Prefeitura de Jacareí
Instituto de Previdência do Município de Jacareí

IPMJ

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

Posição 31/07/2020

CDI ACUMULADO NO MÊS / ANO :	**0,1943%**	**1,9576%**
DESEMPENHO DOS FUNDOS NO MÊS / ANO :	**4,7818%**	**-5,7636%**
META ATUARIAL ACUMULADA NO MÊS / ANO :	**0,9733%**	**4,3405%**

META MÊS 491,27% **META ANO** -132,79%

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	87.120.260,40	14,27%	**Art. 7º I b 100%**	**58,00%**	**75%**	4,3750	2,4173	2251,23	123,48	449,48	55,69	2,27%	9,39
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LONGO PRAZO	22.774.184,71	3,73%				1,6521	3,2901	850,11	168,81	169,73	76,57	0,93%	8,09
FI CAIXA BRASIL IMA-B5 TP RF LONGO PRAZO	8.624.803,50	1,41%				0,9736	4,0455	500,98	206,66	100,03	93,20	0,83%	4,88
FI CAIXA BRASIL IMA-B5+ TP RF LONGO PRAZO	55.202.499,56	9,04%				7,2918	1,4601	3752,10	74,59	749,15	33,64	3,79%	9,44
FIC CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	1.395.185,38	0,23%		**62,15%**		0,9773	5,6480	502,88	288,52	100,41	130,12	0,92%	4,43
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA	75.003.795,20	12,29%				4,2387	1,1811	2181,06	60,34	435,47	27,21	2,15%	9,62
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI	39.976.779,52	6,55%				0,9672	4,0804	497,70	208,44	99,37	94,01	0,81%	4,92
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	72.834.099,31	11,93%				7,2780	1,5117	3745,02	77,22	747,73	34,83	3,80%	9,42
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO	16.515.544,66	2,71%				1,7954	6,6888	923,86	341,69	184,46	154,10	1,41%	5,88
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	3.727.419,30	0,61%	**Art. 7º IV a 40%**	**15,00%**	**40%**	0,5515	2,8312	283,78	144,63	56,66	65,23	0,26%	7,16
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI (T.A)	11.084.862,83	1,82%				0,5515	2,8312	283,78	144,63	56,66	65,23	0,26%	7,16
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	49.149.113,55	8,05%				4,3858	2,3581	2256,80	120,46	450,60	54,33	2,27%	9,42
BB PREVIDENCIARIO PERFIL RF LP REFERENCIADO DI	-	0,00%		**14,37%**		0,2360	0,9878	121,46	50,46	24,25	22,76	0,03%	8,57
SANTANDER ATIVO RENDA FIXA FIC	12.386.018,42	2,03%				0,5346	2,5256	275,09	129,02	54,92	-	0,33%	5,28
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	7.881.066,98	1,29%				0,2398	1,1710	123,41	59,82	24,64	26,98	0,04%	8,6
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI (T.A)	3.485.813,44	0,57%				0,2654	1,1710	136,56	59,82	27,26	26,98	0,04%	8,6
FIDC FECHADO MULTISETORIAL MASTER III	22.249,30	0,00%	**Art. 7º VII a 5%**	**0,00%**	**2%**	-13,6261	-47,3357	-7011,49	-2418,09	-1399,92	-1090,57	11,02%	-6,87
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	8.531.539,14	1,40%	**Art. 8º I a 30%**	**0,00%**	**10%**	8,4631	-9,5553	4354,81	-488,12	869,49	-220,15	9,25%	4,56
OCCAM FIC DE FI AÇÕES	4.950.098,85	0,81%	**Art. 8º II a 20%**	**18,50%**	**20%**	9,9005	-4,7089	5094,44	-240,55	1017,16	-108,49	10,86%	4,55
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	8.322.790,53	1,36%				10,7087	-17,3336	5510,34	-885,47	1100,20	-399,35	9,96%	5,33
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIA	5.906.554,63	0,97%				9,0621	-14,9390	4663,06	-763,14	931,03	-344,18	9,68%	4,66
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	11.361.110,51	1,86%				7,5375	-16,3845	3878,52	-836,98	774,39	-377,48	8,75%	4,3
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	7.453.680,44	1,22%		**16,97%**		8,4344	-9,2535	4340,05	-472,71	866,54	-213,19	9,72%	4,33
BRADESCO FI AÇÕES SELECTION	5.321.459,57	0,87%				10,0451	-16,9501	5168,85	-865,88	1032,02	-390,52	10,30%	4,85
NAVI INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES	31.461.458,43	5,15%				8,7766	-6,4161	4516,12	-327,76	901,69	-147,82	11%	4
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	28.841.684,60	4,72%				4,3617	-16,5703	2244,35	-846,48	448,11	-381,77	8,12%	2,69
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	18.632.093,09	3,05%	**Art. 8º III 10%**	**3,00%**	**10%**	5,6330	-1,1304	2898,52	-57,74	578,72	-26,04	6,44%	4,34
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	9.552,16	0,00%	**Art. 8º IVa 5%**	**1,50%**	**2%**	-0,8894	-99,5553	-457,64	-5085,67	-91,37	-2293,66	2,53%	-5,53
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I	6.995.841,92	1,15%		**1,15%**		-2,6035	5,4875	-1339,68	280,32	-267,48	126,43	-	-
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	5.528.241,00	0,91%	**Art. 8º I b**	**3,00%**	**10%**	8,5044	-10,4892	4376,08	-535,83	873,73	-241,66	10,27%	4,03
TOTAL	**610.499.800,94**	**100%**											