097/0001-55	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	Fundo de Investimento	M	IMA-GERAL	R\$ 1.193.908,57	893	1

R\$ 21.874.405,15





DI BLASI
Consultoria Financeira

Cliente:
CNPJ:

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO
84.645.928/0001-13

Retorno do mês

Fundo	Saldo Inicial	Aplicações	Resgates	Saldo Final	Rentabilidade	Efetivo	Bench.
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO F	R\$ 2.097,96	R\$ 53.998,58	R\$ 40.873,11	R\$ 15.173,62	R\$ 10,19	0,004855	CDI
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO F	R\$ 0	R\$ 368.174,35	R\$ 284.622,39	R\$ 81.572,75	R\$ 20,79	0,000255	CDI
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REI	R\$ 1.623.173,06			R\$ 1.623.639,23	R\$ 466,17	0,000287	IRF-M 1
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1	R\$ 3.167.136,09		R\$ 20.000,00	R\$ 3.148.113,29	R\$ 977,20	0,000309	IRF-M 1
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL II	R\$ 3.201.078,38			R\$ 3.201.985,69	R\$ 807,31	0,000252	IRF-M 1
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL II	R\$ 766.737,94			R\$ 756.091,68	R\$ -10.646,26	-0,013885	IRF-M 1+
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+	R\$ 3.480.939,97	R\$ 300.000,00	R\$ 100.000,00	R\$ 3.682.920,29	R\$ -28.019,68	-0,008049	IRF-M
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL II	R\$ 1.169.046,55			R\$ 1.170.019,78	R\$ 973,23	0,000832	IMA-B 5
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL II	R\$ 1.232.913,39			R\$ 1.211.996,70	R\$ -20.916,69	-0,016965	IMA-B 5+
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL II	R\$ 1.108.047,82			R\$ 1.096.380,27	R\$ -9.667,55	-0,008725	IMA-B
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE F	R\$ 1.193.606,69			R\$ 1.193.908,57	R\$ 301,88	0,000253	IMA-GERAL
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL II	R\$ 3.476.970,47			R\$ 3.481.616,26	R\$ 4.645,79	0,001336	IDKA 2
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REI	R\$ 1.249.640,80			R\$ 1.239.087,03	R\$ -10.553,77	-0,008445	IDKA 2





DI BLASI
Consultoria e Engenharia

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO
CNPJ: 84.645.928/0001-13

Enquadramentos

Identificação

FI 100% títulos TN - 7º, I, b

Saldo do grupo: R\$ 21.777.658,78

Fundo		% Carteira			99,56%			Limites			Situação
		Saldo	N. Cotas	% PL	% Carteira			Lim. Res.	Lim. Pol.	Lim. CNPJ	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIM		R\$ 1.193.908,57	788,188.52	0,01%	5,46%			100,00%	15,00%	20%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PUBL		R\$ 756.091,88	296,132.60	0,03%	3,46%			100,00%	15,00%	20%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PUBL		R\$ 3.201.885,69	1,225,050.73	0,02%	14,64%			100,00%	15,00%	20%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PUBLIC		R\$ 1.098.380,27	299,954.91	0,02%	5,02%			100,00%	15,00%	20%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PUB		R\$ 1.211.996,70	438,477.40	0,07%	5,54%			100,00%	15,00%	20%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PUBL		R\$ 1.170.019,78	362,064.62	0,01%	5,35%			100,00%	15,00%	20%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS		R\$ 3.481.616,26	1,450,449.83	0,03%	15,92%			100,00%	15,00%	20%	Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUN		R\$ 3.652.920,29	598,953.02	0,04%	16,70%			100,00%	15,00%	20%	Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FI		R\$ 3.148.113,29	1,154,854.58	0,04%	14,39%			100,00%	15,00%	20%	Enquadrado





Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO
CNPJ: 84.645.928/0001-13

BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2	R\$ 1.239.087,03	738.201,64	0,19%	5,66%	Lim Res: 100,00% Lim Pol: 15,00% Lim CNPJ: 20% Lim PL: 0,19%	Enquadrado
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRE-M 1 TITL	R\$ 1.623.639,23	630.219,92	0,19%	7,42%	Lim Res: 100,00% Lim Pol: 15,00% Lim CNPJ: 20% Lim PL: 0,19%	Enquadrado

