



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA
MUNICIPAL DE LIMEIRA
IPML**



RELATÓRIO ANUAL DE INVESTIMENTOS 2020



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA
MUNICIPAL DE LIMEIRA
IPML



1. APRESENTAÇÃO

Afim de apresentar o resultado dos investimentos de forma clara e objetiva, o Instituto de Previdência do Município de Limeira, disponibiliza o relatório anual investimentos, referente ao exercício de 2020.

O relatório demonstra de maneira clara e objetiva, os rendimentos em relação a carteira de investimentos do período apresentado o contexto econômico, o enquadramento dos fundos e por fim a meta prevista para exercício.

2. CENÁRIO ECONÔMICO

Diante do choque adverso causado pela pandemia, a economia brasileira devido aos seus efeitos imediatos, políticas de estímulo fiscal, destaque para as transferências de renda em larga escala realizadas pelo governo, e o estímulo monetário que tem se materializado na forma de expansão vigorosa do crédito. Com esses diversos efeitos negativos do Covid-19, o ano de 2020 foi marcado por uma crise econômica global sem precedentes, tendo sua origem fora do mercado financeiro ou de eventos econômicos, mas de ordem puramente sanitária, com perdas de milhares de vidas, empregos e o fechamento de empresas.

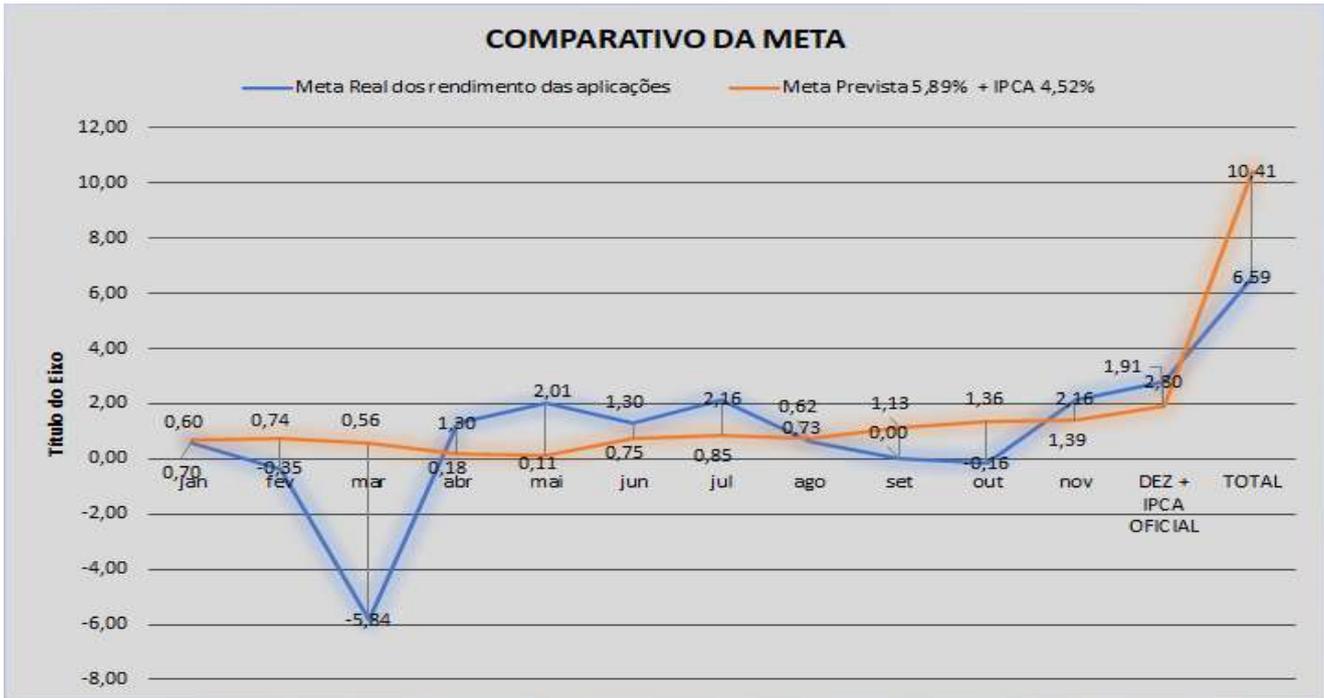
Em dezembro, a economia brasileira seguiu em trajetória de recuperação do choque provocado pela COVID-19, no entanto o aumento do número de casos da doença, mantém as incertezas quanto à continuidade do ciclo.

