



Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Vitória
Relatório Semestral de Diligências dos Fundos – 2021 2º Semestre

Relatório Semestral de Diligências dos Fundos – 2021 2º Semestre



Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Vitória
Relatório Semestral de Diligências dos Fundos – 2021 2º Semestre

SUMÁRIO

1. COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR ATIVOS	1
.....	
2. EVOLUÇÃO PATRIMONIAL	3
.....	
3. ALOCAÇÕES DOS ATIVOS POR SEGMENTO	2
.....	
4. DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR SEGMENTO CONFORME A RESOLUÇÃO	6
.....	
4.1 Alocação por artigo	6
.....	
4.2 Alocação por estratégia.	6
.....	
5. ANEXOS - ANÁLISES DOS FUNDOS	7 a 84
.....	
6. ANEXOS – RISCO DISPERSAO DOS FUNDOS	85 a 97
.....	
7. ANEXOS – INDEXADORES	98 a 101
.....	



Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Vitória
Relatório Semestral de Diligências dos Fundos – 2021 2º Semestre

1. COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR ATIVOS

		Saldo de fundos por CNPJ do ativo			PL	Total aplicado / Patrimônio do fundo	Plano Financeiro	Plano Previdenciário
RENDA FIXA	Art. 7º - inc. I "a"	TÍTULOS PÚBLICOS XP INVESTIMENTOS	02.332.886/0001-04	61.581.519,79	0,00	-	2,20%	5,70%
	Art. 7º - inc. I "a"	TÍTULOS PÚBLICOS GENIAL INSTITUCIONAL	27.652.684/0001-62	9.683.773,62	0,00	-	0,37%	0,88%
	Art. 7º - inc. I "b"	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5	03.543.447/0001-03	104.999.415,17	6.334.560.730,61	1,66%	1,34%	0,32%
	Art. 7º - inc. I "b"	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RENDA FIXA	09.594.596/0001-70	9.354.595,28	205.185.588,32	4,56%	4,56%	0,00%
	Art. 7º - inc. I "b"	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	103.373,11	6.377.941.010,36	0,00%	0,00%	0,00%
	Art. 7º - inc. I "b"	CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.060.913/0001-10	121.577.459,80	11.929.906.744,63	1,02%	0,74%	0,28%
	Art. 7º - inc. I "b"	CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PUBLICOS RENDA FIXA	18.598.288/0001-03	6.888.412,00	456.351.238,07	1,51%	0,00%	1,51%
	Art. 7º - inc. I "b"	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I	19.303.793/0001-46	9.988.179,89	521.561.604,76	1,92%	1,92%	0,00%
	Art. 7º - inc. I "b"	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII	19.523.305/0001-06	868.939,57	246.600.638,26	0,35%	0,00%	0,35%
	Art. 7º - inc. I "b"	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOC						



Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Vitória
Relatório Semestral de Diligências dos Fundos – 2021 2º Semestre

	Saldo de fundos por CNPJ do ativo				PL	Total aplicado / Patrimônio do fundo	Plano Financeiro	Plano Previdenciário
REDA VARIÁVEL	Art. 8º - inc. II, "a"	BANESTES FIC FIA ABSOLUTO BTG PACTUAL	08.018.849/0001-02	16.032.367,05	163.580.355,20	9,80%	0,00%	9,80%
	Art. 8º - inc. II "a"	CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	15.154.441/0001-15	8.460.125,01	935.667.426,61	0,90%	0,90%	0,00%
	Art. 8º - inc. II "a"	CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	30.068.224/0001-04	8.186.036,92	822.161.736,23	1,00%	0,00%	1,00%
	Art. 8º - inc. II "a"	BRABESCO - OCCAM FIC FIA	11.628.883/0001-03	9.690.716,40	981.231.017,58	0,99%	0,00%	0,99%
	Art. 8º - inc. II "a"	BRABESCO - VINCI FATORIAL DINAMICO FIA	23.875.817/0001-09	13.558.991,11	164.213.976,42	8,26%	6,26%	2,00%
	Art. 8º - inc. II "a"	BRABESCO - AZ QUEST SMALL MID CAPS	11.392.165/0001-72	25.855.302,51	2.748.901.583,32	0,94%	1,50%	0,38%
	Art. 8º - inc. II "a"	DAYCOVAL - TARPON GT 30 FIC AÇÕES	35.726.741/0001-39	14.768.116,34	314.117.814,39	4,70%	3,55%	1,15%
	Art. 8º - inc. II "a"	DAYCOVAL - GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC DE FIA	38.280.883/0001-03	5.625.692,67	93.973.193,66	5,99%	5,03%	0,95%
	Art. 8º - inc. III							



Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Vitória
Relatório Semestral de Diligências dos Fundos – 2021 2º Semestre

2. EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

Percebemos que no decorrer dos anos há um crescimento contínuo e com curvatura evolutiva sem períodos contínuos de declínio. Houve, devido ao momento econômico com péssimo desempenho, uma baixa do patrimônio líquido ainda no primeiro trimestre de 2021. Do segundo trimestre em diante, percebemos uma retomada no crescimento do patrimônio líquido.





Instituto de Previdência e Assistência dos Servidores do Município de Vitória
Relatório Semestral de Diligências dos Fundos – 2021 2º Semestre

3. ALOCAÇÕES DOS ATIVOS POR SEGMENTO

Dentro de uma carteira de investimentos, uma das melhores formas de tentar mitigar o risco de mercado é a diversificação. Dessa forma, o Comitê de Investimentos sempre buscar diversificar, dentro das possibilidades previstas na Resolução 3.922/2010 e do que o mercado oferece.

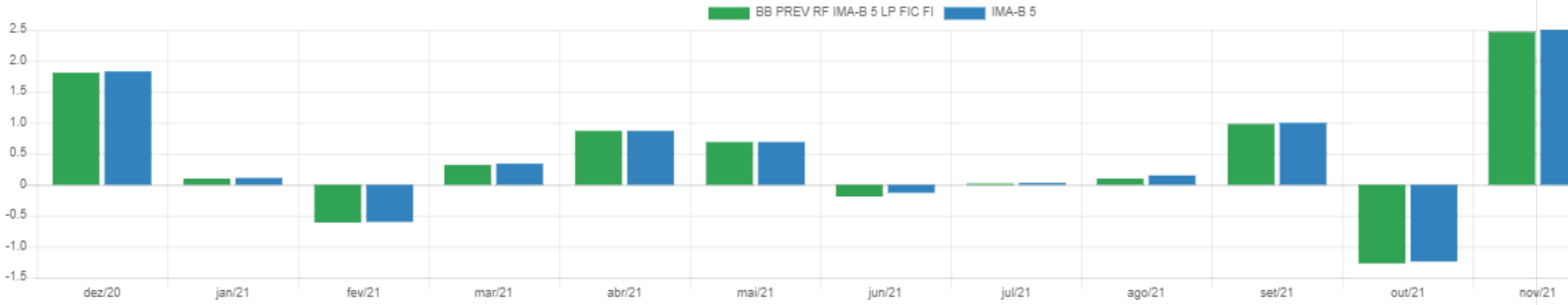
RENDA FIXA						65,82%
Artigo 7º I, Alinea a						
Saldo de fundos por CNPJ do ativo	CNPJ	Valor aplicado	% Carteira	PL	% Fundo	
TÍTULOS PÚBLICOS XP INVESTIMENTOS	02.332.886/0001-04	61.581.519,79	7,90%	0,00	#DIV/0!	
TÍTULOS PÚBLICOS GENIAL INSTITUCIONAL	27.652.684/0001-62	9.683.773,62	1,24%	0,00	#DIV/0!	
Sub-total		71.265.293,41	9,15%			
Artigo 7º I, Alinea b						
Saldo de fundos por CNPJ do ativo	CNPJ	Valor aplicado	% Carteira	PL	% Fundo	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5	03.543.447/0001-03	104.999.415,17	13,48%	6.334.560.730,61	1,66%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M	07.111.384/0001-69	0,00	0,00%	4.900.044.382,84	0,00%	
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RENDA FIXA	09.594.596/0001-70	9.354.595,28	1,20%	205.185.588,32	4,56%	
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LONGO PRAZO	10.740.658/0001-93	0,00	0,00%	4.821.319.332,60	0,00%	
CAIXA BRASIL IR						