FJ Renda Fixa - Geral - 7º, IV, a

% Carteira: 0,44% Saldo do grupo: R\$ 96.746,36

Fundo	Saldo	N. Cotas	% PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIME	R\$ 15.173,62	7.171,22	0,00%	0,07%	Lim Res: 40,00% Lim Pol: 15,00% Lim CNPJ: 20% Lim PL: 0,00%	Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIME	R\$ 81.572,75	38.552,20	0,00%	0,37%	Lim Res: 40,00% Lim Pol: 15,00% Lim CNPJ: 20% Lim PL: 0,00%	Enquadrado





DI BLASI
Consultoria Financeira

Cliente:
CNPJ 84.645.928/0001-13

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO

Enquadramento por Benchmark

CDI

% Carteira: 0,44%

Saldo do grupo: R\$ 95.745,36

Nome do fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIM	R\$ 15.173,62	7.171,22	0,00	0,07	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIM	R\$ 81.572,75	38.552,20	0,00	0,37	Lim. Res.: 40,00% Lim. Pol.: 40,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IDKA 2

% Carteira: 21,58%

Saldo do grupo: R\$ 4.720.703,29

Nome do fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULO:	R\$ 3.481.616,26	1.450.449,83	0,03	15,92	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado
BRADERCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2	R\$ 1.239.087,03	738.201,64	0,19	5,66	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IMA-B

% Carteira: 5,02%

Saldo do grupo: R\$ 1.098.380,27

Nome do fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TITULOS PUBL	R\$ 1.098.380,27	299.954,91	0,02	5,02	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IMA-B 5

% Carteira: 5,35%

Saldo do grupo: R\$ 1.170.019,78

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





Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO
CNPJ: 84.645.928/0001-13

FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PUE	R\$ 1.170.019,78	352,064,62	0,01	5,35	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado
--	------------------	------------	------	------	---	------------

IMA-B 5+

% Carteira: 5,54%

Saldo do grupo: R\$ 1.211.996,70

Nome do fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PU	R\$ 1.211.996,70	438,477,40	0,07	5,54	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IMA-GERAL

% Carteira: 5,46%

Saldo do grupo: R\$ 1.193.908,57

Nome do fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTI	R\$ 1.193.908,57	788,188,52	0,01	5,46	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IRF-M

% Carteira: 16,70%

Saldo do grupo: R\$ 3.652.920,29

Nome do fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FL	R\$ 3.652.920,29	598,953,02	0,04	16,70	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado

IRF-M 1

% Carteira: 36,45%

Saldo do grupo: R\$ 7.973.638,21

Nome do fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PUE	R\$ 3.201.865,69	1,225,050,73	0,02	14,64	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS F	R\$ 3.148.113,29	1,154,854,58	0,04	14,39	Lim. Res.: 100,00% Lim. Pol.: 100,00% Lim. CNPJ: 20% Lim. PL: 15,00%	Enquadrado





Cliente: INSTITUTO DE PREVIDENCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PUBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO
CNPJ: 84.645.928/0001-13

BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M 1 TIT	R\$ 1.623.639,23	630,219,92	0,19	7,42	Lim. Res. 100,00% Lim. Pol. 100,00% Lim. CNPJ 20% Lim. PL 15,00%	Enquadrado
---	------------------	------------	------	------	---	------------

IRF-M 1+

% Carteira: 3,46%

Saldo do grupo: R\$ 756.091,68

Nome do fundo	Saldo	Saldo cotas	%PL	% Carteira	Limites	Situação
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PU	R\$ 756.091,68	296.132,60	0,03	3,46	Lim. Res. 100,00% Lim. Pol. 100,00% Lim. CNPJ 20% Lim. PL 15,00%	Enquadrado



