



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

ABRIL 2020



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

Comparativos		Valor Investido (R\$)	Último Mês	Últimos 3 Meses	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	No ano
IPCA + 6.00%			0.17%	1.47%	5.00%	8.50%	2.18%
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM)		35.680.747,78	1.11%	-1.58%	-0.64%	8.48%	-1.09%
Veículos de Investimento	CNPJ	Valor Investido (R\$)	Último Mês	Últimos 3 Meses	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	No ano
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	23.215.097/0001-55	6.129.433,14	1,11%	1,60%	2,52%	13,46%	2,43%
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	10.740.658/0001-93	5.665.277,69	1,30%	-5,47%	-5,81%	8,46%	-5,24%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.060.913/0001-10	4.864.288,38	0,46%	-0,71%	0,68%	8,09%	-0,17%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	3.832.432,71	0,42%	-0,43%	1,12%	7,34%	0,01%
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	3.116.714,51	0,43%	1,39%	2,55%	6,38%	1,81%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.061.217/0001-28	2.787.401,84	0,83%	-0,72%	-0,08%	8,08%	-0,23%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.508.605/0001-00	2.342.480,12	1,12%	1,65%	2,62%	11,40%	2,50%
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	10.577.503/0001-88	1.946.504,11	1,94%	-8,91%	-10,50%	7,93%	-8,94%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	10.577.519/0001-90	1.078.452,70	1,44%	1,77%	2,71%	-	2,86%
BB PREVID RF IRF-M	07.111.384/0001-69	1.002.151,51	1,07%	1,59%	2,59%	11,39%	2,46%
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	32.161.826/0001-29	738.968,38	1,26%	1,61%	2,51%	12,32%	2,69%
BB PREVID RF FLUXO	13.077.415/0001-05	696.751,16	0,19%	0,66%	1,53%	4,06%	0,95%
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	436.476,15	0,00%	0,41%	1,45%	4,41%	0,79%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	10.551.382/0001-03	415.815,04	10,49%	-30,52%	-20,71%	-4,10%	-29,74%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	13.058.816/0001-18	288.639,84	10,13%	-29,01%	-24,69%	-16,41%	-30,19%
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	05.164.356/0001-84	222.090,06	0,31%	0,96%	2,06%	5,25%	1,35%
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	83.690,41	0,25%	0,49%	1,55%	4,47%	0,85%
BB PREVID RF IDKA 2	13.322.205/0001-35	19.039,23	0,32%	-0,72%	1,01%	6,94%	-0,34%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	14.508.643/0001-55	14.140,80	0,21%	0,71%	1,64%	4,30%	1,01%



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

	Mai/19	Jun/19	Jul/19	Ago/19	Set/19	Out/19	Nov/19	Dez/19	Jan/20	Fev/20	Mar/20	Abr/20	12 Meses	Acumulado 2020
PERFORMANCE GERAL	-	-	-	-	-	-	-	-	0,49%	0,25%	-2,91%	1,11%	-1,09%	-1,09%
INPC + 6.00% (Mai/19 - Dez/19)	-	-	-	-	-	-	-	-	0,69%	0,73%	0,55%	0,17%	2,18%	2,18%
IPCA + 6.00% (Jan/20 - Abr/20)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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				
Total Geral	7.661.552,18	9.386.322,25			-462.890,09		-1,0944		2,1845	-50,0997				