	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	IMA-B TOTAL	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - IMA-B TOTAL	36	43,37	03 meses	-0,92	1,06	-1,98	14,58
Meses abaixo - IMA-B TOTAL	47	56,63	06 meses	-6,81	-0,55	-6,26	12,93
			12 meses	-10,71	-1,26	-9,45	11,65
			24 meses	-8,41	5,06	-13,47	20,94
Maior rentabilidade da Carteira	13,47	2018-10	36 meses	21,63	29,17	-7,54	18,18
Menor rentabilidade da Carteira	-14,39	2020-03	48 meses	36,32	46,04	-9,72	16,57
			60 meses	45,27	64,72	-19,46	17,00
			Desde 14/01/2015	79,15	119,71	-40,56	16,86

RENTABILIDADES MENSAIS - 12 ÚLTIMOS MESES



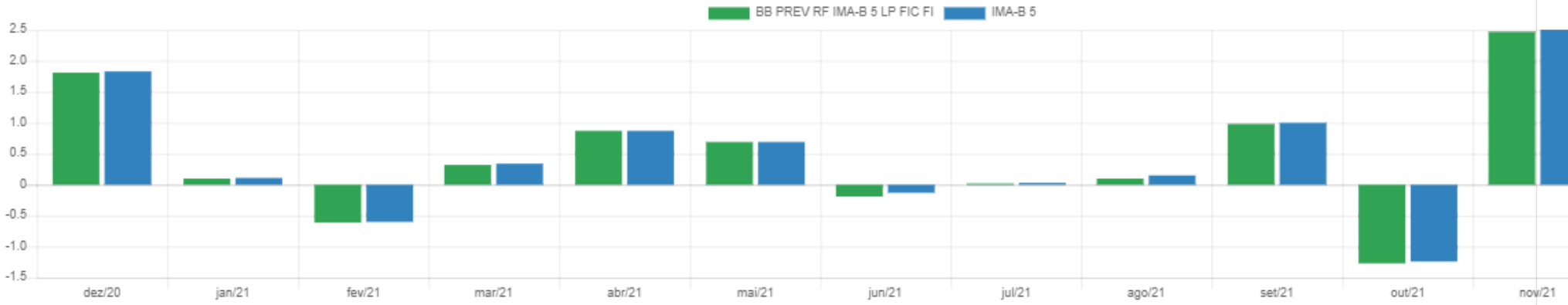
PERFORMANCE SOBRE O BENCHMARK

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - IMA-B 5	6	7,23
Meses abaixo - IMA-B 5	77	92,77
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,07	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-1,79	2020-03

RELATÓRIO

Período	Carteira	IMA-B 5	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,94	2,03	-0,09	3,26
06 meses	3,06	3,24	-0,17	2,78
12 meses	4,27	4,57	-0,30	2,80
24 meses	12,38	12,97	-0,59	4,04
36 meses	26,87	27,83	-0,97	3,49
48 meses	39,11	40,44	-1,33	3,38
60 meses	56,39	58,11	-1,72	3,42
Desde 02/01/2015	106,92	110,64	-3,72	3,28

