



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

FEVEREIRO 2020



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

Comparativos		Valor Investido (R\$)	Último Mês	Últimos 3 Meses	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	No ano
IPCA + 6.00%			0.73%	3.17%	5.24%	10.26%	1.44%
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM)		37.281.891,67	0.25%	1.99%	4.85%	12.07%	0.75%
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	6.069.998,07	0,61%	2,04%	5,45%	14,23%	1,44%
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT. PUBL. RF LP	10.740.658/0001-93	6.019.946,03	0,43%	2,69%	6,35%	17,62%	0,68%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.060.913/0001-10	4.930.366,37	0,62%	2,39%	5,50%	-	1,17%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPKA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	3.872.476,84	0,60%	2,17%	4,96%	10,34%	1,06%
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	3.085.134,93	0,36%	1,19%	2,76%	6,30%	0,78%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.061.217/0001-28	2.820.026,76	0,43%	1,84%	4,27%	10,79%	0,92%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.508.605/0001-00	2.318.968,19	0,63%	2,09%	4,78%	11,51%	1,47%
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	10.577.503/0001-88	2.143.149,89	0,29%	2,81%	6,91%	21,46%	0,25%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	10.577.519/0001-90	1.067.892,35	0,77%	2,57%	5,89%	-	1,86%
BB PREVID RF IRF-M	07.111.384/0001-69	992.621,71	0,63%	2,10%	4,79%	11,62%	1,49%
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	984.859,02	0,27%	0,99%	2,22%	-	0,64%
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	32.161.826/0001-29	732.843,19	0,77%	2,54%	5,82%	-	1,84%
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	632.693,79	0,27%	0,97%	2,22%	-	0,62%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	10.551.382/0001-03	543.676,90	-9,15%	0,45%	6,52%	25,11%	-8,13%
BB PREVID RF FLUXO	13.077.415/0001-05	453.966,39	0,21%	0,78%	1,85%	4,45%	0,50%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	13.058.816/0001-18	372.857,34	-8,30%	-3,66%	3,00%	8,77%	-9,82%
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	05.164.356/0001-84	220.618,09	0,29%	1,05%	2,38%	5,57%	0,67%
BB PREVID RF IDKA 2	13.322.205/0001-35	19.298,67	0,62%	2,17%	5,12%	10,31%	1,01%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	14.508.643/0001-55	497,14	0,22%	0,84%	1,96%	4,69%	0,53%



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

	Mar/19	Abr/19	Mai/19	Jun/19	Jul/19	Ago/19	Set/19	Out/19	Nov/19	Dez/19	Jan/20	Fev/20	12 Meses	Acumulado 2020
PERFORMANCE GERAL	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,49%	0,25%	0,75%	0,75%
INPC + 6,00% (Mar/19 - Dez/19)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,69%	0,73%	1,44%	1,44%
IPCA + 6,00% (Jan/20 - Fev/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				
Total Geral	3.330.356,82	4.207.635,40			290.762,31		0,7572		1,4407	52,5605				

SALDO ANTERIOR (31/01/2020)

R\$ 37.548.948,58

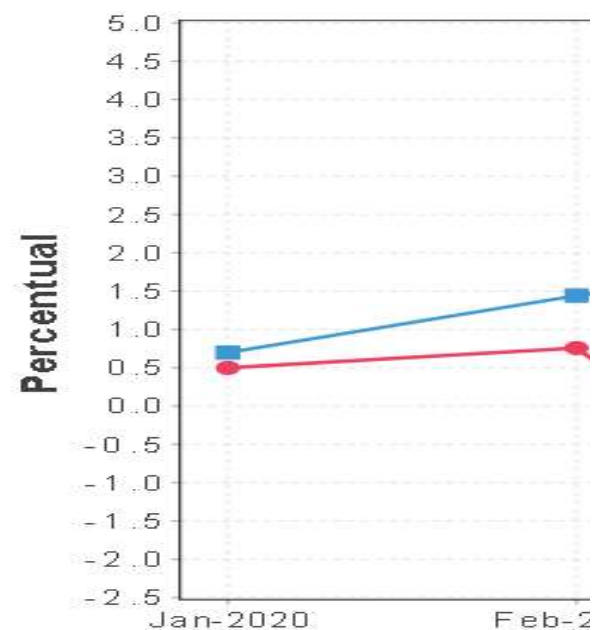
SALDO ATUAL (28/02/2020)

