



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

AGOSTO 2020



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Rentabilidade dos Veículos - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM) - AGO/2020

Comparativos		Valor Investido (R\$)	Último Mês	Últimos 3 Meses	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	No ano
IPCA + 6.00%			0.72%	2.34%	3.20%	8.61%	4.68%
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM)		34.651.239,91	-0.81%	2.59%	2.24%	7.20%	3.01%
Veículos de Investimento	CNPJ	Valor Investido (R\$)	Último Mês	Últimos 3 Meses	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	No ano
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	10.740.658/0001-93	6.011.335,40	-1,83%	4,53%	-0,14%	6,20%	0,54%
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	23.215.097/0001-55	5.685.027,78	-0,55%	1,16%	3,56%	9,21%	5,05%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.060.913/0001-10	4.367.352,33	0,39%	2,48%	3,23%	8,92%	4,45%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	3.498.442,94	0,79%	2,82%	3,69%	8,84%	4,79%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.061.217/0001-28	2.865.141,58	-0,72%	1,81%	1,59%	5,94%	2,54%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.508.605/0001-00	2.400.833,95	-0,77%	1,08%	3,53%	8,48%	5,05%
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.104.624,79	0,09%	0,59%	2,02%	4,85%	2,83%
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	10.577.503/0001-88	2.089.938,53	-3,64%	6,30%	-2,48%	4,26%	-2,23%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	10.577.519/0001-90	1.052.794,19	-1,17%	1,32%	4,25%	10,40%	6,20%
BB PREVID RF IRF-M	07.111.384/0001-69	1.027.019,01	-0,80%	1,08%	3,46%	8,42%	5,00%
BB PREVID RF FLUXO	13.077.415/0001-05	866.453,81	0,07%	0,30%	0,91%	2,78%	1,42%
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	32.161.826/0001-29	762.195,66	-1,24%	1,33%	4,00%	10,06%	5,91%
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	05.073.656/0001-58	522.521,07	-1,91%	4,47%	-	-	4,50%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	10.551.382/0001-03	518.999,18	-3,65%	12,41%	-4,53%	1,68%	-12,30%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	13.058.816/0001-18	355.186,22	-3,42%	13,42%	-4,73%	-1,87%	-14,10%
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	254.371,83	0,14%	0,63%	1,11%	3,36%	1,76%
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	05.164.356/0001-84	223.879,89	0,14%	0,54%	1,47%	3,90%	2,16%
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	24.186,34	0,18%	0,67%	1,16%	3,41%	1,79%
BB PREVID RF IDKA 2	13.322.205/0001-35	19.950,20	0,68%	2,72%	3,37%	8,67%	4,42%



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Rentabilidade dos Veículos - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - AGO/2020

CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF

14.508.643/0001-55

985,21

0,09%

0,34%

1,00%

2,99%

1,54%



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Performance Geral - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM) - AGO/2020

