



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

MARÇO 2020

RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Comparativos		Valor Investido (R\$)	Último Mês	Últimos 3 Meses	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	No ano
IPCA + 6.00%			0.55%	2.00%	5.37%	9.49%	2.00%
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM)		35.800.208,36	-2.91%	-2.18%	0.06%	8.42%	-2.18%
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	6.062.066,08	-0,13%	1,30%	3,12%	13,46%	1,30%
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	10.740.658/0001-93	5.592.401,48	-7,10%	-6,46%	-3,93%	8,66%	-6,46%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.060.913/0001-10	4.841.761,53	-1,79%	-0,64%	1,86%	-	-0,64%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	3.816.182,97	-1,45%	-0,40%	1,98%	8,02%	-0,40%
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	3.103.269,55	0,58%	1,37%	2,72%	6,46%	1,37%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.061.217/0001-28	2.764.415,39	-1,97%	-1,06%	0,76%	8,06%	-1,06%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.508.605/0001-00	2.316.343,01	-0,11%	1,36%	3,19%	10,77%	1,36%
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	10.577.503/0001-88	1.909.362,02	-10,90%	-10,68%	-8,13%	7,74%	-10,68%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	10.577.519/0001-90	1.063.129,87	-0,44%	1,40%	3,50%	-	1,40%
BB PREVID RF IRF-M	07.111.384/0001-69	991.522,07	-0,11%	1,38%	3,21%	10,86%	1,38%
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	32.161.826/0001-29	729.718,76	-0,42%	1,40%	3,48%	-	1,40%
BB PREVID RF FLUXO	13.077.415/0001-05	660.124,22	0,24%	0,75%	1,72%	4,30%	0,75%
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	632.484,60	-0,03%	0,59%	1,73%	-	0,59%
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	436.460,97	0,14%	0,78%	1,91%	-	0,78%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	10.551.382/0001-03	376.323,69	-30,78%	-36,41%	-27,51%	-12,79%	-36,41%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	13.058.816/0001-18	262.069,34	-29,71%	-36,62%	-30,05%	-23,39%	-36,62%
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	05.164.356/0001-84	221.400,12	0,35%	1,03%	2,25%	5,46%	1,03%
BB PREVID RF IDKA 2	13.322.205/0001-35	18.977,80	-1,66%	-0,66%	1,93%	7,77%	-0,66%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	14.508.643/0001-55	2.194,89	0,26%	0,79%	1,83%	4,54%	0,79%



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

	Abr/19	Mai/19	Jun/19	Jul/19	Ago/19	Set/19	Out/19	Nov/19	Dez/19	Jan/20	Fev/20	Mar/20	12 Meses	Acumulado 2020
PERFORMANCE GERAL	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,49%	0,25%	-2,91%	-2,18%	-2,18%
INPC + 6,00% (Abr/19 - Dez/19)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,69%	0,73%	0,55%	2,00%	2,00%
IPCA + 6,00% (Jan/20 - Mar/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				
Total Geral	5.507.902,13	6.729.323,86			-846.777,85		-2,1818		2,0058	-108,7719				

SALDO ANTERIOR (28/02/2020)

R\$ 37.281.891,67

SALDO ATUAL (31/03/2020)

