



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

NOVEMBRO 2020



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

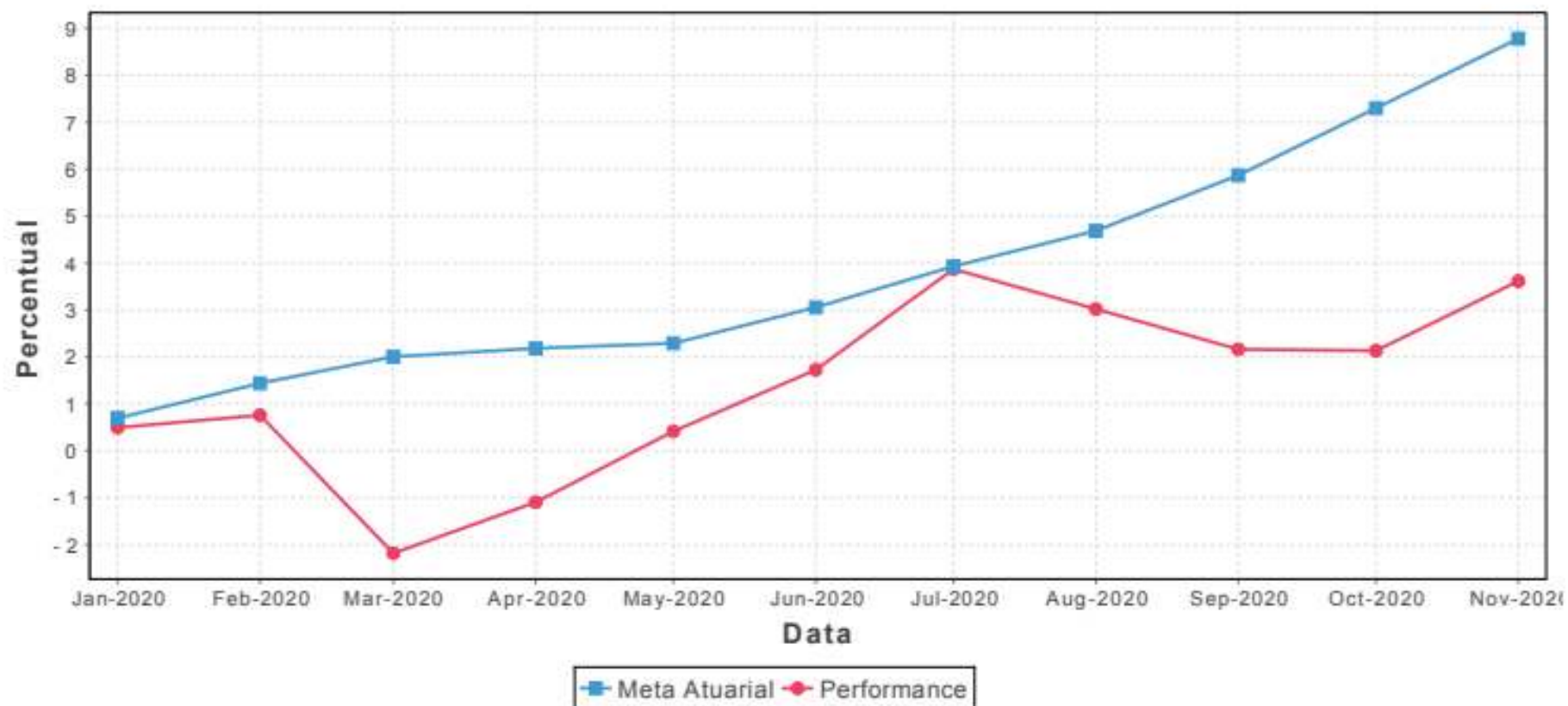


Performance Geral - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA
(IPMM) - NOV/2020

