



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

JANEIRO 2020

RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Comparativos		Valor Investido (R\$)	Último Mês	Últimos 3 Meses	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	No ano
IPCA + 6.00%			0.69%	3.47%	5.11%	10.58%	0.69%
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM)		37.548.948,58	0.49%	0.95%	4.41%	12.06%	0.49%
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	6.032.770,01	0,81%	0,90%	4,66%	13,56%	0,81%
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	10.740.658/0001-93	5.993.638,64	0,24%	-0,35%	5,44%	17,71%	0,24%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.060.913/0001-10	4.899.521,84	0,54%	1,41%	4,88%	-	0,54%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	3.849.324,84	0,45%	1,57%	4,43%	10,30%	0,45%
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	3.073.968,62	0,42%	1,14%	2,93%	6,39%	0,42%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	11.061.217/0001-28	2.807.683,31	0,48%	0,63%	3,95%	10,77%	0,48%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	14.508.605/0001-00	2.304.394,45	0,83%	0,95%	4,33%	11,11%	0,83%
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	10.577.503/0001-88	2.136.923,00	-0,03%	-1,74%	5,76%	20,95%	-0,03%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	10.577.519/0001-90	1.059.649,04	1,07%	0,92%	5,12%	-	1,07%
BB PREVID RF IRF-M	07.111.384/0001-69	986.380,00	0,85%	0,98%	4,38%	11,22%	0,85%
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	982.169,07	0,37%	1,03%	2,44%	-	0,37%
BB PREVID RF FLUXO	13.077.415/0001-05	792.048,89	0,28%	0,86%	2,04%	4,64%	0,28%
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	32.161.826/0001-29	727.205,64	1,05%	0,88%	5,02%	-	1,05%
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	630.970,52	0,34%	1,04%	2,45%	-	0,34%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	10.551.382/0001-03	598.485,00	1,12%	14,11%	19,20%	36,34%	1,12%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	13.058.816/0001-18	406.607,40	-1,66%	6,08%	11,55%	16,17%	-1,66%
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	05.164.356/0001-84	219.975,22	0,38%	1,09%	2,58%	5,76%	0,38%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	14.508.643/0001-55	28.054,89	0,30%	0,92%	2,16%	4,89%	0,30%
BB PREVID RF IDKA 2	13.322.205/0001-35	19.178,20	0,38%	1,75%	4,52%	10,29%	0,38%

RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

COMPARATIVOS	VALOR INVESTIDO	ÚLTIMO MÊS	3 MESES	6 MESES	12 MESES	NO ANO
IPCA + 6% META		0,69%	3,47%	5,11%	10,58%	0,69%
IPMM	R\$ 37.548.948,58	0,49%	0,95%	4,41%	12,06%	0,49%
	VALOR INVESTIDO	ÚLTIMO MÊS	3 MESES	6 MESES	12 MESES	NO ANO
CAIXA FIC BRASIL G. E.	R\$ 6.032.770,01	0,81%	0,90%	4,66%	13,56%	0,81%
CAIXA FI BRASIL IMA-B	R\$ 5.993.638,64	0,24%	-0,35%	5,44%	17,71%	0,24%
CAIXA IMA-B 5	R\$ 4.899.521,84	0,54%	1,41%	4,88%		0,54%
CAIXA FI BRASIL IPCA 2A RF LP	R\$ 3.849.324,84	0,45%	1,57%	4,43%	10,30%	0,45%
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP	R\$ 3.073.968,62	0,42%	1,14%	2,93%	6,39%	0,42%
CAIXA IMA GERAL TP	R\$ 2.807.683,31	0,48%	0,63%	3,95%	10,77%	0,48%
CAIXA IRF-M TP	R\$ 2.304.394,45	0,83%	0,95%	4,33%	20,95%	-0,03%
CAIXA IMA-B 5+ TP RF LP	R\$ 2.136.923,00	-0,03%	-1,74%	5,76%	20,95%	-0,03%
CAIXA IRF-M 1+ TP RF LP	R\$ 1.059.649,04	1,07%	0,92%	5,12%		1,07%
BB PREVID RF IRF-M	R\$ 986.380,00	0,85%	0,98%	4,38%	11,22%	0,85%
CAIXA FI BRASIL REF. DI LP	R\$ 982.169,07	0,37%	1,03%	2,44%		0,37%
BB PREVID RF FLUXO	R\$ 792.048,89	0,28%	0,86%	2,04%	4,64%	0,28%
BB PREVID RF IRF-M 1+ FI	R\$ 727.205,64	1,05%	0,88%	5,02%		1,05%
BB PREVID RF PERFIL	R\$ 630.970,52	0,34%	1,04%	2,45%		0,34%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇOE	R\$ 598.485,00	1,12%	14,11%	19,20%	36,34%	1,12%
CAIXA BRASIL AÇOES IBOVESPA	R\$ 406.607,40	-1,66%	6,08%	11,55%	16,17%	-1,66%
CAIXA FI BRASIL TP RF	R\$ 219.975,22	0,38%	1,09%	2,58%	5,76%	0,38%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADE	R\$ 28.054,89	0,30%	0,92%	2,16%	4,89%	0,30%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 19.178,20	0,38%	1,75%	4,52%	10,29%	0,38%

RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

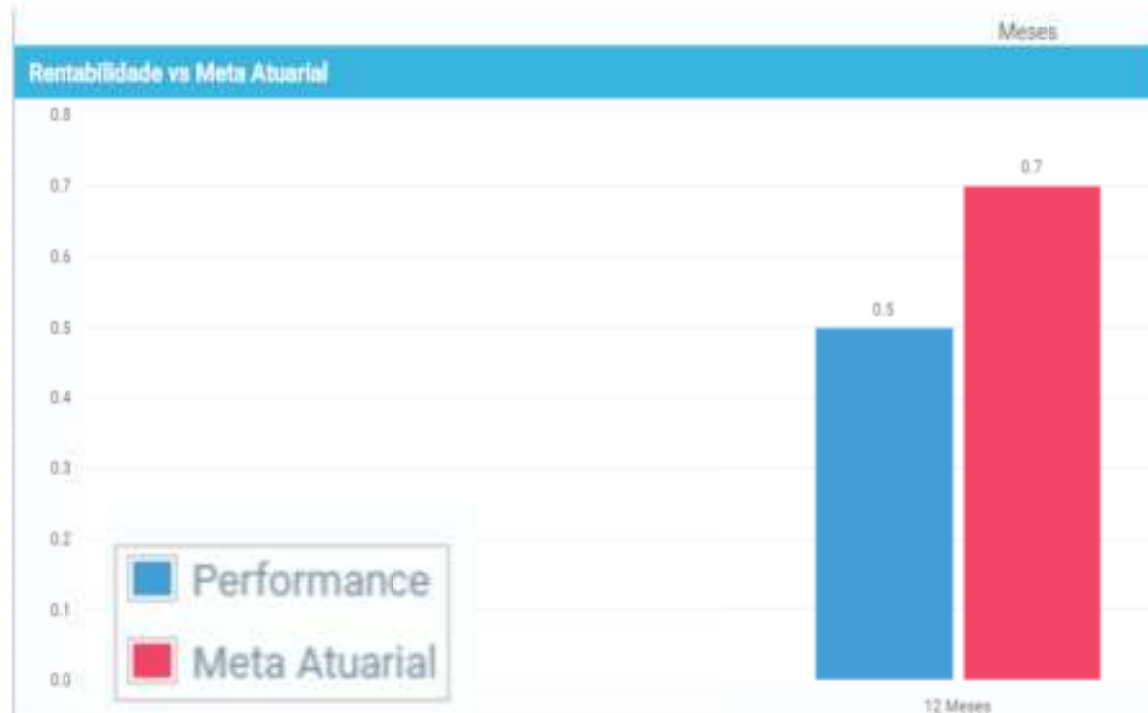


Performance Geral - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA
(IPMM) - JAN/2020

