

IPML

(INVESTIMENTOS_2023)

LEMA 

APRESENTAÇÃO

Este relatório atende ao parágrafo terceiro do art. 101 da Portaria MTP nº 1.467 de 2022:

§ 3º No início de cada exercício, a unidade gestora deverá apresentar aos conselhos deliberativo e fiscal o relatório de acompanhamento da execução da política de investimentos relativo ao ano anterior.

Os dados aqui apresentados foram extraídos do Uno, sistema de gestão de investimentos utilizado pelo IPML.

INFORMAÇÕES RELEVANTES



PREMIAÇÕES

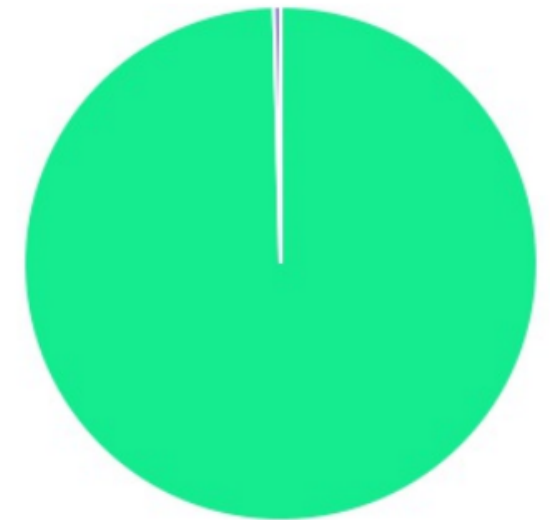
- 12º colocação no 4º Prêmio Destaque Brasil de Investimentos

CARTEIRA_DEZ/2023




ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 98.900,86	12.06%	D+0	7, I "b"
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 180.790,04	22.05%	D+1	7, I "b"
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	R\$ 148.664,56	18.13%	D+1	7, I "b"
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	R\$ 241.601,77	29.47%	D+3	7, I "b"
BB PERFIL FIC RF REF DI...	R\$ 146.472,92	17.87%	D+0	7, III "a"
BB MULTIMERCADO LP...	R\$ 3.413,52	0.42%	D+1	10, I
Total investimentos	R\$ 819.843,67	100.00%		
Disponibilidade	R\$ 11.904,69	-		
Total patrimônio	R\$ 831.748,36	100.00%		

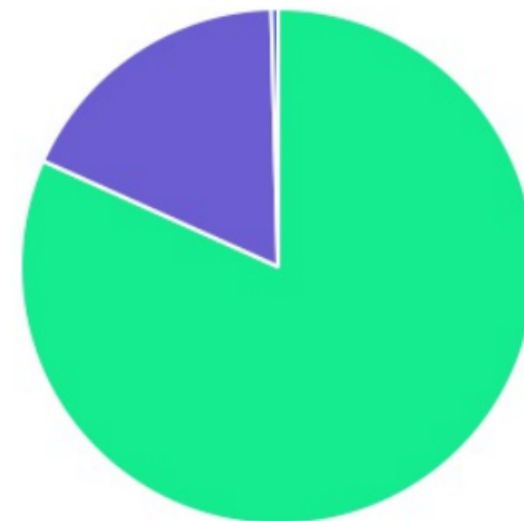
DISTRIBUIÇÃO_CLASSE

CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	99,58%	R\$ 816.430,15	
Estruturados	0,42%	R\$ 3.413,52	
Total	100,00%	R\$ 819.843,67	




DISTRIBUIÇÃO_ENQUADRAMENTO

ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	81,72%	R\$ 669.957,23	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	17,87%	R\$ 146.472,92	
Artigo 10º, Inciso I	0,42%	R\$ 3.413,52	
Total	100,00%	R\$ 819.843,67	




DISTRIBUIÇÃO_GESTOR

GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	100,00%	R\$ 819.843,67	
Total	100,00%	R\$ 819.843,67	








DISTRIBUIÇÃO_ADMINISTRADOR

ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	100,00%	R\$ 819.843,67	
Total	100,00%	R\$ 819.843,67	



