Prefeitura de Jacareí
Instituto de Previdência do Município de Jacareí

IPMJ

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

Posição 28/02/2020

CDI ACUMULADO NO MÊS / ANO :	0,2966%	0,6743%

DESEMPENHO DOS FUNDOS NO MÊS / ANO :	-1,5343%	-1,4127%	META MÊS	-233,32%	META ANO	-105,44%

META ATUARIAL ACUMULADA NO MÊS / ANO :	0,6576%	1,3397%

BANCO / FUNDO	R$	% PATRIMÔNIO	LIMITE Resolução 3922 de 25/11/10	Politica Investimentos 2020		Rendimento do fundo no mês	Rendimento do fundo no ano	BENCHMARK FUNDO X CDI		BENCHMARK FUNDO X META		VaR	Índice de Sharpe
				ALVO	MAXIMO	% Mês	% Ano	% Mês	% Ano	% Mês	% Ano	% Mês	Ano
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LONGO PRAZO	85.648.127,26	14,14%	Art. 7º I b 100%	58,00%	75%	0,4389	0,6867	147,99	101,83	66,75	51,25	2,42%	0,42
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LONGO PRAZO	22.253.428,34	3,67%		62,99%		0,4396	0,9283	148,23	137,66	66,86	69,29	0,97%	1,01
FI CAIXA BRASIL IMA-B5 TP RF LONGO PRAZO	8.387.025,51	1,38%				0,6295	1,1771	212,26	174,55	95,74	87,86	0,86%	2,6
FI CAIXA BRASIL IMA-B5+ TP RF LONGO PRAZO	54.545.585,10	9,01%				0,2914	0,2527	98,25	37,48	44,31	18,86	3,75%	0,03
FIC CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	10.227.594,39	1,69%				0,6171	1,4415	208,06	213,76	93,84	107,59	0,91%	2,35
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA	73.769.524,09	12,18%				-0,1368	-0,4839	-46,11	-71,76	-20,80	-36,12	2,22%	-1,26
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI	38.874.325,02	6,42%				0,6507	1,2101	219,38	179,45	98,95	90,33	0,85%	2,78
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	71.998.119,35	11,89%				0,2990	0,3466	100,82	51,39	45,47	25,87	3,74%	0,05
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO	15.779.851,79	2,61%				1,0253	1,9363	345,69	287,14	155,92	144,53	1,55%	3,14
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	3.646.516,50	0,60%	Art. 7º IV a 40%	15,00%	40%	0,2576	0,5993	86,86	88,87	39,18	44,73	0,01%	-40,4
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI (T.A)	10.844.268,36	1,79%		12,36%		0,2576	0,5993	86,86	88,87	39,18	44,73	0,01%	-40,4
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	47.905.613,88	7,91%				0,4029	0,6670	135,84	98,92	61,27	49,79	2,41%	0,32
BB PREVIDENCIARIO PERFIL RF LP REFERENCIADO DI	- 0,00	0,00%				0,2731	0,2731	92,08	40,50	41,53	20,39	0,02%	-5,93
SANTANDER ATIVO RENDA FIXA FIC	6.025.325,97	0,99%				0,2660	0,6086	89,67	90,26	40,45	45,43	0,13%	-1,47
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	2.016.097,75	0,33%				0,2804	0,6562	94,54	97,32	42,64	48,98	0,01%	-10,39
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI (T.A)	4.407.752,68	0,73%				0,2804	0,6562	94,54	97,32	42,64	48,98	0,01%	-10,39
FIDC FECHADO MULTISETORIAL MASTER III	31.016,28	0,01%	Art. 7º VII a 5%	0,00%	2%	9,2977	-31,3258	3134,84	-4645,45	1413,92	-2338,24	90,89%	3,94
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	8.758.186,89	1,45%	Art. 8º I a 30%	0,00%	10%	-7,7759	-7,1526	-2621,74	-1060,69	-1182,50	-533,89	15,11%	-3,53
OCCAM FIC DE FI AÇÕES	4.745.081,87	0,78%	Art. 8º II a 20%	18,50%	20%	-9,5180	-8,6555	-3209,12	-1283,56	-1447,42	-646,07	17,43%	-3,74
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	9.368.496,47	1,55%		18,02%		-8,6986	-6,9471	-2932,86	-1030,22	-1322,82	-518,55	15,02%	-3,99
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIA	6.510.834,34	1,08%				-8,0899	-6,2367	-2727,63	-924,86	-1230,25	-465,52	17,26%	-3,18
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12.233.629,98	2,02%				-9,7925	-9,9629	-3301,67	-1477,45	-1489,17	-743,66	14,94%	-4,55
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	7.521.421,44	1,24%				-8,1944	-8,4288	-2762,86	-1249,95	-1246,15	-629,15	15,44%	-3,64
BRADESCO FI AÇÕES SELECTION	5.625.566,49	0,93%				-11,0575	-12,2041	-3728,18	-1809,80	-1681,54	-910,94	16,86%	-4,55
NAVI INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES	30.783.385,21	5,08%				-6,2791	-8,4330	-2117,09	-1250,57	-954,88	-629,46	15,26%	-2,79
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	32.349.424,30	5,34%				-7,0011	-6,4236	-2360,51	-952,58	-1064,67	-479,47	12,16%	-4
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	17.495.119,32	2,89%	Art. 8º III 10%	3,00%	10%	-7,5032	-7,1636	-2529,81	-1062,33	-1141,03	-534,71	14,68%	-3,51
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	2.141.939,55	0,35%	Art. 8º IVa 5%	1,50%	2%	-0,1272	-0,2805	-42,90	-41,60	-19,35	-20,94	0%	-5761,39
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I	6.260.577,19	1,03%		1,39%		22,3414	21,8129	7532,70	3234,74	3397,51	1628,17	-	-
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	5.430.006,00	0,90%	Art. 8º I b	3,00%	10%	-10,5024	-12,0798	-3541,00	-1791,37	-1597,12	-901,67	15,61%	-3,7
TOTAL	**605.583.841,32**	**100%**											