

RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

DEZEMBRO 2020



	Jan/20	Fev/20	Mar/20	Abr/20	Mai/20	Jun/20	Jul/20	Ago/20	Set/20	Out/20	Nov/20	Dez/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%	-0,02%	1,45%	2,78%	6,49%	6,49%
IPCA + 6.00%	0,69%	0,73%	0,55%	0,17%	0,10%	0,74%	0,84%	0,72%	1,12%	1,35%	1,38%	1,84%	10,78%	10,78%
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				
2020/10	33.905.700,49	1.604.848,33	1.922.449,59	33.581.297,73	-6.801,50	-0,0272	2,1345	1,3508	7,3006	-2,0134				
2020/11	33.581.297,73	2.916.599,07	3.445.367,96	33.534.515,18	481.986,34	1,4504	3,6158	1,3810	8,7824	105,0229				
2020/12	33.534.515,18	5.685.267,01	3.713.461,77	36.442.613,99	936.293,57	2,7830	6,4995	1,8432	10,7876	150,9816				
Total Geral	31.155.356,09	34.706.625,63			2.125.475,59		6,4995		10,7876	60,2497				

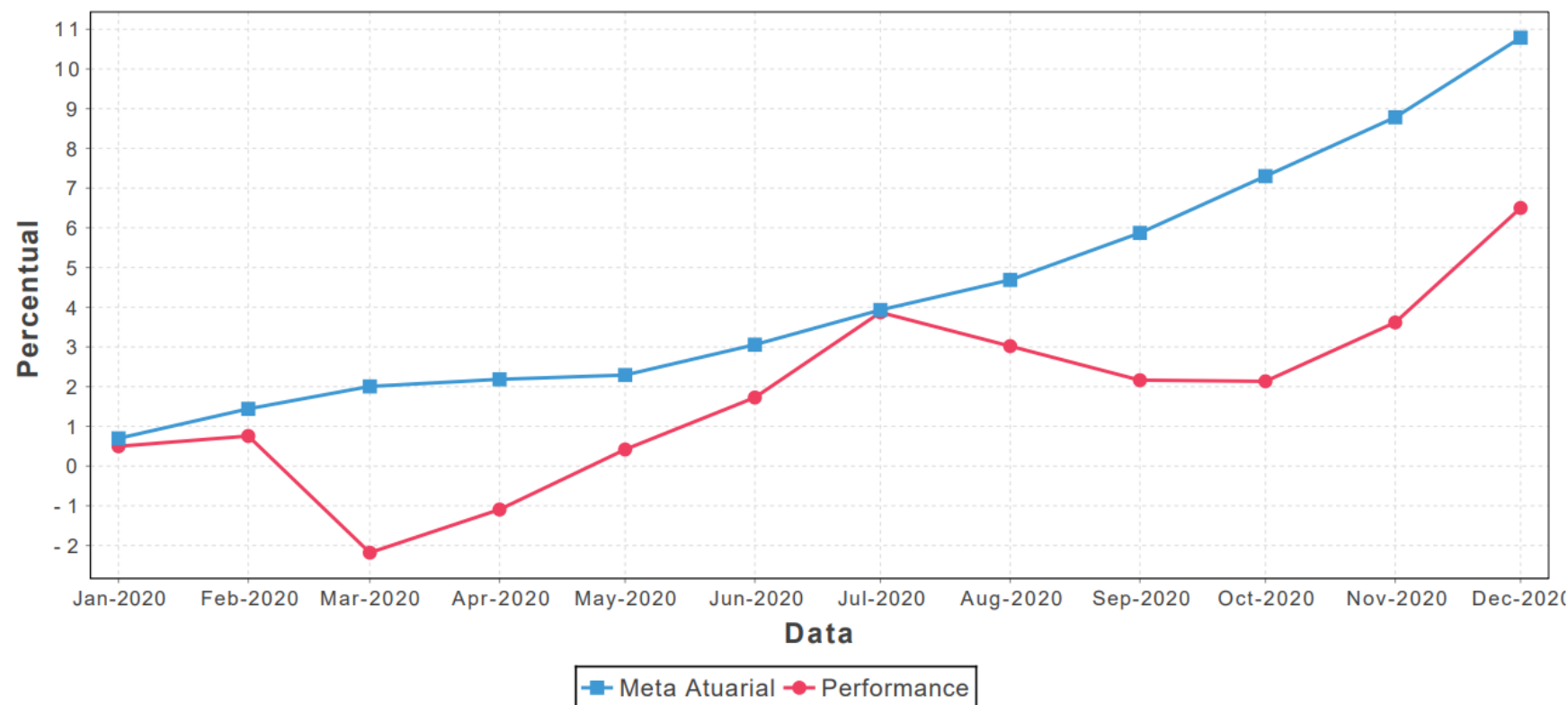
SALDO DE INVESTIMENTOS

Novembro 2020: R\$ 33.534.515,18

Dezembro 2020: R\$ 36.442.613,99



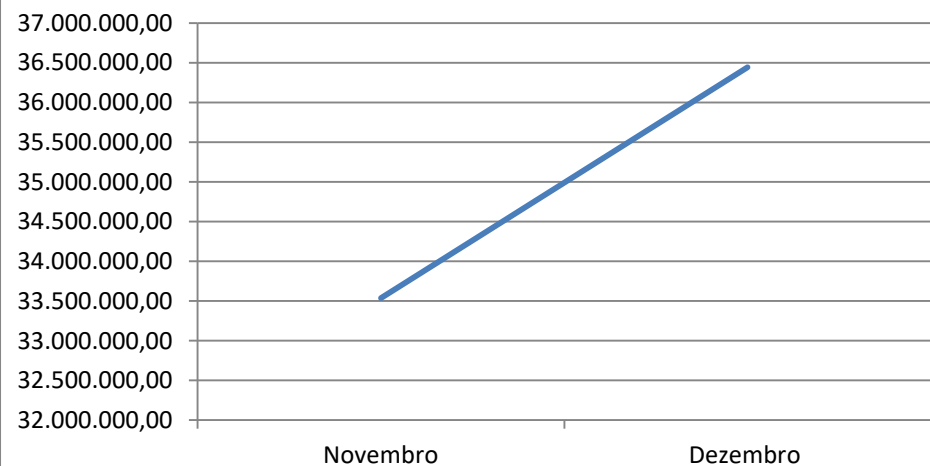
Performance Geral - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA
(IPMM) - DEZ/2020



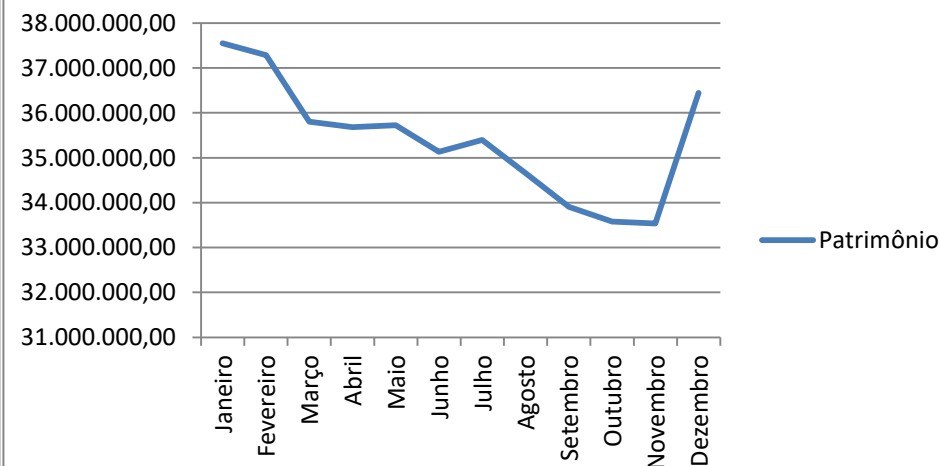
	Dezembro 2020	Acumulado 2020
Rentabilidade	2,78%	6,50%
Meta Atuarial (IPCA + 6%)	1,84%	10,79%