RENTABILIDADES MENSAIS - 12 ÚLTIMOS MESES



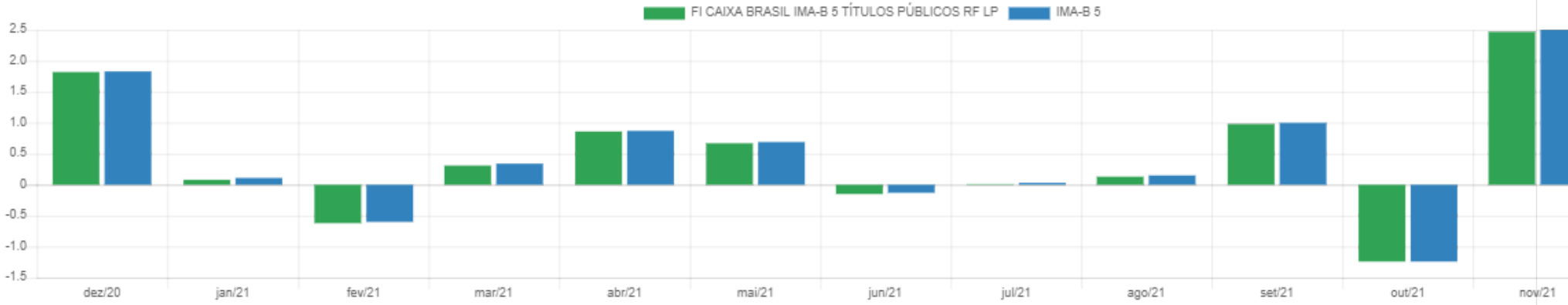
PERFORMANCE SOBRE O BENCHMARK

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - IMA-B 5	6	7,23
Meses abaixo - IMA-B 5	77	92,77
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,07	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-1,79	2020-03

RELATÓRIO

Período	Carteira	IMA-B 5	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,94	2,03	-0,09	3,26
06 meses	3,06	3,24	-0,17	2,78
12 meses	4,27	4,57	-0,30	2,80
24 meses	12,38	12,97	-0,59	4,04
36 meses	26,87	27,83	-0,97	3,49
48 meses	39,11	40,44	-1,33	3,38
60 meses	56,39	58,11	-1,72	3,42
Desde 02/01/2015	106,92	110,64	-3,72	3,28

RENTABILIDADES MENSAIS - 12 ÚLTIMOS MESES



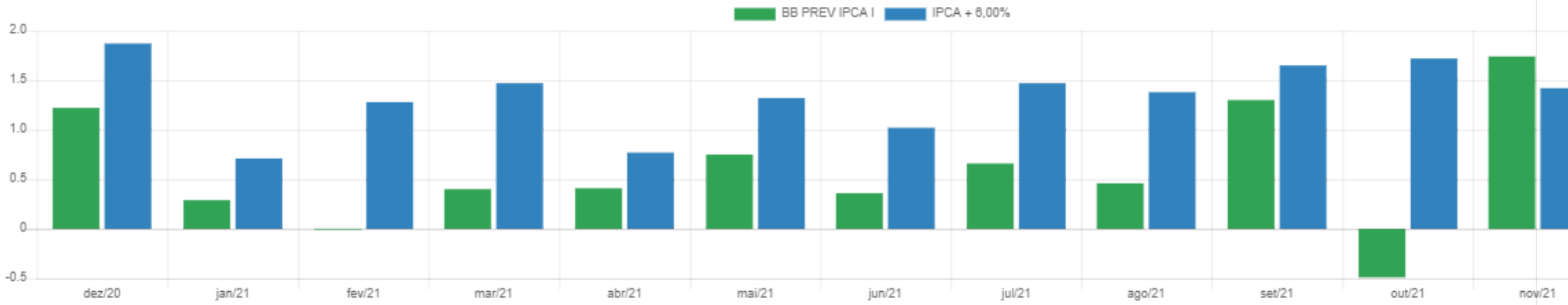
PERFORMANCE SOBRE O BENCHMARK

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - IMA-B 5	4	4,82
Meses abaixo - IMA-B 5	79	95,18
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,10	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-1,80	2020-03

RELATÓRIO

Período	Carteira	IMA-B 5	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,97	2,03	-0,06	3,22
06 meses	3,12	3,24	-0,12	2,75
12 meses	4,31	4,57	-0,25	2,78
24 meses	12,39	12,97	-0,58	4,05
36 meses	26,84	27,83	-0,99	3,50
48 meses	39,10	40,44	-1,34	3,39
60 meses	56,33	58,11	-1,78	3,42
Desde 02/01/2015	106,68	110,64		