R\$ 35.800.208,36

R\$ 35.680.747,78

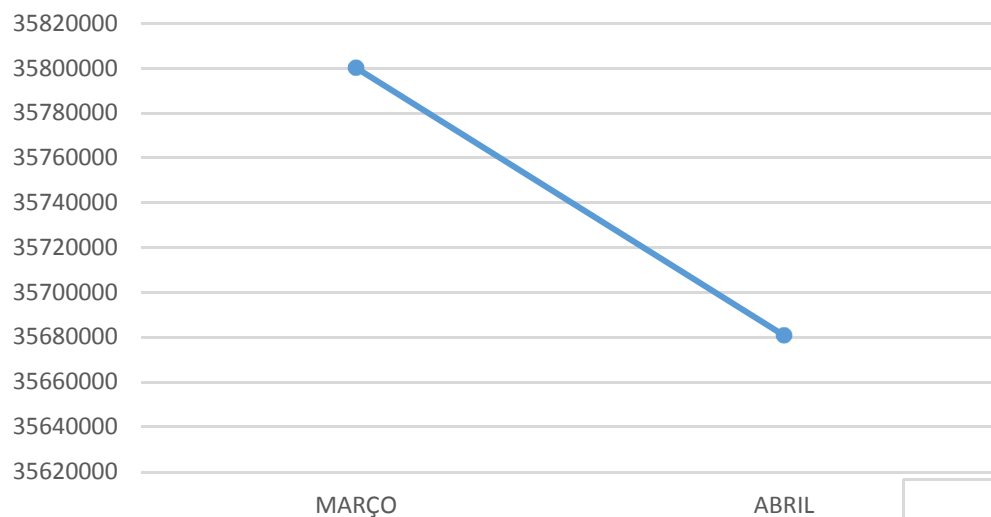


	MÊS	ACUMULADO
PERFORMANCE	1,11%	-1,09%
META	0,17%	2,18%

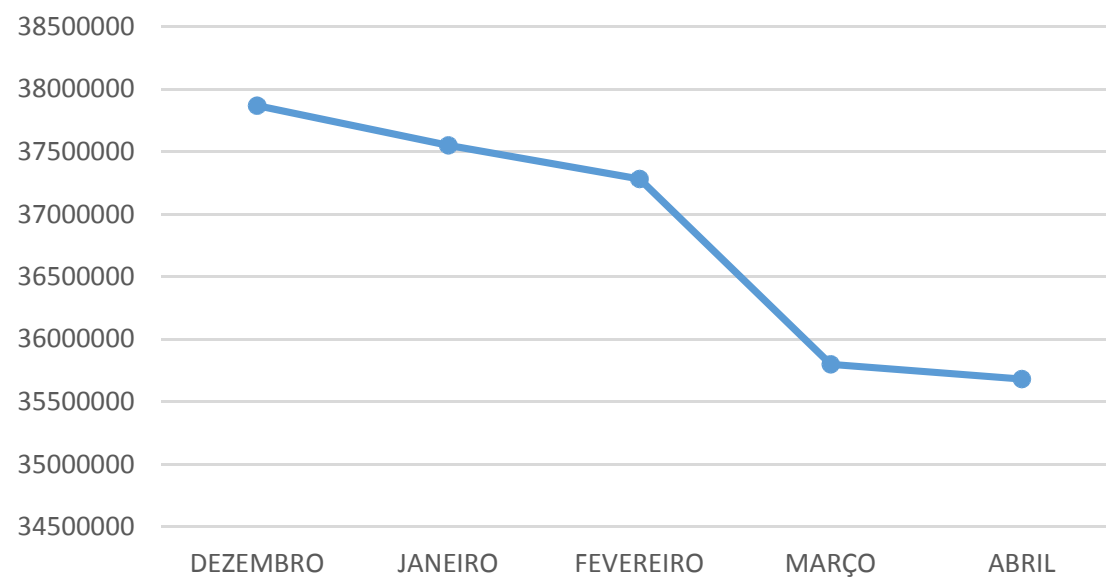


RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO ABRIL



EVOLUÇÃO PATRIMÔNIO 2020





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - ABR/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)		33.745.234,38	94,5754%	100,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	100,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF IDKA 2	IDKA IPCA 2A	19.039,23	0,0533%							Enquadrado
BB PREVID RF IRF-M	IRF-M	1.002.151,51	2,8086%							Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	IRF-M1+	738.968,38	2,0710%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	IDKA IPCA 2A	3.832.432,71	10,7408%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	IMA-B	5.665.277,69	15,8776%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	IRF-M1	3.116.714,51	8,7350%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	CDI	222.090,06	0,6224%							Enquadrado
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	Outros	6.129.433,14	17,1785%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	IMA-B5+	1.946.504,11	5,4553%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	IRF-M1+	1.078.452,70	3,0225%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-GERAL	2.787.401,84	7,8120%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B5	4.864.288,38	13,6328%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M	2.342.480,12	6,5651%							Enquadrado
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7º, Inciso IV, Alínea A)		1.231.058,52	3,4502%	40,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	40,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF FLUXO	CDI	696.751,16	1,9527%							Enquadrado
BB PREVID RF PERFIL	CDI	83.690,41	0,2345%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	14.140,80	0,0396%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	CDI	436.476,15	1,2232%							Enquadrado