Evolução da Carteira de Investimentos

Comparação mês anterior e atual



Trajetória ao longo do ano



RESUMO DE ENQUADRAMENTO – RESOLUÇÃO CMN 3.922/2010 E ALTERAÇÕES



Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - DEZ/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)		30.282.884,37	83,0974%	100,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	100,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF IDKA 2	IDKA IPCA 2A	20.616,93	0,0565%							Enquadrado
BB PREVID RF IRF-M	IRF-M	1.040.592,71	2,8554%							Enquadrado
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	IRF-M1+	775.801,77	2,1288%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	IDKA IPCA 2A	3.606.395,59	9,8960%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	IMA-B	6.341.323,72	17,4008%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	IRF-M1	794.102,63	2,1790%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	CDI	224.511,46	0,6160%							Enquadrado
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	Outros	5.312.756,31	14,5784%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	IMA-B5+	2.249.620,61	6,1730%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	IRF-M1+	1.072.771,95	2,9437%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-GERAL	2.267.986,87	6,2234%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B5	4.144.183,45	11,3718%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M	2.432.220,37	6,6741%							Enquadrado

Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7o, Inciso IV, Alínea A)		5.139.721,83	14,1036%	40,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	40,00%	Enquadrado
BB PREVID RF FLUXO	CDI	4.522.588,94	12,4101%						Enquadrado
BB PREVID RF PERFIL	CDI	24.330,03	0,0667%						Enquadrado
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	37.958,49	0,1041%						Enquadrado
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	CDI	4.465,04	0,0122%						Enquadrado

Página 1

Impresso em 20/01/2021, às 09:24.



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

ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	IMA-B	550.379,33	1,5102%						Enquadrado
Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8o, Inciso I, Alínea A)		424.856,16	1,1658%	30,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	30,00%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	IBOVESPA	424.856,16	1,1658%						Enquadrado
Fundo de Ações - Geral (Art. 8o, Inciso II, Alínea A)		595.151,63	1,6331%	20,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	20,00%	Enquadrado
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	Outros	595.151,63	1,6331%						Enquadrado
Total Geral		36.442.613,99							

RESUMO DE ENQUADRAMENTO – RESOLUÇÃO CMN 3.922/2010 E ALTERAÇÕES

Veículos	Enquadramento	Benchmarks	Instituição Financeira		
Artigo	Total em 31.12.2020 (R\$)	Limite CMN(%)	Limite PI(%)	Valor Item(%)	
Art. 7o, Inciso I, Alínea B	30.282.884,37	100,00	100,00	83,09	
Art. 7o, Inciso IV, Alínea A	5.139.721,83	40,00	40,00	14,10	
Art. 8o, Inciso I, Alínea A	424.856,16	30,00	30,00	1,16	
Art. 8o, Inciso II, Alínea A	595.151,63	20,00	20,00	1,63	

The pie chart visualizes the data from the table above, showing the percentage distribution of vehicle values across different articles. The largest segment is Art. 7o, Inciso I, Alínea B, which accounts for 83% of the total value. The next largest is Art. 7o, Inciso IV, Alínea A, at 14%. The remaining two articles, Art. 8o, Inciso I, Alínea A and Art. 8o, Inciso II, Alínea A, represent very small percentages of 1,16% and 1,63% respectively.

Article	Percentage
Art. 7o, Inciso I, Alínea B	83%
Art. 7o, Inciso IV, Alínea A	14%
Art. 8o, Inciso I, Alínea A	1,16%
Art. 8o, Inciso II, Alínea A	1,63%