RENTABILIDADES MENSAIS - 12 ÚLTIMOS MESES



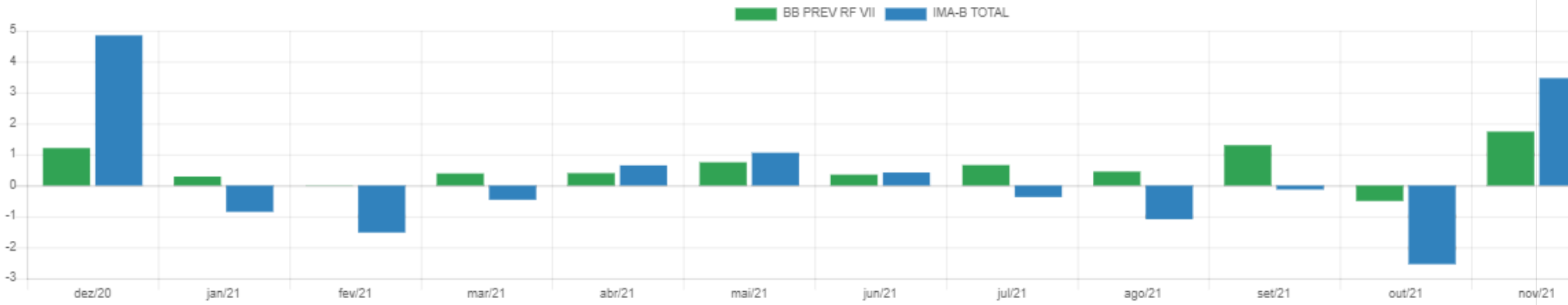
PERFORMANCE SOBRE O BENCHMARK

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - IPCA + 6,00%	38	45,78
Meses abaixo - IPCA + 6,00%	45	54,22
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,11	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-2,87	2018-05

RELATÓRIO

Período	Carteira	IPCA + 6,00%	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,84	4,47	-2,63	1,75
06 meses	4,32	9,25	-4,93	1,44
12 meses	6,64	16,64	-10,00	1,64
24 meses	15,55	29,19	-13,64	3,66
36 meses	31,90	42,87	-10,97	3,29
48 meses	45,89	57,04	-11,16	3,63
60 meses	66,22	71,26	-5,03	4,23
Desde 02/01/2015	121,44	126,01	-4,57	5,35

RENTABILIDADES MENSAIS - 12 ÚLTIMOS MESES

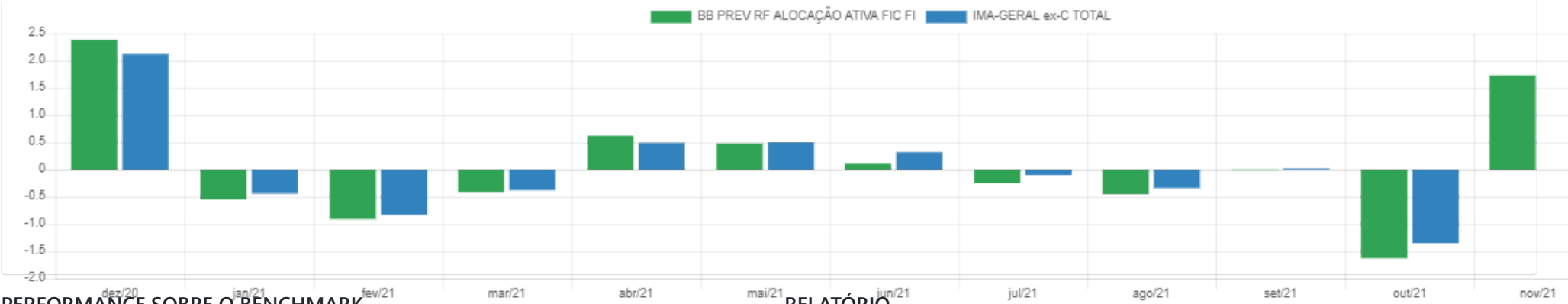


PERFORMANCE SOBRE O BENCHMARK

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - IMA-B TOTAL	35	43,21
Meses abaixo - IMA-B TOTAL	46	56,79
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,53	2017-07
Menor rentabilidade da Carteira	-1,34	2020-03

