



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

JULHO 2020



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

Comparativos		Valor Investido (R\$)	Último Mês	Últimos 3 Meses	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	No ano
IPCA + 6.00%			0.84%	1.70%	3.21%	8.48%	3.93%
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM)		35.396.557,24	2.10%	5.01%	3.35%	7.92%	3.86%
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	6.123.417,78	4,37%	8,08%	2,16%	7,72%	2,41%
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	23.215.097/0001-55	5.716.879,83	0,97%	3,13%	4,78%	9,68%	5,64%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.060.913/0001-10	4.350.307,79	0,97%	4,23%	3,48%	8,53%	4,04%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	3.470.968,84	0,82%	3,95%	3,50%	8,09%	3,97%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.061.217/0001-28	2.886.018,69	1,65%	3,53%	2,79%	6,85%	3,29%
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.701.988,90	0,24%	0,89%	2,29%	5,29%	2,73%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.508.605/0001-00	2.419.467,32	1,08%	3,28%	4,99%	9,54%	5,87%
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	10.577.503/0001-88	2.168.960,70	7,29%	11,42%	1,49%	7,35%	1,46%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	10.577.519/0001-90	1.065.359,59	1,49%	4,47%	6,32%	11,77%	7,46%
BB PREVID RF IRF-M	07.111.384/0001-69	1.035.333,45	1,12%	3,31%	4,96%	9,56%	5,85%
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	32.161.826/0001-29	771.829,20	1,57%	4,44%	6,13%	11,47%	7,25%
BB PREVID RF FLUXO	13.077.415/0001-05	722.801,08	0,10%	0,38%	1,05%	3,12%	1,34%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	10.551.382/0001-03	538.689,35	8,53%	29,55%	-9,99%	7,29%	-8,98%
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	05.073.656/0001-58	532.727,94	4,43%	6,54%	-	-	6,54%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	13.058.816/0001-18	367.800,17	8,14%	27,42%	-9,54%	0,90%	-11,05%
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	254.003,60	0,24%	0,82%	1,24%	3,71%	1,62%
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	05.164.356/0001-84	223.552,32	0,18%	0,65%	1,62%	4,25%	2,01%
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	24.142,59	0,23%	0,75%	1,25%	3,73%	1,61%
BB PREVID RF IDKA 2	13.322.205/0001-35	19.814,25	0,80%	4,07%	3,31%	7,98%	3,71%



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	14.508.643/0001-55	2.493,85	0,11%	0,42%	1,14%	3,33%	1,45%
-------------------------------------	--------------------	----------	-------	-------	-------	-------	-------