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR FUNDOS DE INVESTIMENTO

Veículos		Enquadramento	Benchmarks	Instituição Financeira				
ID	Nome Veículo	Saldo em 30.11.2020 (R\$)	Saldo em 31.12.2020 (R\$)	Rentabilidade (R\$)	VaR*	Volatilidade*	Sharpe*	Art 14.
393	CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	6.048.546,84	6.341.323,72	292.776,88	0,2107	0,0080	0,3180	0,1000%
394	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	4.070.115,67	4.144.183,45	74.067,78	0,0826	0,0031	1,0467	0,0100%
399	BB PREVID RF IDKA 2	20.307,12	20.616,93	309,81	0,0690	0,0026	1,2750	0,0000%
408	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	4.448,90	4.465,04	16,14	0,0061	0,0002	0,0703	0,0000%
409	BB PREVID RF PERFIL	24.268,96	24.330,03	61,07	0,0037	0,0001	0,0309	0,0000%
426	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	2.114.992,78	794.102,63	4.109,85	0,0090	0,0003	1,7942	0,0000%
428	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	3.547.763,02	3.606.395,59	58.632,57	0,0679	0,0026	1,3276	0,0300%
439	BB PREVID RF FLUXO	1.259.198,84	4.522.588,94	2.124,32	0,0025	0,0000	-2,1032	0,1800%
445	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.378,68	37.958,49	40,35	0,0009	0,0000	-1,0785	0,0000%
481	BB PREVID RF IRF-M	1.020.544,83	1.040.592,71	20.047,88	0,1000	0,0038	0,6530	0,0100%
530	CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	223.942,03	224.511,46	569,43	0,0082	0,0003	0,3858	0,0000%
549	ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	524.479,01	550.379,33	25.900,32	0,2394	0,0091	0,3750	0,0800%
561	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.221.191,73	2.267.986,87	46.795,14	0,0908	0,0034	0,4611	0,1800%
571	FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	2.091.445,05	2.249.620,61	158.175,56	0,3259	0,0124	0,1808	0,1200%
572	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	1.041.146,12	1.072.771,95	31.625,83	0,1485	0,0056	0,6341	0,0300%
573	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.385.421,64	2.432.220,37	46.798,73	0,0997	0,0038	0,6606	0,0600%
595	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	388.912,33	424.856,16	35.943,83	0,7357	0,0281	-0,0097	0,0500%
599	CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	549.372,08	595.151,63	45.779,55	0,7852	0,0300	-0,0493	0,1000%
943	CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	5.243.507,24	5.312.756,31	69.249,07	0,0978	0,0037	0,7064	0,0300%
1013	BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	752.532,31	775.801,77	23.269,46	0,1493	0,0057	0,5900	0,1800%
Totais		33.534.515,18	36.442.613,99	936.293,57				

