



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

MAIO 2020



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

Comparativos		Valor Investido (R\$)	Último Mês	Últimos 3 Meses	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	No ano
IPCA + 6.00%			0.10%	0.83%	4.04%	7.93%	2.29%
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM)		35.725.583,95	1.52%	-0.33%	1.65%	8.14%	0.41%
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	6.213.941,20	1,37%	2,37%	4,46%	11,98%	3,84%
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	10.740.658/0001-93	5.750.292,21	1,50%	-4,47%	-1,90%	6,23%	-3,82%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.060.913/0001-10	4.261.543,94	2,10%	0,73%	3,15%	9,15%	1,92%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	3.402.437,05	1,90%	0,85%	3,04%	8,23%	1,92%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.061.217/0001-28	2.814.003,45	0,95%	-0,21%	1,62%	7,17%	0,71%
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.628.652,53	0,39%	1,42%	2,63%	6,11%	2,21%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.508.605/0001-00	2.375.168,80	1,39%	2,42%	4,56%	11,04%	3,93%
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	10.577.503/0001-88	1.965.970,44	1,00%	-8,26%	-5,68%	3,71%	-8,03%
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	1.201.487,53	0,32%	0,47%	1,47%	4,24%	1,12%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	10.577.519/0001-90	1.098.844,28	1,89%	2,89%	5,54%	-	4,81%
BB PREVID RF IRF-M	07.111.384/0001-69	1.015.960,42	1,37%	2,35%	4,50%	10,99%	3,87%
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	32.161.826/0001-29	752.150,38	1,78%	2,63%	5,24%	12,86%	4,52%
BB PREVID RF FLUXO	13.077.415/0001-05	643.985,82	0,15%	0,60%	1,40%	3,76%	1,11%
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	05.073.656/0001-58	500.137,26	0,02%	-	-	-	0,02%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	10.551.382/0001-03	461.700,16	11,03%	-15,07%	-14,68%	2,39%	-21,99%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	13.058.816/0001-18	313.147,35	8,49%	-16,01%	-19,08%	-9,96%	-24,26%
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	05.164.356/0001-84	222.655,66	0,25%	0,92%	1,99%	4,92%	1,60%
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	83.904,46	0,25%	0,48%	1,46%	4,26%	1,10%
BB PREVID RF IDKA 2	13.322.205/0001-35	19.420,13	2,00%	0,62%	2,82%	8,06%	1,65%



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

	Jun/19	Jul/19	Ago/19	Set/19	Out/19	Nov/19	Dez/19	Jan/20	Fev/20	Mar/20	Abr/20	Mai/20	12 Meses	Acumulado 2020
PERFORMANCE GERAL	-	-	-	-	-	-	-	0,49%	0,25%	-2,91%	1,11%	1,52%	0,41%	0,41%
INPC + 6,00% (Jun/19 - Dez/19)	-	-	-	-	-	-	-	0,69%	0,73%	0,55%	0,17%	0,10%	2,29%	2,29%
IPCA + 6,00% (Jan/20 - Mai/20)	-	-	-	-	-	-	-	0,69%	0,73%	0,55%	0,17%	0,10%	2,29%	2,29%
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				
Total Geral	11.654.668,98	13.884.842,97		87.350,00			0,4173		2,2916	18,2098				

