



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

JUNHO 2020



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

Comparativos		Valor Investido (R\$)	Último Mês	Últimos 3 Meses	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	No ano
IPCA + 6.00%			0.74%	1.03%	3.05%	8.20%	3.05%
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM)		35.134.640,27	1.30%	3.99%	1.72%	6.87%	1.72%
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	6.260.521,59	0,74%	3,27%	4,62%	9,82%	4,62%
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	10.740.658/0001-93	5.866.746,86	2,02%	4,90%	-1,87%	4,52%	-1,87%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.060.913/0001-10	4.308.362,00	1,09%	3,70%	3,04%	8,51%	3,04%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	3.442.425,09	1,17%	3,54%	3,11%	8,19%	3,11%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.061.217/0001-28	2.839.113,99	0,89%	2,70%	1,61%	6,09%	1,61%
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.695.491,39	0,25%	1,08%	2,48%	5,78%	2,48%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.508.605/0001-00	2.393.398,37	0,76%	3,32%	4,73%	9,54%	4,73%
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	10.577.503/0001-88	2.021.553,18	2,82%	5,87%	-5,43%	1,57%	-5,43%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	10.577.519/0001-90	1.049.623,32	1,01%	4,41%	5,88%	11,00%	5,88%
BB PREVID RF IRF-M	07.111.384/0001-69	1.023.803,38	0,77%	3,25%	4,68%	9,50%	4,68%
BB PREVID RF FLUXO	13.077.415/0001-05	855.854,89	0,12%	0,48%	1,24%	3,50%	1,24%
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	32.161.826/0001-29	759.898,67	1,03%	4,13%	5,59%	11,16%	5,59%
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	05.073.656/0001-58	510.107,46	1,99%	-	-	-	2,02%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	10.551.382/0001-03	496.333,67	7,50%	31,89%	-16,13%	4,63%	-16,13%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	13.058.816/0001-18	340.107,97	8,60%	29,77%	-17,74%	-5,96%	-17,74%
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	05.164.356/0001-84	223.136,06	0,21%	0,78%	1,82%	4,64%	1,82%
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	24.085,73	0,26%	0,77%	1,37%	4,06%	1,37%
BB PREVID RF IDKA 2	13.322.205/0001-35	19.655,70	1,21%	3,57%	2,88%	8,17%	2,88%
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	3.349,29	0,24%	0,57%	1,36%	4,02%	1,36%