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR BENCHMARK

Competência

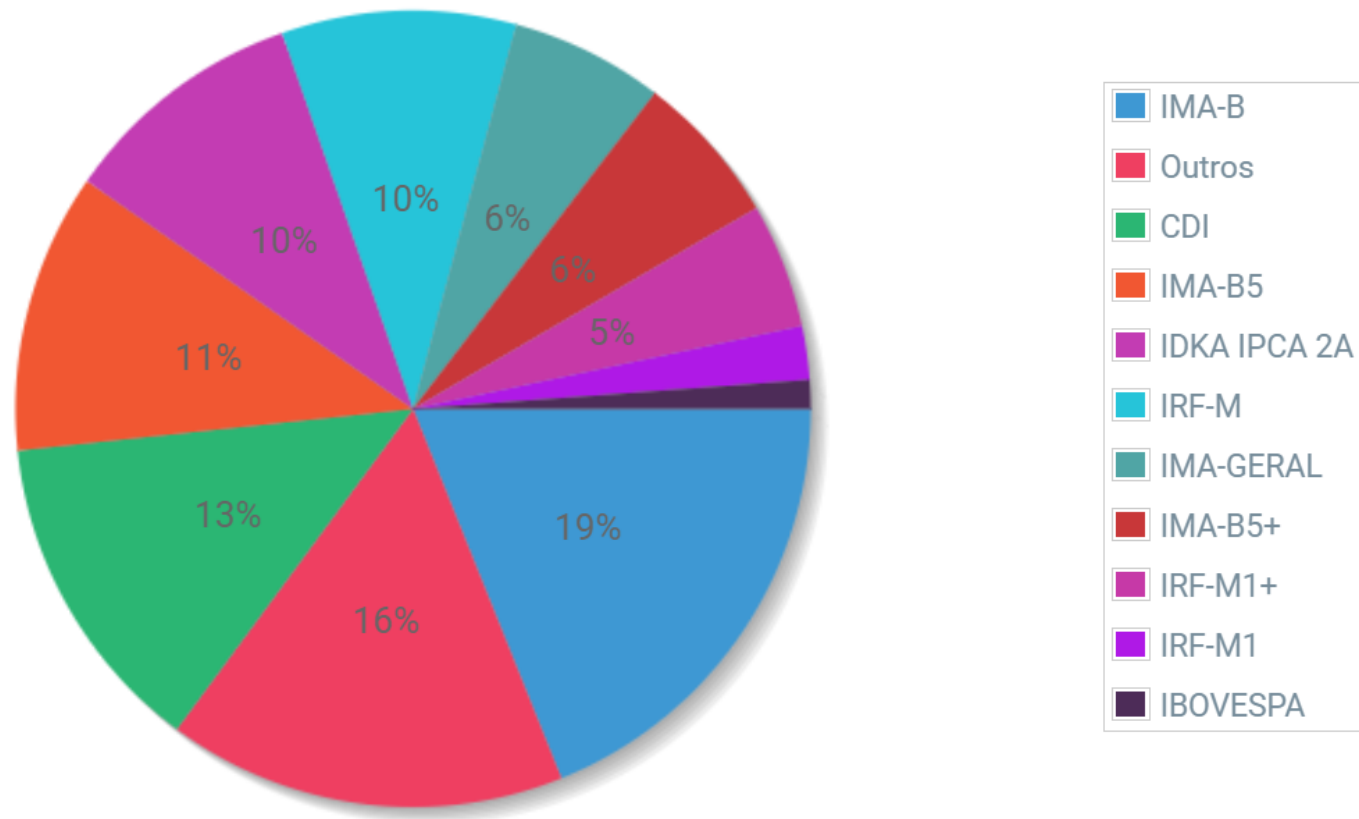
DEZ/2020



*O Valor do VaR, volatilidade e Sharpe foram calculados baseado nas cotas dos fundos de investimentos e do IMA-S. Para metodologias completas, favor contatar nosso suporte.

Veículos	Enquadramento	Benchmarks	Instituição Financeira	
Nome	Descrição		Total em 31.12.2020 (R\$)	Percentual Item(%)
IMA-B	Índice de Mercado ANBIMA - NTN-B		6.891.703,05	18,91
Outros	Outros		5.907.907,94	16,21
CDI	Certificado de Depósito Interbancário		4.813.853,96	13,20
IMA-B5	Índice de Mercado ANBIMA - NTN-B < 5 anos		4.144.183,45	11,37
IDKA IPCA 2A	Índice de Duração Constante ANBIMA segmento 2A		3.627.012,52	9,95
IRF-M	Índice de Mercado ANBIMA - LTN e NTN-F		3.472.813,08	9,52
IMA-GERAL	Índice de Mercado ANBIMA - Média ponderada dos retornos diários		2.267.986,87	6,22
IMA-B5+	Índice de Mercado ANBIMA - NTN-B >= 5 anos		2.249.620,61	6,17
IRF-M1+	Índice de Mercado ANBIMA - LTN E NTN-F >= 1 anos		1.848.573,72	5,07
IRF-M1	Índice de Mercado ANBIMA - LTN e NTN-F < 1 anos		794.102,63	2,17
IBOVESPA	Índice Bovespa		424.856,16	1,16