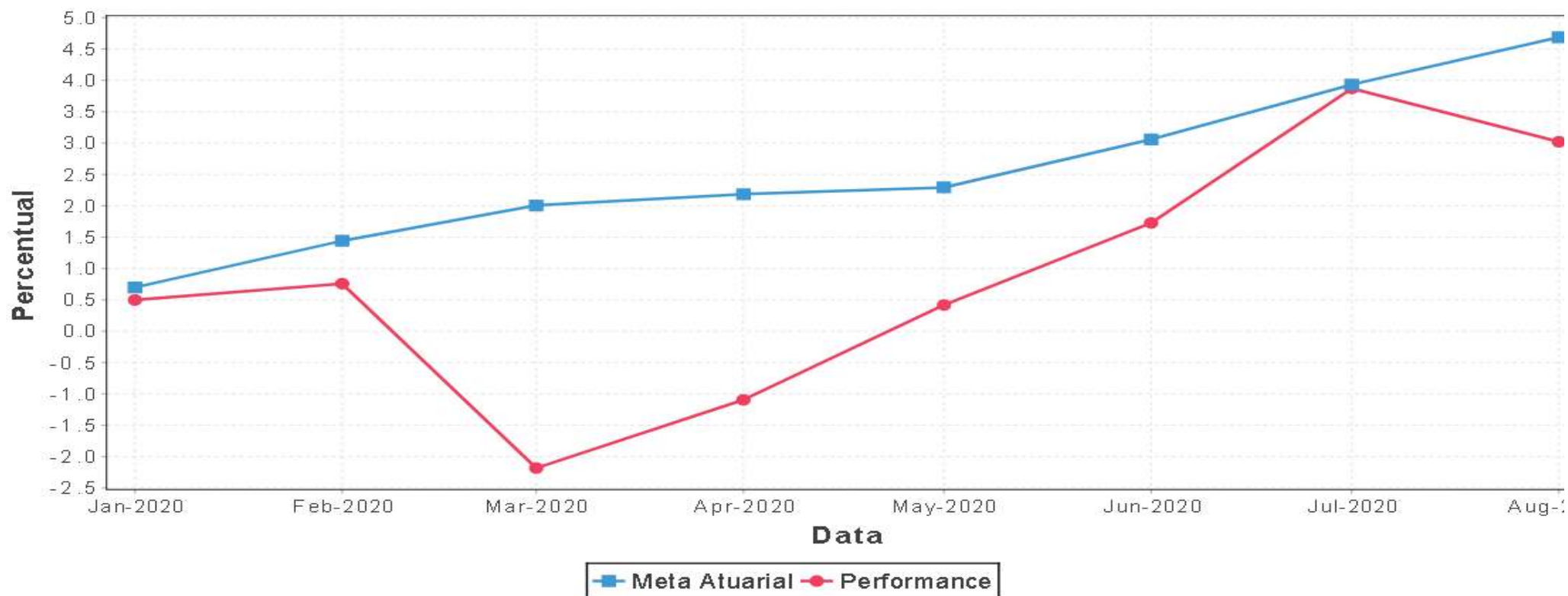
	Set/19	Out/19	Nov/19	Dez/19	Jan/20	Fev/20	Mar/20	Abr/20	Mai/20	Jun/20	Jul/20	Ago/20	12 Meses	Acumulado 2020
PERFORMANCE GERAL	-	-	-	-	0,49%	0,25%	-2,91%	1,11%	1,52%	1,30%	2,10%	-0,81%	3,01%	3,01%
INPC + 6,00% (Set/19 - Dez/19)	-	-	-	-	0,69%	0,73%	0,55%	0,17%	0,10%	0,74%	0,84%	0,72%	4,68%	4,68%
IPCA + 6,00% (Jan/20 - Ago/20)	-	-	-	-	0,69%	0,73%	0,55%	0,17%	0,10%	0,74%	0,84%	0,72%	4,68%	4,68%
Mês	Saldo Anterior (R\$)	Aplicações (R\$)	Resgates (R\$)	Saldo Atual (R\$)	Rentabilidade (R\$)	Rentabilidade (%)	Rent. Acumulada (%)	Meta Atuarial (%)	Meta Acumulada (%)	Efetividade (%)				
2020/01	37.868.407,94	2.006.237,36	2.516.074,77	37.548.948,58	190.378,05	0,4975	0,4975	0,6977	0,6977	71,3034				
2020/02	37.548.948,58	1.324.119,46	1.691.560,63	37.281.891,67	100.384,26	0,2585	0,7572	0,7379	1,4407	35,0310				
2020/03	37.281.891,67	2.177.545,31	2.521.688,46	35.800.208,36	-1.137.540,16	-2,9170	-2,1818	0,5570	2,0058	-523,6607				
2020/04	35.800.208,36	2.153.650,05	2.656.998,39	35.680.747,78	-383.887,76	1,1116	-1,0944	0,1751	2,1845	634,5074				
2020/05	35.680.747,78	3.993.116,80	4.498.520,72	35.725.583,95	550.240,09	1,5285	0,4173	0,1048	2,2916	1.457,7968				
2020/06	35.725.583,95	1.882.125,29	2.930.505,57	35.134.640,27	457.436,60	1,3037	1,7264	0,7479	3,0568	174,2995				
2020/07	35.134.640,27	2.669.647,16	3.152.500,40	35.396.557,24	744.770,21	2,1071	3,8699	0,8484	3,9311	248,3464				
2020/08	35.396.557,24	2.337.841,56	2.796.459,57	34.651.239,91	-286.699,32	-0,8185	3,0197	0,7278	4,6876	-112,4517				
Total Geral	18.544.282,99	22.764.308,51			1.002.857,49		3,0197		4,6876	64,4191				