3. RESULTADO DA META

Com esse cenário a autarquia encerrou o exercício 2020 com a meta de 6,59% contra 10,41%, constituída pela meta prevista em 5,89% + 4,52% do IPCA, um ano atípico, mesmo diversificando a carteira, não foi possível alcançar a meta. O Comitê de Investimento da autarquia, continua com a análise no mercado na tentativa de diversificar a carteira mantendo prudência para exercício de 2021.

Rendimento dos Investimentos (IPCA +5,89% + IPCA 4,52%)													Saldo Inicial 2020 R\$ 546.084.403,56 → Meta Prevista de R\$ 56.847.386,41	
Rendimento percentual médio dos investimentos dos recursos do IPML em relação à meta prevista de 5,89% + IPCA														
Mês	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	DEZ + IPCA OFICIAL	TOTAL	
Valor Mensal Rendimentos	3.339.503,12	- 1.944.428,23	- 30.793.490,31	6.924.800,42	11.048.416,09	7.239.480,72	12.133.791,44	3.493.398,79	- 5.688,52	- 893.932,11	12.346.857,67	16.391.974,00	39.280.683,08	
Meta Real dos rendimento das aplicações	0,60	-0,35	-5,84	1,30	2,01	1,30	2,16	0,62	0,00	-0,16	2,16	2,80	6,59	
IPCA	0,21	0,25	0,07	-0,31	-0,38	0,26	0,36	0,24	0,64	0,86	0,89	1,43	4,52	
5,89% ao ano mensal	0,49	0,49	0,49	0,49	0,49	0,49	0,49	0,49	0,49	0,49	0,49	0,49	5,890	
Meta Prevista 5,89% + IPCA 4,52%	0,70	0,74	0,56	0,18	0,11	0,75	0,85	0,73	1,13	1,36	1,39	1,91	10,41	
IPCA +5,89% ao ano acumulado	0,70	1,45	2,02	2,20	2,31	3,08	3,96	4,72	5,91	7,34	8,83	10,41	10,41	
% MENSAL S/ META	0,9%	-0,5%	-10,4%	7,2%	18,5%	1,7%	2,5%	0,8%	0,0%	-0,1%	1,6%	1,5%	63,3%	

3.1 ACOMPANHAMENTO DA META



4. ENQUADRAMENTO

Regulamento Cumulativo: Segmento Renda Fixa Art. 7º, I, II

Regulamento: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"