R\$ 35.800.208,36

PERFORMANCE
META

MÊS
-2,91%
0,55%

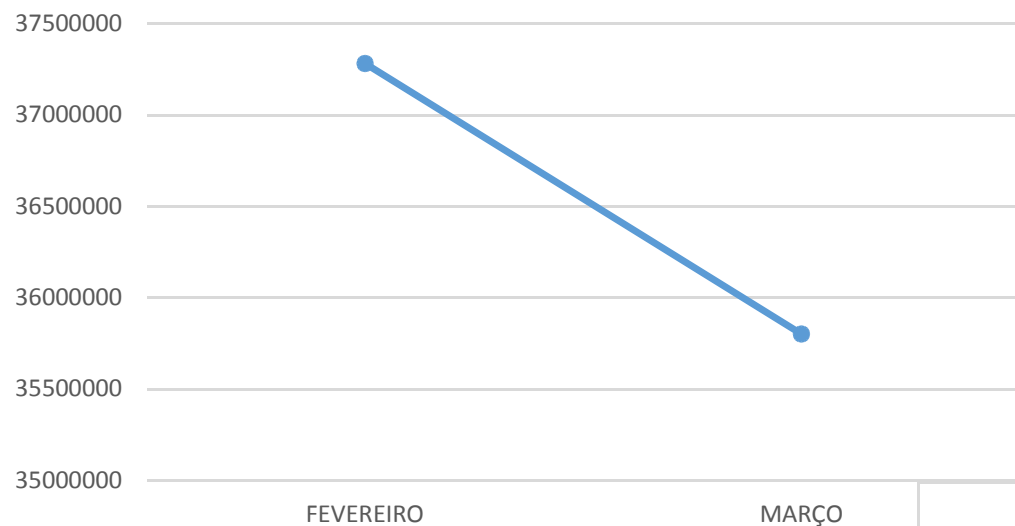
ACUMULADO
-2,18%
2,00%



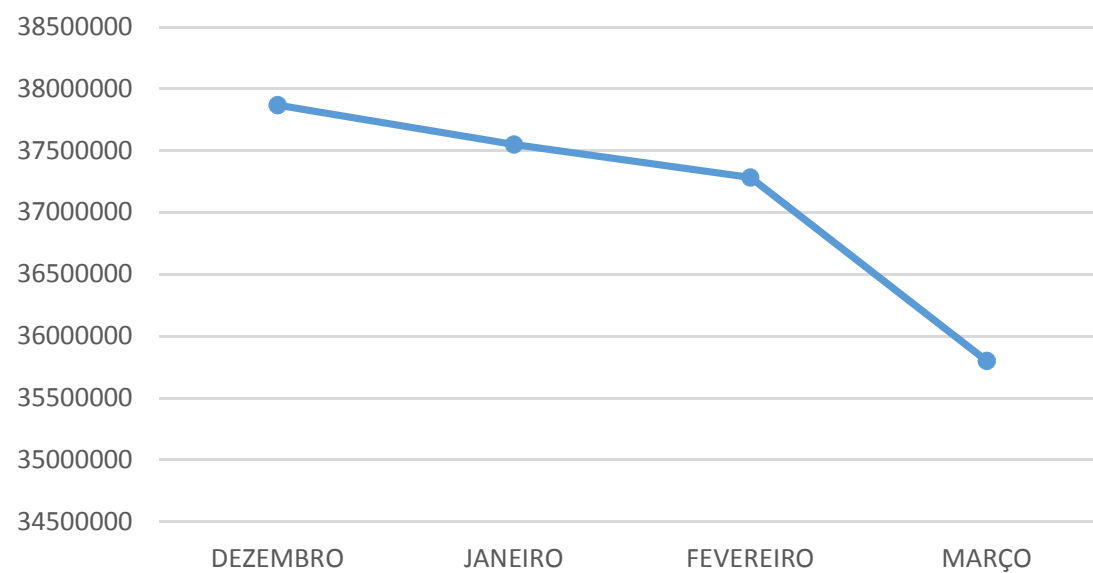


RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO MARÇO



EVOLUÇÃO PATRIMÔNIO 2020





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - MAR/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)		33.430.550,65	93,3808%	100,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	100,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF IDKA 2	IDKA IPCA 2A	18.977,80	0,0530%							Enquadrado
BB PREVID RF IRF-M	IRF-M	991.522,07	2,7695%							Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	IRF-M1+	729.718,76	2,0383%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	IDKA IPCA 2A	3.816.182,97	10,6596%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	IMA-B	5.592.401,48	15,6211%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	IRF-M1	3.103.269,55	8,6683%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	CDI	221.400,12	0,6184%							Enquadrado
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	Outros	6.062.066,08	16,9330%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	IMA-B5+	1.909.362,02	5,3333%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	IRF-M1+	1.063.129,87	2,9696%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-GERAL	2.764.415,39	7,7217%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B5	4.841.761,53	13,5243%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M	2.316.343,01	6,4701%							Enquadrado
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7º, Inciso IV, Alínea A)		1.731.264,68	4,8359%	40,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	40,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF FLUXO	CDI	660.124,22	1,8439%							Enquadrado
BB PREVID RF PERFIL	CDI	632.484,60	1,7667%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	2.194,89	0,0061%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	CDI	436.460,97	1,2191%							Enquadrado



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8o, Inciso I, Alínea A)		262.069,34	0,7320%	30,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	30,00%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	IBOVESPA	262.069,34	0,7320%						Enquadrado
Fundo de Ações - Geral (Art. 8o, Inciso II, Alínea A)		376.323,69	1,0511%	20,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	20,00%	Enquadrado
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	Outros	376.323,69	1,0511%						Enquadrado
Total Geral		35.800.208,36							



