



RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Janeiro 2022

SUMÁRIO

1. PARECER DO COMITÊ DE ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS FINANCEIROS (CAIF).....	3
2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS	4
3. Apresentação	5
4. Cenário Econômico	5
5. Desempenho e Movimentações.....	5
6. Carteira de Janeiro.....	7
7. Conformidade com a Política de Investimentos.....	10
7.1. Demonstrações Gráficas.....	10
8. Fundos Estressados e Estruturados	12
8.1. Fundos Estressados	12
8.2. Fundos Estruturados (FIP)	13
9. Alocação por Instituição.....	14
10. Risco (VaR) dos Fundos na Carteira.....	15
11. Demonstração dos fundos por segmento.....	16
11.1. Renda Fixa.....	16
11.2. Renda Variável.....	17
11.3. Exterior.....	18
12. Agenda Realizada.....	19

1. PARECER DO COMITÊ DE ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS FINANCEIROS (CAIF)

Em 02 de Julho de 2019 o IPMJ formalizou sua adesão ao Programa de Certificação Institucional e Modernização da Gestão dos Regimes Próprios de Previdência Social da União, dos Estados, do Distrito Federal e dos Municípios - "Pró Gestão RPPS". Em atendimento ao Manual do Pró Gestão RPPS, apresenta-se o presente relatório, referente ao mês de janeiro de 2022, que é elaborado mensalmente pela Unidade de Gestão de Investimentos.

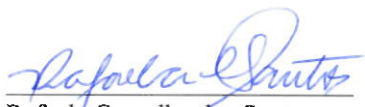
O relatório foi apresentado ao Comitê e contém seus respectivos valores registrados pela Contabilidade. Foram analisadas a legalidade e a conformidade com a Política de Investimentos. O relatório reflete que as movimentações financeiras atenderam aos requisitos legais e às previsões da Política de Investimentos e que atende às necessidades da gestão dos investimentos.



Renata de Souza Santos Esteves
Diretora do Dep. Administrativo-Financeiro - CPA-10



Vanderlei Massarioli
Assessor da Presidência - CPA-10



Rafaela Carvalho dos Santos
Membro do CAIF

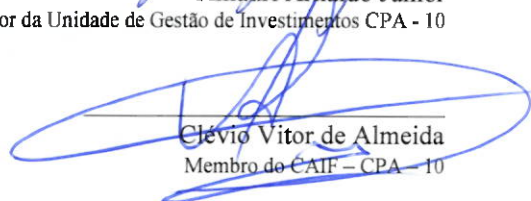


José Ricardo Vinhas

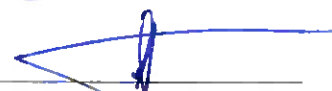
Membro do CAIF



Amauri Arnaldo Junior
Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos CPA - 10



Clévio Vitor de Almeida
Membro do CAIF - CPA - 10

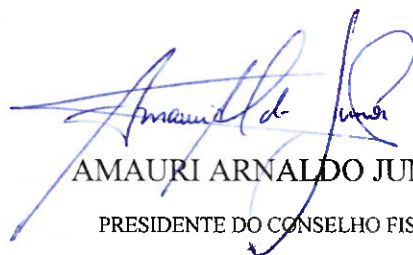


Victor Adriano Vieira Silva
Membro do CAIF

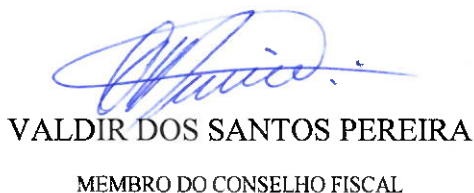
2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Aos 24 dias de fevereiro de 2022 nas dependências do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, situado na Rua Antônio Afonso, nº 513 — Centro, Jacareí – SP — CEP: 12327-270, o Conselho Fiscal — biênio 2021/2023 reuniu-se, para análise do relatório de investimentos referente ao mês de janeiro de 2022, considerando as explicações dos investimentos, rentabilidade e pormenores constantes no presente documento, pela Diretoria Administrativo - Financeiro deste Instituto, APROVAMOS o relatório de investimentos referente ao mês de janeiro de 2022.

