Prefeitura de Jacareí
Instituto de Previdência do Município de Jacareí

IPMJ

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

Posição 30/09/2020

CDI ACUMULADO NO MÊS / ANO :	**0,1570%**	**2,2809%**
DESEMPENHO DOS FUNDOS NO MÊS / ANO :	**-2,4627%**	**-9,7799%**
META ATUARIAL ACUMULADA NO MÊS / ANO :	**1,4802%**	**6,7049%**

META MÊS	**-166,38%**	
META ANO	**-145,86%**	

BANCO / FUNDO	R$	% PATRIMÔNIO	LIMITE Resolução 3922 de 25/11/10	Politica Investimentos 2020 ALVO	Politica Investimentos 2020 MAXIMO	Rendimento do fundo no mês	Rendimento do fundo no ano	BENCHMARK FUNDO X CDI		BENCHMARK FUNDO X META		VaR	Indice de Sharpe	LIMITE DEFIFINIDO NA POLITICA CARTEIRA	
						% Mês	% Ano	% Mês	% Ano	% Mês	% Ano	Mês	Ano		
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LONGO PRAZO	84.214.240,87	14,46%	**Art. 7º I b 100%**	**58,00%**	**75%**	-1,5333	-0,9990	-976,82	-43,80	-103,59	-14,90	1,10%	0,47	**10%**	
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LONGO PRAZO	2.561.180,10	0,44%				-0,6081	1,9194	-387,40	84,15	-41,08	28,63	2,25%	-0,21		
FI CAIXA BRASIL IMA-B5 TP RF LONGO PRAZO	8.644.803,21	1,48%				-0,1593	4,2868	-101,48	187,94	-10,76	63,93	3,31%	-0,30		
FI CAIXA BRASIL IMA-B5+ TP RF LONGO PRAZO	51.785.448,92	8,89%				-2,6430	-4,8203	-1683,75	-211,33	-178,56	-71,89	1,18%	0,39		
FIC CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	21.333.830,62	3,66%		**62,85%**		-0,5032	4,5307	-320,54	198,64	-33,99	67,57	11,66%	-0,32	**5,04%**	
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA	72.722.627,25	12,49%				-1,2635	-1,8962	-804,94	-83,13	-85,36	-28,28	8,82%			
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI	40.061.741,04	6,88%				-0,1536	4,3016	-97,88	188,59	-10,38	64,16	1,12%	0,47		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	68.291.326,48	11,73%				-2,6466	-4,8197	-1686,03	-211,31	-178,80	-71,88	3,30%	-0,30		
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO	16.332.665,03	2,80%				-0,8123	5,5074	-517,46	241,46	-54,87	82,14	12,60%	-0,58		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	3.714.236,11	0,64%	**Art. 7º IV a 40%**	**15,00%**	**40%**	-0,2292	2,4675	-146,05	108,18	-15,49	36,80	10,90%	-0,30	**10%**	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI (T.A)	11.045.657,73	1,90%				-0,2292	2,4675	-146,05	108,18	-15,49	36,80	10,90%	-0,30		
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	47.511.350,51	8,16%				-1,5668	-1,0527	-998,16	-46,15	-105,85	-15,70	2,23%	-0,22		
SANTANDER ATIVO RENDA FIXA FIC	14.196.920,36	2,44%		**14,41%**		-0,2251	1,9340	-143,41	84,79	-15,21	28,84	5,81%	-1,21	**5,14%**	
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	4.455.736,95	0,77%				0,0445	1,4649	28,36	64,23	3,01	21,85	0,50%	-0,55		
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI (T.A)	2.964.596,86	0,51%				0,0445	1,4649	28,36	64,23	3,01	21,85	0,50%	-0,55		
FIDC FECHADO MULTISETORIAL MASTER III	65.177,32	0,01%	**Art. 7º VII a 5%**	**0,00%**	**2%**	38,1109	21,1497	24278,96	927,26	2574,70	315,44	-	-	-	-
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	7.921.591,07	1,36%	**Art. 8º I a 30%**	**0,00%**	**10%**	-4,2644	-16,0215	-2716,65	-702,42	-288,09	-238,95	10,68%	-0,41	**25%**	**10,68%**
OCCAM FIC DE FI AÇÕES	4.562.406,13	0,78%	**Art. 8º II a 20%**	**18,50%**	**20%**	-5,7212	-12,1721	-3644,73	-533,66	-386,51	-181,54	10,92%	-0,32	**25%**	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7.506.514,98	1,29%				-7,9400	-25,4413	-5058,27	-1115,41	-536,41	-379,44	0,35%	-2,32		
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIA	5.531.427,71	0,95%				-4,4913	-20,3412	-2861,22	-891,81	-303,42	-303,38	0,26%	-2,18		
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	10.776.287,47	1,85%				-4,9612	-20,6887	-3160,60	-907,05	-335,17	-308,56	10,26%	-0,71		
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	6.924.293,89	1,19%		**16,29%**		-4,2855	-15,6987	-2730,11	-688,27	-289,52	-234,14	11,35%	-0,40	**27,60%**	
BRADESCO FI AÇÕES SELECTION	5.116.547,97	0,88%				-2,7371	-20,1481	-1743,68	-883,35	-184,91	-300,50	11,58%	-0,27		
NAVI INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES	28.380.001,96	4,87%				-7,1213	-15,5820	-4536,71	-683,16	-481,10	-232,40	174,99%			
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	26.054.260,78	4,47%				-5,4134	-24,6335	-3448,68	-1080,00	-365,72	-367,39	1,12%	-0,07		
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	18.949.937,14	3,25%	**Art. 8º III 10%**	**3,00%**	**10%**	-4,8756	0,5562	-3106,08	24,39	-329,39	8,30	2,15%	-0,28	**25%**	**2,15%**
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	9.462,90	0,00%	**Art. 8º IVa 5%**	**1,50%**	**2%**	-0,2857	-99,5594	-182,01	-4364,95	-19,30	-1484,87	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I	5.605.161,27	0,96%		**0,96%**		-2,0273	-15,4820	-1291,54	-678,77	-136,96	-230,91	-	-	-	-
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	5.054.589,00	0,87%	**Art. 8º I b**	**3,00%**	**10%**	-5,4999	-18,1584	-3503,74	-796,11	-371,56	-270,82	0,34%	0,08	**25%**	**0,34%**
TOTAL	**582.294.021,64**	**100%**													