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Competência

MAR/2020

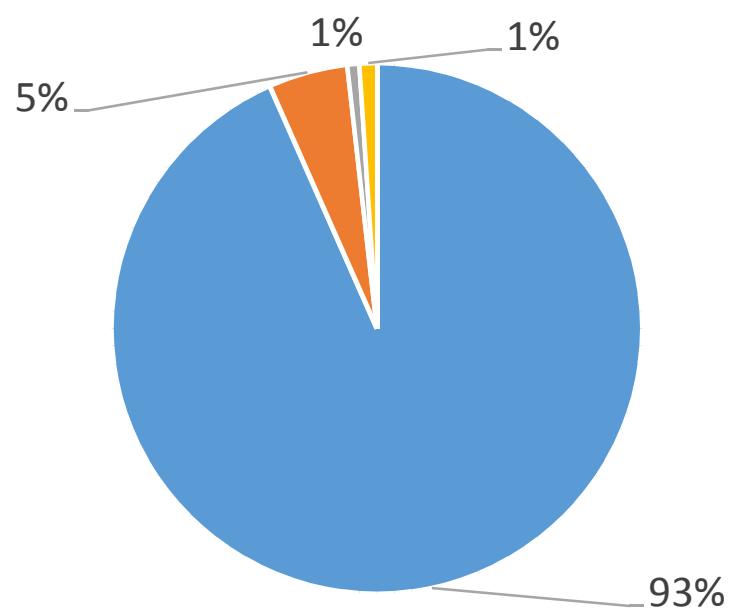
Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira

Artigo	Total em 31/03/2020 (R\$)	LIMITE CMN (%)	LIMITE PI (%)	VALOR ITEM (%)
Art. 7º, Inciso I, Alínea B	R\$ 33.430.550,65	100%	100%	93,38
Art. 7º, Inciso IV, Alínea A	R\$ 1.731.264,68	40%	40%	4,83
Art. 8º, Inciso I, Alínea A	R\$ 262.069,34	30%	30%	0,73
Art. 8º, Inciso II, Alínea A	R\$ 376.323,69	20%	20%	1,05





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Alocação Máxima - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - ABR/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)	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 31/03/2020 (R\$)	PERCENTUAL (%)
OUTROS	Outros	R\$ 6.438.389,77	17,98%
IMA-B	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B	R\$ 5.592.401,48	15,62%
IMA-B5	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B < 5 anos	R\$ 4.841.761,53	13,52%
IDKA IPCA 2A	Índice de Duração Contante AMBIMA segmento 2A	R\$ 3.835.160,77	10,71%
IRF-M	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F	R\$ 3.307.865,08	9,23%
IRF-M1	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F < 1 anos	R\$ 3.103.269,55	8,66%
IMA-GERAL	Índice de Mercado AMBIMA - Média ponderada dos retornos diários	R\$ 2.764.415,39	7,72%
CDI	Certificado de Depósito Interbancário	R\$ 1.952.664,80	5,45%
IMA-B5+	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B >= 5 anos	R\$ 1.909.362,02	5,33%
IRF-M1+	Índice de Mercado AMBIMA-LTN E NTN-F >= 1 anos	R\$ 1.792.848,63	5,00%
IBOVESPA	Índice Bovespa	R\$ 262.069,34	0,73%