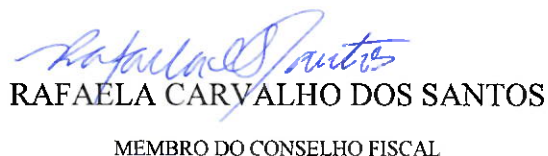
Jacareí, 24 de fevereiro de 2022.



AMAURI ARNALDO JUNIOR
PRESIDENTE DO CONSELHO FISCAL



VALDIR DOS SANTOS PEREIRA
MEMBRO DO CONSELHO FISCAL



RAFAELA CARVALHO DOS SANTOS
MEMBRO DO CONSELHO FISCAL

3. APRESENTAÇÃO

Este documento apresenta o relatório mensal de investimentos do Instituto de Previdência do Município de Jacareí – IPMJ para mês de Janeiro de 2022.

4. CENÁRIO ECONÔMICO

Em janeiro, a Bolsa de Valores Brasileira, IBOVESPA, fechou o mês com alta de 6,98%, terminando sua última sessão aos 112.143 pontos, em alta de 0,21%, sendo melhor performance quando comparado ao mesmo mês de 2020, totalizando assim o segundo mês consecutivo de alta. O Ibovespa começou o ano descontado segundo analistas, e juntamente com o real desvalorizado culminou com a entrada expressiva de capital estrangeiro, levando em consideração também a pressão negativa do dólar e o aumento da inflação norte americana, tudo isso contribuiu para essa elevação para entrada de capital estrangeiro, ajudando a terminar o mês positivo. Já no cenário externo, a expectativa estava nos movimentos do FED para controlar a inflação no país americano, após reuniões do comitê deste, foi resolvido não aumentar a taxa de juros e começar a tirar os estímulos econômicos que estavam, sendo injetados.

No ambiente interno, destaca-se a reunião do COPOM para definir a taxa básica de Juros a Selic, chegando assim a um consenso de elevar em 1,50 pontos percentuais com a taxa agora totalizando 10,75% a.a. Segundo o pesquisador do Ibre/FGV Paulo Picchetti, os barômetros globais sinalizam que está começando uma nova fase de adaptação, com efeitos das novas ondas de covid-19, as políticas monetárias mais restritivas e as expectativas dos níveis das atividades econômicas, começa a se iniciar uma nova fase de adaptação.

A maioria dos índices de renda fixa encerraram o mês de janeiro negativos: IRF-M -0,08%, IMA-B -0,73%, IMA-B5+ -1,61% e IMA-B5 positivo em 0,11%, e na renda variável os índices ficaram positivos: IBOV 6,98%, o Índice Small Cap. 3,42%, IBRX 50 7,66%.

5. DESEMPENHO E MOVIMENTAÇÕES

O patrimônio do IPMJ no fechamento do mês de janeiro de 2022 foi de R\$ 629.511.503,52 (Seiscentos e vinte e nove milhões, quinhentos e onze mil, quinhentos e três reais e cinquenta e dois centavos).

A carteira de renda fixa rendeu R\$ 2.086.069,15 (dois milhões, oitenta e seis mil, sessenta e nove reais e quinze centavos). Com a carteira de renda variável a rentabilidade foi de R\$ 4.289.766,04 (quatro milhões, duzentos e oitenta e nove mil, setecentos e sessenta e seis reais e quatro centavos). A carteira do exterior rendeu R\$ -8.637.265,04 (oito milhões, seiscentos e trinta e sete mil, duzentos e sessenta e cinco reais e quatro centavos negativos).

