Prefeitura de Jacareí
Instituto de Previdência do Município de Jacareí

IPMJ

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

Posição 30/04/2020

CDI ACUMULADO NO MÊS / ANO :	0,2849%	1,3053%

DESEMPENHO DOS FUNDOS NO MÊS / ANO :	2,5406%	-12,3345%	META MÊS	1043,58%	META ANO	-536,97%

META ATUARIAL ACUMULADA NO MÊS / ANO :	0,2434%	2,2971%

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	80.602.122,05	14,64%	Art. 7º I b 100%	58,00%	75%	1,3031	-5,2453	457,36	-401,85	535,28	-228,35	9,03%	0,76
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LONGO PRAZO	21.995.978,20	3,99%				0,8315	-0,2394	291,83	-18,34	341,56	-10,42	4,14%	0,83
FI CAIXA BRASIL IMA-B5 TP RF LONGO PRAZO	8.274.620,51	1,50%				0,4653	-0,1789	163,29	-13,71	191,11	-7,79	3,24%	0,36
FI CAIXA BRASIL IMA-B5+ TP RF LONGO PRAZO	49.540.728,22	9,00%				1,9453	-8,9460	682,73	-685,35	799,05	-389,45	14,33%	0,83
FIC CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	1.352.751,27	0,25%	63,64%			1,1113	2,4347	390,03	186,52	456,48	105,99	4,96%	1,04
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA	69.442.396,51	12,61%				1,1328	-6,3213	397,57	-484,27	465,30	-275,19	8,45%	0,68
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI	38.363.736,63	6,97%				0,4865	-0,1192	170,75	-9,13	199,84	-5,19	3,19%	0,41
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	65.391.235,73	11,87%				1,9190	-8,8617	673,50	-678,90	788,25	-385,78	14,30%	0,82
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO	15.547.749,22	2,82%				0,8968	0,4369	314,74	33,47	368,37	19,02	6,95%	0,59
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	3.671.048,43	0,67%	Art. 7º IV a 40%	15,00%	40%	0,1433	1,2760	50,29	97,76	58,85	55,55	2,58%	-0,30
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI (T.A)	10.917.223,13	1,98%				0,1433	1,2760	50,29	97,76	58,85	55,55	2,58%	-0,30
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	45.445.261,85	8,25%				1,2204	-5,3556	428,34	-410,29	501,32	-233,15	9,05%	0,71
BB PREVIDENCIARIO PERFIL RF LP REFERENCIADO DI	432.078,70	0,08%	14,70%			0,2323	0,2323	81,54	17,80	95,44	10,11	0,12%	-1,32
SANTANDER ATIVO RENDA FIXA FIC	5.470.401,27	0,99%				0,4446	1,1491	156,05	88,03	182,64	50,02	0,89%	1,08
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	11.064.609,08	2,01%				0,0619	0,6454	21,74	49,44	25,44	28,10	0,31%	-4,56
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI (T.A)	3.972.124,21	0,72%				0,0619	0,6454	21,74	49,44	25,44	28,10	0,31%	-4,56
FIDC FECHADO MULTISETORIAL MASTER III	28.390,99	0,01%	Art. 7º VII a 5%	0,00%	2%	-2,1441	-32,7982	-752,51	-2512,67	-880,72	-1427,84	9,03%	-1,53
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	6.709.224,18	1,22%	Art. 8º I a 30%	0,00%	10%	11,5744	-28,8741	4062,24	-2212,04	4754,37	-1257,00	22,66%	3,05
OCCAM FIC DE FI AÇÕES	3.816.983,93	0,69%	Art. 8º II a 20%	18,50%	20%	10,2161	-26,5217	3585,52	-2031,83	4196,42	-1154,59	21,38%	2,86
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	6.303.561,66	1,14%				9,6851	-37,3897	3399,17	-2864,43	3978,32	-1627,72	22,07%	2,66
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIA	4.475.758,92	0,81%				13,4443	-35,5440	4718,52	-2723,03	5522,46	-1547,37	25,08%	3,20
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	9.175.878,88	1,67%				11,0280	-32,4674	3870,48	-2487,33	4529,93	-1413,43	25,89%	2,62
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	5.828.820,41	1,06%	15,04%			11,3920	-29,0357	3998,23	-2224,43	4679,45	-1264,04	22,38%	3,04
BRADESCO FI AÇÕES SELECTION	4.114.937,39	0,75%				6,8431	-35,7798	2401,71	-2741,10	2810,91	-1557,64	21,82%	1,96
NAVI INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES	24.920.403,10	4,52%				12,2191	-25,8728	4288,51	-1982,12	5019,19	-1126,34	24,84%	2,97
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	24.206.158,30	4,40%				6,0768	-29,9794	2132,75	-2296,73	2496,13	-1305,12	22,28%	1,73
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	16.598.767,91	3,01%	Art. 8º III 10%	3,00%	10%	11,7737	-11,9200	4132,19	-913,20	4836,24	-518,93	20,05%	3,44
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	2.135.462,48	0,39%	Art. 8º IVa 5%	1,50%	2%	-0,1471	-0,5820	-51,64	-44,59	-60,43	-25,34	0,00%	-5953,94
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I	6.631.915,59	1,20%	1,59%			-0,0421	15,0350	-14,76	1151,83	-17,28	654,53		-
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	4.305.879,00	0,78%	Art. 8º I b	3,00%	10%	10,1916	-30,2811	3576,93	-2319,84	4186,36	-1318,26	22,79%	2,72
TOTAL	**550.736.207,75**	**100%**											