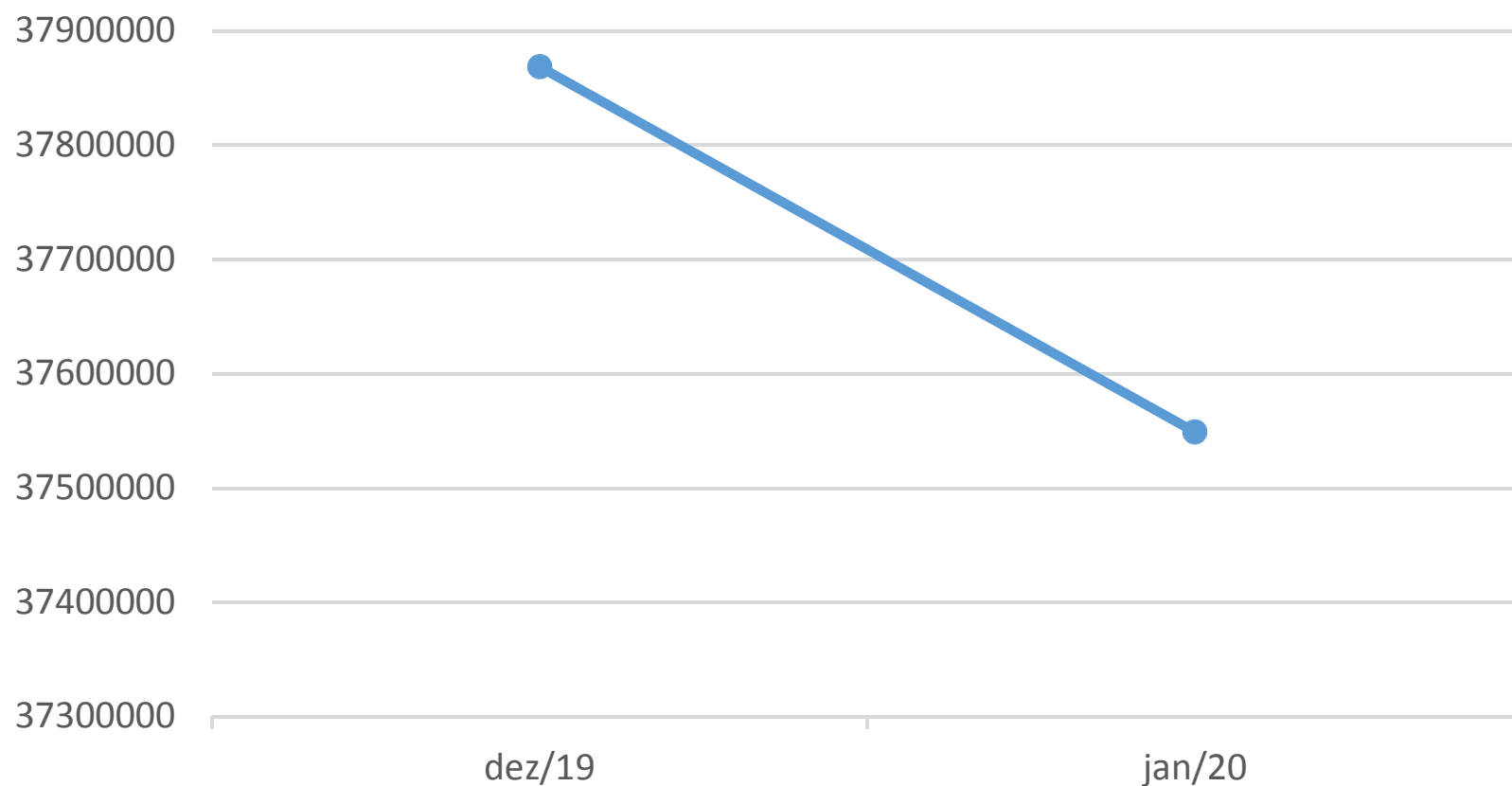
	Fev/19	Mar/19	Abr/19	Mai/19	Jun/19	Jul/19	Ago/19	Set/19	Out/19	Nov/19	Dez/19	Jan/20	12 Meses	Acumulado 2020
PERFORMANCE GERAL	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,49%	0,49%	0,49%
INPC + 6,00% (Fev/19 - Dez/19)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,69%	0,69%	0,69%
IPCA + 6,00% (Jan/20 - Jan/20)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Mês	Saldo 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				
Total Geral		2.006.237,36	2.516.074,77		190.378,05		0,4975		0,6977	71,3034				