SALDO ANTERIOR
R\$ 35.396.557,24

SALDO ATUAL
R\$ 34.651.239,21



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

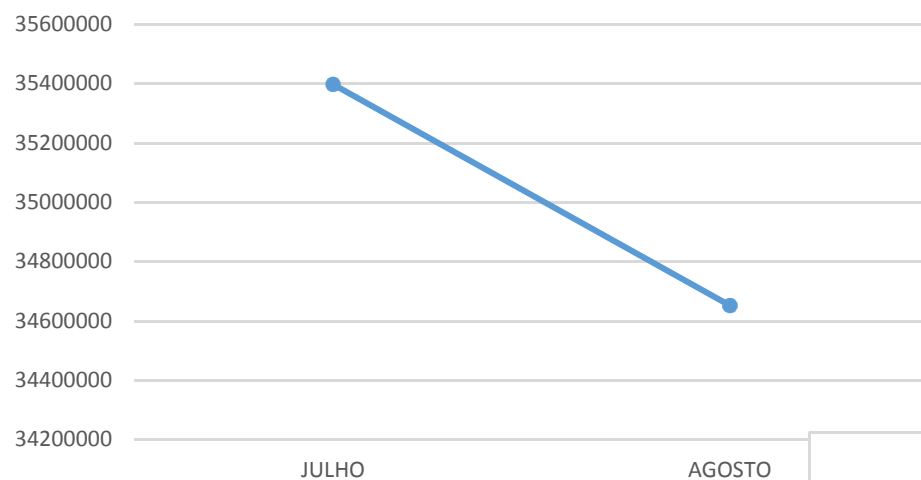


	MÊS	ACUMULADO
PERFORMANCE	-0,81%	3,01%
META	0,72%	4,68%

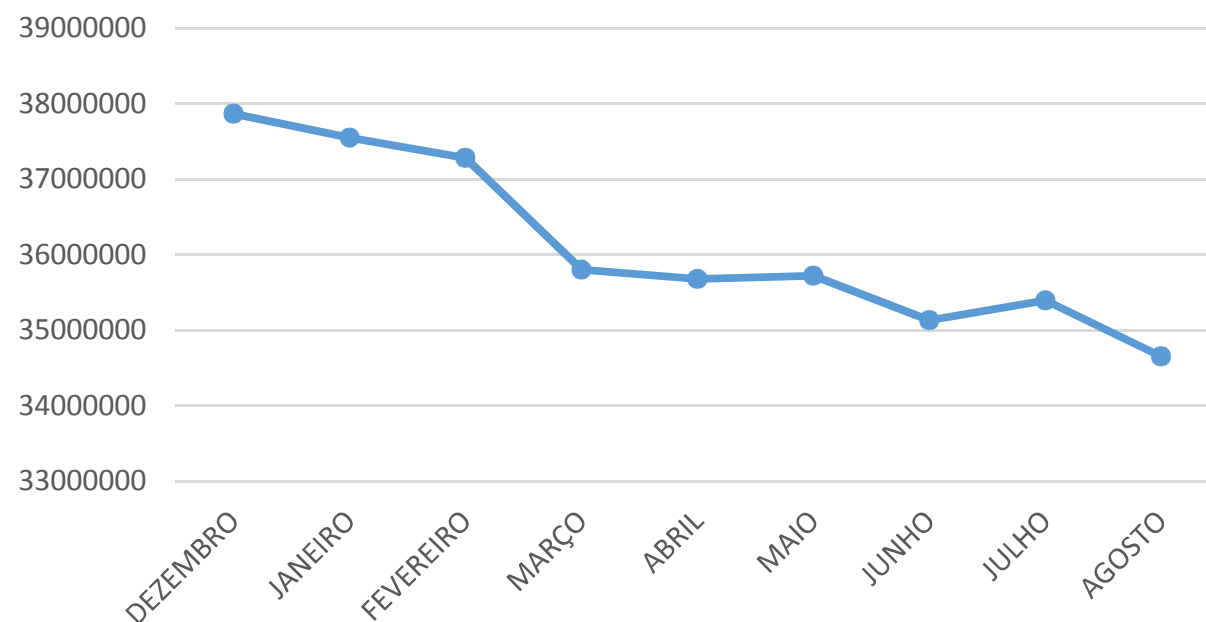


RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

EVOLUÇÃO PATRIMÔNIO AGOSTO 2020



EVOLUÇÃO PATRIMÔNIO 2020





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM) - AGO/2020

Limites de Alocação e Concentração (Limite Art. 14 PI: 15,00%)