Fundo 8560 - CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	2.249.326,90	0,38		10.655.087.063,09	0,02111	15,00	V
Fundo 8560 - CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	9.403.653,55	1,61		10.655.087.063,09	0,08828	15,00	V
Fundo 8587 - BB IDKA 2 TITULOS PUBLICOS FI RF PREVID	54.712.930,82	9,36		8.478.640.994,51	0,64546	15,00	V
Fundo 8590 - BB PREVID. RF IRF-M	20.966.177,57	3,59		8.554.814.280,00	0,24509	15,00	V
Fundo 8591 - BB PREVIDENCIARIO IMA-B TP	22.899.335,82	3,92		8.693.778.987,76	0,26340	15,00	V
Fundo 8592 - BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA TIT. PUBLIC	625.745,21	0,11		436.337.264,96	0,14341	15,00	V
Fundo 8594 - BB TIT. PUBL VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI	430.114,40	0,07		245.863.748,75	0,17494	15,00	V
Fundo 8612 - CAIXA BRASIL 2024 IV TITULOS PUBLICOS FI R	17.379.082,06	2,97		1.463.442.575,00	1,18755	15,00	V
Fundo 8614 - CAIXA BRASIL IMA-B 5 TIT PUBLIC. FI RENDA	48.345.983,78	8,27		20.761.505.098,66	0,23266	15,00	V
Fundo 8617 - CAIXA BRASIL IRFM 1 TIT. PUBLIC RENDA FIXA	3.026.827,68	0,52		16.753.976.831,37	0,01807	15,00	V
Fundo 8617 - CAIXA BRASIL IRFM 1 TIT. PUBLIC RENDA FIXA	6.921.883,51	1,18		16.753.976.831,37	0,04131	15,00	V
Fundo 8618 - CAIXA ECONOMICA FEDERAL	85.259.918,78	14,58		10.655.087.063,09	0,80018	15,00	V
Fundo 8618 - CAIXA ECONOMICA FEDERAL	14.542.705,76	2,49		16.753.976.831,37	0,08680	15,00	V
Fundo 8619 - CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBLIC. RF L	44.179.487,27	7,56		8.193.173.925,17	0,71336	15,00	V
Fundo 8620 - CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	12.345.105,59	2,11		3.566.953.490,66	0,34610	15,00	V
Fundo 8621 - CAIXA FI BRASIL IRF-M1 TP RF LP	39.874.799,24	6,82		2.814.559.159,07	1,41673	15,00	V
Fundo 8645 - SANTANDER IMA-B INST. TIT. PUB RF. LP	39.208.343,16	6,71		1.116.892.204,20	3,51049	15,00	V
Fundo 8703 - CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATEGICA RF	31.346.414,83	5,36		14.722.139.597,34	0,21292	15,00	V

TOTAL POR REGULAMENTO: 483.717.836,83

77,61 100,00 V

TOTAL POR REGULAMENTO CUMULATIVO: 483.717.836,83

Regulamento Cumulativo: Segmento Renda Fixa Art. 7º, III

Regulamento: FI Renda Fixa "Referenciado" - Art. 7º, III, "a"

Fundo 8582 - BANCO DO BRASIL	17.706.305,70	3,03	20,00 V	9.568.490.825,39	0,18505	15,00	V
------------------------------	---------------	------	---------	------------------	---------	-------	---

TOTAL POR REGULAMENTO: 17.706.305,70

3,03 60,00 V

TOTAL POR REGULAMENTO CUMULATIVO: 17.706.305,70

Regulamento Cumulativo: Segmento Renda Fixa Art. 7º, VII

Regulamento: FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior - Art. 7º, VII, "a"

Fundo 8634 - INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	5.394.403,26	0,92	20,00 V	56.590.916,43	9,53228	5,00	X
Fundo 8639 - LEME IPCA MULTISSETORIAL SENIOR	1.336.458,06	0,23	20,00 V	72.335.427,37	1,84758	5,00	V

TOTAL POR REGULAMENTO: 6.730.861,32

1,15 5,00 V

Regulamento: FI Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, "b"

Fundo 8588 - BB IPCA III RENDA FIXA PREVIDENCIARIO C	5.923.185,92	1,01	20,00 V	626.431.567,64	0,94554	5,00	V
Fundo 8616 - CAIXA BRASIL IPCA XVI RENDA FIXA CREDI	6.082.785,27	1,04	20,00 V	199.070.839,42	3,05559	5,00	V

TOTAL POR REGULAMENTO: 12.005.971,19

2,05 5,00 V

Regulamento Cumulativo: Segmento Renda Variável Art. 8º

Regulamento: FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, "a"

Fundo 8702 - BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNAÇÃO FD	17.823.184,45	3,05	20,00 V	1.245.394.782,64	1,43113	15,00 V
--	---------------	------	---------	------------------	---------	---------