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

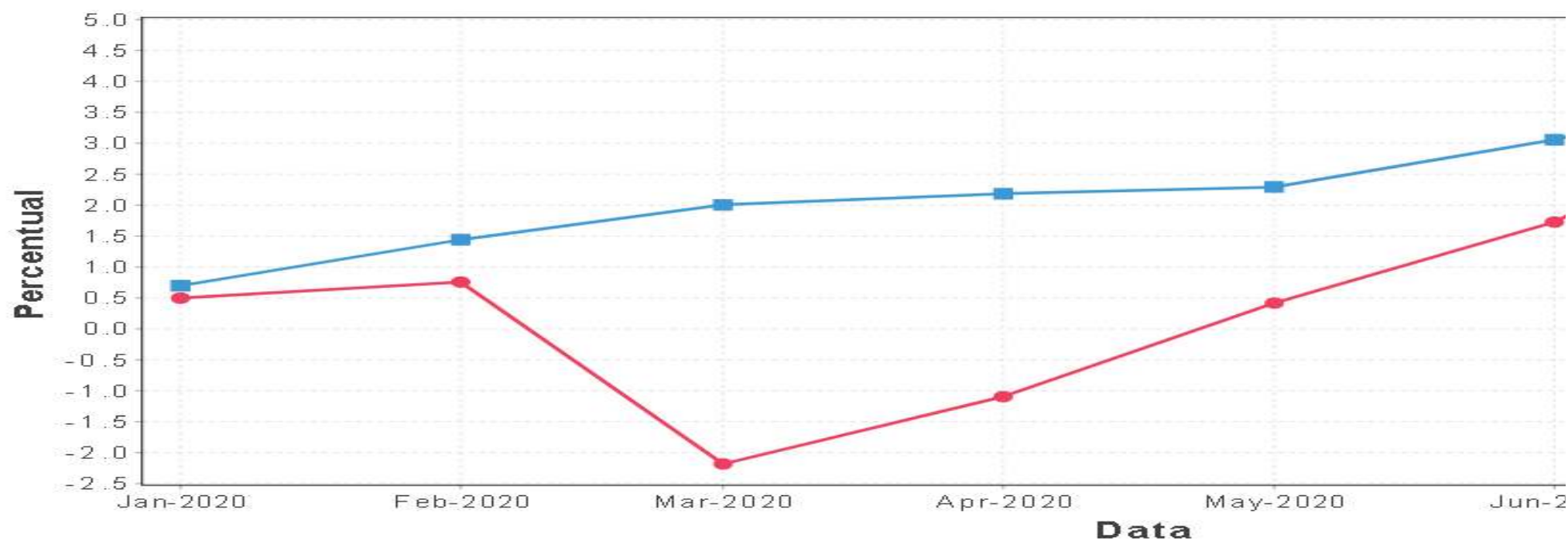
	Jul/19	Ago/19	Set/19	Out/19	Nov/19	Dez/19	Jan/20	Fev/20	Mar/20	Abr/20	Mai/20	Jun/20	12 Meses	Acumulado 2020
PERFORMANCE GERAL	-	-	-	-	-	-	0,49%	0,25%	-2,91%	1,11%	1,52%	1,30%	1,72%	1,72%
INPC + 6,00% (Jul/19 - Dez/19)	-	-	-	-	-	-	0,69%	0,73%	0,55%	0,17%	0,10%	0,74%	3,05%	3,05%
IPCA + 6,00% (Jan/20 - Jun/20)	-	-	-	-	-	-	0,69%	0,73%	0,55%	0,17%	0,10%	0,74%	3,05%	3,05%
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				
Total Geral	13.536.794,27	16.815.348,54		544.786,60			1,7264		3,0568	56,4790				

SALDO ANTERIOR
R\$ 35.725.583,95

SALDO ATUAL
R\$ 35.134.640,27



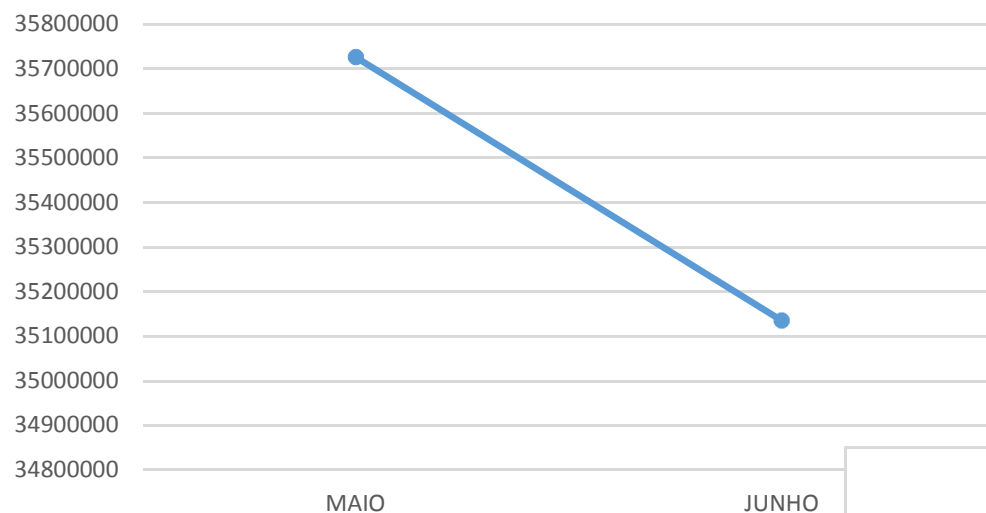
RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