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



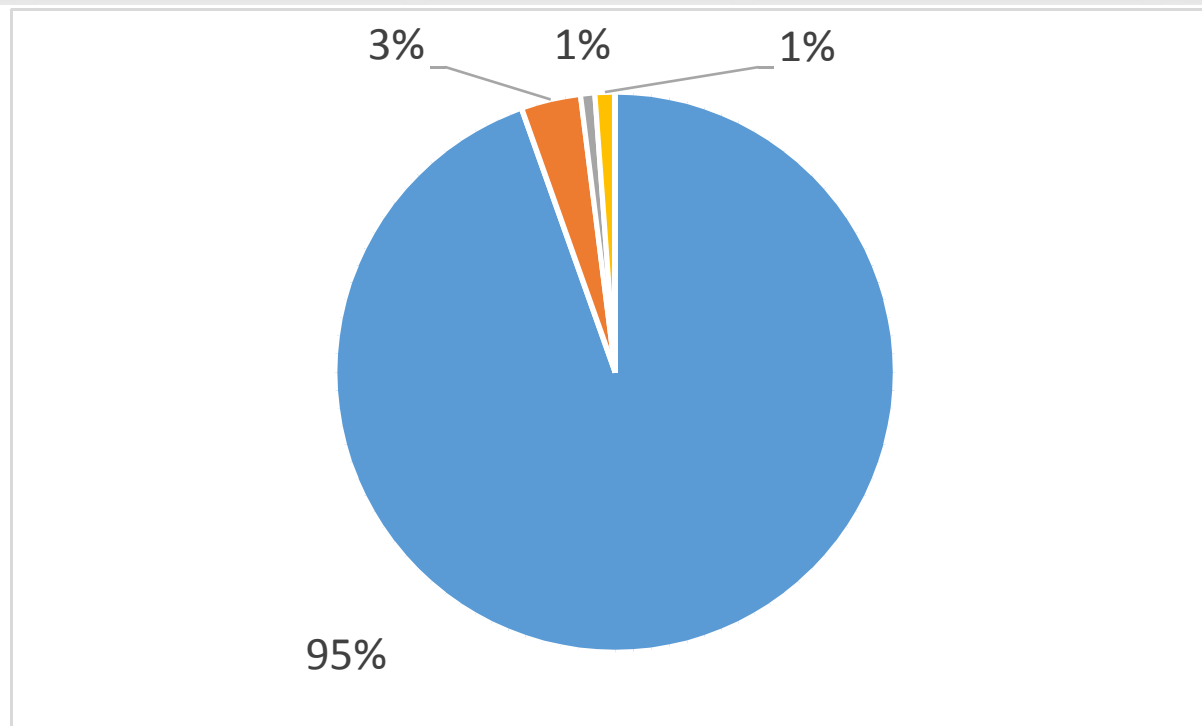
Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM) - ABR/2020

Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8º, Inciso I, Alínea A)		288.639,84	0,8089%	30,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	30,00%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	IBOVESPA	288.639,84	0,8089%						Enquadrado
Fundo de Ações - Geral (Art. 8º, Inciso II, Alínea A)		415.815,04	1,1653%	20,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	20,00%	Enquadrado
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	Outros	415.815,04	1,1653%						Enquadrado
Total Geral		35.680.747,78							

RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Competência: ABR/2020

Veículos	Enquadramento	Benchmarks	Instituição Financeira		
Artigo		Total em 30/04/2020 (R\$)	LIMITE CMN (%)	LIMITE PI (%)	VALOR ITEM (%)
Art. 7º, Inciso I, Alínea B		R\$ 33.745.234,38	100%	100%	94,57
Art. 7º, Inciso IV, Alínea A		R\$ 1.231.058,52	40%	40%	3,45
Art. 8º, Inciso I, Alínea A		R\$ 288.639,84	30%	30%	0,8
Art. 8º, Inciso II, Alínea A		R\$ 415.815,04	20%	20%	1,16