	Dez/19	Jan/20	Fev/20	Mar/20	Abr/20	Mai/20	Jun/20	Jul/20	Ago/20	Set/20	Out/20	Nov/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%	3,61%	3,61%
INPC + 6,00% (Dez/19 - Dez/19)	-	0,69%	0,73%	0,55%	0,17%	0,10%	0,74%	0,84%	0,72%	1,12%	1,35%	1,38%	8,78%	8,78%
IPCA + 6,00% (Jan/20 - Nov/20)	-	0,69%	0,73%	0,55%	0,17%	0,10%	0,74%	0,84%	0,72%	1,12%	1,35%	1,38%	8,78%	8,78%
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				
Total Geral	25.470.089,08	30.993.163,86			1.189.182,02		3,6158		8,7824	41,1716				

SALDO ANTERIOR
R\$ 33.581.297,73

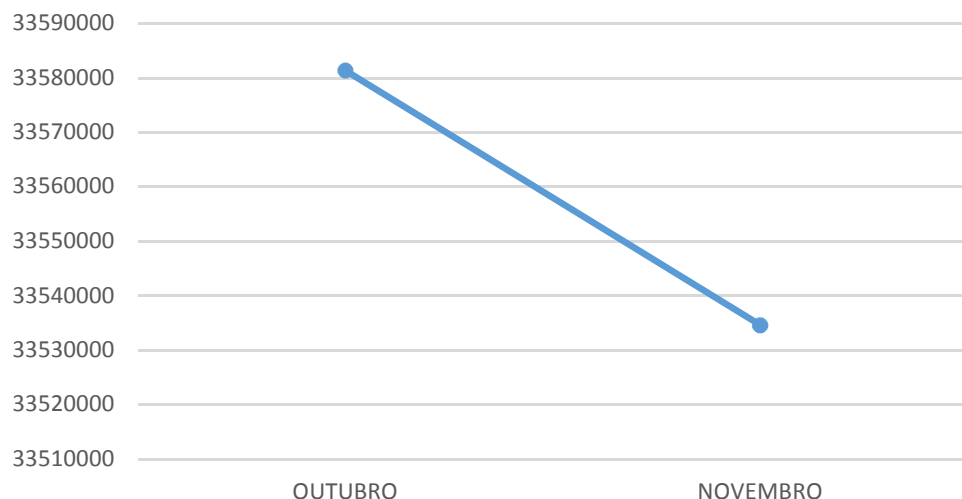
SALDO ATUAL
R\$ 33.534.515,18



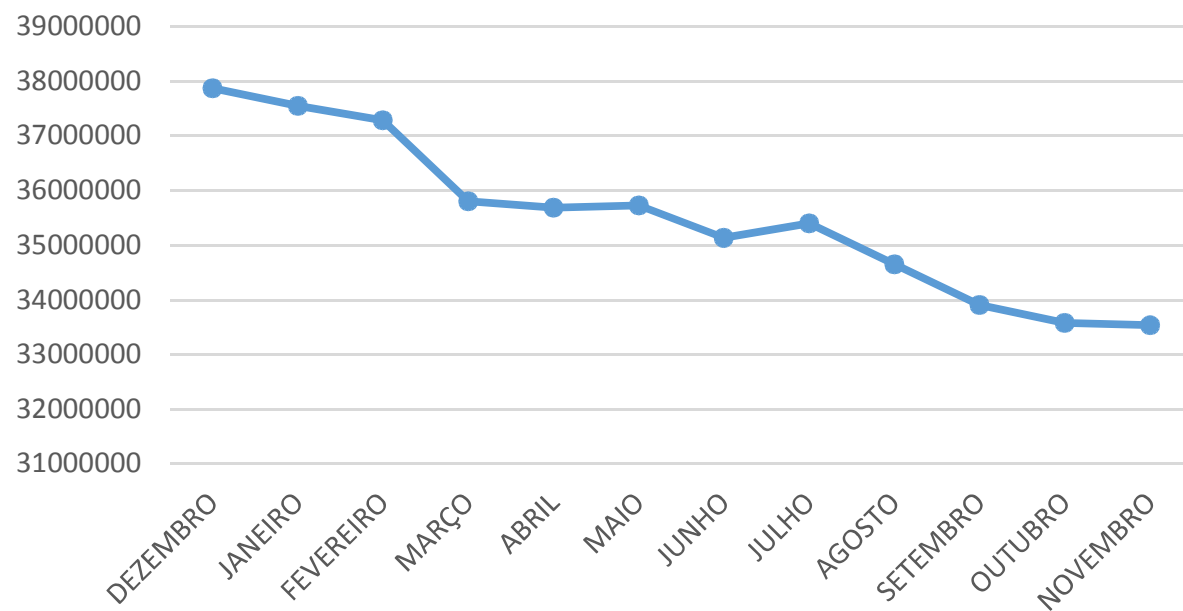
	MÊS	ACUMULADO
PERFORMANCE	1,45%	3,61%
META	1,38%	8,38%

RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO NOVEMBRO 2020



EVOLUÇÃO PATRIMÔNIO 2020





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - NOV/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)		30.781.456,38	91,7903%	100,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	100,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF IDKA 2	IDKA IPCA 2A	20.307,12	0,0605%							Enquadrado
BB PREVID RF IRF-M	IRF-M	1.020.544,83	3,0432%							Enquadrado
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	IRF-M1+	752.532,31	2,2440%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	IDKA IPCA 2A	3.547.763,02	10,5794%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	IMA-B	6.048.546,84	18,0367%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	IRF-M1	2.114.992,78	6,3069%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	CDI	223.942,03	0,6677%							Enquadrado
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	Outros	5.243.507,24	15,6361%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	IMA-B5+	2.091.445,05	6,2366%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	IRF-M1+	1.041.146,12	3,1047%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-GERAL	2.221.191,73	6,6235%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B5	4.070.115,67	12,1370%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M	2.385.421,64	7,1133%							Enquadrado
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7o, Inciso IV, Alínea A)		1.814.774,39	5,4116%	40,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	40,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF FLUXO	CDI	1.259.198,84	3,7549%							Enquadrado
BB PREVID RF PERFIL	CDI	24.268,96	0,0723%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	2.378,68	0,0070%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	CDI	4.448,90	0,0132%							Enquadrado



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



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

ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	IMA-B	524.479,01	1,5839%							Enquadrado
Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8º, Inciso I, Alínea A)		388.912,33	1,1597%	30,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	30,00%	Enquadrado	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASEL BOVESPA	IBOVESPA	388.912,33	1,1597%							Enquadrado
Fundo de Ações - Geral (Art. 8º, Inciso II, Alínea A)		549.372,08	1,6382%	20,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	20,00%	Enquadrado	
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	Outros	549.372,08	1,6382%							Enquadrado
Total Geral		33.534.515,18								

RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

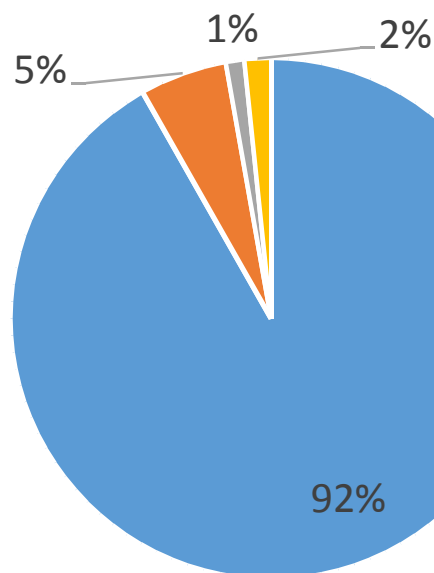
Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira

Artigo	Total em 30/11/2020 (R\$)	LIMITE CMN (%)	LIMITE PI (%)	VALOR ITEM (%)
Art. 7º, Inciso I, linha B	R\$ 30.781.456,38	100%	100%	91,79
Art. 7º, Inciso IV, linha 2	R\$ 1.814.774,39	40%	40%	5,41
Art. 8º, Inciso I, linha 2	R\$ 388.912,33	30%	30%	1,15
Art. 8º, Inciso II, linha 2	R\$ 549.372,08	20%	20%	1,63





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira

NOME	DESCRIÇÃO	TOTAL EM 30/11/2020 (R\$)	PERCENTUAL (%)
OUTROS	Outros	R\$ 5.792.879,32	17,27%
IMA-B	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B	R\$ 6.573.025,85	19,60%
IMA-B5	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B < 5 anos	R\$ 4.070.115,67	12,13%
IDKA IPCA 2A	Índice de Duração Contante AMBIMA segmento 2A	R\$ 3.568.070,14	10,63%
IRF-M	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F	R\$ 3.405.966,47	10,63%
IRF-M1	Índice de Mercado AMBIMA - LTN e NTN-F < 1 anos	R\$ 2.114.992,78	6,30%
IMA-GERAL	Índice de Mercado AMBIMA - Média ponderada dos retornos diários	R\$ 2.221.191,73	6,62%
CDI	Certificado de Depósito Interbancário	R\$ 1.514.237,61	4,51%
IMA-B5+	Índice de Mercado AMBIMA-NTN-B >= 5 anos	R\$ 2.091.445,05	6,23%
IRF-M1+	Índice de Mercado AMBIMA-LTN E NTN-F >= 1 anos	R\$ 1.793.678,43	5,34%
IBOVESPA	Índice Bovespa	R\$ 388.912,33	1,15%

RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira

OUTROS

IM-B

IM-B5

IDK IPC 2

IRF-M

IRF-M1

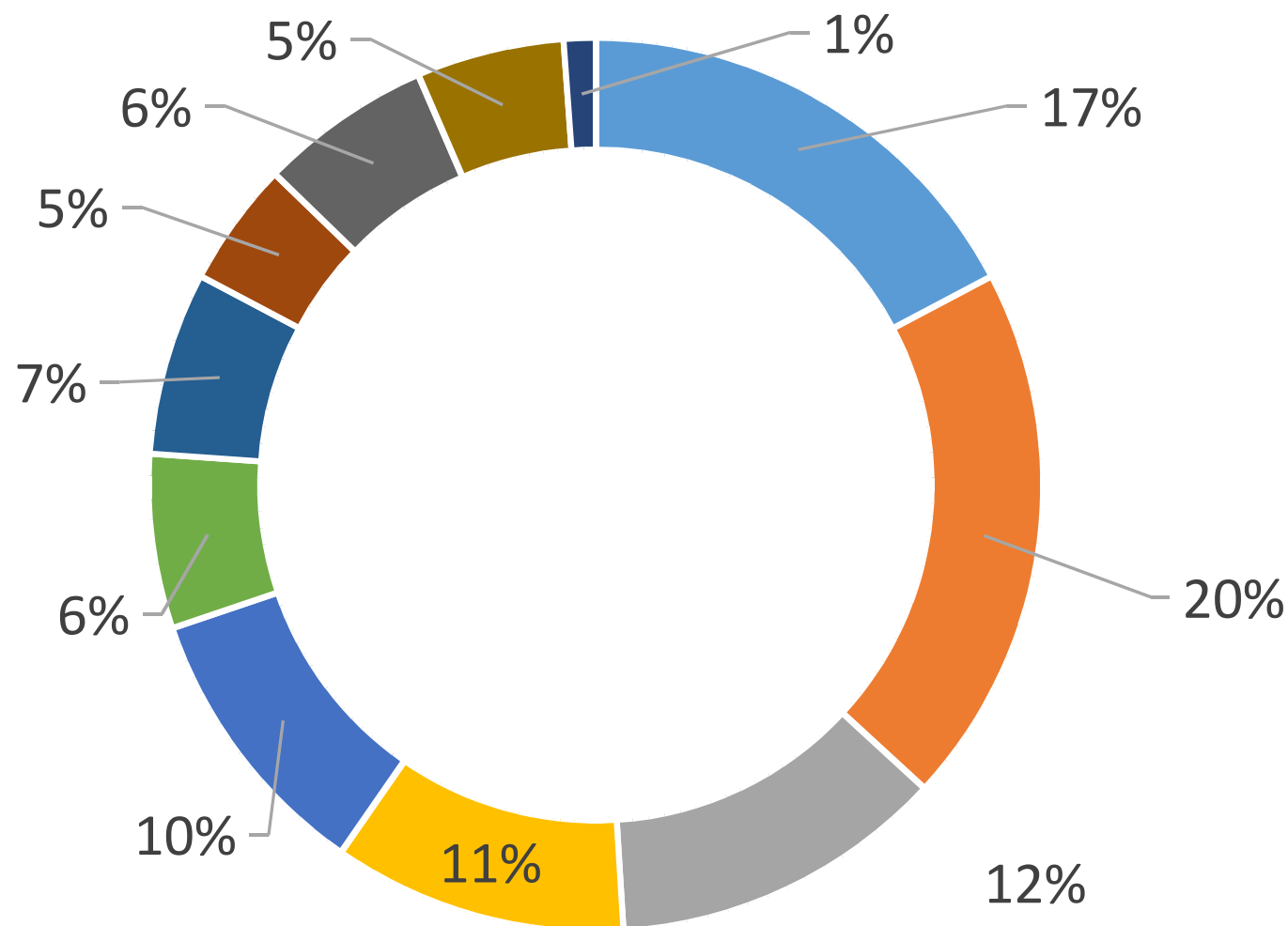
IM-GERL

CDI

IM-B5+

IRF-M1+

IBOVESPA





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Competência

NOV/2020



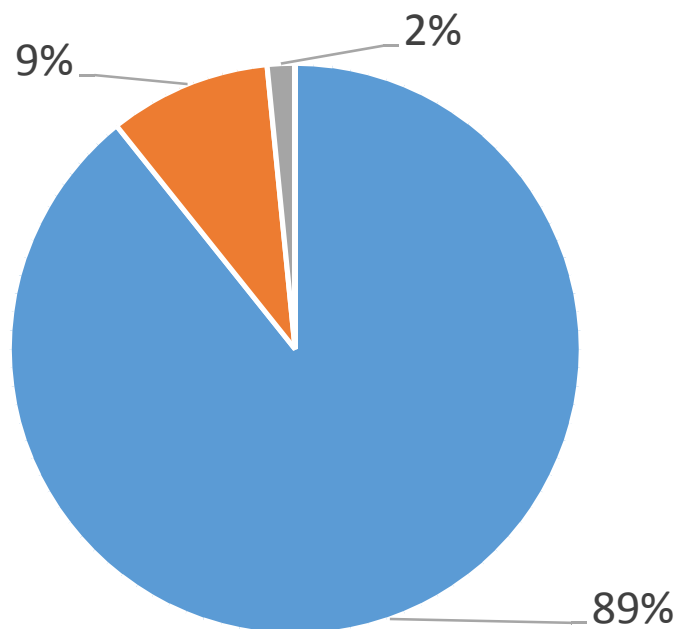
Veículos

Enquadramento

Benchmarks

Instituição Financeira

NOME	TOTAL EM 30/11/2020 (R\$)	PERCENTUAL (%)
CRIIX	R\$ 29.933.184,11	89,26%
BB DTVM S.A.	R\$ 3.076.852,06	9,17%
ITÚ UNIBANCO	R\$ 524.479,01	1,56%



RESUMO DE LOCALIZAÇÃO DE RECURSOS