SALDO ANTERIOR
R\$ 35.680.747,78

SALDO ATUAL
R\$ 35.725.583,95



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

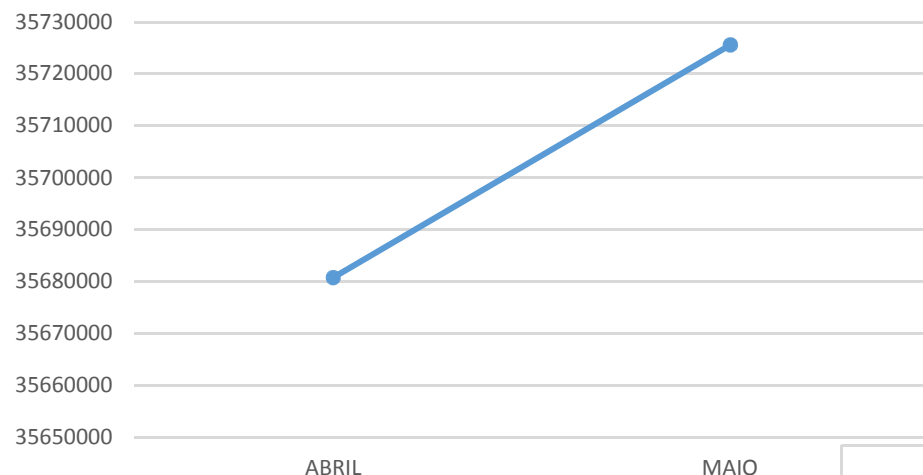


	MÊS	ACUMULADO
PERFORMANCE	1,52%	0,41%
META	0,10%	2,29%

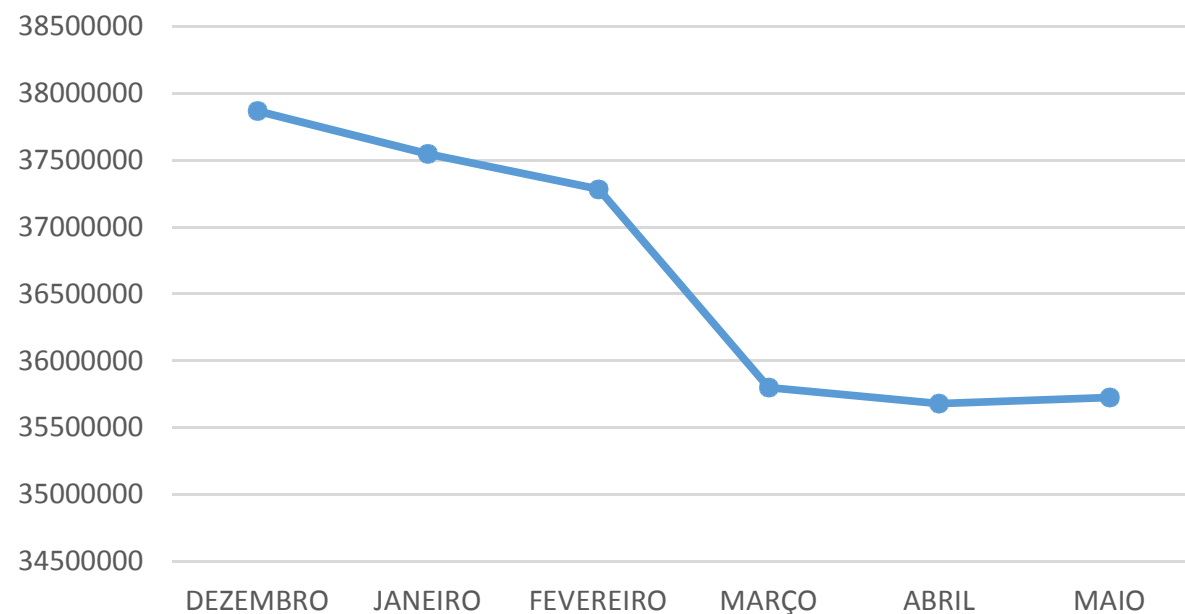


RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO MAIO



EVOLUÇÃO PATRIMÔNIO 2020





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - MAI/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)		32.521.040,49	91,0301%	100,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	100,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF IDKA 2	IDKA IPCA 2A	19.420,13	0,0543%							Enquadrado
BB PREVID RF IRF-M	IRF-M	1.015.960,42	2,8437%							Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	IRF-M1+	752.150,38	2,1053%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	IDKA IPCA 2A	3.402.437,05	9,5238%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	IMA-B	5.750.292,21	16,0957%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	IRF-M1	2.628.652,53	7,3578%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF	CDI	222.655,66	0,6232%							Enquadrado
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	Outros	6.213.941,20	17,3935%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	IMA-B5+	1.965.970,44	5,5029%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	IRF-M1+	1.098.844,28	3,0757%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-GERAL	2.814.003,45	7,8767%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B5	4.261.543,94	11,9285%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M	2.375.168,80	6,6483%							Enquadrado
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7º, Inciso IV, Alínea A)		2.429.695,95	6,8009%	40,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	40,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF FLUXO	CDI	643.985,82	1,8025%							Enquadrado
BB PREVID RF PERFIL	CDI	83.904,46	0,2348%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	180,88	0,0005%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	CDI	1.201.487,53	3,3631%							Enquadrado