RELATÓRIO

Período	Carteira	IMA-B TOTAL	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,82	1,06	0,76	1,75
06 meses	4,29	-0,55	4,83	1,44
12 meses	6,57	-1,26	7,83	1,63
24 meses	12,55	5,06	7,49	2,07
36 meses	24,32	29,17	-4,85	1,84
48 meses	36,50	46,04	-9,54	1,90
60 meses	53,07	64,72	-11,66	2,24
Desde 16/03/2015	96,00	119,24	-23,24	2,58



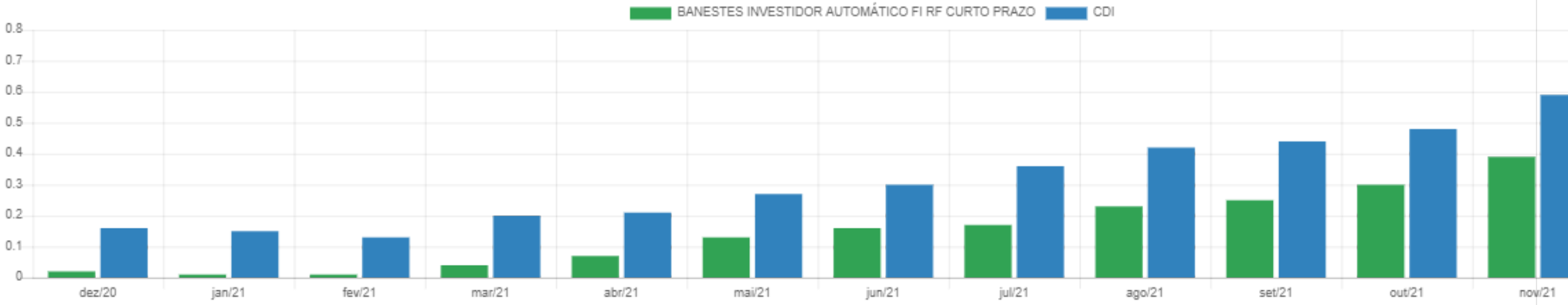
PERFORMANCE SOBRE O BENCHMARK

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - IMA-GERAL ex-C TOTAL	28	45,16
Meses abaixo - IMA-GERAL ex-C TOTAL	34	54,84
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,50	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2020-03

RELATÓRIO

Período	Carteira	IMA-GERAL ex-C TOTAL	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,99			3,32
06 meses	0,28			2,87
12 meses	-0,40			2,84
24 meses	4,67			4,86
36 meses	18,35			4,20
48 meses	30,07			3,90
60 meses	46,02			4,14
Desde 31/08/2016	52,18			4,12

RENTABILIDADES MENSAIS - 12 ÚLTIMOS MESES



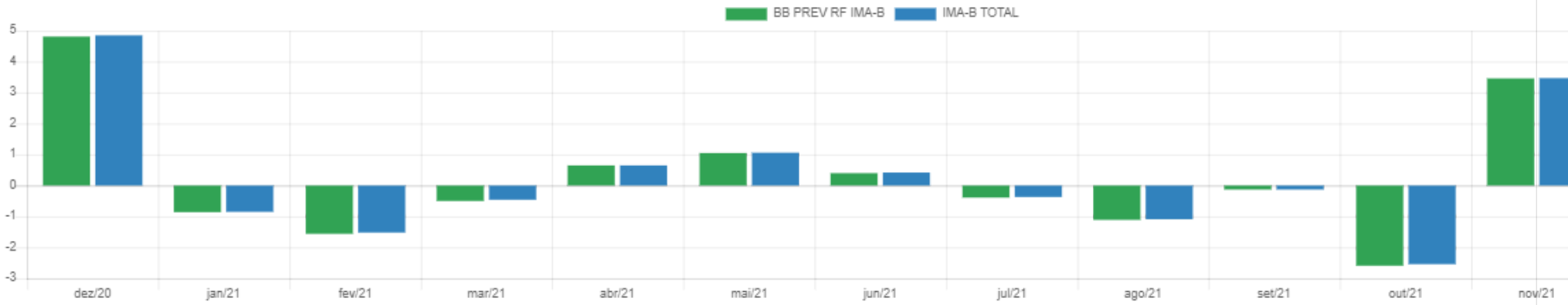
PERFORMANCE SOBRE O BENCHMARK

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - CDI	0	0,00
Meses abaixo - CDI	83	100,00
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,94	2016-08
Menor rentabilidade da Carteira	0,01	2021-02