R\$ 37.281.891,67

PERFORMANCE
META

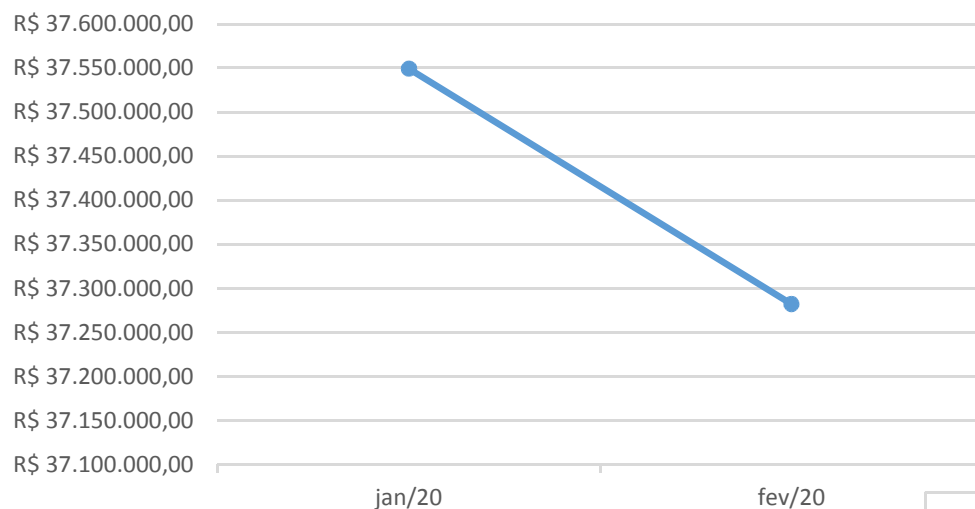
MÊS
0,25%
0,73%

ACUMULADO
0,75%
1,44%

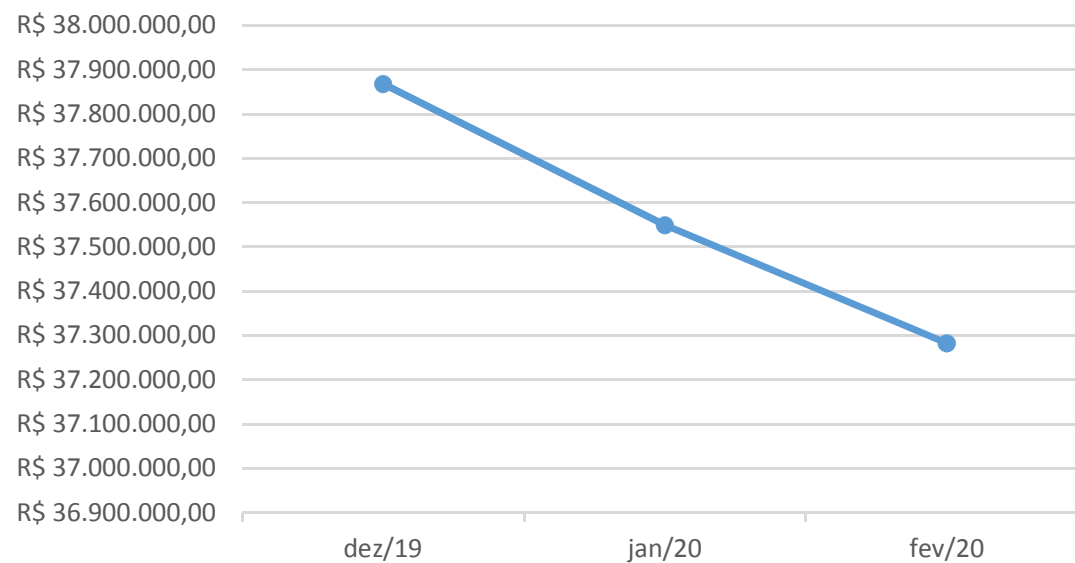


RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO FEVEREIRO/2020



EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO 2020





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - FEV/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)		34.293.341,09	91,9839%	100,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	100,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF IDKA 2	IDKA IPCA 2A	19.298,67	0,0517%							Enquadrado
BB PREVID RF IRF-M	IRF-M	992.621,71	2,6624%							Enquadrado
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	IRF-M1+	732.843,19	1,9656%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	IDKA IPCA 2A	3.872.476,84	10,3870%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	IMA-B	6.019.946,03	16,1471%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	IRF-M1	3.085.134,93	8,2751%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	CDI	220.618,09	0,5917%							Enquadrado
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	Outros	6.069.998,07	16,2813%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	IMA-B5+	2.143.149,89	5,7485%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	IRF-M1+	1.067.892,35	2,8643%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-GERAL	2.820.026,76	7,5640%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B5	4.930.366,37	13,2245%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M	2.318.968,19	6,2200%							Enquadrado
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7º, Inciso IV, Alínea A)		2.072.016,34	5,5577%	40,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	40,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF FLUXO	CDI	453.966,39	1,2176%							Enquadrado
BB PREVID RF PERFIL	CDI	632.693,79	1,6970%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	497,14	0,0013%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	CDI	984.859,02	2,6416%							Enquadrado



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



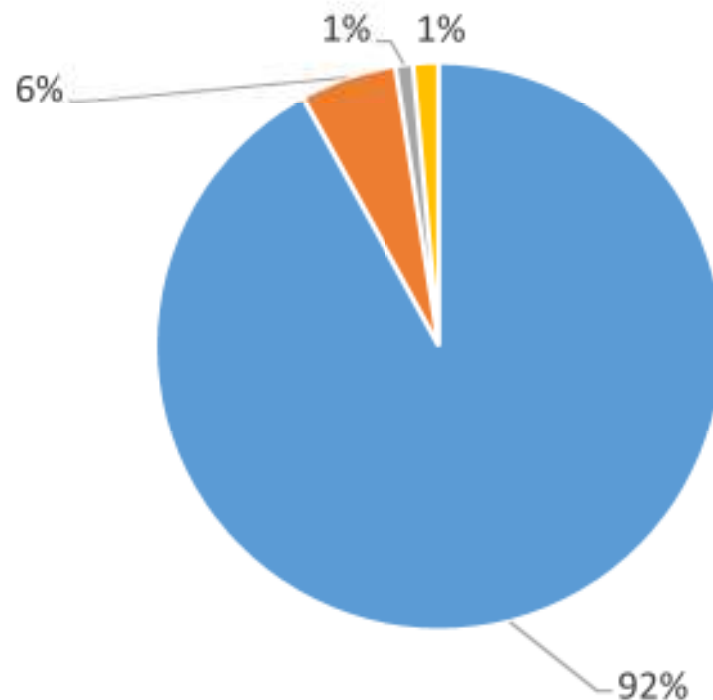
Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM) - FEV/2020

Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8º, Inciso I, Alínea A)		372.857,34	1,0001%	30,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	30,00%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	IBOVESPA	372.857,34	1,0001%						Enquadrado