OUTROS

IMA-B

IMA-B5

IDKA IPCA 2A

IRF-M

IRF-M1

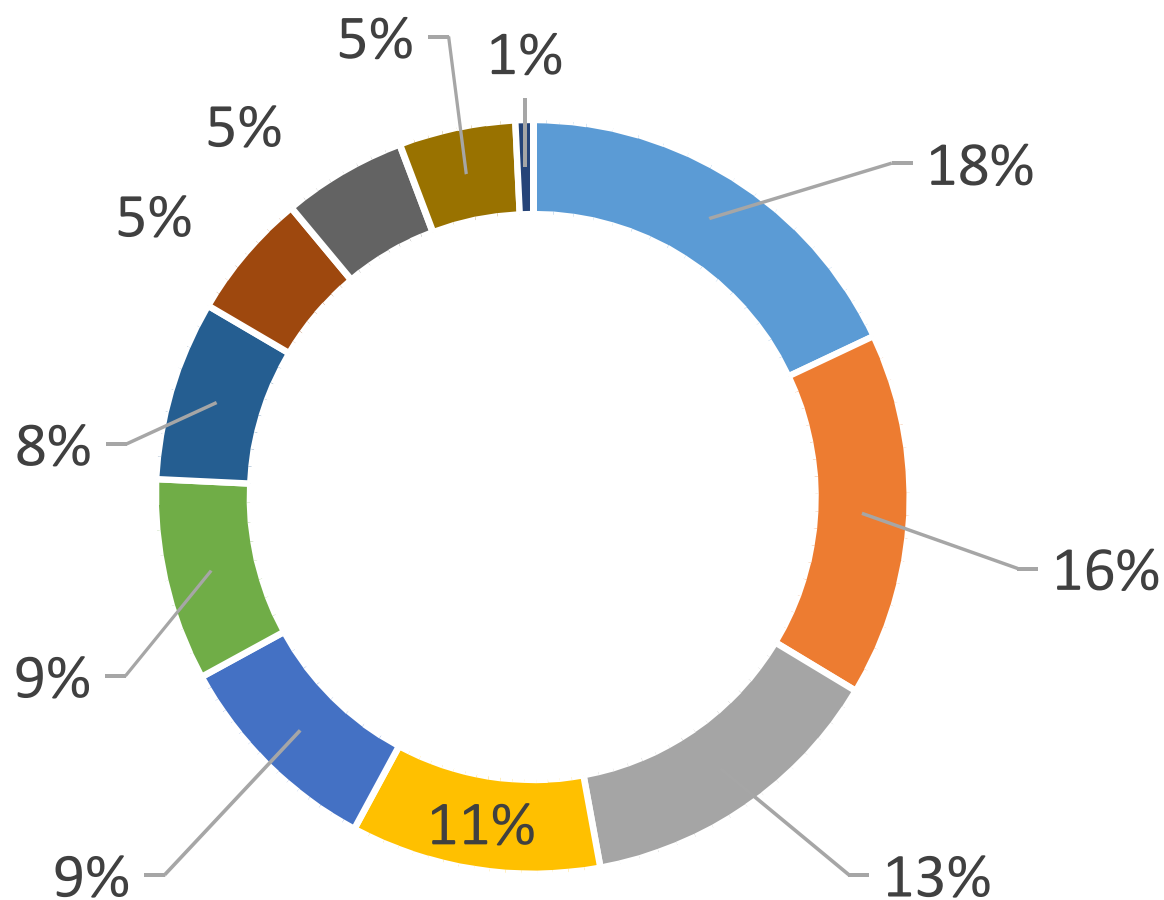
IMA-GERAL

CDI

IMA-B5+

IRF-M1+

IBOVESPA



Competência

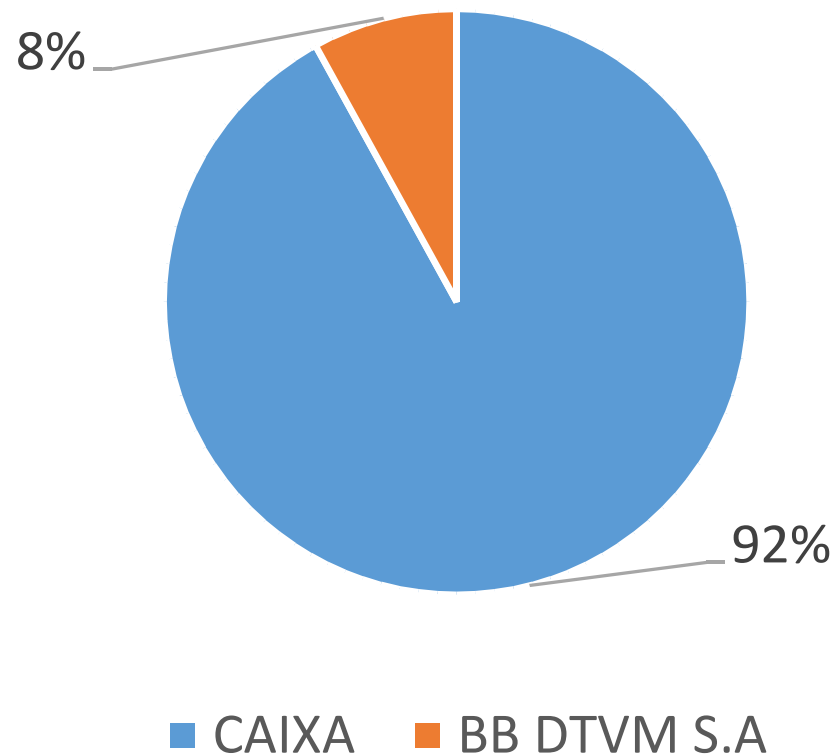
MAR/2020

Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira



RESUMO DE ALOCAÇÃO DE RECURSOS