Tabela 1 Rendimento Mensal Acumulado

Acumulado 2021	Renda Fixa	Renda Variável	Exterior	Total
Jan	R\$ 2.086.069,15	R\$ 4.289.766,04	-R\$ 8.637.265,04	-R\$ 2.261.429,85
Total Ano	R\$ 2.086.069,15	R\$ 4.289.766,04	-R\$ 8.637.265,04	-R\$ 2.261.429,85

Assim, a rentabilidade da carteira no mês de janeiro de 2022 foi de R\$ -2.261.429,85 (dois milhões, duzentos e sessenta e um mil, quatrocentos e vinte e nove reais e oitenta e cinco centavos). O rendimento acumulado no ano apresentou o mesmo valor devido a ser o primeiro mês vigente do ano. Por fim, a rentabilidade da carteira no mês e no ano foi de 0,40%, atingindo -38,21% da meta atuarial mensal e anual.

Tabela 2 Investimento - Saldo mensal

Acumulado 2021	Renda Fixa	Renda Variável	Exterior	Total
Jan	R\$ 386.794.806,56	R\$ 185.453.128,63	R\$ 57.263.568,34	R\$ 629.511.503,52

Tabela 3 Relatório Mensal de Investimentos – Janeiro

Tipo de Aplicação	Renda Fixa	Renda Variável	Exterior	Total
Saldo mês anterior	R\$ 380.882.235,48	R\$ 181.163.362,66	R\$ 65.900.833,38	R\$ 627.946.431,52
Aplicações no mês	R\$ 21.227.002,02	R\$ -	R\$ -	R\$ 21.227.002,02
Resgates no mês	-R\$ 17.400.500,00	R\$ -	R\$ -	-R\$ 17.400.500,00
Rendimento no mês	R\$ 2.086.069,15	R\$ 4.289.766,04	-R\$ 8.637.265,04	-R\$ 2.261.429,85
Saldo final do mês	R\$ 386.794.806,56	R\$ 185.453.128,63	R\$ 57.263.568,34	R\$ 629.511.503,52
Rendimento no mês %	0,54%	2,31%	-15,08%	-0,40%

Ressalta-se ainda que, no mês de janeiro, foram realizadas as seguintes compras de títulos públicos:

- 17 de Janeiro de 2022:

NTN-B 2022, PU 3.888,26955600, taxa indicativa de IPCA + 5,85, quantidade 1.285, de valor total R\$ 4.996.426,38;

NTN-B 2023, PU 3.834,90086100, taxa indicativa de IPCA + 5,93, quantidade 1.303, de valor total R\$ 4.996.875,82;

6. CARTEIRA DE JANEIRO

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS												
Posição: 31/01/2022												
COI ACUMULADO												
DESEMPENHO DA CARTEIRA:												
META ATUARIAL (IPCA + 5,50%):												
RENTABILIDADE DA CARTEIRA x META ATUARIAL:												
PATRIMÔNIO LÍQUIDO:												
R\$ 629.511.693,62												
BANCO / FUNDO	Patrimônio (PMJ (R\$))	% PATRIMÔNIO	LIMITE de Rescisão 4963/2021	Política de Investimentos 2022		Rentabilidade (R\$) dos fundos		Rentabilidade (%) dos fundos		Fundo x Meta		
				ALVO	MAXIMO	Mês (R\$)	Ano (R\$)	Mês (%)	Ano (%)	Mês (%)	Ano (%)	
TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN (Selic)	158.259.663,80	25,14%	Art. 7º I a 100%	44,50%	70,00%	1.669.736,90	1.669.736,90	1,08	1,08	103,768	103,768	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	106.667.291,57	16,94%	Art. 7º I b 100%	6,50%	70%	96.316,51	96.316,51	0,09	0,09	8,696	8,696	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI	61.164.949,21	9,72%		26,86%		46.946,48	46.946,48	0,08	0,08	7,39	7,39	
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA (T.A)	13.917.387,82	2,21%	Art. 7º III a 60%	8,00%	30%	72.321,72	72.321,72	0,52	0,52	50,260	50,260	
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	8.859.005,40	1,41%				-65.063,18	-65.063,18	-0,73	-0,73	-70,149	-70,149	
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	16.101.275,47	2,56%		7,22%		141.486,45	141.486,45	0,80	0,80	76,61	76,61	
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI (T.A)	1.378.936,94	0,22%				12.693,26	12.693,26	0,80	0,80	76,61	76,61	
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	5.220.671,25	0,83%				-9.068,00	-9.068,00	-0,17	-0,17	-16,68	-16,68	
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	31.351,85	0,005%	Art. 7º V a 5%	0,50%	7,0%	635,99	635,99	2,07	2,07	199,2	199,2	
PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	15.194.275,33	2,414%	Art. 7º V b 5%	5,00%	5,0%	120.063,02	120.063,02	0,80	0,80	76,6	76,6	
TOTAL RENDA FIXA	386.794.806,56	61,44%				2.096.069,15	2.096.069,15					