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

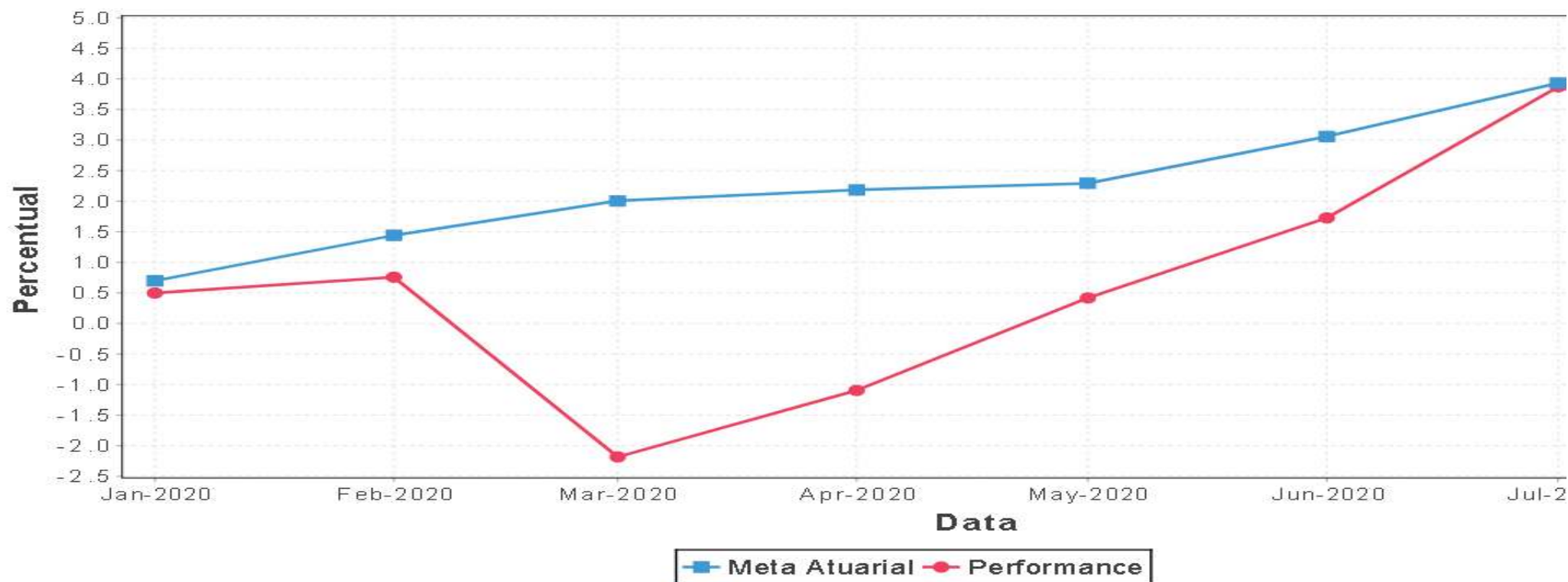
		Ago/19	Set/19	Out/19	Nov/19	Dez/19	Jan/20	Fev/20	Mar/20	Abr/20	Mai/20	Jun/20	Jul/20	12 Meses	Acumulado 2020
PERFORMANCE GERAL		-	-	-	-	-	0,49%	0,25%	-2,91%	1,11%	1,52%	1,30%	2,10%	3,86%	3,86%
INPC + 6.00% (Ago/19 - Dez/19)		-	-	-	-	-	0,69%	0,73%	0,55%	0,17%	0,10%	0,74%	0,84%	3,93%	3,93%
IPCA + 6.00% (Jan/20 - Jul/20)		-	-	-	-	-	0,69%	0,73%	0,55%	0,17%	0,10%	0,74%	0,84%	3,93%	3,93%
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					
Total Geral		16.206.441,43	19.967.848,94		1.289.556,81		3,8699		3,9311	98,4417					