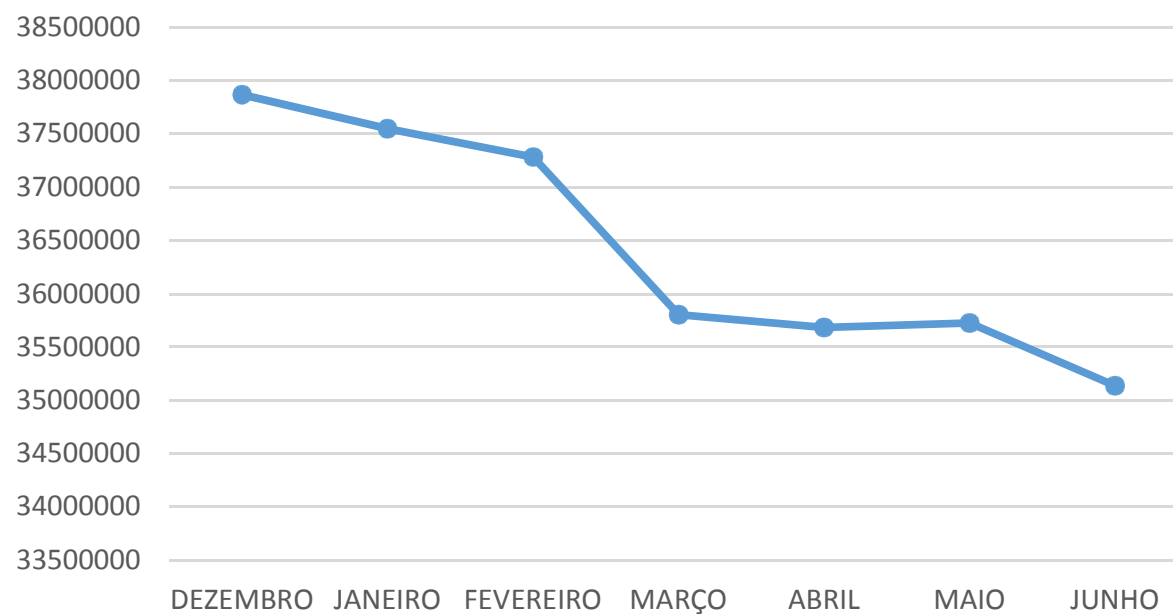
	MÊS	ACUMULADO
PERFORMANCE	1,30%	1,72%
META	0,74%	3,05%

RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

EVOLUÇÃO PATRIMÔNIO JUNHO 2020



EVOLUÇÃO PATRIMÔNIO 2020





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - JUN/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)		32.903.729,60	93,6503%	100,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	100,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF IDKA 2	IDKA IPCA 2A	19.655,70	0,0559%							Enquadrado
BB PREVID RF IRF-M	IRF-M	1.023.803,38	2,9139%							Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	IRF-M1+	759.898,67	2,1628%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	IDKA IPCA 2A	3.442.425,09	9,7978%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	IMA-B	5.866.746,86	16,6978%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	IRF-M1	2.695.491,39	7,6718%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF	CDI	223.136,06	0,6350%							Enquadrado
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	Outros	6.260.521,59	17,8186%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	IMA-B5+	2.021.553,18	5,7537%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	IRF-M1+	1.049.623,32	2,9874%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-GERAL	2.839.113,99	8,0806%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B5	4.308.362,00	12,2624%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M	2.393.398,37	6,8120%							Enquadrado
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7o, Inciso IV, Alínea A)		1.394.469,03	3,9689%	40,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	40,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF FLUXO	CDI	855.854,89	2,4359%							Enquadrado
BB PREVID RF PERFIL	CDI	24.085,73	0,0685%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	1.071,66	0,0030%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	CDI	3.349,29	0,0095%							Enquadrado