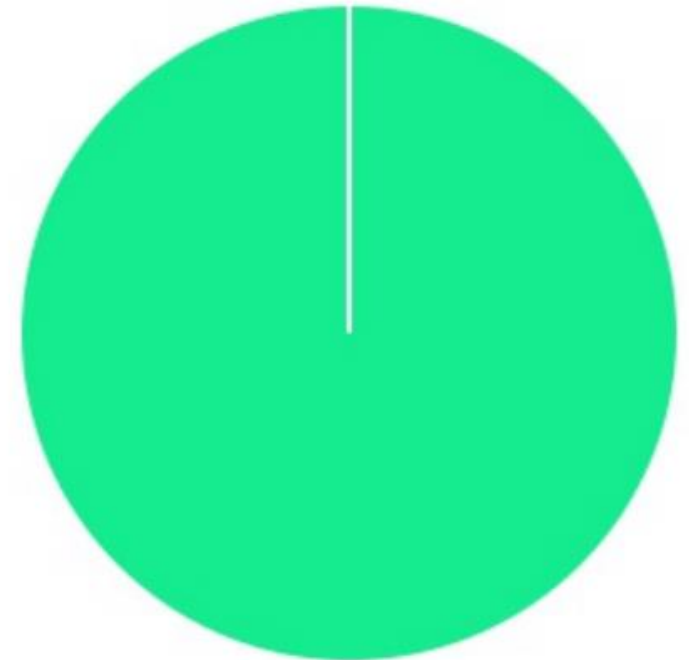
DISTRIBUIÇÃO_BENCHMARK

BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA Geral ex-C	29,47%	R\$ 241.601,77	
IRF-M	22,05%	R\$ 180.790,04	
CDI	18,28%	R\$ 149.886,44	
IMA-B 5	18,13%	R\$ 148.664,56	
IRF-M 1	12,06%	R\$ 98.900,86	
Total	100,00%	R\$ 819.843,67	



DISTRIBUIÇÃO_LIQUIDEZ

LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	100,00%	R\$ 819.843,67	
Total	100,00%	R\$ 819.843,67	



ENQUADRAMENTOS

	Tipo de Ativo	Carteira Atual (R\$)	Carteira Atual (%)	Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)
RENDA FIXA	Títulos Tesouro Nacional – SELIC - Art. 7º, I, "a".	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	5.00%	10.00%
	FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	R\$ 669.957,23	81.72%	30.00%	57.00%	95.00%
	FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - Art. 7º, I, "c"	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
	Operações Compromissadas - Art. 7º, II	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
	FI Renda Fixa - Art. 7º, III, "a"	R\$ 146.472,92	17.87%	10.00%	20.00%	50.00%
	FI de Índices Renda Fixa - Art. 7º, III, "b"	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
	Ativos Bancários - Art. 7º, IV	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	5.00%	10.00%
	FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - Art. 7º, V, "a"	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
	FI Renda Fixa "Crédito Privado"- Art. 7º, V, "b"	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	2.00%	4.00%
	FI "Debentures"- Art. 7º, V, "c"	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
	Subtotal	R\$ 816.430,15	99.58%	40.00%	89.00%	100.00%

ENQUADRAMENTOS

	Tipo de Ativo	Carteira Atual (R\$)	Carteira Atual (%)	Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)
RV	FI Ações - Art. 8º, I	R\$ 0.00	R\$ 0.00	0.00%	4.00%	10.00%
	FI de Índices Ações - Art. 8º, II	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
	Subtotal	R\$ 0.00	R\$ 0.00	0.00%	4.00%	10.00%
	Tipo de Ativo	Carteira Atual (R\$)	Carteira Atual (%)	Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)
Exterior	FI Renda Fixa - Dívida Externa - Art. 9º, I	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
	FI Investimento no Exterior - Art. 9º, II	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
	FI Ações - BDR Nível I - Art. 9º, III	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	3.00%	9.00%
	Subtotal	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	3.00%	9.00%

ENQUADRAMENTOS

	Tipo de Ativo	Carteira Atual (R\$)	Carteira Atual (%)	Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)
Estruturado	FI Multimercado - aberto - Art. 10, I	R\$ 3.413,52	0.42%	0.00%	4.00%	10.00%
	FI em Participações - Art. 10, II	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
	FI "Ações - Mercado de Acesso"- Art. 10, III	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
	Subtotal	R\$ 3.413,52	0.42%	0.00%	4.00%	10.00%
	Tipo de Ativo	Carteira Atual (R\$)	Carteira Atual (%)	Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)
FII	FI Imobiliário - Art. 11	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
	Subtotal	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%

