# Prefeitura de Jacareí
## Instituto de Previdência do Município de Jacareí

IPMJ

**CARTEIRA DE INVESTIMENTOS**

**Posição 31/03/2020**

| | | |
|---|---|---|
| **CDI ACUMULADO NO MÊS / ANO :** | **0,3551%** | **1,0175%** |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **DESEMPENHO DOS FUNDOS NO MÊS / ANO :** | **-13,2815%** | **-14,5065%** | **META MÊS** | **-1898,62%** | **META ANO** | **-708,11%** |

| | | |
|---|---|---|
| **META ATUARIAL ACUMULADA NO MÊS / ANO :** | **0,6995%** | **2,0486%** |

| 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 | 79.565.283,71 | 14,88% | **Art. 7º I b 100%** | **58,00%** | **75%** | -7,1021 | -6,4642 | -2083,63 | -635,31 | -1015,27 | -315,54 | 16,65% | -2,34 |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LONGO PRAZO | 21.814.587,23 | 4,08% | | | | -1,9720 | -1,0620 | -578,55 | -104,38 | -281,90 | -51,84 | 7,16% | -1,7 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B5 TP RF LONGO PRAZO | 8.236.300,19 | 1,54% | | | | -1,7971 | -0,6412 | -527,24 | -63,02 | -256,90 | -31,30 | 6,80% | -1,65 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B5+ TP RF LONGO PRAZO | 48.595.419,76 | 9,09% | | | | -10,9086 | -10,6834 | -3200,37 | -1049,98 | -1559,41 | -521,49 | 25,40% | -2,28 |
| FIC CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA | 10.214.229,46 | 1,91% | | **66,35%** | | -0,1307 | 1,3089 | -38,34 | 128,64 | -18,68 | 63,89 | 7,65% | -0,26 |
| SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA | 68.664.583,70 | 12,84% | | | | -6,9201 | -7,3705 | -2030,23 | -724,39 | -989,25 | -359,78 | 16,70% | -2,27 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI | 38.177.995,57 | 7,14% | | | | -1,7912 | -0,6028 | -525,51 | -59,24 | -256,06 | -29,42 | 6,78% | -1,65 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI | 64.160.018,67 | 12,00% | | | | -10,8865 | -10,5777 | -3193,90 | -1039,59 | -1556,25 | -516,33 | 25,25% | -2,3 |
| WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO | 15.409.557,74 | 2,88% | | | | -2,3466 | -0,4558 | -688,45 | -44,79 | -335,46 | -22,25 | 11,97% | -1,11 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI | 3.665.796,12 | 0,69% | **Art. 7º IV a 40%** | **15,00%** | **40%** | 0,5287 | 1,1311 | 155,11 | 111,17 | 75,58 | 55,22 | 0,36% | 2,84 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI (T.A) | 10.901.603,46 | 2,04% | | | | 0,5287 | 1,1311 | 155,11 | 111,17 | 75,58 | 55,22 | 0,36% | 2,84 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI | 44.897.314,50 | 8,39% | | | | -7,1163 | -6,4967 | -2087,79 | -638,51 | -1017,29 | -317,13 | 16,53% | -2,37 |
| BB PREVIDENCIARIO PERFIL RF LP REFERENCIADO DI | - | 0,00% | | **13,25%** | | -0,0331 | 0,2400 | -9,70 | 23,58 | -4,73 | 11,71 | 0,18% | -11,25 |
| SANTANDER ATIVO RENDA FIXA FIC | 5.446.185,95 | 1,02% | | | | 0,0921 | 0,7013 | 27,03 | 68,93 | 13,17 | 34,23 | 0,84% | -1,57 |
| SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | 1.795.193,92 | 0,34% | | | | -0,0727 | 0,5831 | -21,32 | 57,31 | -10,39 | 28,46 | 0,21% | -11,44 |
| SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI (T.A) | 4.182.349,38 | 0,78% | | | | -0,0727 | 0,5831 | -21,32 | 57,31 | -10,39 | 28,46 | 0,21% | -11,44 |
| FIDC FECHADO MULTISETORIAL MASTER III | 29.013,06 | 0,01% | **Art. 7º VII a 5%** | **0,00%** | **2%** | -6,4586 | -35,7612 | -1894,84 | -3514,66 | -923,28 | -1745,62 | - | - |
| ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI | 6.013.229,41 | 1,12% | **Art. 8º I a 30%** | **0,00%** | **10%** | -31,3416 | -36,2525 | -9195,02 | -3562,94 | -4480,36 | -1769,60 | 57,80% | -2,95 |
| OCCAM FIC DE FI AÇÕES | 3.463.182,13 | 0,65% | **Art. 8º II a 20%** | **18,50%** | **20%** | -27,0153 | -33,3325 | -7925,77 | -3275,97 | -3861,90 | -1627,07 | 52,79% | -2,72 |
| SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES | 5.746.960,80 | 1,07% | | | | -38,6565 | -42,9181 | -11341,07 | -4218,06 | -5526,04 | -2094,97 | 62,30% | -3,6 |
| BNP PARIBAS SMALL CAPS FIA | 3.945.336,44 | 0,74% | | | | -39,4035 | -43,1827 | -11560,23 | -4244,06 | -5632,82 | -2107,89 | 59,04% | -3,8 |
| ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI | 8.264.472,53 | 1,55% | | | | -32,4446 | -39,1751 | -9518,63 | -3850,19 | -4638,04 | -1912,26 | 55,05% | -3,31 |
| BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA | 5.232.709,72 | 0,98% | | **14,12%** | | -30,4292 | -36,2932 | -8927,35 | -3566,95 | -4349,93 | -1771,59 | 57,14% | -2,87 |
| BRADESCO FI AÇÕES SELECTION | 3.851.383,52 | 0,72% | | | | -31,5379 | -39,8930 | -9252,59 | -3920,74 | -4508,41 | -1947,31 | 57,04% | -3,03 |
| NAVI INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES | 22.206.917,39 | 4,15% | | | | -27,8607 | -33,9442 | -8173,79 | -3336,09 | -3982,75 | -1656,93 | 57,35% | -2,52 |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | 22.819.472,49 | 4,27% | | | | -29,4594 | -33,9907 | -8642,82 | -3340,65 | -4211,29 | -1659,19 | 49,38% | -3,34 |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 14.850.334,13 | 2,78% | **Art. 8º III 10%** | **3,00%** | **10%** | -15,1173 | -21,1980 | -4435,11 | -2083,37 | -2161,05 | -1034,74 | 41,01% | -1,8 |
| PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP | 2.138.608,92 | 0,40% | **Art. 8º IVa 5%** | **1,50%** | **2%** | -0,1555 | -0,4356 | -45,62 | -42,81 | -22,23 | -21,26 | 0% | -4710,74 |
| KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I | 6.634.706,38 | 1,24% | | **1,64%** | | -5,5244 | -5,5244 | -1555,61 | 0,00 | - | - | | |
| IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11 | 3.907.629,00 | 0,73% | **Art. 8º I b** | **3,00%** | **10%** | -28,0364 | -36,7294 | -8225,33 | -3661,53 | -4007,86 | -1821,63 | 57,94% | -2,75 |
| **TOTAL** | **534.830.375,28** | **100%** | | | | | | | | | | | |