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS												
Posição: 31/01/2022												
COACUMULADO												
DESEMPENHO DA CARTEIRA:												
META ATUARIAL (IPCA + 3.50%):												
RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL:												
PATRIMÔNIO LÍQUIDO:												
BANCO / FUNDO	Patrimônio (PMJ (R\$))	% PATRIMÔNIO	LIMITE da Resolução 4863/2021	Política de Investimentos 2022		Rentabilidade (R\$) dos fundos	Rentabilidade (%) dos fundos	Fundo x Meta	MÊS		ANO	
				ALVO	MAXIMO							
	28.755.628,41	4,73%	Art. 8º I - 30%	10,00%	30%	1.821.776,32	6,52	627,50	1.821,776,32	0,80%	0,80%	
OCCAM FIC AÇÕES	4.040.219,32	0,64%				153.738,40	3,96	390,61	153.738,40	-0,40%	-0,40%	
INDIE FIC AÇÕES	5.391.357,56	0,86%				256.906,57	5,00	481,43	256.906,57	1,04%	1,04%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.227.670,28	1,31%				435.131,13	5,58	537,27	435.131,13	-38,21	-38,21	
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	11.984.167,06	1,90%				158.680,11	1,34	129,11	158.680,11	629.511,503,52		
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	5.240.583,72	0,83%			10,03%	341.154,13	6,56	669,97	341.154,13			
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	36.283.646,36	5,60%				2.161.473,99	6,53	627,89	2.161.473,99			
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.538.552,87	0,40%				225.410,68	9,74	937,61	225.410,68			
META VALOR FI AÇÕES	5.956.018,56	0,95%				78.921,61	1,34	129,21	78.921,61			
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	5.084.132,97	0,81%				199.373,43	4,08	392,71	199.373,43			
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES			Art. 8º II	0,50%	10%							
IT NOW IBOVSPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	12.073.252,42	1,92%				804.384,32	7,14	696,81	804.384,32			
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	43.587.516,46	6,92%	Art. 10º I	9,00%	10%	-2.394.361,84	-5,21	-501,02	-2.394.361,84			
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	6.305.184,19	1,00%				-346.184,75	-5,20	-500,78	-346.184,75			
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICIP	27.190,78	0,004%	Art. 10º II	2,00%	5,0%	41,69	0,2	14,84	41,69			
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTISTRATÉGIA FIP	9.958.007,66	1,582%				393.320,06	4,1	395,66	393.320,06			
TOTAL RENDA VARIÁVEL*	185.453.129,63	29,46%				4.289.766,04		395,66	4.289.766,04			