RELATÓRIO

Período	Carteira	CDI	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,22	1,84	66,32	0,06
06 meses	1,88	3,09	61,02	0,09
12 meses	2,33	4,40	52,94	0,11
24 meses	2,83	7,28	38,79	0,10
36 meses	5,77	13,69	42,14	0,09
48 meses	9,31	20,99	44,34	0,09
60 meses	16,73	33,03	50,66	0,15
Desde 02/01/2015	42,08	71,64	58,73	0,23

RENTABILIDADES MENSAIS - 12 ÚLTIMOS MESES



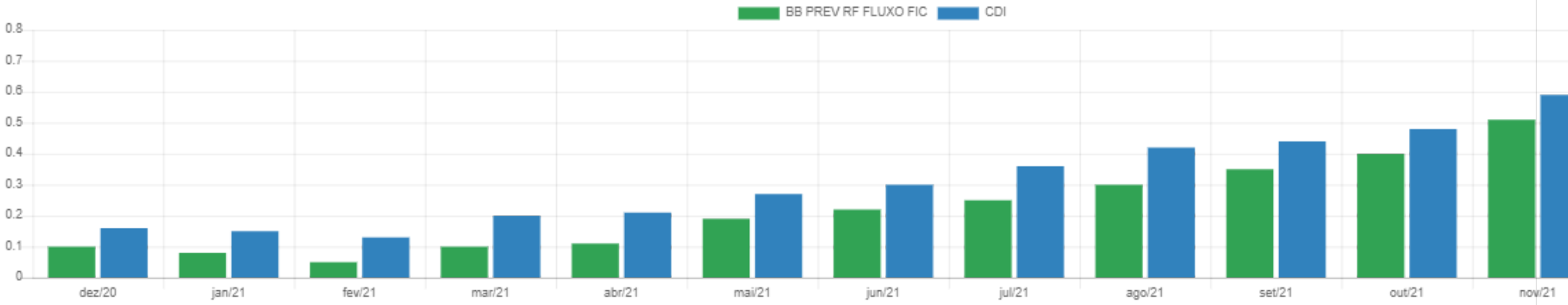
PERFORMANCE SOBRE O BENCHMARK

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - IMA-B TOTAL	24	28,92
Meses abaixo - IMA-B TOTAL	59	71,08
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	7,09	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-7,12	2020-03

RELATÓRIO

Período	Carteira	IMA-B TOTAL	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,99	1,06	-0,07	6,82
06 meses	-0,65	-0,55	-0,10	6,15
12 meses	-1,48	-1,26	-0,21	5,80
24 meses	4,35	5,06	-0,71	9,89
36 meses	27,90	29,17	-1,27	8,57
48 meses	44,30	46,04	-1,74	7,90
60 meses	62,77	64,72	-1,95	8,24
Desde 02/01/2015	119,88	123,66	-3,78	8,25

RENTABILIDADES MENSAIS - 12 ÚLTIMOS MESES



PERFORMANCE SOBRE O BENCHMARK

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - CDI	1	1,20
Meses abaixo - CDI	82	98,80
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,17	2016-06
Menor rentabilidade da Carteira	-0,00	2020-09

RELATÓRIO

Período	Carteira	CDI	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,58	1,84	85,85	0,07
06 meses	2,49	3,09	80,68	0,10
12 meses	3,27	4,40	74,33	0,13
24 meses	4,96	7,28	68,13	0,15
36 meses	10,02	13,69	73,22	0,14
48 meses	15,84	20,99	75,45	0,14
60 meses	26,11	33,03	79,04	0,18
Desde 02/01/2015	60,21	71,64	84,04	0,26