Produto	Benchmark	Valor Investido (R\$)	Percentual Investido	Limite Legal	Status	Alocação Mínima	Status	Alocação Máxima	Status	Art. 14
Fundos 100% Títulos Públicos Federais (Art. 7o, Inciso I, Alínea B)		32.108.536,25	92,6620%	100,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	100,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF IDKA 2	IDKA IPCA 2A	19.950,20	0,0575%							Enquadrado
BB PREVID RF IRF-M	IRF-M	1.027.019,01	2,9638%							Enquadrado
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	IRF-M1+	762.195,66	2,1996%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	IDKA IPCA 2A	3.498.442,94	10,0961%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	IMA-B	6.011.335,40	17,3481%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	IRF-M1	2.104.624,79	6,0737%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	CDI	223.879,89	0,6460%							Enquadrado
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	Outros	5.685.027,78	16,4064%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	IMA-B5+	2.089.938,53	6,0313%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	IRF-M1+	1.052.794,19	3,0382%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-GERAL	2.865.141,58	8,2685%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B5	4.367.352,33	12,6037%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M	2.400.833,95	6,9285%							Enquadrado
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7o, Inciso IV, Alínea A)		1.668.518,26	4,8151%	40,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	40,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF FLUXO	CDI	866.453,81	2,5004%							Enquadrado
BB PREVID RF PERFIL	CDI	24.186,34	0,0697%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	985,21	0,0028%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	CDI	254.371,83	0,7340%							Enquadrado



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM) - AGO/2020

ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	IMA-B	522.521,07	1,5079%							Enquadrado
Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8º, Inciso I, Alínea A)		355.186,22	1,0250%	30,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	30,00%	Enquadrado	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	IBOVESPA	355.186,22	1,0250%							Enquadrado
Fundo de Ações - Geral (Art. 8º, Inciso II, Alínea A)		518.999,18	1,4977%	20,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	20,00%	Enquadrado	
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	Outros	518.999,18	1,4977%							Enquadrado
Total Geral		34.651.239,91								



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Competência: AGO/2020

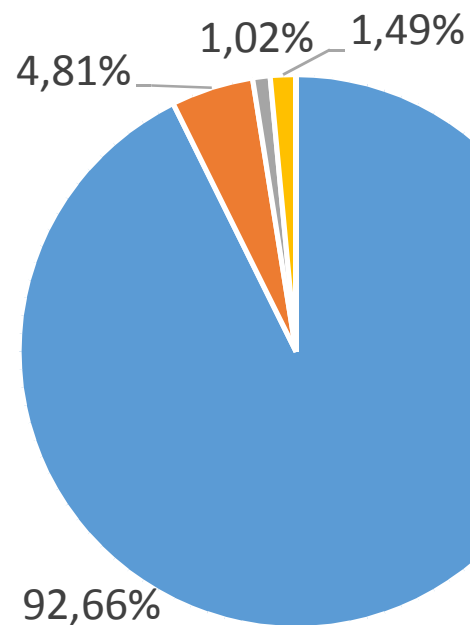
Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira

Artigo	Total em 31/08/2020 (R\$)	LIMITE CMN (%)	LIMITE PI (%)	VALOR ITEM (%)
Art. 7º, Inciso I, Alínea B	R\$ 32.108.536,25	100%	100%	92,66
Art. 7º, Inciso IV, Alínea A	R\$ 1.66/.518,26	40%	40%	4,81
Art. 8º, Inciso I, Alínea A	R\$ 355.186,22	30%	30%	1,02
Art. 8º, Inciso II, Alínea A	R\$ 518.999,18	20%	20%	1,49





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Alocação Máxima - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - AGO/2020

Limites de Alocação e Concentração (Limite Art. 14 PI: 15,00%)

Este relatório indica qual a máxima alocação possível de ser efetuada em uma classe ou em um veículo individual, respeitando os limites da Política de Investimentos (incluindo o Artigo 14) e do Artigo 13, se aplicável.

Os valores apresentados neste relatório perdem a sua acurácia se qualquer alteração for feita na configurações dos investimentos.