TOTAL POR REGULAMENTO:	17.823.184,45
-------------------------------	----------------------

3,05	30,00 V
-------------	----------------

Regulamento: FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a"

Fundo 8548 - BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC	3.680.488,83	0,83		2.636.774.357,29	0,13958	15,00 V
Fundo 8622 - CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	14.182.199,81	2,43		755.510.912,48	1,87117	15,00 V
Fundo 8631 - GUERARDO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.980.477,02	0,85		422.858.548,85	1,17782	15,00 V
Fundo 8640 - PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.494.047,54	1,80		381.432.702,48	2,90348	15,00 V
Fundo 8651 - XP INVESTOR FI AÇÕES	10.019.545,17	1,71		382.685.561,31	2,61822	15,00 V
Fundo 8695 - NAVI INSTITUCIONAL FIA	2.833.346,24	0,48		1.182.853.376,73	0,22283	15,00 V
Fundo 8710 - AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	2.101.423,18	0,38		812.822.043,38	0,25880	15,00 V
Fundo 8726 - BB AÇÕES RETORNO TOTAL FUNDO DE INVE	5.607.147,64	0,98		1.427.892.857,60	0,39278	15,00 V

TOTAL POR REGULAMENTO:	53.699.275,23
-------------------------------	----------------------

9,19	20,00 V
-------------	----------------

Regulamento: FI - Multimercado - Aberto - Art. 8º, III

Fundo 8704 - CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	1.098.863,87	0,19		4.935.289.077,51	0,02227	5,00 V
--	--------------	------	--	------------------	---------	--------

TOTAL POR REGULAMENTO:	1.098.863,87
-------------------------------	---------------------

0,19	10,00 V
-------------	----------------

Regulamento: FI em Participações - Art. 8º, IV, "a"

Fundo 8578 - ATICO GERAÇÃO DE ENERGIA FI FIP	82.809,53	0,01		8.008.142,29	0,78432	5,00 V
Fundo 8649 - W7BZ INFRAPEC FUNDO DE INVESTIMENTOS	9.833.400,93	1,68		134.598.706,26	7,30572	5,00 X

TOTAL POR REGULAMENTO:	9.896.210,46
-------------------------------	---------------------

1,69	5,00 V
-------------	---------------

Regulamento: FI Imobiliários - Art. 8º, IV, "b"

Fundo 8579 - ATICO RENDA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOB	1.150.415,83	0,20		71.997.811,23	1,59785	5,00 V
Fundo 8599 - BR HOYEIS FII	1.582.121,47	0,27		158.187.317,81	1,01298	5,00 V
Fundo 8629 - GBX PROPERTIES	1.727.134,20	0,30		185.741.830,48	0,92988	5,00 V