SALDO ANTERIOR
R\$ 35.134.640,27

SALDO ATUAL
R\$ 35.396.557,24



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

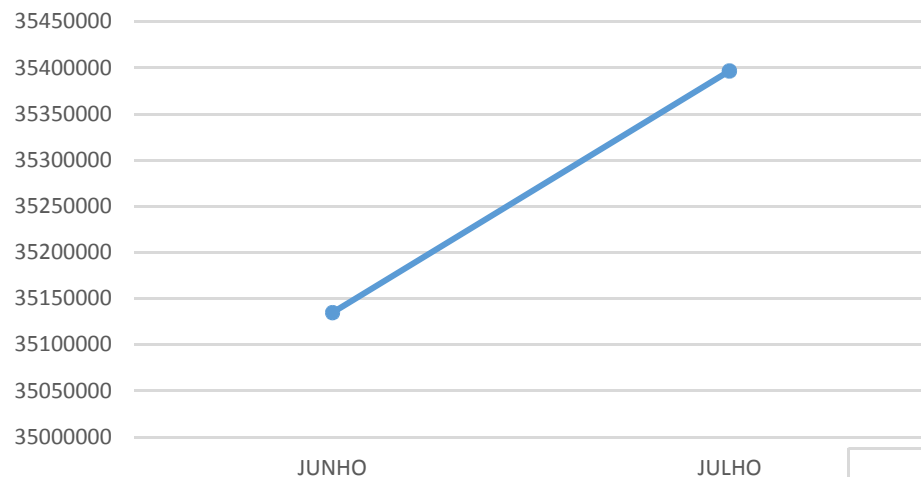


	MÊS	ACUMULADO
PERFORMANCE	2,10%	3,86%
META	0,84%	3,93%

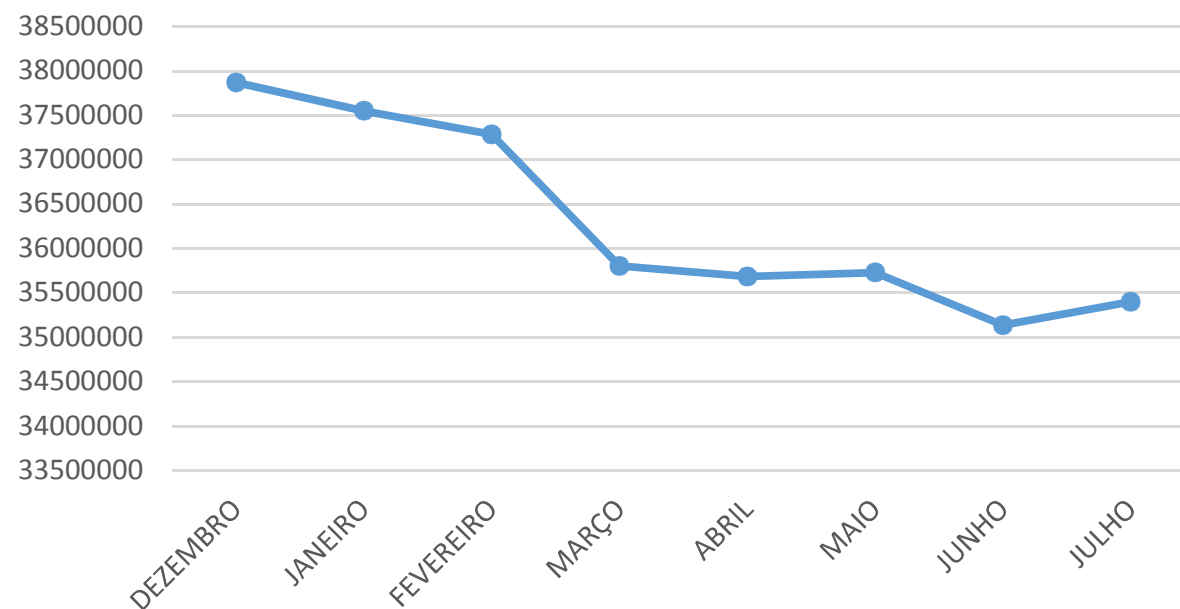


RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

EVOLUÇÃO PATRIMÔNIO JULHO 2020



EVOLUÇÃO PATRIMÔNIO 2020





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - JUL/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)		32.953.898,66	93,0991%	100,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	100,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF IDKA 2	IDKA IPCA 2A	19.814,25	0,0559%							Enquadrado
BB PREVID RF IRF-M	IRF-M	1.035.333,45	2,9249%							Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	IRF-M1+	771.829,20	2,1805%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	IDKA IPCA 2A	3.470.968,84	9,8059%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	IMA-B	6.123.417,78	17,2994%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	IRF-M1	2.701.988,90	7,6334%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF	CDI	223.552,32	0,6315%							Enquadrado
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	Outros	5.716.879,83	16,1509%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	IMA-B5+	2.168.960,70	6,1276%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	IRF-M1+	1.065.359,59	3,0097%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-GERAL	2.886.018,69	8,1533%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B5	4.350.307,79	12,2902%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M	2.419.467,32	6,8353%							Enquadrado
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7o, Inciso IV, Alínea A)		1.536.169,06	4,3398%	40,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	40,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF FLUXO	CDI	722.801,08	2,0420%							Enquadrado
BB PREVID RF PERFIL	CDI	24.142,59	0,0682%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	2.493,85	0,0070%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	CDI	254.003,60	0,7175%							Enquadrado