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



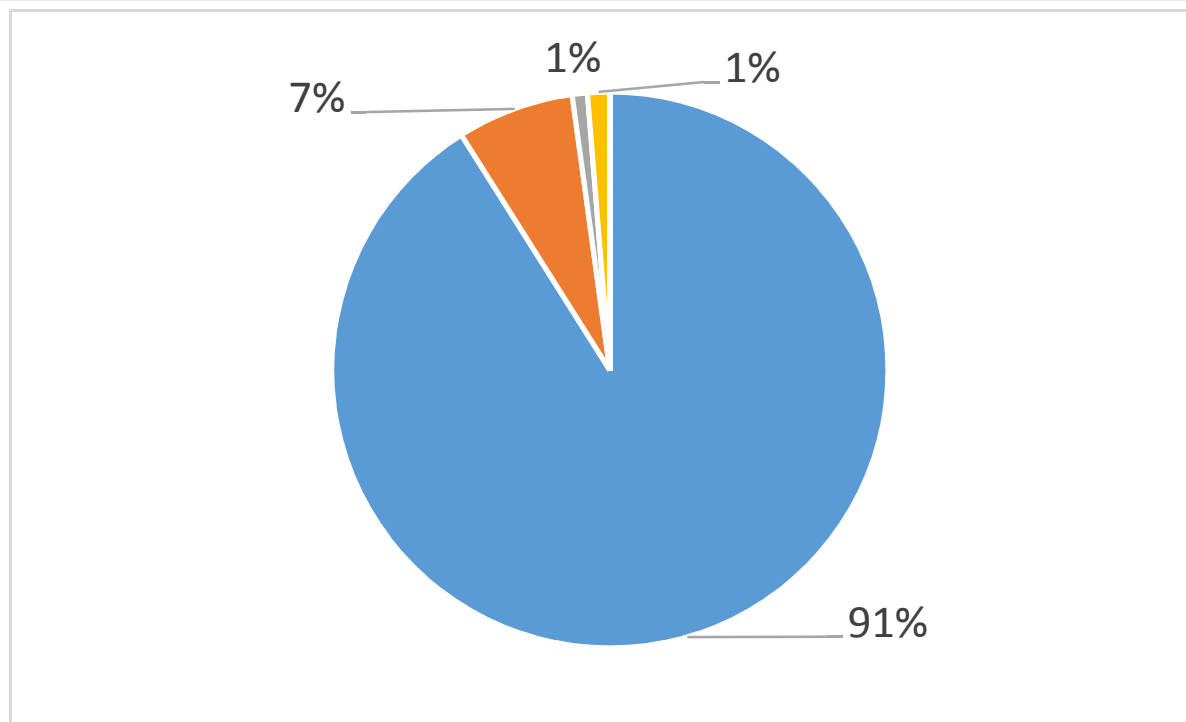
Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM) - MAI/2020

ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	IMA-B	500.137,26	1,3999%							Enquadrado
Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8o, Inciso I, Alínea A)		313.147,35	0,8765%	30,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	30,00%	Enquadrado	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	IBOVESPA	313.147,35	0,8765%							Enquadrado
Fundo de Ações - Geral (Art. 8o, Inciso II, Alínea A)		461.700,16	1,2923%	20,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	20,00%	Enquadrado	
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	Outros	461.700,16	1,2923%							Enquadrado
Total Geral		35.725.583,95								

RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Competência: ABR/2020

Veículos	Enquadramento	Benchmarks	Instituição Financeira		
Artigo		Total em 30/05/2020 (R\$)	LIMITE CMN (%)	LIMITE PI (%)	VALOR ITEM (%)
Art. 7º, Inciso I, Alínea B		R\$ 32.521.040,49	100%	100%	91,03
Art. 7º, Inciso IV, Alínea A		R\$ 2.429.695,95	40%	40%	6,8
Art. 8º, Inciso I, Alínea A		R\$ 313.147,35	30%	30%	0,87
Art. 8º, Inciso II, Alínea A		R\$ 461700,16	20%	20%	1,29