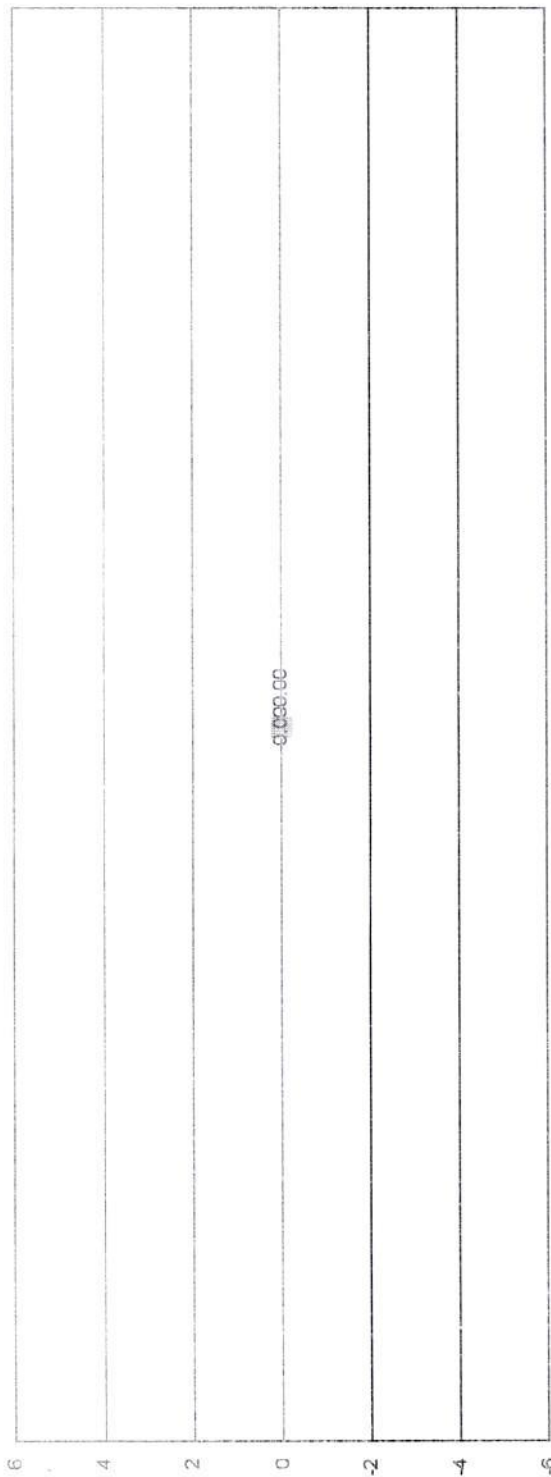


Cliente: INSTITUTO DE PREVIDENCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO
CNPJ: 84.645.928/0001-13

Retorno acumulado no ano

Período	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno R\$	Retorno %	Meta	Atingimento
January	R\$ 21.671.389,12	R\$ 720.112,93	R\$ 445.495,50	R\$ 21.874.405,15	-R\$ 71.601,40	0,00%	0,00%	0,00

