



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

SETEMBRO 2020



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

Comparativos		Valor Investido (R\$)	Último Mês	Últimos 3 Meses	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	No ano
IPCA + 6,00%			1,12%	2,73%	3,78%	9,36%	5,87%
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM)		33.905.700,49	-0,83%	0,42%	4,44%	4,50%	2,16%
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	5.919.162,53	-1,53%	0,89%	5,84%	1,67%	-0,99%
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	23.215.097/0001-55	5.656.423,07	-0,50%	-0,09%	3,18%	6,40%	4,53%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.060.913/0001-10	4.011.095,57	-0,15%	1,20%	4,95%	6,91%	4,28%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	3.499.727,73	0,03%	1,66%	5,26%	7,35%	4,83%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.061.217/0001-28	2.847.718,43	-0,60%	0,30%	3,01%	3,80%	1,91%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.508.605/0001-00	2.386.123,89	-0,61%	-0,30%	3,01%	6,30%	4,41%
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.107.430,87	0,13%	0,47%	1,56%	4,33%	2,96%
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	10.577.503/0001-88	2.034.701,41	-2,64%	0,65%	6,56%	-2,10%	-4,82%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	10.577.519/0001-90	1.042.499,33	-0,97%	-0,67%	3,70%	7,33%	5,16%
BB PREVID RF IRF-M	07.111.384/0001-69	1.020.267,31	-0,65%	-0,34%	2,89%	6,21%	4,31%
BB PREVID RF FLUXO	13.077.415/0001-05	1.009.538,52	0,00%	0,17%	0,66%	2,40%	1,42%
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	32.161.826/0001-29	753.359,89	-1,15%	-0,86%	3,23%	6,83%	4,69%
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	05.073.656/0001-58	513.805,16	-1,66%	0,72%	-	-	2,76%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	10.551.382/0001-03	492.107,45	-5,18%	-0,85%	30,76%	-5,20%	-16,85%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	13.058.816/0001-18	338.455,60	-4,71%	-0,48%	29,14%	-9,67%	-18,14%
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	05.164.356/0001-84	223.472,94	-0,18%	0,15%	0,93%	3,21%	1,98%
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	24.192,15	0,02%	0,44%	1,22%	2,97%	1,81%
BB PREVID RF IDKA 2	13.322.205/0001-35	19.972,97	0,11%	1,61%	5,24%	7,28%	4,54%
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	4.436,69	0,00%	0,39%	0,96%	2,89%	1,76%



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	14.508.643/0001-55	1.208,98	0,08%	0,29%	0,82%	2,67%	1,63%
-------------------------------------	--------------------	----------	-------	-------	-------	-------	-------