Fundo de Ações - Geral (Art. 8º, Inciso II, Alínea A)		543.676,90	1,4582%	20,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	20,00%	Enquadrado
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	Outros	543.676,90	1,4582%						Enquadrado
Total Geral		37.281.891,67							

RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Competência: ▼

Veículos	Enquadramento	Benchmarks	Instituição Financeira		
Artigo		Total em 28/02/2020 (R\$)	LIMITE CMN (%)	LIMITE PI (%)	VALOR ITEM (%)
	Art. 7º, Inciso I, Alínea B	R\$ 34.293.341,09	100%	100%	91,98
	Art. 7º, Inciso IV, Alínea A	R\$ 2.072.016,34	40%	40%	5,55
	Art. 8º, Inciso I, Alínea A	R\$ 372.857,34	30%	30%	1
	Art. 8º, Inciso II, Alínea A	R\$ 543.676,90	20%	20%	1,45





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Alocação Máxima - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - FEV/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)	34.293.341,09	91,9839%	100,00	100,00%	Infinito	Infinito
BB PREVID RF IDKA 2	19.298,67	0,0517%			9.315.648,25	9.296.349,58
BB PREVID RF IRF-M	992.621,71	2,6624%			9.072.317,49	8.079.695,78
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	732.843,19	1,9656%			9.137.262,12	8.404.418,93
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	3.872.476,84	10,3870%			8.352.353,70	4.479.876,86
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	6.019.946,03	16,1471%			7.815.486,41	1.795.540,38
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	3.085.134,93	8,2751%			8.549.189,18	5.464.054,25
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	220.618,09	0,5917%			9.265.318,39	9.044.700,30
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	6.069.998,07	16,2813%			7.802.973,40	1.732.975,33
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	2.143.149,89	5,7485%			8.784.685,44	6.641.535,55
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	1.067.892,35	2,8643%			9.053.499,83	7.985.607,48
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.820.026,76	7,5640%			8.615.466,22	5.795.439,46
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	4.930.366,37	13,2245%			8.087.881,32	3.157.514,95
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.318.968,19	6,2200%			8.740.730,87	6.421.762,68
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7o, Inciso IV, Alínea A)	2.072.016,34	5,5577%	40,00	40,00%	23.473.250,22	21.401.233,88
BB PREVID RF FLUXO	453.966,39	1,2176%			9.206.981,32	8.753.014,93
BB PREVID RF PERFIL	632.693,79	1,6970%			9.162.299,47	8.529.605,68
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	497,14	0,0013%			9.320.348,63	9.319.851,49