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	3.349,29	0,0095%			8.782.822,74	8.779.473,45
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	510.107,46	1,4518%			8.656.133,20	8.146.025,74
Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8º, Inciso I, Alínea A)	340.107,97	0,9680%	30,00	30,00%	14.911.942,41	14.571.834,44
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	340.107,97	0,9680%			8.698.633,07	8.358.525,10
Fundo de Ações - Geral (Art. 8º, Inciso II, Alínea A)	496.333,67	1,4126%	20,00	20,00%	8.659.576,65	8.163.242,98
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	496.333,67	1,4126%			8.659.576,65	8.163.242,98



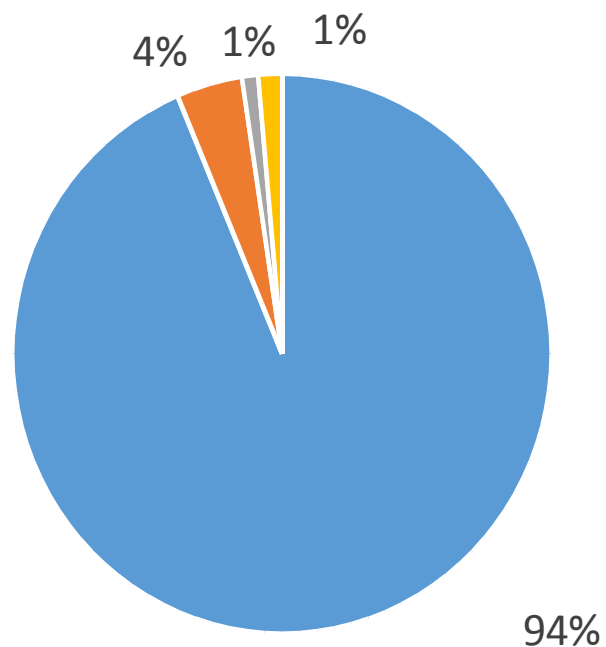
RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Competência

JUN/2020



Artigo	Total em 30/06/2020 (R\$)	LIMITE CMN (%)	LIMITE PI (%)	VALOR ITEM (%)
Art. 7º, Inciso I, Alínea B	R\$ 32.903.729,60	100%	100%	93,65
Art. 7º, Inciso IV, Alínea A	R\$ 1.394.469,03	40%	40%	3,96
Art. 8º, Inciso I, Alínea A	R\$ 340.107,97	30%	30%	0,96
Art. 8º, Inciso II, Alínea A	R\$ 496.333,67	20%	20%	1,41





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Alocação Máxima - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - JUN/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)	32.903.729,60	93,6503%	100,00	100,00%	Infinito	Infinito
BB PREVID RF IDKA 2	19.655,70	0,0559%			8.778.746,14	8.759.090,44
BB PREVID RF IRF-M	1.023.803,38	2,9139%			8.527.709,22	7.503.905,84
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	759.898,67	2,1628%			8.593.685,40	7.833.786,73
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	3.442.425,09	9,7978%			7.923.053,79	4.480.628,70
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	5.866.746,86	16,6978%			7.316.973,35	1.450.226,49
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	2.695.491,39	7,6718%			8.109.787,22	5.414.295,83
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	223.136,06	0,6350%			8.727.876,05	8.504.739,99
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	6.260.521,59	17,8186%			7.218.529,67	958.008,08
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	2.021.553,18	5,7537%			8.278.271,77	6.256.718,59
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	1.049.623,32	2,9874%			8.521.254,23	7.471.630,91
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.839.113,99	8,0806%			8.073.881,57	5.234.767,58
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	4.308.362,00	12,2624%			7.706.569,56	3.398.207,56
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.393.398,37	6,8120%			8.185.310,47	5.791.912,10
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7º, Inciso IV, Alínea A)	1.394.469,03	3,9689%	40,00	40,00%	22.493.447,49	21.098.978,46
BB PREVID RF FLUXO	855.854,89	2,4359%			8.569.696,34	7.713.841,45
BB PREVID RF PERFIL	24.085,73	0,0685%			8.777.638,63	8.753.552,90
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.071,66	0,0030%			8.783.392,15	8.782.320,49



