

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MAPFRE MASTER IGPM

Perfil do Fundo
Público Alvo: Restrito, a sociedades seguradoras, resseguradoras, sociedades de capitalização e entidades abertas de previdência complementar.
Objetivo: O FUNDO tem como objetivo de investimento buscar proporcionar a valorização de suas cotas.
Política: Mínimo de 80% do patrimônio líquido do FUNDO ([PPL]) deve ser investido em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa, relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, à variação de taxa de juros, de índice de preço, ou ambos (pós ou préfixados).

Informações Gerais	
CNPJ	02.037.763/0001-32
Início do fundo	07/10/1997
Código Anbima	072605
Classificação Anbima	Renda Fixa Duração Livre Soberano
Gestão	Mapfre Invest.
Custodiante	Banco BNP Paribas Brasil
Administrador	Banco BNP Paribas Brasil
Aplicação	D+0
Resgate	D+0
Pagamento	D+0
Aplicação inicial	
Movimentação mínima	
Taxa de administração	0 %
Taxa de performance	0 %
Patrimônio líquido	R\$ 270.814.279,42
Patrimônio médio em 12 meses	R\$ 263.494.526,89

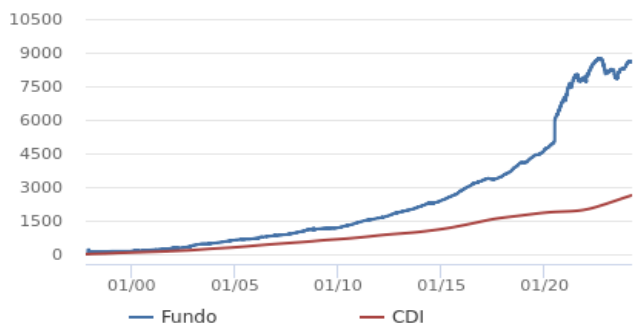
Período da Análise: 07/10/1997 a 28/03/2024. Retornos em %.

Ativo	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	Mês	Fev 2024	Jan 2024	Dez 2023	Nov 2023	Out 2023	Set 2023	Ago 2023	Jul 2023	Jun 2023	Mai 2023	Abr 2023
Fundo	0,51	4,03	3,46	13,09	-0,46	0,17	0,80	1,87	1,19	-0,11	0,71	1,85	2,62	-0,32	-3,73	-0,38
CDI	2,62	12,46	27,39	35,51	0,83	0,80	0,97	0,89	0,92	1,00	0,97	1,14	1,07	1,07	1,12	0,92
Percent CDI	19,34	32,31	12,62	36,85	-55,29	20,93	83,02	208,71	129,66	-11,02	73,17	162,93	244,47	-29,82	-331,78	-41,24
IBOV	-4,53	25,85	6,74	10,99	-0,71	0,99	-4,79	5,38	12,54	-2,94	0,71	-5,09	3,26	9,00	3,74	2,50
OURO	20,77	7,19	18,07	9,27	10,65	1,64	7,39	-0,98	-2,85	-0,99	-2,57	4,08	-0,17	-6,21	0,00	-0,95
POUPANCA1	1,64	7,60	16,54	21,59	0,53	0,51	0,59	0,57	0,58	0,61	0,61	0,72	0,66	0,68	0,72	0,58

Indicadores de Performance.

Ativo	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	Mês	Fev 2024	Jan 2024	Dez 2023	Nov 2023	Out 2023	Set 2023	Ago 2023	Jul 2023	Jun 2023	Mai 2023	Abr 2023
VaR (%)	0,47	1,10	1,34	1,88	0,53	0,42	0,34	0,54	0,31	0,76	0,43	0,84	2,11	0,76	1,78	0,64
Volatilidade (%)	0,99	2,32	2,83	3,95	1,11	0,88	0,72	1,13	0,64	1,61	0,91	1,78	4,44	1,61	3,74	1,35
Índice de Sharpe	-8,80	-3,45	-3,72	-1,58	-14,18	-9,49	-2,58	10,63	5,22	-8,23	-3,63	4,34	4,14	-10,33	-15,02	-13,44

Retorno Acumulado (% Efetivo)



Patrimônio Líquido (R\$ milhões)



Quadro Estatístico

Meses com retorno positivo:	272
Maior retorno mensal:	187,00% (Nov/1997)
Meses com retorno negativo:	25
Menor retorno mensal:	-21,44% (Dez/1997)
Retorno acumulado:	8573,00%
Retorno acumulado benchmark:	2628,09%
Meses acima do benchmark:	180
Meses abaixo do benchmark:	138

Alocação por classe de ativo em 02/2024