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Alocação Máxima - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - MAI/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	Límite Legal	Límite PI	Máxima Alocação (R\$)	Diferença (R\$)
Fundos 100% Títulos Públicos Federais (Art. 7o, Inciso I, Alínea B)	32.521.040,49	91,0301%	100,00	100,00%	Infinito	Infinito
BB PREVID RF IDKA 2	19.420,13	0,0543%			8.926.540,95	8.907.120,82
BB PREVID RF IRF-M	1.015.960,42	2,8437%			8.677.405,88	7.661.445,46
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	752.150,38	2,1053%			8.743.358,39	7.991.208,01
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	3.402.437,05	9,5238%			8.080.786,72	4.678.349,67
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	5.750.292,21	16,0957%			7.493.822,93	1.743.530,72
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	2.628.652,53	7,3578%			8.274.232,85	5.645.580,32
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	222.655,66	0,6232%			8.875.732,07	8.653.076,41
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	6.213.941,20	17,3935%			7.377.910,68	1.163.969,48
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	1.965.970,44	5,5029%			8.439.903,37	6.473.932,93
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	1.098.844,28	3,0757%			8.656.684,91	7.557.840,63
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.814.003,45	7,8767%			8.227.895,12	5.413.891,67
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	4.261.543,94	11,9285%			7.866.010,00	3.604.466,06
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.375.168,80	6,6483%			8.337.603,78	5.962.434,98
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7o, Inciso IV, Alínea A)	2.429.695,95	6,8009%	40,00	40,00%	22.197.258,66	19.767.562,71
BB PREVID RF FLUXO	643.985,82	1,8025%			8.770.399,53	8.126.413,71
BB PREVID RF PERFIL	83.904,46	0,2348%			8.910.419,87	8.826.515,41
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	180,88	0,0005%			8.931.350,76	8.931.169,88



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	1.201.487,53	3,3631%			8.631.024,10	7.429.536,57
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	500.137,26	1,3999%			8.806.361,67	8.306.224,41
Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8o, Inciso I, Alínea A)	313.147,35	0,8765%	30,00	30,00%	15.176.758,54	14.863.611,19
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	313.147,35	0,8765%			8.853.109,15	8.539.961,80
Fundo de Ações - Geral (Art. 8o, Inciso II, Alínea A)	461.700,16	1,2923%	20,00	20,00%	8.815.970,94	8.354.270,78
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	461.700,16	1,2923%			8.815.970,94	8.354.270,78



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

[Veículos](#)[Enquadramento](#)[Benchmarks](#)[Instituição Financeira](#)

NOME	DESCRIÇÃO	TOTAL EM 31/05/2020 (R\$)	PERCENTUAL (%)
OUTROS	Outros	R\$ 6.675.641,36	18,68%
IMA-B	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B	R\$ 6.250.429,47	17,49%
IMA-B5	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B < 5 anos	R\$ 4.261.543,94	11,92%
IDKA IPCA 2A	Índice de Duração Contante AMBIMA segmento 2A	R\$ 3.421.857,18	9,57%
IRF-M	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F	R\$ 3.391.129,22	9,49%
IRF-M1	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F < 1 anos	R\$ 2.628.652,53	7,35%
IMA-GERAL	Índice de Mercado AMBIMA - Média ponderada dos retornos diários	R\$ 2.814.003,45	7,87%
CDI	Certificado de Depósito Interbancário	R\$ 2.152.214,35	6,02%
IMA-B5+	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B >= 5 anos	R\$ 1.965.970,44	5,50%
IRF-M1+	Índice de Mercado AMBIMA-LTN E NTN-F >= 1 anos	R\$ 1.850.994,66	5,18%
IBOVESPA	Índice Bovespa	R\$ 313.147,35	0,87%