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

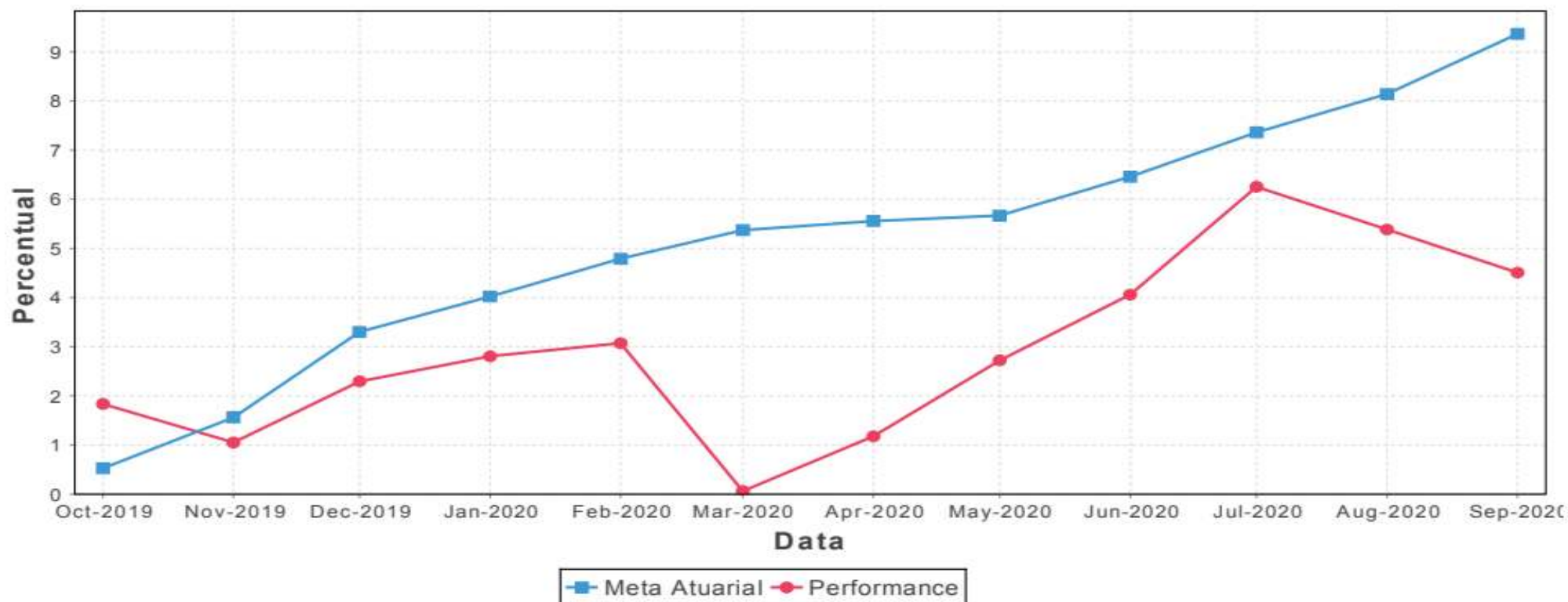


Performance Geral - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM) - SET/2020

	Out/19	Nov/19	Dez/19	Jan/20	Fev/20	Mar/20	Abr/20	Mai/20	Jun/20	Jul/20	Ago/20	Set/20	12 Meses	Acumulado 2020
PERFORMANCE GERAL	-	-	-	0,49%	0,25%	-2,91%	1,11%	1,52%	1,30%	2,10%	-0,81%	-0,83%	2,16%	2,16%
INPC + 6,00% (Out/19 - Dez/19)	-	-	-	0,69%	0,73%	0,55%	0,17%	0,10%	0,74%	0,84%	0,72%	1,12%	5,87%	5,87%
IPCA + 6,00% (Jan/20 - Set/20)	-	-	-	0,69%	0,73%	0,55%	0,17%	0,10%	0,74%	0,84%	0,72%	1,12%	5,87%	5,87%
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				
2020/09	34.651.239,91	2.404.358,69	2.861.037,80	33.905.700,49	-288.860,31	-0,8323	2,1623	1,1298	5,8704	-73,6669				
Total Geral	20.948.641,68	25.625.346,31			713.997,18		2,1623		5,8704	36,8340				

SALDO ANTERIOR
R\$ 34.651.239,21

SALDO ATUAL
R\$ 33.905.700,49



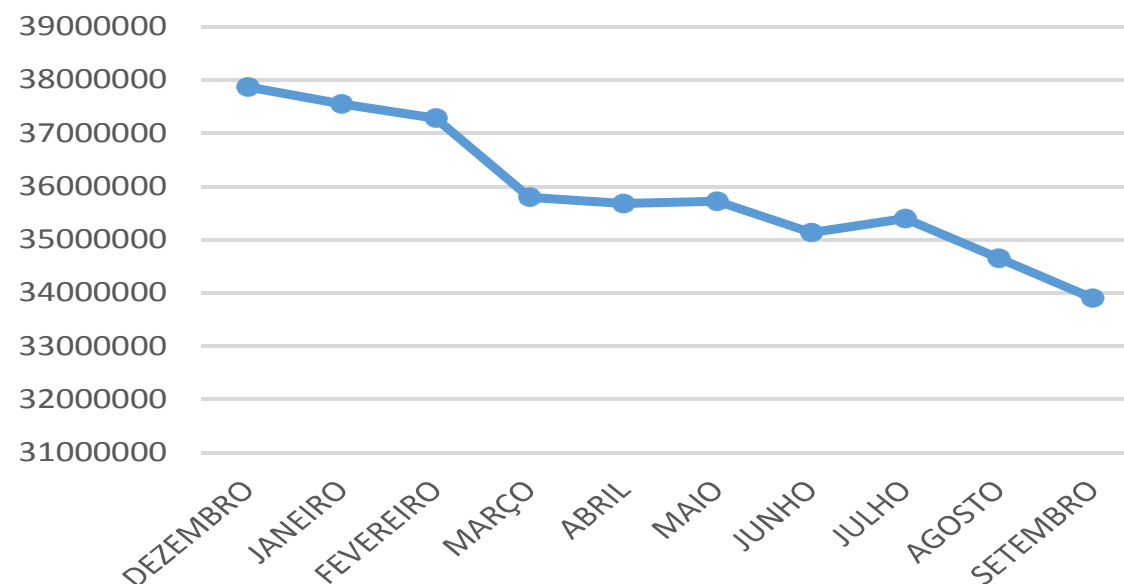
	MÊS	ACUMULADO
PERFORMANCE	-0,83%	2,16%
META	1,12%	5,87%

RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

EVOLUÇÃO PATRIMÔNIO SETEMBRO 2020



EVOLUÇÃO PATRIMÔNIO 2020





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - SET/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)		31.521.955,94	92,9694%	100,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	100,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF IDKA 2	IDKA IPCA 2A	19.972,97	0,0589%							Enquadrado
BB PREVID RF IRF-M	IRF-M	1.020.267,31	3,0091%							Enquadrado
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	IRF-M1+	753.359,89	2,2219%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	IDKA IPCA 2A	3.499.727,73	10,3219%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	IMA-B	5.919.162,53	17,4577%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	IRF-M1	2.107.430,87	6,2155%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	CDI	223.472,94	0,6591%							Enquadrado
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	Outros	5.856.423,07	16,6828%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	IMA-B5+	2.034.701,41	6,0010%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	IRF-M1+	1.042.499,33	3,0747%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-GERAL	2.847.718,43	8,3989%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B5	4.011.095,57	11,8301%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M	2.386.123,89	7,0375%							Enquadrado
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7o, Inciso IV, Alínea A)		1.553.181,50	4,5808%	40,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	40,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF FLUXO	CDI	1.009.538,52	2,9774%							Enquadrado
BB PREVID RF PERFIL	CDI	24.192,15	0,0713%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	1.208,98	0,0035%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	CDI	4.436,69	0,0130%							Enquadrado



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	IMA-B	513.805,16	1,5153%							Enquadrado
Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8o, Inciso I, Alínea A)		338.455,60	0,9982%	30,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	30,00%	Enquadrado	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	IBOVESPA	338.455,60	0,9982%							Enquadrado
Fundo de Ações - Geral (Art. 8o, Inciso II, Alínea A)		492.107,45	1,4514%	20,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	20,00%	Enquadrado	
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	Outros	492.107,45	1,4514%							Enquadrado
Total Geral		33.905.700,49								

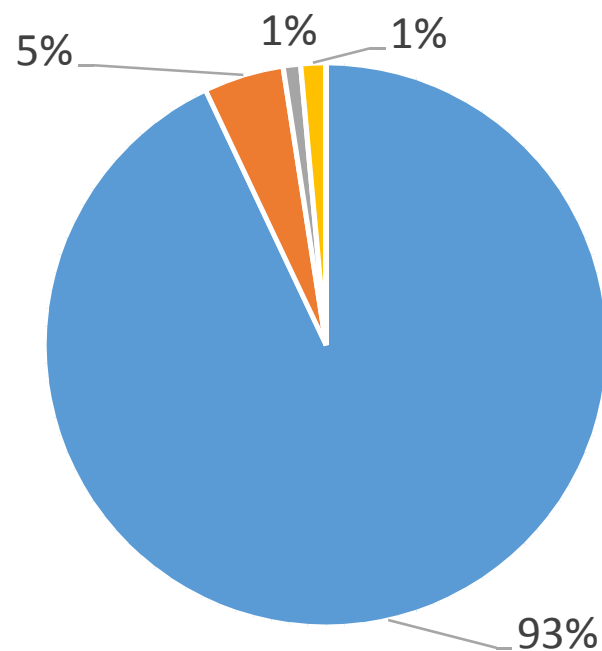


RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Competência: 9ET/2020

Veículos Enquadramento Benchmarks Instituição Financeira

Artigo	Total em 30/09/2020 (R\$)	LIMITE CMN (%)	LIMITE PI (%)	VALOR ITEM (%)
Art. 7º, Inciso I, Alínea B	R\$ 31.521.955,94	100%	100%	92,96
Art. 7º, Inciso IV, Alínea A	R\$ 1.553.181,50	40%	40%	4,58
Art. 8º, Inciso I, Alínea A	R\$ 338.455,60	30%	30%	0,99
Art. 8º, Inciso II, Alínea A	R\$ 492.107,45	20%	20%	1,45