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	984.859,02	2,6416%			9.074.258,16	8.089.399,14
Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8º, Inciso I, Alínea A)	372.857,34	1,0001%	30,00	30,00%	15.818.157,57	15.445.300,23
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	372.857,34	1,0001%			9.227.258,58	8.854.401,24
Fundo de Ações - Geral (Art. 8º, Inciso II, Alínea A)	543.676,90	1,4582%	20,00	20,00%	9.184.553,69	8.640.876,79
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	543.676,90	1,4582%			9.184.553,69	8.640.876,79



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira

NOME	DESCRIÇÃO	TOTAL EM 28/02/2020 (R\$)	PERCENTUAL (%)
OUTROS	Outros	R\$ 6.613.674,97	17,73%
IMA-B	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B	R\$ 6.019.946,03	16,14%
IMA-B5	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B < 5 anos	R\$ 4.930.366,37	13,22%
IDKA IPCA 2A	Índice de Duração Contante AMBIMA segmento 2A	R\$ 3.891.775,51	10,43%
IRF-M	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F	R\$ 3.311.589,90	8,88%
IRF-M1	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F < 1 anos	R\$ 3.085.134,93	8,27%
IMA-GERAL	Índice de Mercado AMBIMA - Média ponderada dos retornos diários	R\$ 2.820.026,76	7,56%
CDI	Certificado de Depósito Interbancário	R\$ 2.292.634,43	6,14%
IMA-B5+	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B >= 5 anos	R\$ 2.143.149,89	5,74%
IRF-M1+	Índice de Mercado AMBIMA-LTN E NTN-F >= 1 anos	R\$ 1.800.735,54	4,83%
IBOVESPA	Índice Bovespa	R\$ 372.857,34	1,00%

