Prefeitura de Jacareí
Instituto de Previdência do Município de Jacareí

IPMJ

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

Posição 31/08/2020

CDI ACUMULADO NO MÊS / ANO :	**0,1599%**	**2,1206%**
DESEMPENHO DOS FUNDOS NO MÊS / ANO :	**-1,8447%**	**-7,5020%**
META ATUARIAL ACUMULADA NO MÊS / ANO :	**0,7744%**	**5,1485%**

META MÊS	**-238,20%**	**META ANO**	**-145,71%**

BANCO / FUNDO	R$	% PATRIMÔNIO	LIMITE Resolução 3922 de 25/11/10	Política 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	85.525.620,46	14,24%	**Art. 7º I b 100%**	**58,00%**	**75%**	-1,8304	0,5426	-1144,76	25,59	-236,35	10,54	2,94%	-3,86
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LONGO PRAZO	2.576.850,13	0,43%				-0,7234	2,5429	-452,42	119,92	-93,41	49,39	1,31%	-3,85
FI CAIXA BRASIL IMA-B5 TP RF LONGO PRAZO	8.658.595,54	1,44%				0,3918	4,4532	245,04	210,00	50,59	86,49	0,96%	1,39
FI CAIXA BRASIL IMA-B5+ TP RF LONGO PRAZO	53.191.295,93	8,86%				-3,6433	-2,2364	-2278,60	-105,46	-470,45	-43,44	4,80%	-4,55
FIC CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	21.441.716,49	3,57%	**61,92%**			-0,5572	5,0594	-348,46	238,58	-71,94	98,27	1,39%	-2,93
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA	73.653.258,00	12,27%				-1,8006	-0,6407	-1126,15	-30,22	-232,51	-12,45	2,74%	-4,08
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI	40.123.388,09	6,68%				0,3667	4,4621	229,36	210,42	47,35	86,67	0,99%	1,2
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	70.147.843,07	11,68%				-3,6882	-2,2322	-2306,66	-105,26	-476,24	-43,36	4,76%	-4,64
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO	16.466.414,27	2,74%				-0,2975	6,3714	-186,05	300,46	-38,41	123,75	1,91%	-1,34
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	3.722.770,56	0,62%	**Art. 7º IV a 40%**	**15,00%**	**40%**	-0,1247	2,7029	-78,00	127,46	-16,10	52,50	0,38%	-4,3
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI (T.A)	11.071.038,08	1,84%				-0,1247	2,7029	-78,00	127,46	-16,10	52,50	0,38%	-4,3
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	48.267.621,34	8,04%				-1,7935	0,5223	-1121,69	24,63	-231,59	10,14	2,93%	-3,79
SANTANDER ATIVO RENDA FIXA FIC	13.777.558,30	2,29%	**14,75%**			-0,3527	2,1640	-220,59	102,05	-45,54	42,03	0,48%	-6,09
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	8.533.532,70	1,42%				0,2459	1,4198	153,78	66,95	31,75	27,58	0,06%	7,92
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI (T.A)	3.219.102,76	0,54%				0,2459	1,4198	153,78	66,95	31,75	27,58	0,06%	7,92
FIDC FECHADO MULTISETORIAL MASTER III	47.192,01	0,01%	**Art. 7º VII a 5%**	**0,00%**	**2%**	112,1056	11,7040	70112,99	551,92	14475,71	227,33	254,67%	3,04
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	8.274.442,45	1,38%	**Art. 8º I a 30%**	**0,00%**	**10%**	-3,0135	-12,2809	-1884,69	-579,13	-389,12	-238,53	10,02%	-1,73
OCCAM FIC DE FI AÇÕES	4.839.268,84	0,81%	**Art. 8º II a 20%**	**18,50%**	**20%**	-2,2389	-6,8424	-1400,28	-322,66	-289,11	-132,90	10,25%	-1,24
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	8.153.939,79	1,36%				-2,0288	-19,0107	-1268,84	-896,49	-261,97	-369,25	10,55%	-1,09
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIA	5.791.542,11	0,96%				-1,9472	-16,5953	-1217,82	-782,58	-251,43	-322,33	10,54%	-1,04
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	11.338.832,63	1,89%				-0,1961	-16,5485	-122,64	-780,37	-25,32	-321,42	10,78%	-0,08
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	7.234.319,29	1,20%	**16,77%**			-2,9430	-11,9242	-1840,60	-562,31	-380,02	-231,60	9,94%	-1,7
BRADESCO FI AÇÕES SELECTION	5.260.532,95	0,88%				-1,1449	-17,9010	-716,06	-844,15	-147,84	-347,69	10,39%	-0,62
NAVI INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES	30.555.990,68	5,09%				-2,8780	-9,1094	-1799,97	-429,57	-371,63	-176,93	10,55%	-1,56
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	27.545.411,74	4,59%				-4,4944	-20,3200	-2810,91	-958,23	-580,35	-394,68	10,70%	-2,42
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	19.921.226,39	3,32%	**Art. 8º III 10%**	**3,00%**	**10%**	6,9189	5,7103	4327,20	269,28	893,41	110,91	3,59%	10,42
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	9.490,02	0,00%	**Art. 8º IVa 5%**	**1,50%**	**2%**	-0,6505	-99,5582	-406,87	-4694,84	-84,00	-1933,73	2,73%	1,74
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I	5.721.148,85	0,95%	**0,95%**			-18,2207	-13,7331	-11395,59	-647,61	-2352,76	-266,74	-	-
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	5.348.763,00	0,89%	**Art. 8º I b**	**3,00%**	**10%**	-3,2466	-13,3952	-2030,46	-631,68	-419,22	-260,18	10,17%	-1,95
TOTAL	**600.418.706,48**	**100%**											