Meta x Atingimento



1/1/2021

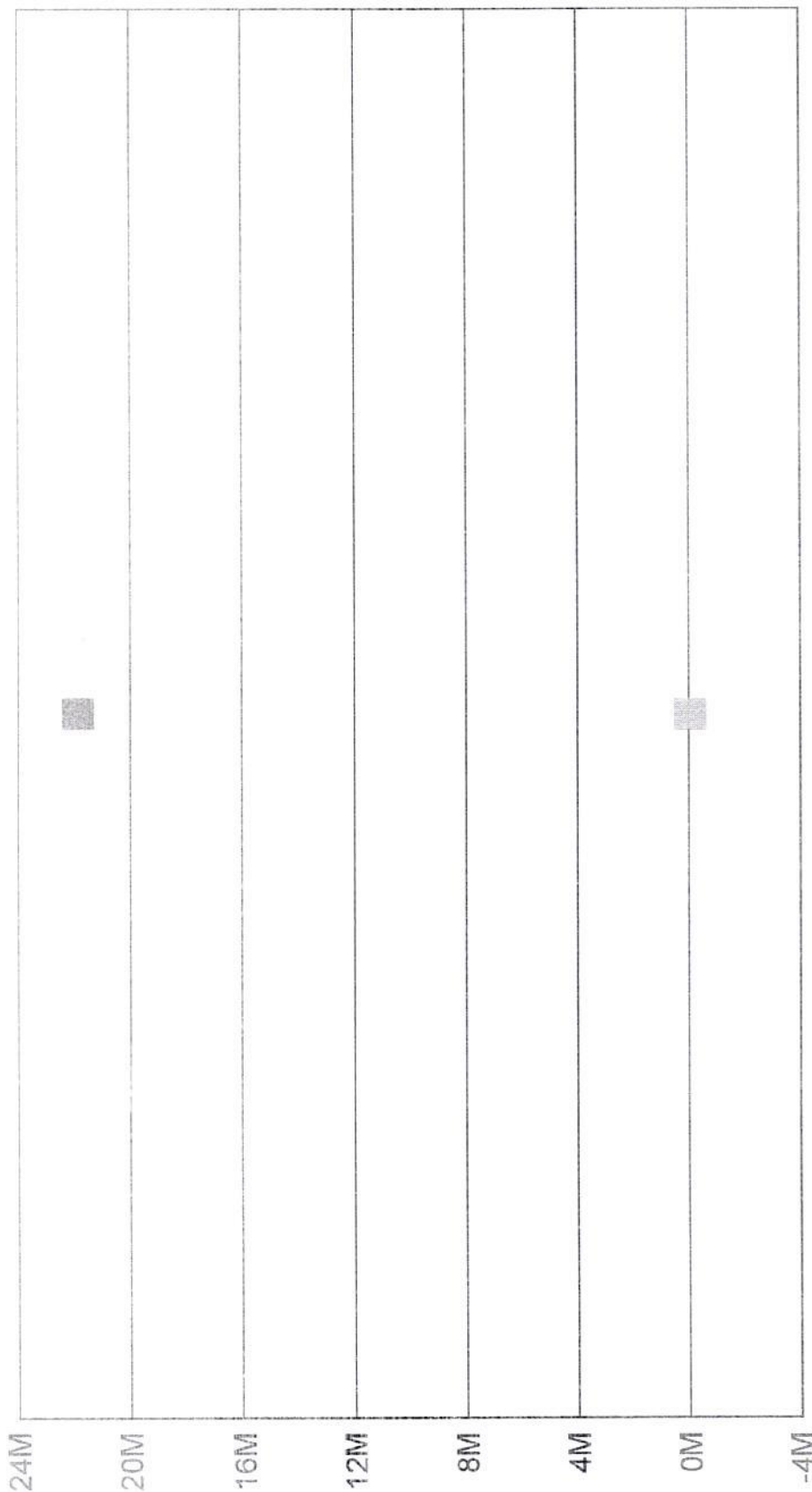




DI BLASI
Consultoria Financeira

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO
CNPJ: 84.645.928/0001-13

Evolução do patrimônio



■ Sum of saldoAtual ■ Sum of retorno

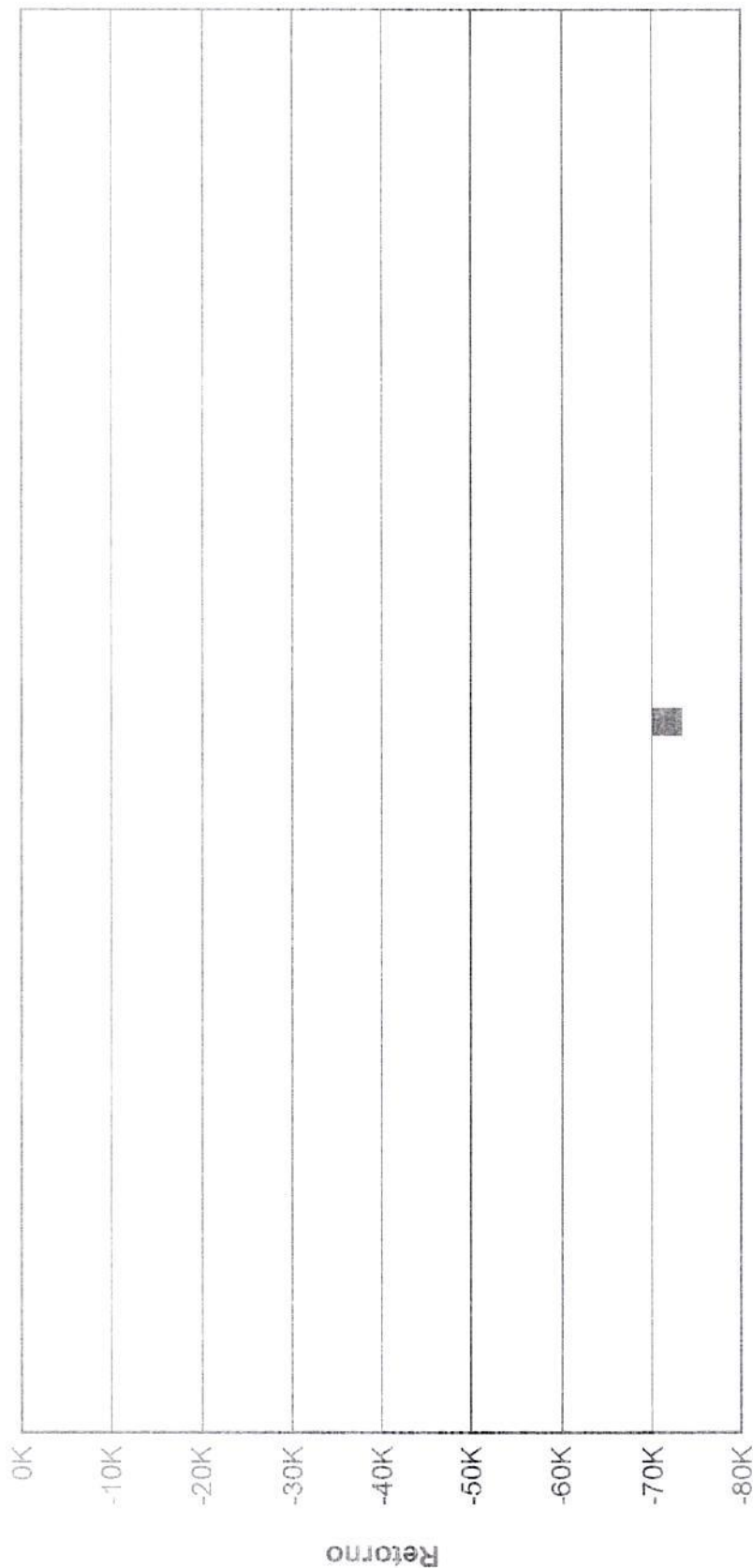




DI BLASI
Consultoria Financeira

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDENCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO
CNPJ: 84.645.928/0001-13

Retorno Mensal





DI BLASI
Consultoria Financeira

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO
CNPJ: 84.645.928/0001-13

Índices Econômicos - IPCA





DI BLASI
Consultoria Financeira

Ciente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO
CNPJ: 84.645.928/0001-13

Índices Econômicos - INPC





DI BLASI
Consultoria Financeira

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO
CNPJ: 84.645.928/0001-13

Índices Econômicos - SELIC





DI BLASI
Consultoria Financeira

Cliente:
CNPJ:

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO
84.645.928/0001-13

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 emissores 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 do fundo	Benchmark	Sharpe	VAR	VOL3	VOL6	VOL12

Provisão de risco - Mercado

CNPJ	Nome do fundo	Benchmark	Saldo	VAR12	VOL12	VAR% BASE 1

Saldo Total:	
Provisão para perda e investimentos	
% Provisão de perda	
% Aceitável perda	2%
Limite de utilização	