TOTAL POR REGULAMENTO:	4.459.671,50
-------------------------------	---------------------

0,76	5,00 V
-------------	---------------

TOTAL POR REGULAMENTO CUMULATIVO:	86.977.205,51
--	----------------------

Regulamento Cumulativo: Segmento Exterior Art. 9ºA

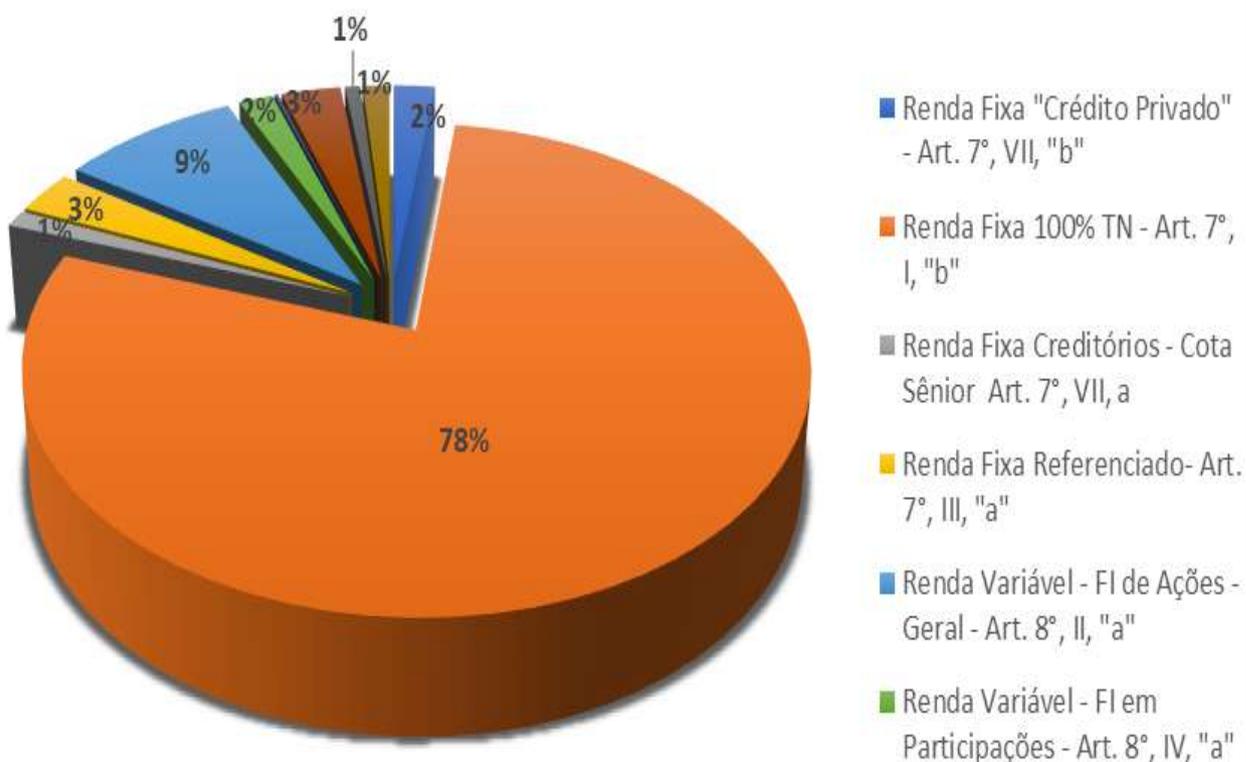
Regulamento: Fundos de Ações - BDR Nivel I - Art. 9º, III

Fundo 8727 - FUNDO DE INVESTIMENTOS EM AÇÕES BDR NIV	2.154.268,38	0,37		1.987.917.898,76	0,10837	
Fundo 8729 - BB AÇÕES GLOBAIS DE INVESTIMENTO EM C	5.296.801,12	0,91		528.483.255,80	1,00223	