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	3.349,29	0,0095%			8.782.822,74	8.779.473,45
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	510.107,46	1,4518%			8.656.133,20	8.146.025,74
Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8º, Inciso I, Alínea A)	340.107,97	0,9680%	30,00	30,00%	14.911.942,41	14.571.834,44
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	340.107,97	0,9680%			8.698.633,07	8.358.525,10
Fundo de Ações - Geral (Art. 8º, Inciso II, Alínea A)	496.333,67	1,4126%	20,00	20,00%	8.659.576,65	8.163.242,98
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	496.333,67	1,4126%			8.659.576,65	8.163.242,98



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

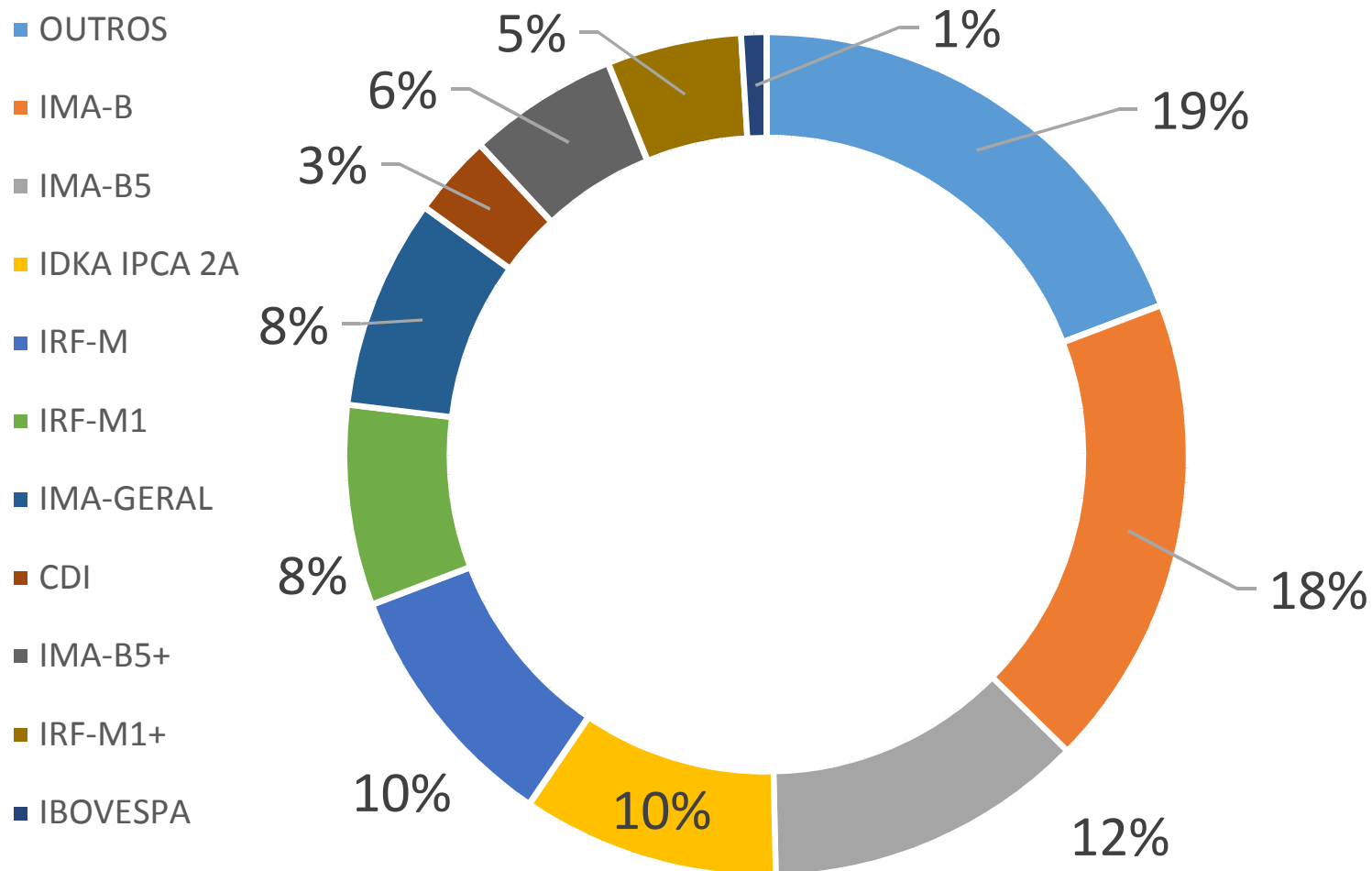
Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira

NOME	DESCRIÇÃO	TOTAL EM 30/06/2020 (R\$)	PERCENTUAL (%)
OUTROS	Outros	R\$ 6.756.855,26	19,23%
IMA-B	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B	R\$ 6.376.854,32	18,14%
IMA-B5	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B < 5 anos	R\$ 4.308.362,00	12,26%
IDKA IPCA 2A	Índice de Duração Contante AMBIMA segmento 2A	R\$ 3.462.080,79	9,85%
IRF-M	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F	R\$ 3.417.201,75	9,72%
IRF-M1	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F < 1 anos	R\$ 2.695.491,39	7,67%
IMA-GERAL	Índice de Mercado AMBIMA - Média ponderada dos retornos diários	R\$ 2.839.113,99	8,08%
CDI	Certificado de Depósito Interbancário	R\$ 1.107.497,63	3,15%
IMA-B5+	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B >= 5 anos	R\$ 2.021.553,18	5,75%
IRF-M1+	Índice de Mercado AMBIMA-LTN E NTN-F >= 1 anos	R\$ 1.809.521,99	5,15%
IBOVESPA	Índice Bovespa	R\$ 340.107,97	0,96%



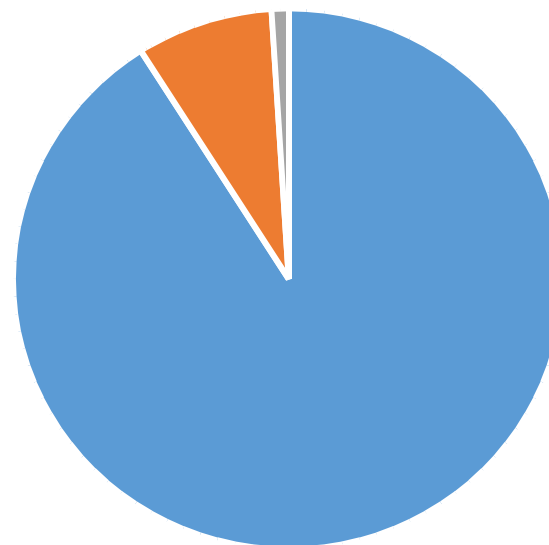


RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Competência JUN/2020

Veículos Enquadramento Benchmarks Instituição Financeira

	PERCENTUAL (%)
CAIXA	R\$ 31.941.234,44 90,91%
BB DTVM S.A	R\$ 2.683.298,37 7,63%
ITAÚ UNIBANCO	R\$ 510.107,46 1,45%



91%

8%

1%

■ CAIXA

■ BB DTVM S.A

■ ITAÚ UNIBANCO

RESUMO DE ALOCAÇÃO DE RECURSOS