ENQUADRAMENTOS

	Tipo de Ativo	Carteira Atual (R\$)	Carteira Atual (%)	Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)
E.C.	Empréstimos Consignados – Art. 12	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
	Subtotal	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
	Total Geral	R\$ 819.843,67	100.00%	-	100.00%	-

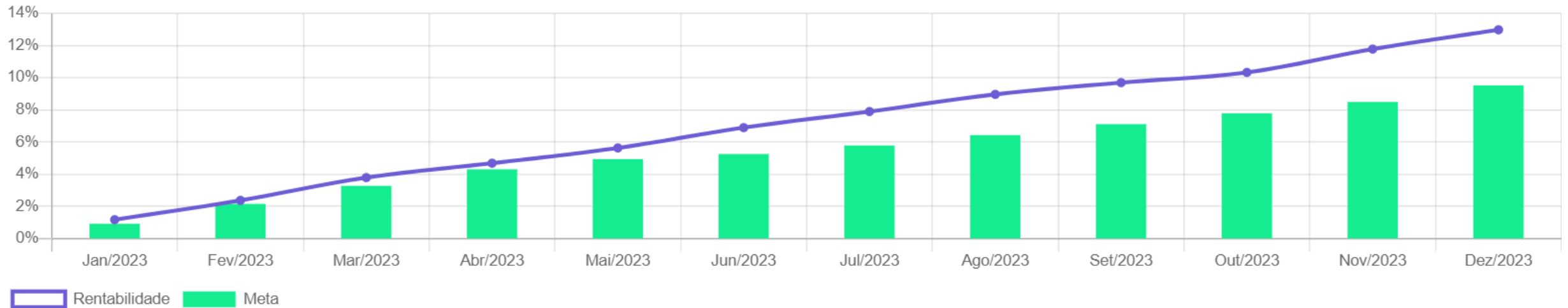
ENQUADRAMENTOS

TIPO DE ATIVO	CARTEIRA ATUAL (R\$)	CARTEIRA ATUAL (%)	LIMITE INFERIOR (%)	ESTRATÉGIA ALVO (%)	LIMITE SUPERIOR (%)
Títulos Tesouro – SELIC - Art. 7º, I, "a".	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	5.00%	10.00%
FI RF Ref 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	R\$ 669.957,23	81.72%	30.00%	57.00%	95.00%
FI Renda Fixa - Art. 7º, III, "a"	R\$ 146.472,92	17.87%	10.00%	20.00%	50.00%
Ativos Bancários - Art. 7º, IV	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	5.00%	10.00%
FI RF "Crédito Privado"- Art. 7º, V, "b"	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	2.00%	4.00%
FI Ações - Art. 8º, I	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	4.00%	10.00%
FI Ações - BDR Nível I - Art. 9º, III	R\$ 0.00	0.00%	0.00%	3.00%	9.00%
TOTAL	R\$ 819.843,67	100%	-	100%	-

RENTABILIDADES_2023

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2023			IPCA + 4.68% a.a.			
Janeiro	R\$ 2.961.978,92	R\$ 2.895.078,13	0,91%	R\$ 34.155,58	1,17%	0,25%
Fevereiro	R\$ 2.895.078,13	R\$ 3.070.187,19	1,22%	R\$ 33.015,90	1,19%	-0,03%
Março	R\$ 3.070.187,19	R\$ 3.188.693,60	1,09%	R\$ 41.898,00	1,39%	0,29%
Abril	R\$ 3.188.693,60	R\$ 2.820.259,91	0,99%	R\$ 27.385,05	0,86%	-0,13%
Maiο	R\$ 2.820.259,91	R\$ 2.440.895,87	0,61%	R\$ 24.670,42	0,91%	0,29%
Junho	R\$ 2.440.895,87	R\$ 2.184.490,23	0,30%	R\$ 27.112,02	1,20%	0,89%
Julho	R\$ 2.184.490,23	R\$ 1.909.670,42	0,50%	R\$ 19.423,74	0,94%	0,43%
Agosto	R\$ 1.909.670,42	R\$ 1.814.836,03	0,61%	R\$ 18.322,41	0,99%	0,38%
Setembro	R\$ 1.814.836,03	R\$ 1.767.576,76	0,64%	R\$ 10.805,03	0,67%	0,03%
Outubro	R\$ 1.767.576,76	R\$ 1.354.935,50	0,62%	R\$ 10.383,91	0,58%	-0,04%
Novembro	R\$ 1.354.935,50	R\$ 1.140.543,67	0,66%	R\$ 16.742,64	1,32%	0,65%
Dezembro	R\$ 1.140.543,67	R\$ 831.748,36	0,94%	R\$ 11.356,30	1,07%	0,13%
Total	R\$ 1.140.543,67	R\$ 831.748,36	9,52%	R\$ 275.271,00	12,98%	3,46%