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	IMA-B	532.727,94	1,5050%							Enquadrado
Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8o, Inciso I, Alínea A)		367.800,17	1,0390%	30,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	30,00%	Enquadrado	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	IBOVESPA	367.800,17	1,0390%							Enquadrado
Fundo de Ações - Geral (Art. 8o, Inciso II, Alínea A)		538.689,35	1,5218%	20,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	20,00%	Enquadrado	
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	Outros	538.689,35	1,5218%							Enquadrado
Total Geral		35.396.557,24								

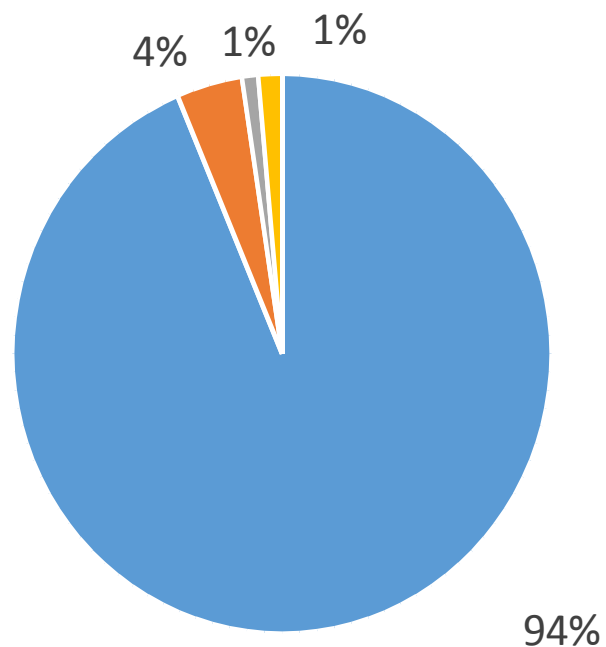


RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Competência: JUL/2020

Veículos Enquadramento Benchmarks Instituição Financeira

Artigo	Total em 31/07/2020 (R\$)	LIMITE CMN (%)	LIMITE PI (%)	VALOR ITEM (%)
Art. 7º, Inciso I, linha B	R\$ 32.953.898,66	100%	100%	93,09
Art. 7º, Inciso IV, linha 2	R\$ 1.536.169,06	40%	40%	4,33
Art. 8º, Inciso I, linha 2	R\$ 367.800,17	30%	30%	1,03
Art. 8º, Inciso II, linha 2	R\$ 538.689,35	20%	20%	1,52





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Alocação Máxima - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - JUL/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)	32.953.898,66	93,0991%	100,00	100,00%	Infinito	Infinito
BB PREVID RF IDKA 2	19.814,25	0,0559%			8.844.185,74	8.824.371,49
BB PREVID RF IRF-M	1.035.333,45	2,9249%			8.590.305,94	7.554.972,49
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	771.829,20	2,1805%			8.656.182,01	7.884.352,81
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	3.470.968,84	9,8059%			7.981.397,10	4.510.428,26
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	6.123.417,78	17,2994%			7.318.284,86	1.194.867,08
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	2.701.988,90	7,6334%			8.173.642,08	5.471.653,18
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	223.552,32	0,6315%			8.793.251,23	8.569.698,91
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	5.716.879,83	16,1509%			7.419.919,35	1.703.039,52
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	2.168.960,70	6,1276%			8.306.899,13	6.137.938,43
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	1.065.359,59	3,0097%			8.582.799,41	7.517.439,82
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.886.018,69	8,1533%			8.127.634,63	5.241.615,94
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	4.350.307,79	12,2902%			7.761.562,36	3.411.254,57
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.419.467,32	6,8353%			8.244.272,48	5.824.805,16
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7º, Inciso IV, Alínea A)	1.536.169,06	4,3398%	40,00	40,00%	22.573.592,12	21.037.423,06
BB PREVID RF FLUXO	722.801,08	2,0420%			8.668.439,04	7.945.637,96
BB PREVID RF PERFIL	24.142,59	0,0682%			8.843.103,66	8.818.961,07
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.493,85	0,0070%			8.848.515,84	8.846.021,99



