Prefeitura de Jacareí
Instituto de Previdência do Município de Jacareí

IPMJ

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

Posição 29/05/2020

CDI ACUMULADO NO MÊS / ANO :	0,2358%	1,5442%

DESEMPENHO DOS FUNDOS NO MÊS / ANO :	2,3331%	-10,2892%	META MÊS	1040,13%	META ANO	-407,25%

META ATUARIAL ACUMULADA NO MÊS / ANO :	0,2243%	2,5265%

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	81.811.656,86	14,48%	Art. 7º I b 100%	58,00%	75%	1,5006	-3,8234	636,38	-247,60	669,00	-151,33	3,66%	2,09
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LONGO PRAZO	22.205.897,17	3,93%				0,9544	0,7127	404,72	46,15	425,46	28,21	1,53%	2,81
FI CAIXA BRASIL IMA-B5 TP RF LONGO PRAZO	8.448.822,67	1,50%				2,1053	1,9226	892,79	124,50	938,55	76,10	1,25%	8,87
FI CAIXA BRASIL IMA-B5+ TP RF LONGO PRAZO	50.036.168,08	8,86%				1,0001	-8,0354	424,10	-520,36	445,84	-318,04	5,80%	0,84
FIC CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	1.371.402,00	0,24%	62,93%			1,3787	3,8470	584,68	249,13	614,65	152,27	1,72%	3,97
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA	70.447.330,10	12,47%				1,4471	-4,9656	613,70	-321,56	645,16	-196,54	3,51%	2,08
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI	39.172.412,20	6,93%				2,1079	1,9862	893,91	128,62	939,74	78,61	1,24%	8,92
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	66.043.581,28	11,69%				0,9976	-7,9525	423,06	-514,99	444,74	-314,76	5,79%	0,84
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO	15.998.221,28	2,83%				2,8973	3,3470	1228,69	216,74	1291,67	132,47	2,64%	5,98
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	3.690.889,40	0,65%	Art. 7º IV a 40%	15,00%	40%	0,5405	1,8234	229,20	118,08	240,95	72,17	0,70%	2,61
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI (T.A)	10.976.227,60	1,94%				0,5405	1,8234	229,20	118,08	240,95	72,17	0,70%	2,61
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	46.146.671,95	8,17%				1,5434	-3,8948	654,52	-252,22	688,07	-154,16	3,66%	2,16
BB PREVIDENCIARIO PERFIL RF LP REFERENCIADO DI	886.898,77	0,16%	14,64%			0,2558	0,4887	108,46	31,65	114,02	19,34	0,05%	2,55
SANTANDER ATIVO RENDA FIXA FIC	5.496.837,88	0,97%				0,4833	1,6379	204,94	106,07	215,45	64,83	0,45%	3,25
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	11.668.090,51	2,07%				0,2171	0,8639	92,06	55,94	96,78	34,19	0,08%	1,46
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI (T.A)	3.820.000,17	0,68%				0,2171	0,8639	92,06	55,94	96,78	34,19	0,08%	1,46
FIDC FECHADO MULTISETORIAL MASTER III	27.234,35	0,00%	Art. 7º VII a 5%	0,00%	2%	-4,0740	-35,5360	-1727,67	-2301,26	-1816,23	-1406,52	10,48%	-2,40
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	7.241.721,91	1,28%	Art. 8º I a 30%	0,00%	10%	7,9368	-23,2289	3365,79	-1504,27	3538,32	-919,40	15,19%	3,07
OCCAM FIC DE FI AÇÕES	4.133.368,84	0,73%	Art. 8º II a 20%	18,50%	20%	8,2889	-20,4312	3515,10	-1323,10	3695,28	-808,67	12,87%	3,73
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	6.964.724,32	1,23%				10,4887	-30,8227	4448,00	-1996,03	4676,00	-1219,96	16,48%	3,71
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIA	4.786.521,64	0,85%				6,9432	-31,0687	2944,45	-2011,97	3095,38	-1229,70	18,19%	2,31
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	9.667.631,08	1,71%				5,3592	-28,8482	2272,69	-1868,17	2389,19	-1141,81	16,91%	1,93
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	6.321.686,77	1,12%	15,69%			8,4557	-23,0352	3585,84	-1491,73	3769,65	-911,74	14,29%	3,45
BRADESCO FI AÇÕES SELECTION	4.438.334,15	0,79%				7,8591	-30,7327	3332,84	-1990,21	3503,68	-1216,40	11,45%	3,95
NAVI INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES	26.705.734,25	4,73%				7,1641	-20,5622	3038,13	-1331,58	3193,86	-813,86	15,79%	2,69
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	25.614.836,53	4,53%				5,8195	-25,9046	2467,90	-1677,54	2594,41	-1025,31	18,56%	1,93
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	17.490.390,85	3,10%	Art. 8º III 10%	3,00%	10%	5,3716	-7,1887	2277,97	-465,53	2394,74	-284,53	11,36%	2,75
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	2.132.273,49	0,38%	Art. 8º IVa 5%	1,50%	2%	-0,1493	-0,7232	-63,33	-46,83	-66,58	-28,62	0%	-961,84
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I	6.628.018,83	1,17%	1,55%			-0,0588	14,9674	-24,92	969,27	-26,19	592,41	-	-
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	4.598.460,00	0,81%	Art. 8º I b	3,00%	10%	6,7949	-25,5438	2881,55	-1654,18	3029,26	-1011,03	15,16%	3,30
TOTAL	**564.972.044,95**	**100%**											