Produto	Valor Investido (R\$)	Percentual Investido	Limite Legal	Limite PI	Máxima Alocação (R\$)	Diferença (R\$)
Fundos 100% Títulos Públicos Federais (Art. 7º, Inciso I, Alínea B)	32.108.536,25	92,6620%	100,00	100,00%	Infinito	Infinito
BB PREVID RF IDKA 2	19.950,20	0,0575%			8.657.822,42	8.637.872,22
BB PREVID RF IRF-M	1.027.019,01	2,9638%			8.406.055,22	7.379.036,21
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	762.195,66	2,1996%			8.472.261,06	7.710.065,40
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	3.498.442,94	10,0961%			7.788.199,24	4.289.756,30
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	6.011.335,40	17,3481%			7.159.976,12	1.148.640,72
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	2.104.624,79	6,0737%			8.136.653,78	6.032.028,99
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	223.879,89	0,6460%			8.606.840,00	8.382.960,11
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	5.685.027,78	16,4064%			7.241.553,03	1.556.525,25
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	2.089.938,53	6,0313%			8.140.325,34	6.050.386,81
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	1.052.794,19	3,0382%			8.399.611,43	7.346.817,24
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.865.141,58	8,2685%			7.946.524,58	5.081.383,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	4.367.352,33	12,6037%			7.570.971,89	3.203.619,56
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.400.833,95	6,9285%			8.062.601,49	5.661.767,54
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7º, Inciso IV, Alínea A)	1.668.518,26	4,8151%	40,00	40,00%	21.988.481,10	20.319.962,84
BB PREVID RF FLUXO	866.453,81	2,5004%			8.446.196,52	7.579.742,71
BB PREVID RF PERFIL	24.186,34	0,0697%			8.656.763,39	8.632.577,05
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	985,21	0,0028%			8.662.563,67	8.661.578,46



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Alocação Máxima - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM) - AGO/2020

CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	254.371,83	0,7340%			8.599.217,02	8.344.845,19
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	522.521,07	1,5079%			8.532.179,71	8.009.658,64
Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8º, Inciso I, Alínea A)	355.186,22	1,0250%	30,00	30,00%	14.698.308,72	14.343.122,50
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	355.186,22	1,0250%			8.574.013,42	8.218.827,20
Fundo de Ações - Geral (Art. 8º, Inciso II, Alínea A)	518.999,18	1,4977%	20,00	20,00%	8.533.060,18	8.014.061,00
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	518.999,18	1,4977%			8.533.060,18	8.014.061,00



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

[Veículos](#)[Enquadramento](#)[Benchmarks](#)[Instituição Financeira](#)

NOME	DESCRIÇÃO	TOTAL EM 31/08/2020 (R\$)	PERCENTUAL (%)
OUTROS	Outros	R\$ 6.204.026,96	17,90%
IMA-B	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B	R\$ 6.533.856,47	18,85%
IMA-B5	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B < 5 anos	R\$ 4.367.352,33	12,60%
IDKA IPCA 2A	Índice de Duração Contante AMBIMA segmento 2A	R\$ 3.518.393,14	10,15%
IRF-M	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F	R\$ 3.427.852,96	9,89%
IRF-M1	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F < 1 anos	R\$ 2.104.624,79	6,07%
IMA-GERAL	Índice de Mercado AMBIMA - Média ponderada dos retornos diários	R\$ 2.865.141,58	8,26%
CDI	Certificado de Depósito Interbancário	R\$ 1.369.877,08	3,95%
IMA-B5+	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B >= 5 anos	R\$ 2.089.938,53	6,03%
IRF-M1+	Índice de Mercado AMBIMA-LTN E NTN-F >= 1 anos	R\$ 1.814.989,85	5,23%
IBOVESPA	Índice Bovespa	R\$ 355.186,22	1,02%