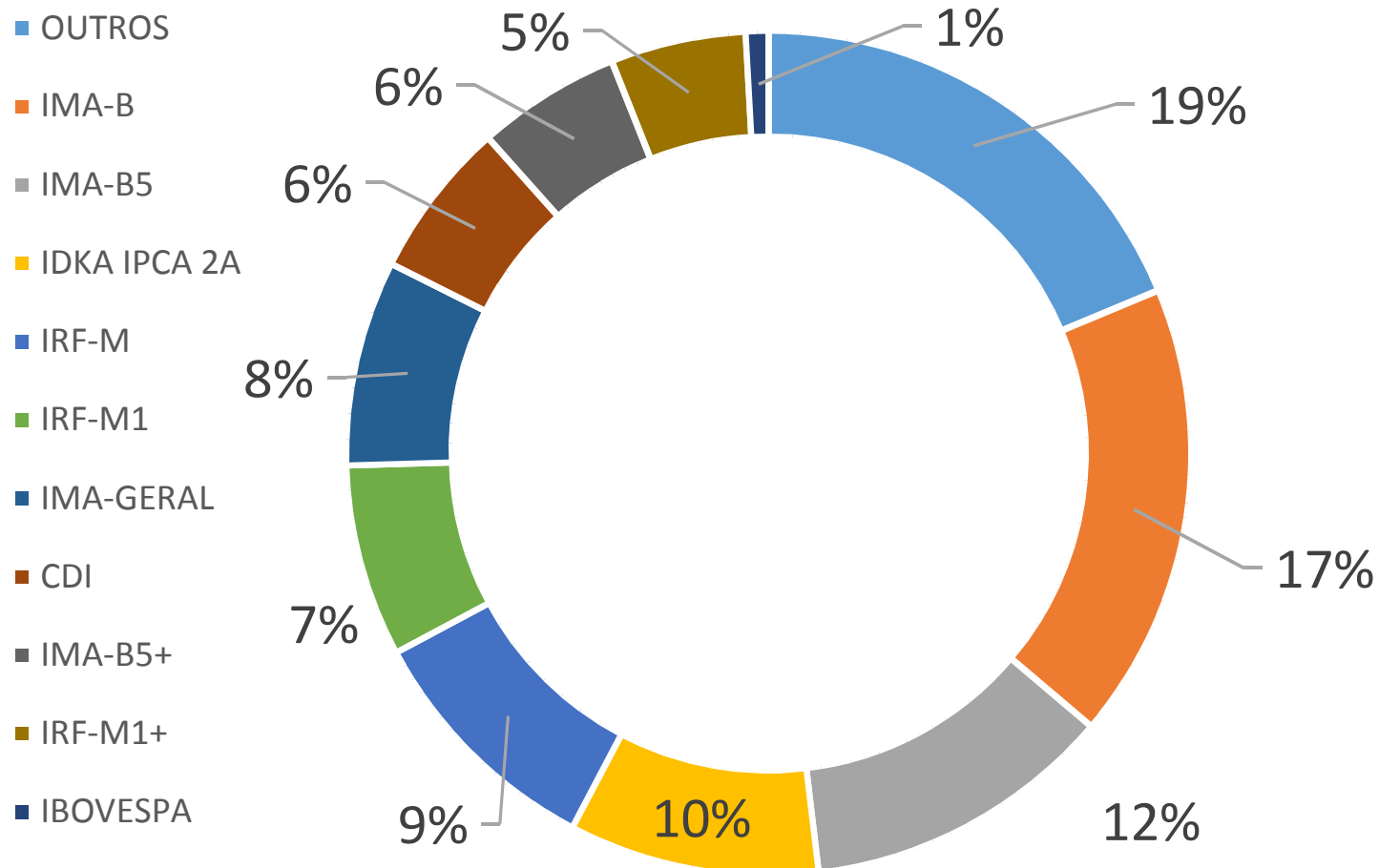
RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira



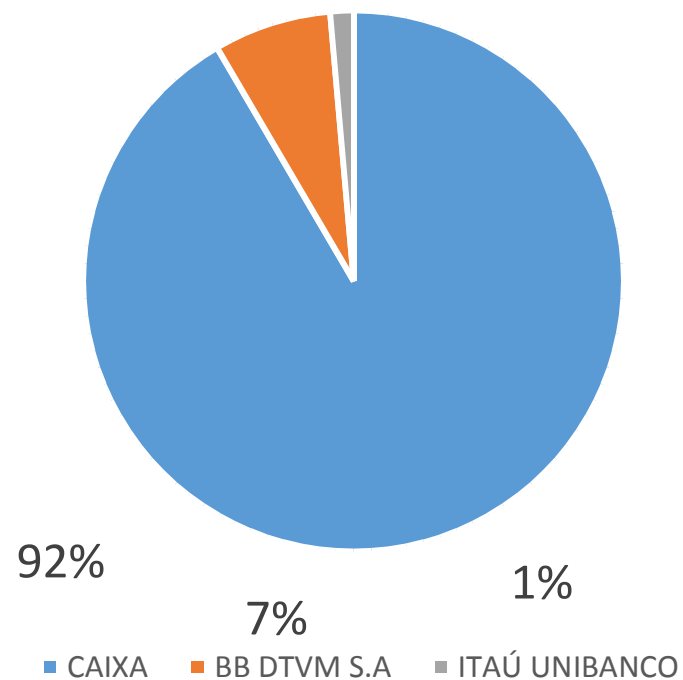


RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Competência: MAI/2020

Veículos Enquadramento Benchmarks Instituição Financeira

NOME	TOTAL EM 29/05/2020 (R\$)	PERCENTUAL (%)
CAIXA	R\$ 32.710.025,48	92%
BB DTVM S.A	R\$ 2.515.421,21	7%
ITAÚ UNIBANCO	R\$ 500.137,26	1,39%



RESUMO DE ALOCAÇÃO DE RECURSOS