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Alocação Máxima - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - OUT/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 configuração 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)	31.077.285,46	92,5434%	100,00	100,00%	Infinito	Infinito
BB PREVID RF IDKA 2	20.038,60	0,0596%			8.390.314,78	8.370.276,18
BB PREVID RF IRF-M	1.017.064,88	3,0286%			8.141.058,21	7.123.993,33
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	749.244,79	2,2311%			8.208.013,23	7.458.768,44
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	3.505.074,52	10,4375%			7.519.055,80	4.013.981,28
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	5.930.617,61	17,6604%			6.912.670,03	982.052,42
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	2.110.442,32	6,2845%			7.867.713,85	5.757.271,53
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	223.732,65	0,6662%			8.339.391,27	8.115.658,62
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	5.200.861,13	15,4873%			7.095.109,15	1.894.248,02
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	2.039.133,76	6,0722%			7.885.540,99	5.846.407,23
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	1.036.652,30	3,0869%			8.136.161,35	7.099.509,05
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.848.493,95	8,4823%			7.683.200,94	4.834.706,99
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	4.018.365,27	11,9660%			7.390.733,11	3.372.367,84
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.377.563,68	7,0800%			7.800.933,51	5.423.369,83
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7o, Inciso IV, Alínea A)	1.686.943,06	5,0234%	40,00	40,00%	21.262.903,11	19.575.960,05
BB PREVID RF FLUXO	1.142.359,39	3,4017%			8.109.734,58	6.967.375,19
BB PREVID RF PERFIL	24.230,70	0,0721%			8.389.266,75	8.365.036,05
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.108,34	0,0062%			8.394.797,34	8.392.689,00



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	4.442,03	0,0132%			8.394.213,92	8.389.771,89
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	513.802,60	1,5300%			8.266.873,78	7.753.071,18
Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8º, Inciso I, Alínea A)	335.964,83	1,0004%	30,00	30,00%	14.247.999,81	13.912.034,98
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	335.964,83	1,0004%			8.311.333,22	7.975.368,39
Fundo de Ações - Geral (Art. 8º, Inciso II, Alínea A)	481.104,38	1,4326%	20,00	20,00%	8.275.048,33	7.793.943,95
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	481.104,38	1,4326%			8.275.048,33	7.793.943,95



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

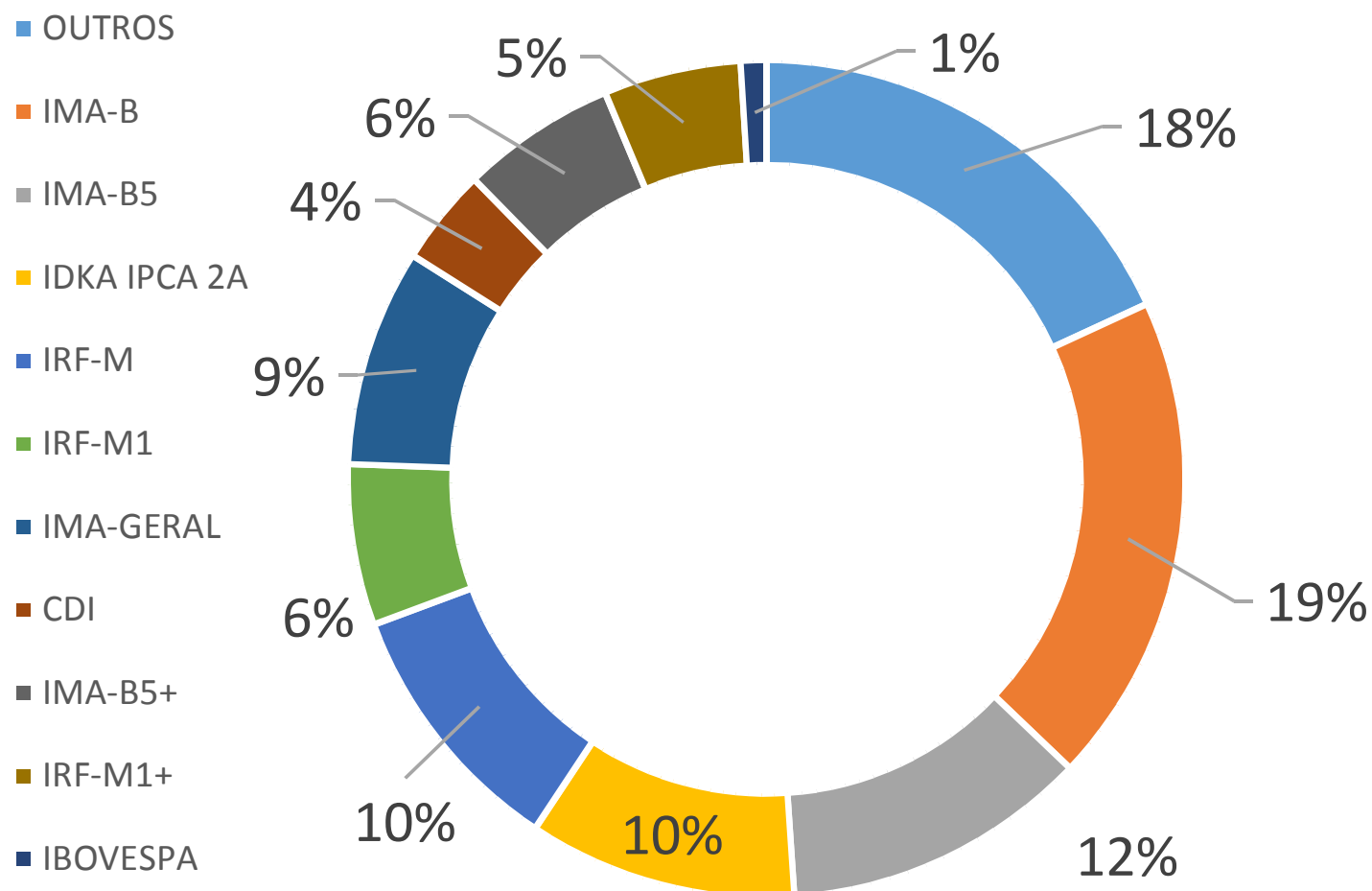
Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira