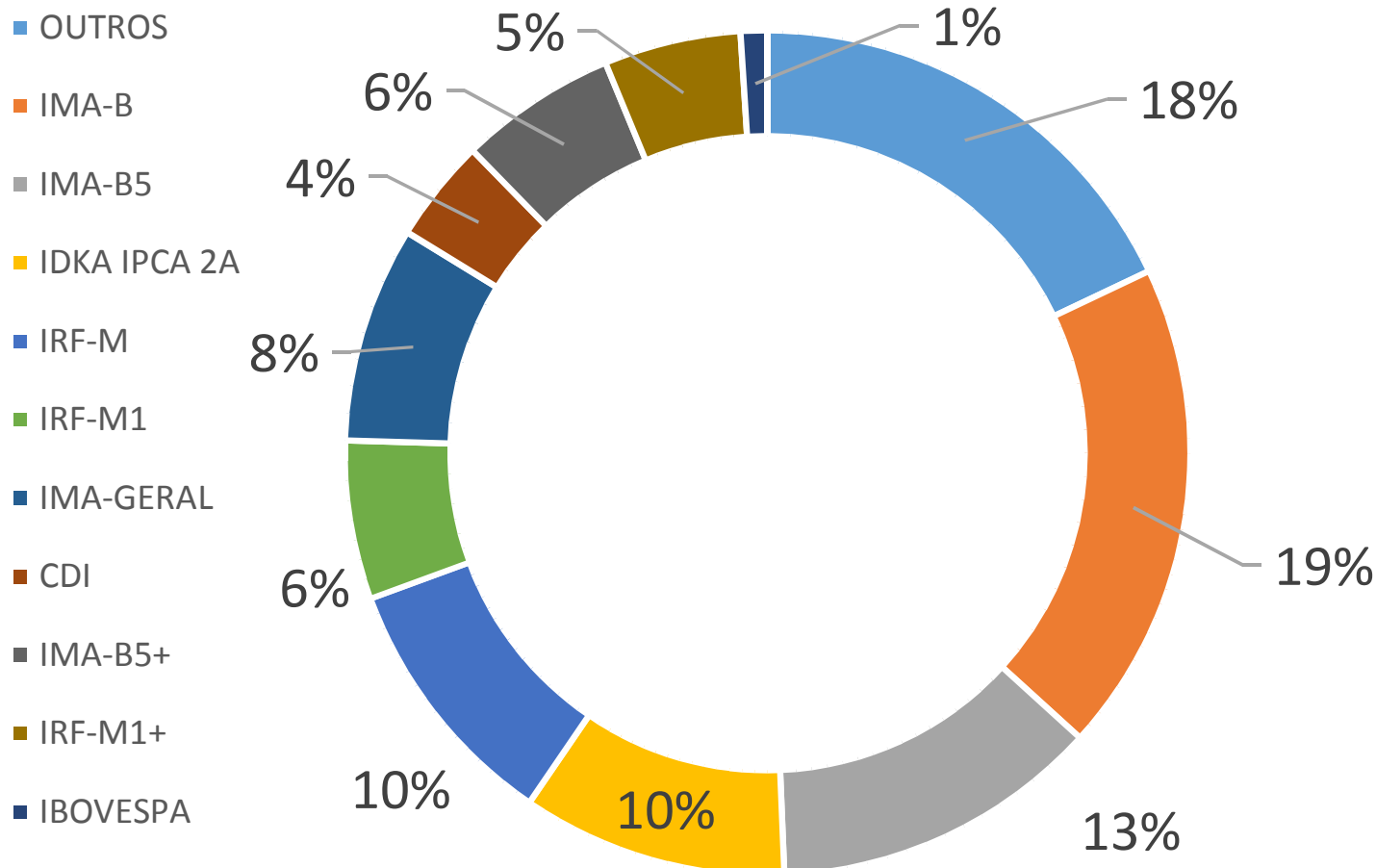
RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Competência

AGO/2020



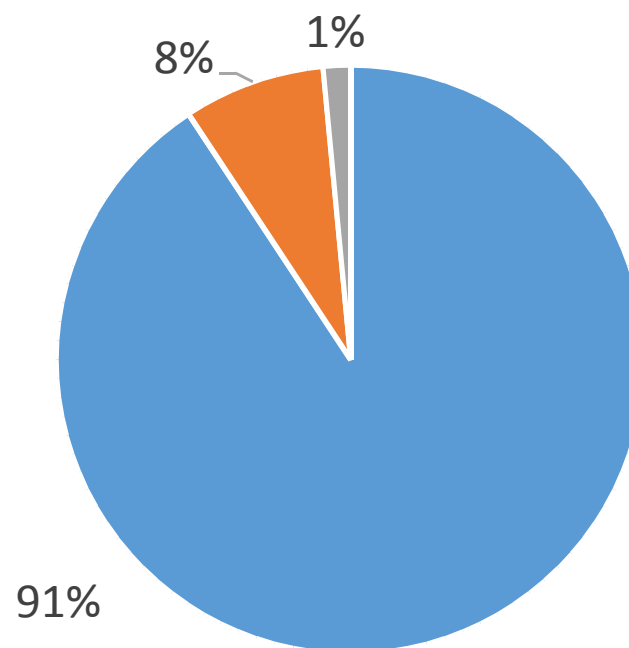
Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira

NOME	TOTAL EM 31/08/2020 (R\$)	PERCENTUAL (%)
CAIXA	R\$ 31.428.913,82	90,70%
BB DTVM S.A	R\$ 2.699.805,02	7,79%
ITAÚ UNIBANCO	R\$ 522.521,07	1,50%



RESUMO DE ALOCAÇÃO DE RECURSOS