TOTAL POR REGULAMENTO:	7.450.869,50
-------------------------------	---------------------

1,27	10,00 V
-------------	----------------

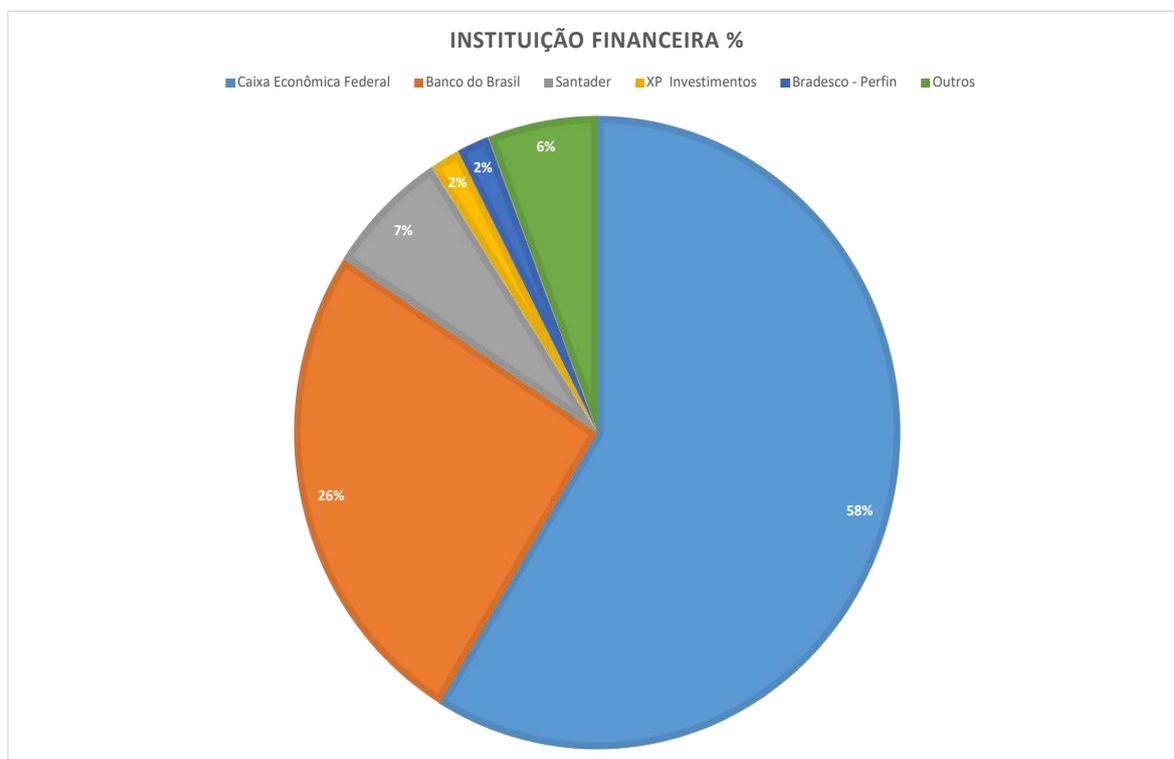
ENQUADRAMENTO



5. ALOCAÇÃO POR INSTITUIÇÃO

O período de 2020, foi marcado por muito instabilidade no mercado financeiro, portanto seguimos mantendo aplicação em instituições sólidas, não aplicamos com fundos com alta volatilidade e nem fundos inferiores a dois anos no mercado.

INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	Participação %
Caixa Econômica Federal	338.393.305,88	58%
Banco do Brasil	151.991.328,45	26%
Santader	39.208.343,16	7%
XP Investimentos	10.019.545,17	2%
Bradesco - Perfin	10.494.047,54	2%
Outros	34.482.478,55	6%
Total	584.589.048,75	



6. DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO

Plano Previdenciário

Enquadramento	Fundo	Saldo 31/12/2022	Participação %
Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8587 - BB IDKA 2 TITULOS PUBLICOS FI RF PREVID	54.712.930,62	9%
Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8590 - BB PREVID. RF IRF-M	20.966.177,57	4%
Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8591 - BB PREVIDENCIARIO IMA-B TP	22.899.335,82	4%
Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8592 - BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA TIT. PUBLIC	625.745,21	0%
Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8594 - BB TIT. PUBL VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI	430.114,40	0%
Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8612 - CAIXA BRASIL 2024 IV TITULOS PUBLICOS FI R	17.379.082,06	3%
Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8614 - CAIXA BRASIL IMA-B 5 TIT PUBLIC. FI RENDA	48.345.983,78	8%
Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8617 - CAIXA BRASIL IRFM 1 TIT. PUBLIC	3.026.827,68	1%
Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8618 - CAIXA ECONOMICA FEDERAL	85.259.918,78	15%
Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8619 - CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBLIC. RF L	44.179.487,27	8%
Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8620 - CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	12.345.105,59	2%
Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8621 - CAIXA FI BRASIL IRF-M1 TP RF LP	39.874.799,24	7%
Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8645 - SANTANDER IMA-B INST. TIT. PUB RF. LP	39.208.343,16	7%
Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8703 - CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATEGICA RF	31.346.414,63	5%
Renda Fixa Referenciado - Art. 7º, III, "a"	Fundo 8582 - BB BANCO DO BRASIL	17.706.305,70	3%
Renda Fixa Creditórios - Cota Sênior Art. 7º, VII, a	Fundo 8634 - INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	5.394.403,26	1%
Renda Fixa Creditórios - Cota Sênior Art. 7º, VII, a	Fundo 8639 - LEME IPCA MULTISSETORIAL SENIOR	1.336.458,06	0%
Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, "b"	Fundo 8588 - BB IPCA III RENDA FIXA PREVIDENCIARIO C	5.923.185,92	1%
Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, "b"	Fundo 8616 - CAIXA BRASIL IPCA XVI RENDA FIXA CREDI	6.082.785,27	1%