NOME	DESCRIÇÃO	TOTAL EM 30/09/2020 (R\$)	PERCENTUAL (%)
OUTROS	Outros	R\$ 6.148.530,52	18,13%
IMA-B	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B	R\$ 6.432.967,69	18,97%
IMA-B5	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B < 5 anos	R\$ 4.011.095,57	11,83%
IDKA IPCA 2A	Índice de Duração Contante AMBIMA segmento 2A	R\$ 3.519.700,70	10,38%
IRF-M	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F	R\$ 3.406.391,20	10,04%
IRF-M1	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F < 1 anos	R\$ 2.107.430,87	6,21%
IMA-GERAL	Índice de Mercado AMBIMA - Média ponderada dos retornos diários	R\$ 2.847.718,43	8,39%
CDI	Certificado de Depósito Interbancário	R\$ 1.262.849,28	3,72%
IMA-B5+	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B >= 5 anos	R\$ 2.034.701,41	6,00%
IRF-M1+	Índice de Mercado AMBIMA-LTN E NTN-F >= 1 anos	R\$ 1.795.859,22	5,29%
IBOVESPA	Índice Bovespa	R\$ 338.455,60	0,99%



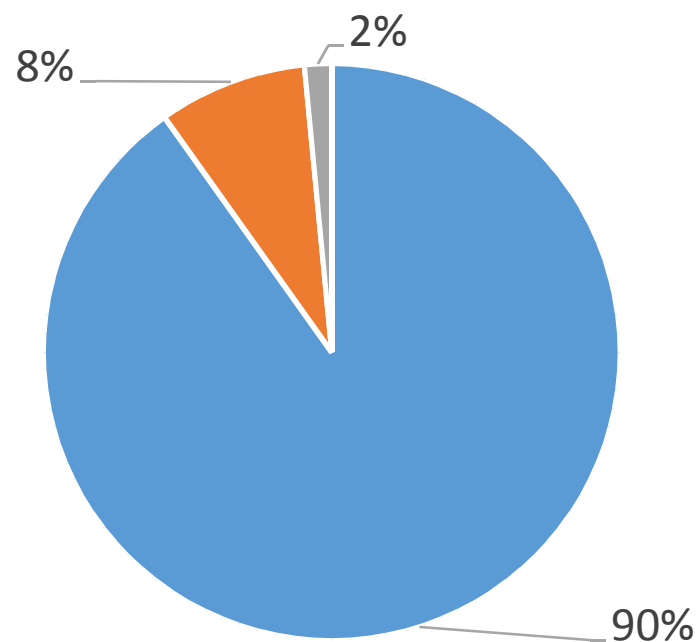


RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Competência SET/2020

Veículos Enquadramento Benchmarks Instituição Financeira

NOME	TOTAL EM 30/09/2020 (R\$)	PERCENTUAL (%)
CAIXA	R\$ 30.564.564,49	90,14%
BB DTVM S.A	R\$ 2.827.330,84	8,33%
ITAÚ UNIBANCO	R\$ 513.805,16	1,51%



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

