Prefeitura de Jacareí
Instituto de Previdência do Município de Jacareí

IPMJ

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

Posição 30/06/2020

CDI ACUMULADO NO MÊS / ANO :	**0,2123%**	**1,7598%**
DESEMPENHO DOS FUNDOS NO MÊS / ANO :	**2,7235%**	**-7,8459%**
META ATUARIAL ACUMULADA NO MÊS / ANO :	**0,7882%**	**3,3347%**

META MÊS	**345,53%**	**META ANO**	**-235,28%**

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	83.468.502,72	14,36%	**Art. 7º I b 100%**	**58,00%**	**75%**	2,0252	-1,8757	953,81	-106,58	256,93	-56,25	2,99%	3,45
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LONGO PRAZO	22.404.049,70	3,85%				0,8923	1,6114	420,27	91,57	113,21	48,32	1,18%	3,28
FI CAIXA BRASIL IMA-B5 TP RF LONGO PRAZO	8.541.642,89	1,47%				1,0986	3,0423	517,42	172,88	139,38	91,23	0,91%	5,54
FI CAIXA BRASIL IMA-B5+ TP RF LONGO PRAZO	51.450.811,69	8,85%				2,8272	-5,4353	1331,55	-308,86	358,69	-163,00	4,98%	3,00
FIC CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	1.381.682,18	0,24%		**62,42%**		0,7496	4,6255	353,04	262,84	95,10	138,71	1,17%	2,61
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA	71.953.913,54	12,38%				2,1386	-2,9332	1007,21	-166,68	271,32	-87,96	2,74%	3,99
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI	39.593.818,40	6,81%				1,0758	3,0833	506,66	175,21	136,48	92,46	0,89%	5,49
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	67.892.833,35	11,68%				2,8000	-5,3751	1318,74	-305,44	355,24	-161,19	4,98%	2,97
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO	16.224.251,96	2,79%				1,4128	4,8071	665,41	273,16	179,25	144,16	1,70%	4,01
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	3.706.975,59	0,64%	**Art. 7º IV a 40%**	**15,00%**	**40%**	0,4358	2,2672	205,27	128,83	55,29	67,99	0,38%	3,32
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI (T.A)	11.024.065,89	1,90%				0,4358	2,2672	205,27	128,83	55,29	67,99	0,38%	3,32
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	47.084.076,65	8,10%				2,0314	-1,9426	956,71	-110,39	257,72	-58,25	2,99%	3,46
BB PREVIDENCIARIO PERFIL RF LP REFERENCIADO DI	-	0,00%		**14,52%**		0,2600	0,7500	122,46	42,62	32,99	22,49	0,03%	8,34
SANTANDER ATIVO RENDA FIXA FIC	11.868.958,05	2,04%				0,3370	1,9804	158,71	112,54	42,75	59,39	0,31%	2,33
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	7.080.404,26	1,22%				0,0391	0,9032	18,39	51,33	4,96	27,09	0,29%	-3,35
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI (T.A)	3.652.515,15	0,63%				0,0391	0,9032	18,39	51,33	4,96	27,09	0,29%	-3,35
FIDC FECHADO MULTISETORIAL MASTER III	25.759,28	0,00%	**Art. 7º VII a 5%**	**0,00%**	**2%**	-5,4162	-39,0275	-2550,89	-2217,72	-687,15	-1170,36	3,91%	-8,38
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	7.865.845,09	1,35%	**Art. 8º I a 30%**	**0,00%**	**10%**	8,6184	-16,6125	4059,02	-944,00	1093,41	-498,18	11,52%	4,11
OCCAM FIC DE FI AÇÕES	4.504.164,36	0,77%	**Art. 8º II a 20%**	**18,50%**	**20%**	8,9708	-13,2933	4224,97	-755,38	1138,11	-398,64	11,12%	4,41
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7.517.735,78	1,29%				7,9402	-25,3299	3739,59	-1439,36	1007,36	-759,60	13,71%	3,23
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIA	5.415.769,78	0,93%				13,1463	-22,0068	6191,49	-1250,53	1667,85	-659,94	15,81%	4,55
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	10.564.791,42	1,82%				9,2800	-22,2452	4370,62	-1264,08	1177,35	-667,09	13,00%	3,93
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	6.873.906,29	1,18%		**16,56%**		8,7353	-16,3121	4114,07	-926,93	1108,24	-489,17	11,75%	4,08
BRADESCO FI AÇÕES SELECTION	4.835.707,80	0,83%				8,9532	-24,5311	4216,70	-1393,97	1135,88	-735,64	12,00%	4,10
NAVI INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES	28.923.005,90	4,97%				8,3026	-13,9668	3910,28	-793,66	1053,34	-418,84	12,56%	3,65
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	27.636.286,39	4,75%				7,8917	-20,0572	3716,76	-1139,74	1001,21	-601,48	11,50%	3,78
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	17.638.523,44	3,03%	**Art. 8º III 10%**	**3,00%**	**10%**	0,8469	-6,4027	398,88	-363,83	107,45	-192,00	12,81%	0,41
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	9.637,88	0,00%	**Art. 8º IVa 5%**	**1,50%**	**2%**	-99,5480	-99,5513	-46884,12	-5656,95	-12629,54	-2985,36	163,73%	-3,48
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I	7.182.849,23	1,24%		**1,24%**		8,3710	24,5913	3942,48	1397,39	1062,02	737,45	-	-
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	5.094.945,00	0,88%	**Art. 8º I b**	**3,00%**	**10%**	10,7968	-17,5049	5084,95	-994,71	1369,77	-524,94	12,59%	3,83
TOTAL	**581.417.429,67**	**100%**											