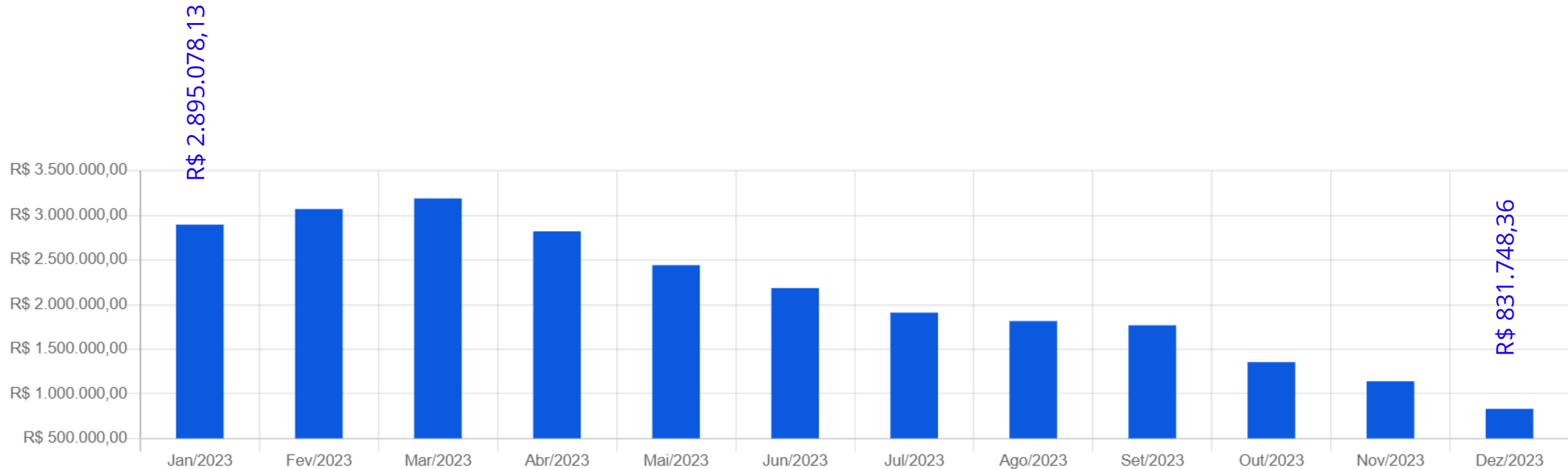
RENTABILIDADE ACUMULADA_2023



Meta atuarial: 9,52%

Rentabilidade: 12,98%

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL_2023



CONCLUSÃO

O IPML encerrou 2023 superando a meta atuarial em 3,46 p.p., porém, com uma redução do patrimônio de cerca de R\$ 2 milhões.

Os investimentos permaneceram aderentes aos limites impostos pela Política de Investimentos e pela Resolução CMN nº 4.963/2021.

A composição da carteira de investimentos do IPML respeita o seu perfil de risco considerado como conservador.

Os processos decisórios das aplicações dos recursos são sempre avaliados e aprovados pelo Comitê de Investimentos com o apoio da LEMA.

A análise dos riscos e a avaliação e acompanhamento do retorno dos investimentos foi realizada mensalmente através de relatórios específicos gerados pelo Uno e monitorados conjuntamente pelo Comitê de Investimentos e pela LEMA.

IPML

(INVESTIMENTOS_2023)

LEMA 