Plano Financeiro

Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8560 - CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	9.403.653,55	2%
Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8617 - CAIXA BRASIL IRFM 1 TIT. PUBLIC - FUNDO OSCILAÇÃO	6.921.883,51	1%

Reserva Administrativa

Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8560 - CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	2.249.326,90	0%
Renda Fixa 100% TN - Art. 7º, I, "b"	Fundo 8618 - CAIXA ECONOMICA FEDERAL	14.542.705,76	2%

TOTAL GERAL RENDA FIXA	490.160.973,74	84%
-------------------------------	-----------------------	------------

PLANO PREVIDENCIÁRIO

Enquadramento	Fundo	Saldo Inicial	Participação %
Renda Variável FI de Ações - no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, "a"	Fundo 8702 - BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNAÇA FD	17.823.184,45	3%
Renda Variável - FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a"	Fundo 8548 - BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC	3.680.488,83	1%
Renda Variável - FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a"	Fundo 8622 - CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	14.182.199,61	2%
Renda Variável - FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a"	Fundo 8631 - GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.980.477,02	1%
Renda Variável - FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a"	Fundo 8640 - PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.494.047,54	2%
Renda Variável - FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a"	Fundo 8651 - XP INVESTOR FI AÇÕES	10.019.545,17	2%
Renda Variável - FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a"	Fundo 8695 - NAVI INSTITUCIONAL FIA	2.633.346,24	0%
Renda Variável - FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a"	Fundo 8710 - AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	2.101.423,18	0%
Renda Variável - FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a"	Fundo 8726 - BB AÇÕES RETORNO TOTAL FUNDO	5.607.747,64	1%
Renda Variável FI - Multimercado - Aberto - Art. 8º, III	Fundo 8704 - CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	1.098.863,87	0%
Renda Variável - FI em Participações - Art. 8º, IV, "a"	Fundo 8578 - ATICO GERAÇÃO DE ENERGIA FI FIP	62.809,53	0%
Renda Variável - FI em Participações - Art. 8º, IV, "a"	Fundo 8649 - W7 BZ INFRATEC FUNDO DE INVESTIMENTOS	9.833.400,93	2%
Renda Variável Imobiliários Art. 8º, IV, b	Fundo 8579 - ATICO RENDA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOB	1.150.415,83	0%
Renda Variável Imobiliários Art. 8º, IV, b	Fundo 8599 - BR HOTEIS FII	1.582.121,47	0%
Renda Variável Imobiliários Art. 8º, IV, b	Fundo 8629 - GBX PROPERTIES	1.727.134,20	0%
TOTAL RENDA VARIÁVEL		86.977.205,51	15%
Segmento Exterior Art. 9ºA	Fundo 8727 - CAIXA INVESTIMENTOS EM AÇÕES BDR NIV	2.154.268,38	0%
Segmento Exterior Art. 9ºA	Fundo 8729 - BB AÇÕES GLOBAIS DE INVESTIMENTO	5.296.601,12	1%
TOTAL SEGMENTO NO EXTERIOR		7.450.869,50	1%
TOTAL GERAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS		584.589.048,75	100%



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA
MUNICIPAL DE LIMEIRA
IPML**