OUTROS

IM-B

IM-B5

IDK IPC

2

IRF-M

IRF-M1

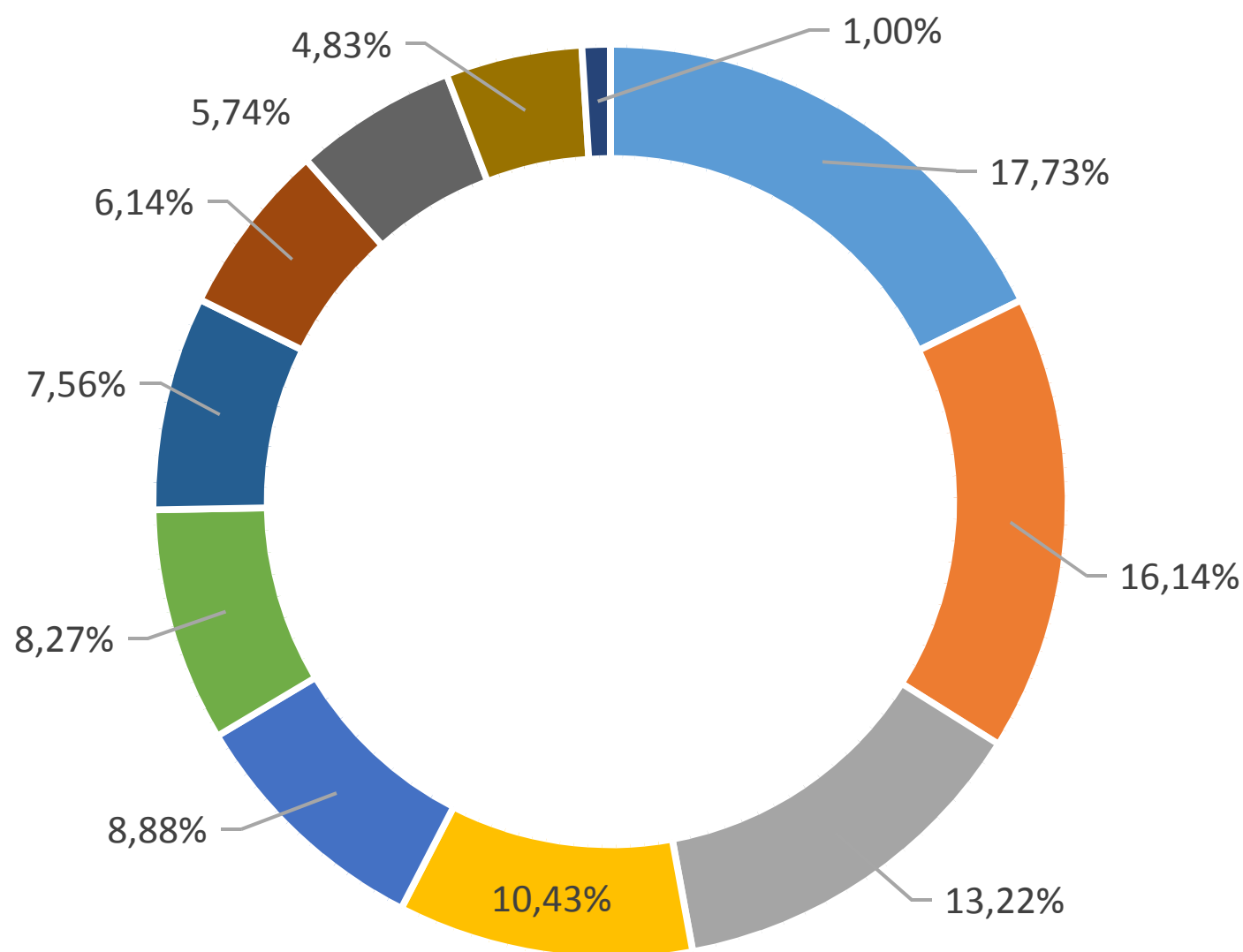
IM-GERL

CDI

IM-B5+

IRF-M1+

IBOVESPA



Competência

FEV/2020

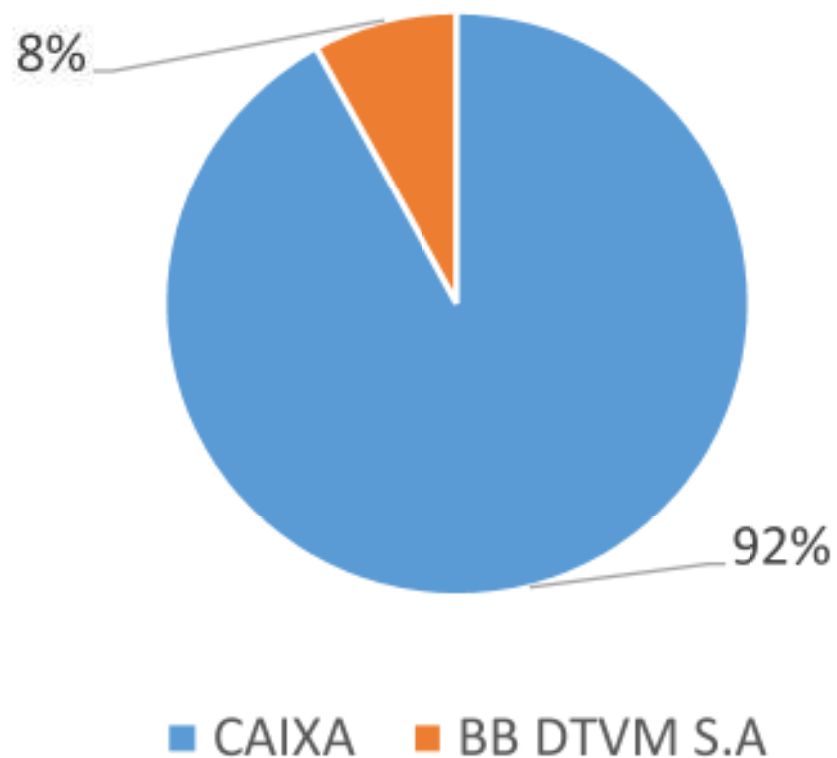


Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira



RESUMO DE ALOCAÇÃO DE RECURSOS