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)	33.745.234,38	94,5754%	100,00	100,00%	Infinito	Infinito
BB PREVID RF IDKA 2	19.039,23	0,0533%			8.915.427,13	8.896.387,90
BB PREVID RF IRF-M	1.002.151,51	2,8086%			8.669.649,06	7.667.497,55
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	738.968,38	2,0710%			8.735.444,85	7.996.476,47
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	3.832.432,71	10,7408%			7.962.078,76	4.129.646,05
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	5.665.277,69	15,8776%			7.503.867,52	1.838.589,83
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	3.116.714,51	8,7350%			8.141.008,31	5.024.293,80
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	222.090,06	0,6224%			8.864.664,43	8.642.574,37
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	6.129.433,14	17,1785%			7.387.828,66	1.258.395,52
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	1.946.504,11	5,4553%			8.433.560,91	6.487.056,80
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	1.078.452,70	3,0225%			8.650.573,77	7.572.121,07
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.787.401,84	7,8120%			8.223.336,48	5.435.934,64
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	4.864.288,38	13,6328%			7.704.114,85	2.839.826,47
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.342.480,12	6,5651%			8.334.566,91	5.992.086,79
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7o, Inciso IV, Alínea A)	1.231.058,52	3,4502%	40,00	40,00%	22.966.459,50	21.735.400,98
BB PREVID RF FLUXO	696.751,16	1,9527%			8.745.999,15	8.049.247,99
BB PREVID RF PERFIL	83.690,41	0,2345%			8.899.264,34	8.815.573,93
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	14.140,80	0,0396%			8.916.651,74	8.902.510,94



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	436.476,15	1,2232%			8.811.067,90	8.374.591,75
Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8º, Inciso I, Alínea A)	288.639,84	0,8089%	30,00	30,00%	15.168.046,26	14.879.406,42
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	288.639,84	0,8089%			8.848.026,98	8.559.387,14
Fundo de Ações - Geral (Art. 8º, Inciso II, Alínea A)	415.815,04	1,1653%	20,00	20,00%	8.816.233,18	8.400.418,14
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	415.815,04	1,1653%			8.816.233,18	8.400.418,14



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

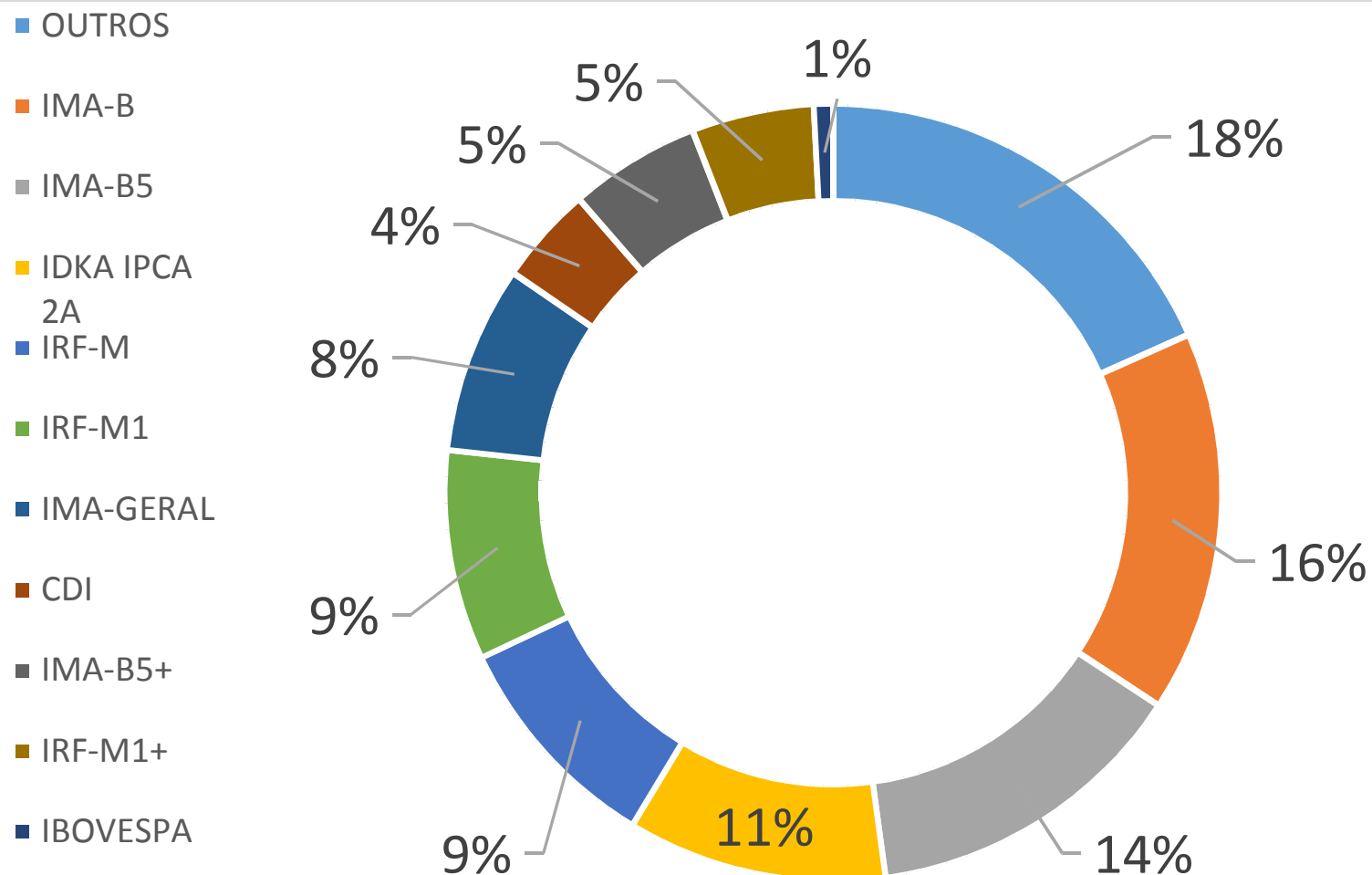
Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira

NOME	DESCRIÇÃO	TOTAL EM 30/04/2020 (R\$)	PERCENTUAL (%)
OUTROS	Outros	R\$ 6.545.248,18	18,34%
IMA-B	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B	R\$ 5.665.277,69	15,87%
IMA-B5	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B < 5 anos	R\$ 4.864.288,38	13,63%
IDKA IPCA 2A	Índice de Duração Contante AMBIMA segmento 2A	R\$ 3.851.471,94	10,79%
IRF-M	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F	R\$ 3.344.631,63	9,37%
IRF-M1	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F < 1 anos	R\$ 3.116.714,51	8,73%
IMA-GERAL	Índice de Mercado AMBIMA - Média ponderada dos retornos diários	R\$ 2.787.401,84	7,81%
CDI	Certificado de Depósito Interbancário	R\$ 1.453.148,58	4,07%
IMA-B5+	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B >= 5 anos	R\$ 1.946.504,11	5,45%
IRF-M1+	Índice de Mercado AMBIMA-LTN E NTN-F >= 1 anos	R\$ 1.817.421,08	5,09%
IBOVESPA	Índice Bovespa	R\$ 288.639,84	0,80%



Competência

ABR/2020

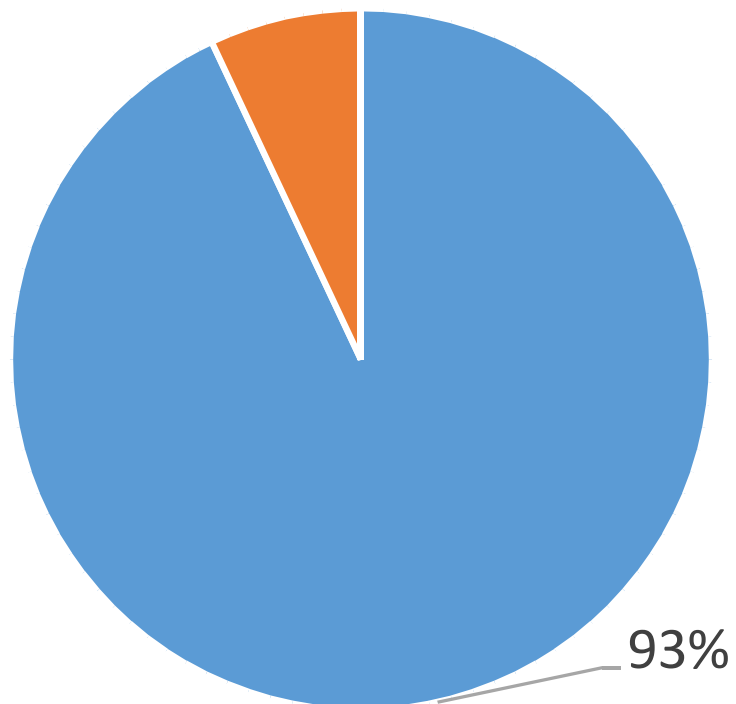
Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira

7%



93%

■ CAIXA

■ BB DTVM S.A

RESUMO DE ALOCAÇÃO DE RECURSOS