Nome do Fundo	Saldo	% Part.	N. Cotistas	% PL	PL do Fundo	Legislação	Grau risco	Prazo Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDC	R\$ 81.572,75	0,37%	757	0,00%	R\$ 2.849.785.990,61	Art 7º, IV "a"	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDC	R\$ 15.173,62	0,07%	757	0,00%	R\$ 2.849.785.990,61	Art 7º, IV "a"	Baixo	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS	R\$ 3.652.920,29	16,70%	697	0,04%	R\$ 8.554.179.050,63	Art 7º, I "b"	Médio	D+ 0
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS	R\$ 3.148.113,29	14,39%	1.213	0,04%	R\$ 8.234.435.809,83	Art 7º, I "b"	Baixo	D+ 0
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FI	R\$ 1.239.087,03	5,66%	121	0,19%	R\$ 641.831.921,75	Art 7º, I "b"	Alto	D+ 1
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FI	R\$ 1.623.639,23	7,42%	262	0,19%	R\$ 841.943.584,13	Art 7º, I "b"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKAI P	R\$ 3.481.616,26	15,92%	1.003	0,03%	R\$ 10.619.179.611,85	Art 7º, I "b"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5	R\$ 1.211.996,70	5,54%	320	0,07%	R\$ 1.727.687.146,55	Art 7º, I "b"	Médio	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5	R\$ 1.170.019,78	5,35%	978	0,01%	R\$ 20.598.446.982,04	Art 7º, I "b"	Médio	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 1	R\$ 1.098.380,27	5,02%	893	0,02%	R\$ 6.157.829.130,75	Art 7º, I "b"	Médio	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1	R\$ 3.201.885,69	14,64%	1.348	0,02%	R\$ 16.497.362.164,50	Art 7º, I "b"	Baixo	D+ 0
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1	R\$ 756.091,68	3,46%	374	0,03%	R\$ 2.811.803.095,13	Art 7º, I "b"	Médio	D+ 1
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDC	R\$ 1.193.908,57	5,46%	893	0,01%	R\$ 14.709.432.867,03	Art 7º, I "b"	Médio	D+ 1

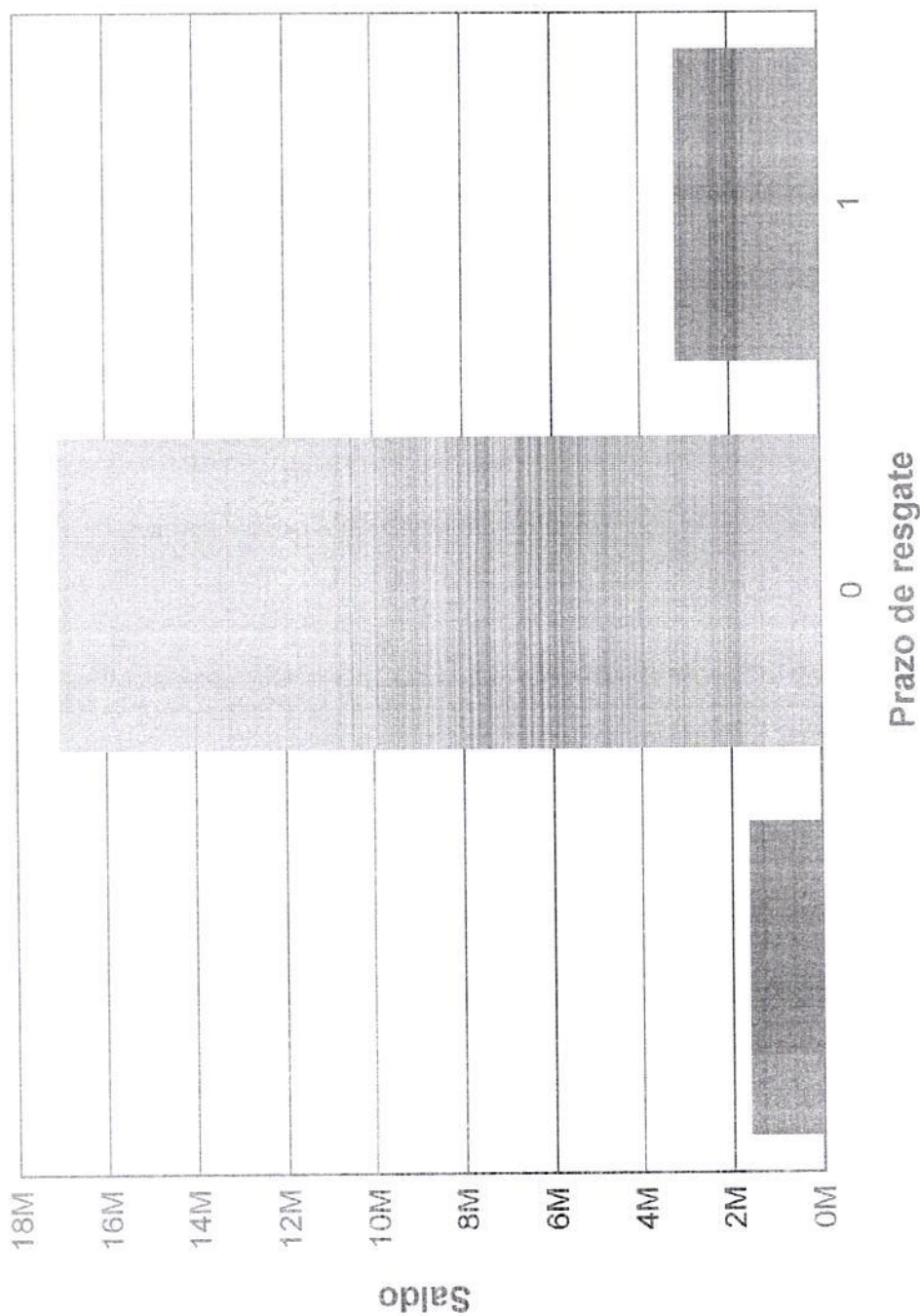
Prazo Resgate	Saldo	N. Fundo	% Carteira
0	R\$ 1.623.639,23	1	7,42%
1	R\$ 17.061.678,64	9	78,00%
1	R\$ 3.189.087,27	3	14,58%