SALDO ANTERIOR (31/12/2019) R\$ 37.868.407,94
SALDO ATUAL (31/01/2020) R\$ 37.548.948,58

PERFORMANCE 0,49%
META 0,69%



EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO JÊN/2020





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - JAN/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)		34.110.612,81	90,8430%	100,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	100,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF IDKA 2	IDKA IPCA 2A	19.178,20	0,0510%							Enquadrado
BB PREVID RF IRF-M	IRF-M	986.380,00	2,6269%							Enquadrado
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	IRF-M1+	727.205,64	1,9366%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	IDKA IPCA 2A	3.849.324,84	10,2514%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	IMA-B	5.993.638,64	15,9622%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	IRF-M1	3.073.968,62	8,1865%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	CDI	219.975,22	0,5858%							Enquadrado
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	Outros	6.032.770,01	16,0664%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	IMA-B5+	2.136.923,00	5,6910%							Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	IRF-M1+	1.059.649,04	2,8220%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-GERAL	2.807.683,31	7,4773%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IMA-B5	4.899.521,84	13,0483%							Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M	2.304.394,45	6,1370%							Enquadrado
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7o, Inciso IV, Alínea A)		2.433.243,37	6,4801%	40,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	40,00%	Enquadrado	
BB PREVID RF FLUXO	CDI	792.048,89	2,1093%							Enquadrado
BB PREVID RF PERFIL	CDI	630.970,52	1,6803%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	CDI	28.054,89	0,0747%							Enquadrado
CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	CDI	982.169,07	2,6157%							Enquadrado



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



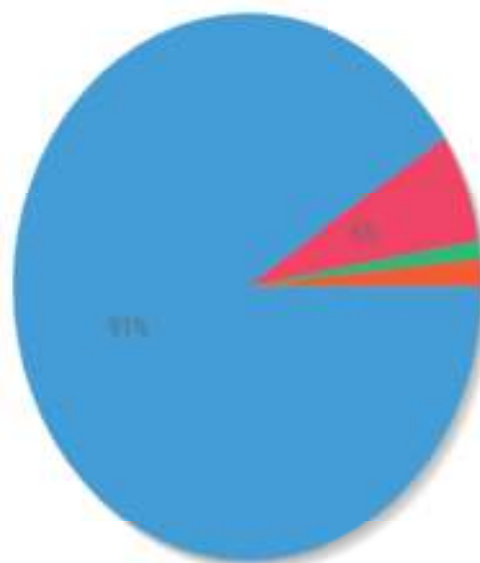
Resumo Enquadramento - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM) - JAN/2020

Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8o, Inciso I, Alínea A)		406.607,40	1,0828%	30,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	30,00%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	IBOVESPA	406.607,40	1,0828%						Enquadrado
Fundo de Ações - Geral (Art. 8o, Inciso II, Alínea A)		598.485,00	1,5938%	20,00	Enquadrado	0,00%	Enquadrado	20,00%	Enquadrado
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	Outros	598.485,00	1,5938%						Enquadrado
Total Geral		37.548.948,58							

RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Competência: JAN/2020

Veículos	Enquadramento	Benchmarks	Instituição Financeira		
Artigo		Total em 31.01.2020 (R\$)	Limite CMR(%)	Limite PI(%)	Valor Item(%)
Art. 7o, inciso I, Alínea B		34.110.612,81	100,00	100,00	90,84
Art. 7o, inciso IV, Alínea A		2.433.243,77	40,00	40,00	6,48
Art. 8o, inciso I, Alínea A		406.507,40	30,00	30,00	1,08
Art. 8o, inciso II, Alínea A		598.485,00	20,00	20,00	1,59





RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



Resumo Alocação Máxima - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE
MAFRA (IPMM) - JAN/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 configuração 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)	34.110.612,81	90,8430%	100,00	100,00%	Infinito	Infinito
BB PREVID RF IDKA 2	19.178,20	0,0510%			9.382.442,59	9.363.264,39
BB PREVID RF IRF-M	986.380,00	2,6269%			9.140.642,14	8.154.262,14
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 + FUNDO DE INVESTIMENTO	727.205,64	1,9366%			9.205.435,73	8.478.230,09
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	3.849.324,84	10,2514%			8.424.905,93	4.575.581,09
CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP	5.993.638,64	15,9622%			7.888.827,48	1.895.188,84
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	3.073.968,62	8,1865%			8.618.744,99	5.544.776,37
CAIXA FI BRASIL TITULOS PUBLICOS RF	219.975,22	0,5858%			9.332.243,34	9.112.268,12
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA	6.032.770,01	16,0664%			7.879.044,64	1.846.274,63
FI CAIXA BRASIL IMA B5+ TP RF LP	2.136.923,00	5,6910%			8.853.006,39	6.716.083,39
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	1.059.649,04	2,8220%			9.122.324,88	8.062.675,84
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA GERAL TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.807.683,31	7,4773%			8.685.316,31	5.877.633,00
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	4.899.521,84	13,0483%			8.162.356,68	3.262.834,84
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.304.394,45	6,1370%			8.811.138,53	6.506.744,08
Fundos Renda Fixa - Geral (Art. 7o, Inciso IV, Alínea A)	2.433.243,37	6,4801%	40,00	40,00%	23.410.470,14	20.977.226,77
BB PREVID RF FLUXO	792.048,89	2,1093%			9.189.224,92	8.397.176,03
BB PREVID RF PERFIL	630.970,52	1,6803%			9.229.494,51	8.598.523,99
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	28.054,89	0,0747%			9.380.223,42	9.352.168,53



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS



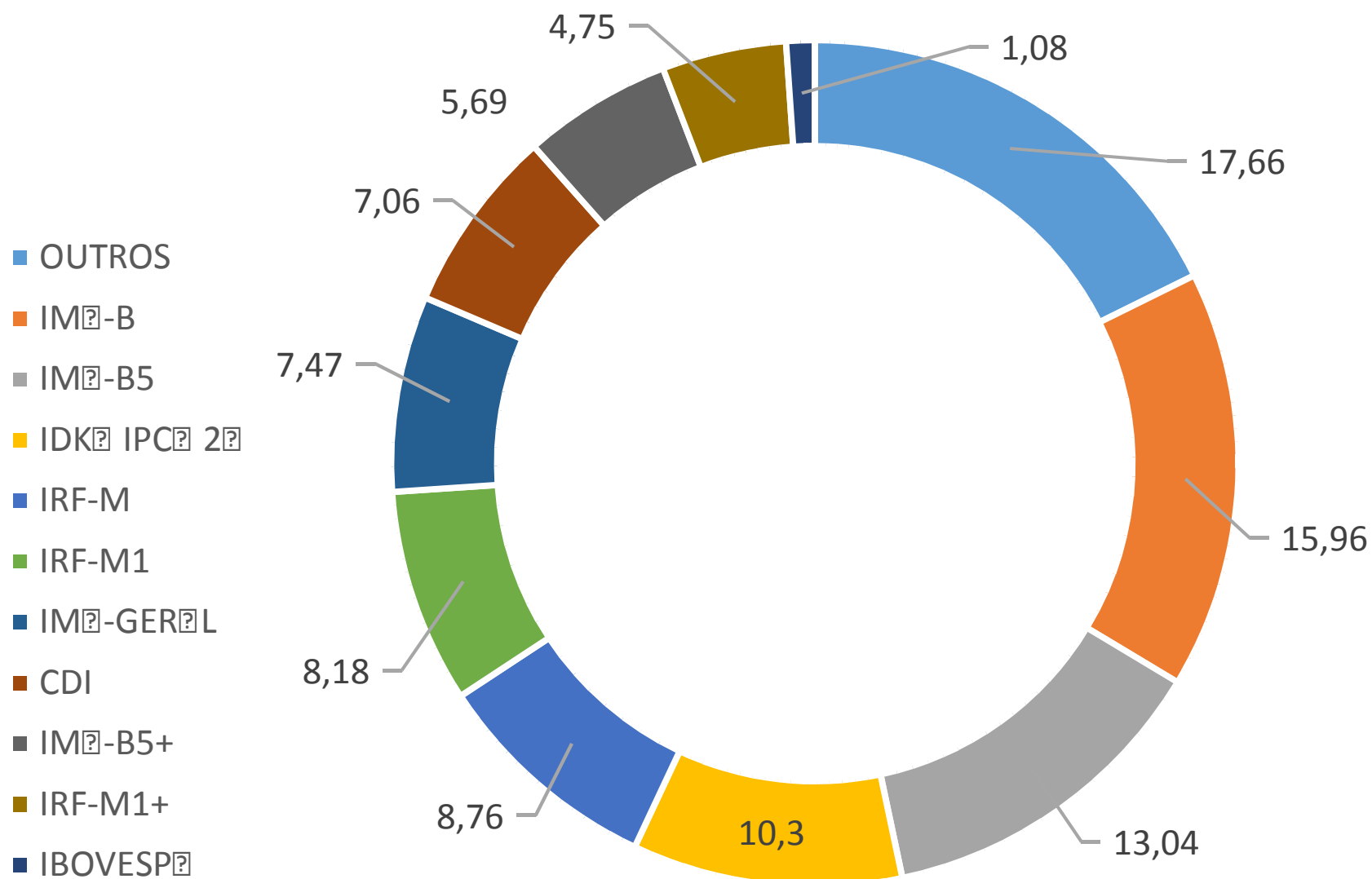
Resumo Alocação Máxima - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE MAFRA (IPMM) - JAN/2020

CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	982.169,07	2,6157%			9.141.694,87	8.159.525,80
Fundo de Ações - Índices com no mínimo 50 ações (Art. 8º, Inciso I, Alínea A)	406.607,40	1,0828%	30,00	30,00%	15.918.146,22	15.511.538,82
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA BRASIL IBOVESPA	406.607,40	1,0828%			9.285.585,29	8.878.977,89
Fundo de Ações - Geral (Art. 8º, Inciso II, Alínea A)	598.485,00	1,5938%	20,00	20,00%	9.237.615,89	8.639.130,89
CAIXA INFRAESTRUTURA FI ACOES	598.485,00	1,5938%			9.237.615,89	8.639.130,89



RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Veículos	Enquadramento	Benchmarks	Instituição Financeira
Nome	Descrição	Total em 31.01.2020 (R\$)	Percentual Item(%)
Outros	Outros	6.631.255,01	17,66
IMA-B	Índice de Mercado ANBIMA - NTN-B	5.993.638,64	15,96
IMA-B5	Índice de Mercado ANBIMA - NTN-B < 5 anos	4.899.521,84	13,04
IDKA IPCA 2A	Índice de Duração Constante ANBIMA segmento 2A	3.868.503,04	10,30
IRF-M	Índice de Mercado ANBIMA - LTN e NTN-F	3.290.774,45	8,76
IRF-M1	Índice de Mercado ANBIMA - LTN e NTN-F < 1 anos	3.073.968,62	8,18
IMA-GERAL	Índice de Mercado ANBIMA - Média ponderada dos retornos diários	2.807.683,31	7,47
CDI	Certificado de Depósito Interbancário	2.653.218,59	7,06
IMA-B5+	Índice de Mercado ANBIMA - NTN-B >= 5 anos	2.136.923,00	5,69
IRF-M1+	Índice de Mercado ANBIMA - LTN E NTN-F >= 1 anos	1.786.854,68	4,75
IBOVESPA	Índice Bovespa	406.607,40	1,08





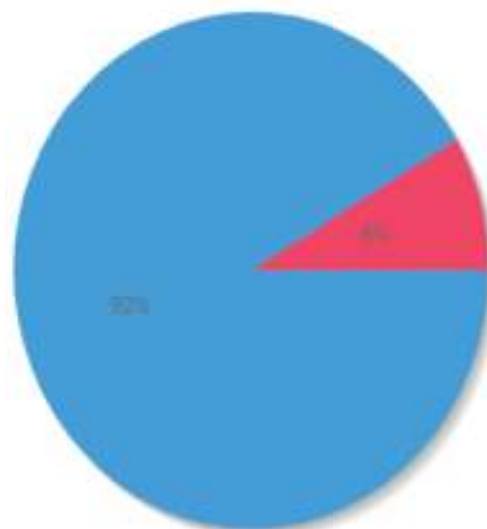
RELATÓRIO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS

Competência: JAN/2020



Veículos Enquadramento Benchmarks **Instituição Financeira**

Nome	CNPJ	Total em 31.01.2020 (R\$)	Percentual Item(%)
Caixa Econômica Federal	00.360.305/0001-04	34.392.165,33	91,59
BB-DTVM S.A.	30.822.936/0001-69	3.155.783,25	8,40



■ Caixa Econômica Federal
■ BB-DTVM S.A.

RESUMO DE ALOCAÇÃO DE RECURSOS