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	254.003,60	0,7175%			8.785.638,41	8.531.634,81
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	532.727,94	1,5050%			8.715.957,32	8.183.229,38
Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8º, Inciso I, Alínea A)	367.800,17	1,0390%	30,00	30,00%	15.012.324,45	14.644.524,28
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	367.800,17	1,0390%			8.757.189,26	8.389.389,09
Fundo de Ações - Geral (Art. 8º, Inciso II, Alínea A)	538.689,35	1,5218%	20,00	20,00%	8.714.466,97	8.175.777,62
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	538.689,35	1,5218%			8.714.466,97	8.175.777,62



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

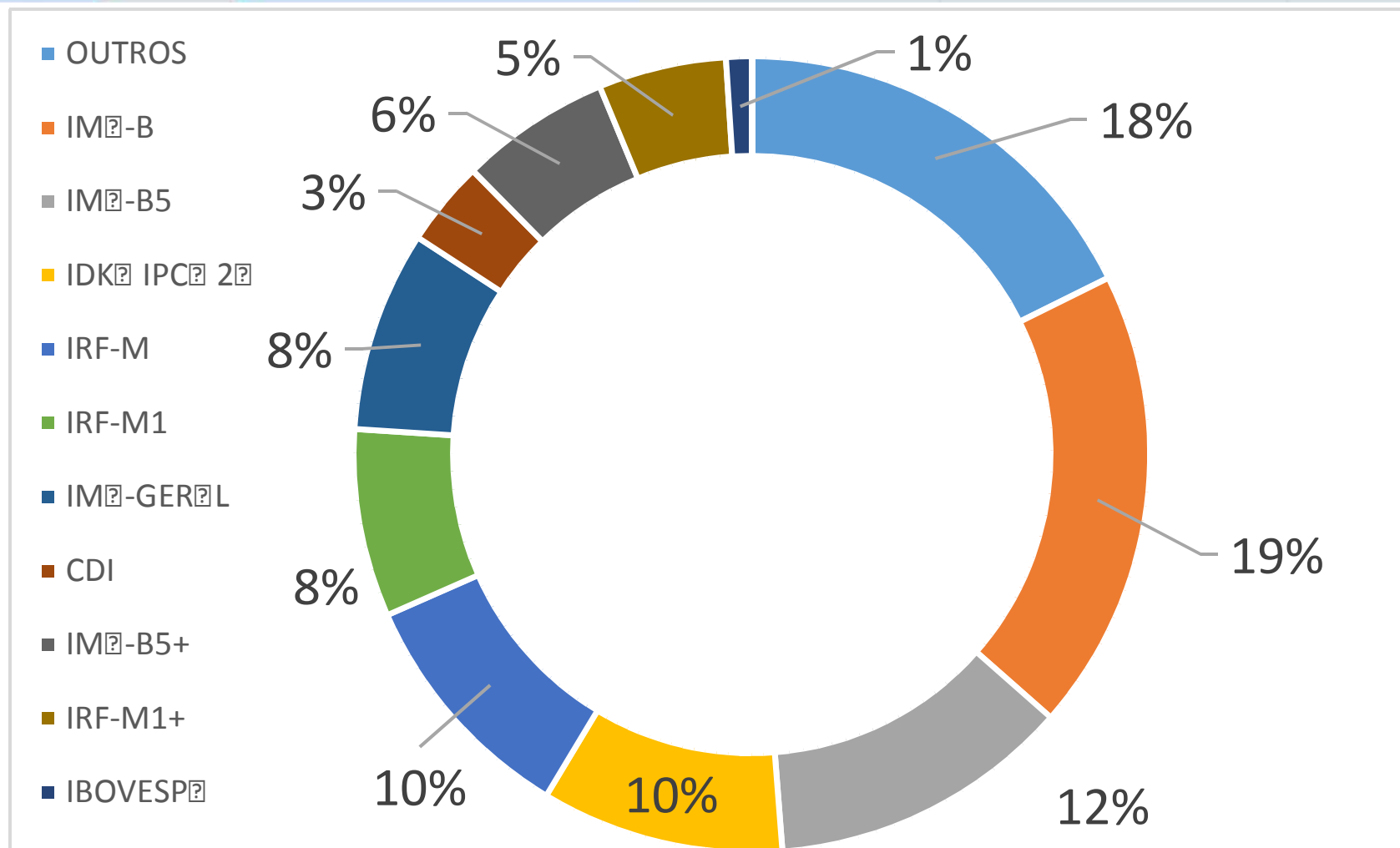
Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira

NOME	DESCRIÇÃO	TOTAL EM 31/07/2020 (R\$)	PERCENTUAL (%)
OUTROS	Outros	R\$ 6.255.569,18	17,67%
IMA-B	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B	R\$ 6.656.145,72	18,80%
IMA-B5	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B < 5 anos	R\$ 4.350.307,79	12,29%
IDKA IPCA 2A	Índice de Duração Contante AMBIMA segmento 2A	R\$ 3.490.783,09	9,86%
IRF-M	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F	R\$ 3.454.800,77	9,76%
IRF-M1	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F < 1 anos	R\$ 2.701.988,90	7,63%
IMA-GERAL	Índice de Mercado AMBIMA - Média ponderada dos retornos diários	R\$ 2.886.018,69	8,15%
CDI	Certificado de Depósito Interbancário	R\$ 1.226.993,44	3,46%
IMA-B5+	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B >= 5 anos	R\$ 2.168.960,70	6,12%
IRF-M1+	Índice de Mercado AMBIMA-LTN E NTN-F >= 1 anos	R\$ 1.837.188,79	5,19%
IBOVESPA	Índice Bovespa	R\$ 367.800,17	1,03%



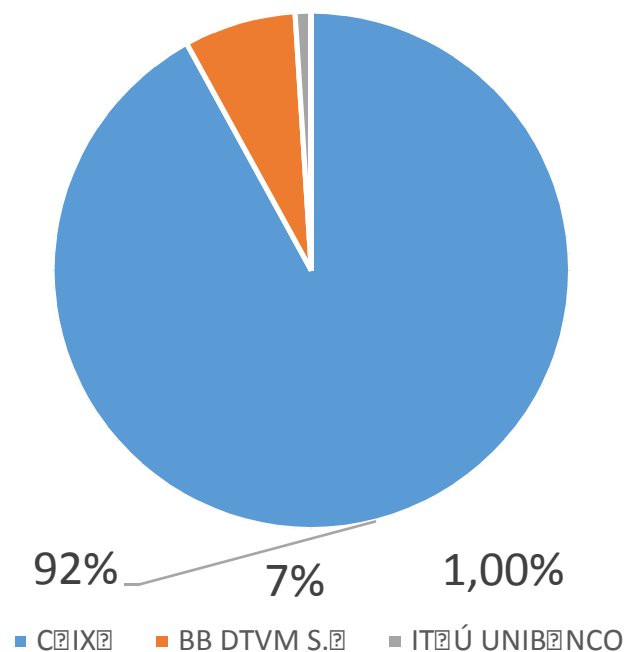


RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Competência: JUL/2020

Veículos Enquadramento Benchmarks Instituição Financeira

NOME	TOTAL EM 30/06/2020 (R\$)	PERCENTUAL (%)
CEIX	R\$ 32.289.908,73	91,92%
BB DTVM S.A.	R\$ 2.573.920,57	7,27%
ITÚ UNIBANCO	R\$ 532.727,24	1,50%



RESUMO DE LOCALIZAÇÃO DE RECURSOS