DI BLASI
Consultoria Financeira

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO
CNPJ: 84.645.928/0001-13

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO





DI BLASI
Consultoria Financeira

Cliente:
CNPJ:

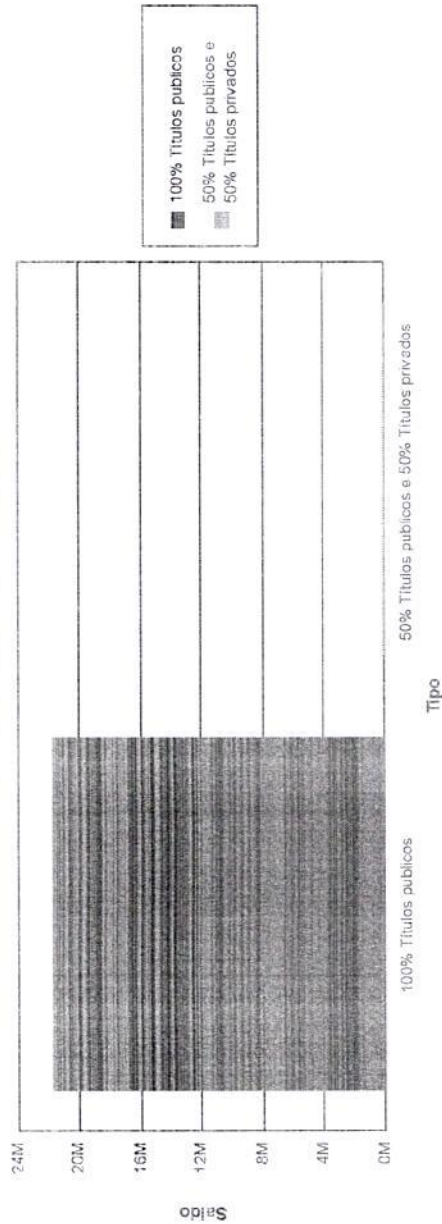
INSTITUTO DE PREVIDENCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MONTE NEGRO
84.645.928/0001-13

Risco Crédito

Legislação	Limite	Limite Política	Saldo	% Carteira
FI 100% títulos TN - 7ª I, b	100,00%	100,00%	R\$ 21.777.658,78	99,56
FI Renda Fixa - Geral - 7ª IV, a	40,00%	40,00%	R\$ 96.745,36	0,44

	Saldo	% Carteira
100% títulos públicos	21.826.031,97	99,78
50% Títulos públicos e 50% Títulos privados	48.373,18	0,22
100% títulos privados	0,00	0,00

Distribuição dos saídos



Assinatura