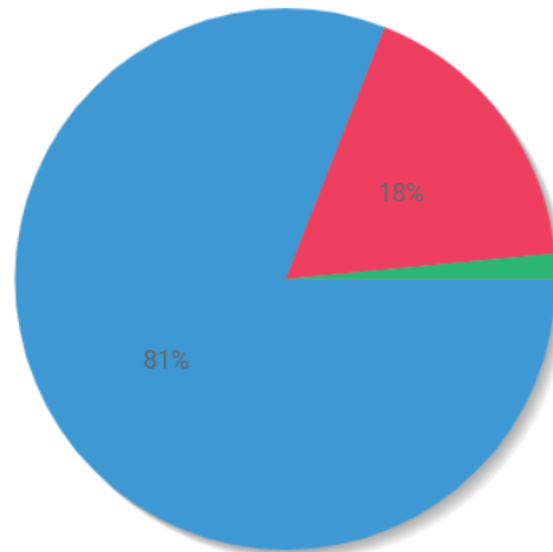
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR BENCHMARK



DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

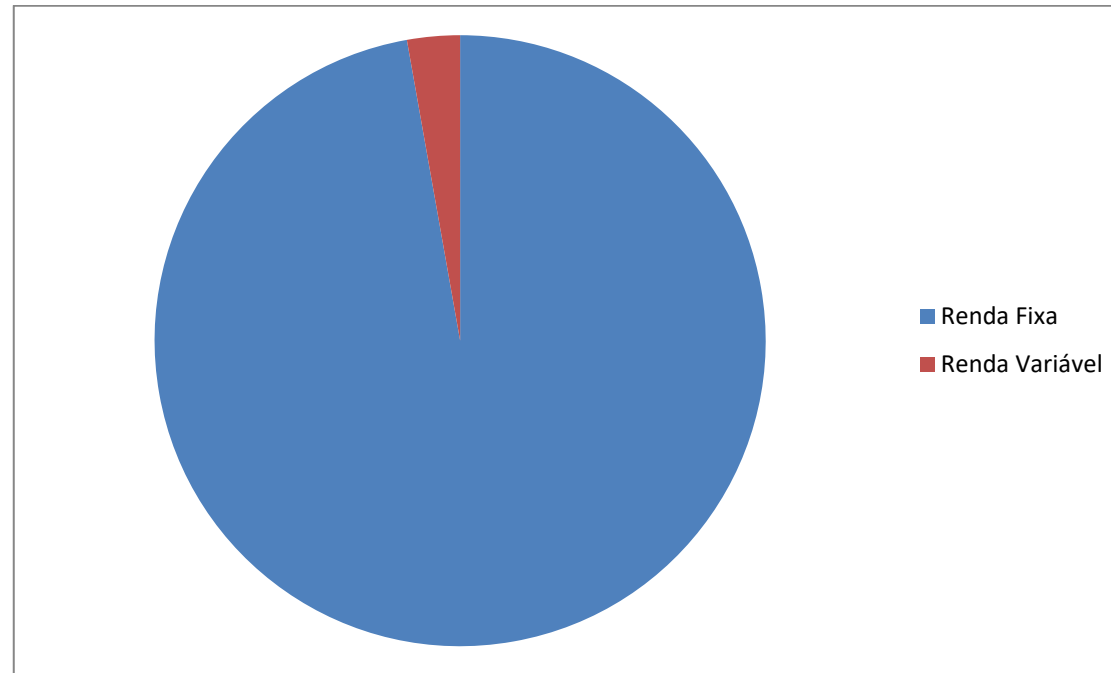
Competência: DEZ/2020 ▼ O valor do VaR, volatilidade e Sharpe foram calculados baseado nas cotações dos fundos de investimentos e do IMA-S. Para metodologias completas, favor contatar nosso suporte.

Veículos	Enquadramento	Benchmarks	Instituição Financeira	
Nome	CNPJ	Total em 31.12.2020 (R\$)	Percentual Item(%)	
Caixa Econômica Federal	00.360.305/0001-04	29.508.304,28	80,97	
BB-DTVM S.A.	30.822.936/0001-69	6.383.930,38	17,51	
ITAU UNIBANCO S.A.	60.701.190/0001-04	550.379,33	1,51	



- Caixa Econômica Federal
- BB-DTVM S.A.
- ITAU UNIBANCO S.A.

ALOCAÇÃO RENDA FIXA E RENDA VARIÁVEL



Renda Fixa 97,2%

Renda Variável 2,8%