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS										
Posição: 31/01/2022										
CDI ACUMULADO:										
		MES		ANO						
		0,80%		0,80%						
		-0,40%		-0,40%						
		1,04%		1,04%						
		-38,21		-38,21						
		R\$		629.511.503,52						
DESEMPENHO DA CARTEIRA										
META ATUARIAL (IPCA + 5,50%)										
RENTABILIDADE DA CARTEIRA x META ATUARIAL										
PATRIMÔNIO LÍQUIDO:										
BANCO / FUNDO	Patrimônio IPMJ (R\$)	% PATRIMÔNIO	LIMITE da Resolução 4963/2021	Política de Investimentos 2022		ALVO	MÁXIMO	Rentabilidade (R\$) dos fundos	Rentabilidade (%) dos fundos	Fundo x Meta
			Art. 9º II			3,69%	18%			
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	17.038.403,52	2,71%						-1.707.391,15	-9,11	-876,45
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTMENT NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	3.475.987,25	0,55%						-919.124,78	-20,91	-2012,35
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	3.219.707,34	0,51%						-700.113,87	-17,66	-1718,51
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	3.274.598,75	0,52%			5,86%			-561.901,24	-14,65	-1409,21
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	2.985.670,45	0,47%						-1.168.434,89	-28,13	-2706,31
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	5.665.772,02	0,90%						-710.308,45	-11,14	-1071,87
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	21.605.919,01	3,43%	Art. 9º III		5,00%	10%		-2.869.990,66	-11,73	-1128,22
TOTAL EXTERIOR*	57.263.569,34	9,10%			3,43%			-6.637.246,94		
TOTAL PATRIMÔNIO LÍQUIDO	629.511.503,52	100%								
RENDIMENTO NO MÊS	-2.335.429,16									
RENDIMENTO ANUALIZADO¹	-2.335.429,16									

* Nos rendimentos anualizados constam as aplicações e resgates consolidadas ao longo do ano.

7. CONFORMIDADE COM A POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

A Tabela 5 abaixo apresenta a distribuição do patrimônio em porcentagem de acordo com alocação objetiva definida na política de investimentos e resolução 4.963/2021 e posteriores atualizações.

Tabela 4 Distribuição do Patrimônio, em porcentagem, por resolução 3.922

Enquadramento	Tipo de Ativo	Alocação Objetivo	Limite Superior	Alocado	Total
Art. 7º, I, "a"	Títulos Públicos	44,50%	70%	25,14%	61,44%
Art. 7º, I, "b"	Fundos 100% Títulos Públicos	6,50%	70%	26,66%	
Art. 7º, I, "c"	FI em Índice de Mercado (ETF) de RF	0,00%	20%	0,00%	
Art. 7º, II	Operações Compromissadas	0,00%	1%	0,00%	
Art. 7º, III, "a"	Renda Fixa conforme CVM	6,00%	40%	7,22%	
Art. 7º, III, "b"	ETF RF CVM	0,00%	1%	0,00%	
Art. 7º, IV	Ativos de renda fixa de emissão com obrigação ou coobrigação de instituições financeiras (BACEN)*	4,00%	20%	0,00%	
Art. 7º, V, "a"	Cota Sênior de FIDC	0,50%	2%	0,005%	
Art. 7º, V, "b"	Renda Fixa "Crédito Privado"	1,50%	5%	2,41%	
Art. 7º, V, "c"	Fundo de Debêntures	0,00%	1%	0,00%	
Art. 8º, I, "a"	Fundos de Ações CVM	18,00%	30%	18,03%	
Art. 8º, I, "b"	FI em índice de mercado (ETF) de renda variável	0,50%	10%	1,92%	
Art. 9º, I	Renda Fixa - Dívida Externa	0,00%	1%	0,00%	9,09%
Art. 9º, II	Fundos de Investimento no Exterior	3,00%	10%	5,66%	
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	5,00%	10%	3,43%	
Art. 10º, I, "a"	Fundos Multimercados	8,00%	10%	7,93%	9,52%
Art. 10º, I, "b"	Fundos de Participações	2,00%	5%	1,59%	
Art. 10º, I, "c"	Fundos de Ações - Mercado de Acesso	0,00%	1%	0,00%	
Art. 11º	Fundos de Investimentos Imobiliários	0,50%	5%	0,00%	0,00%
Art. 12º	Empréstimos Consignados	0,00%	1%	0,00%	0,00%

7.1. Demonstrações Gráficas

A seguir, demonstrações gráficas referentes a conformidade com a política de investimentos

Gráfico 1 Demonstração Gráfica Alocação por tipo de ativo

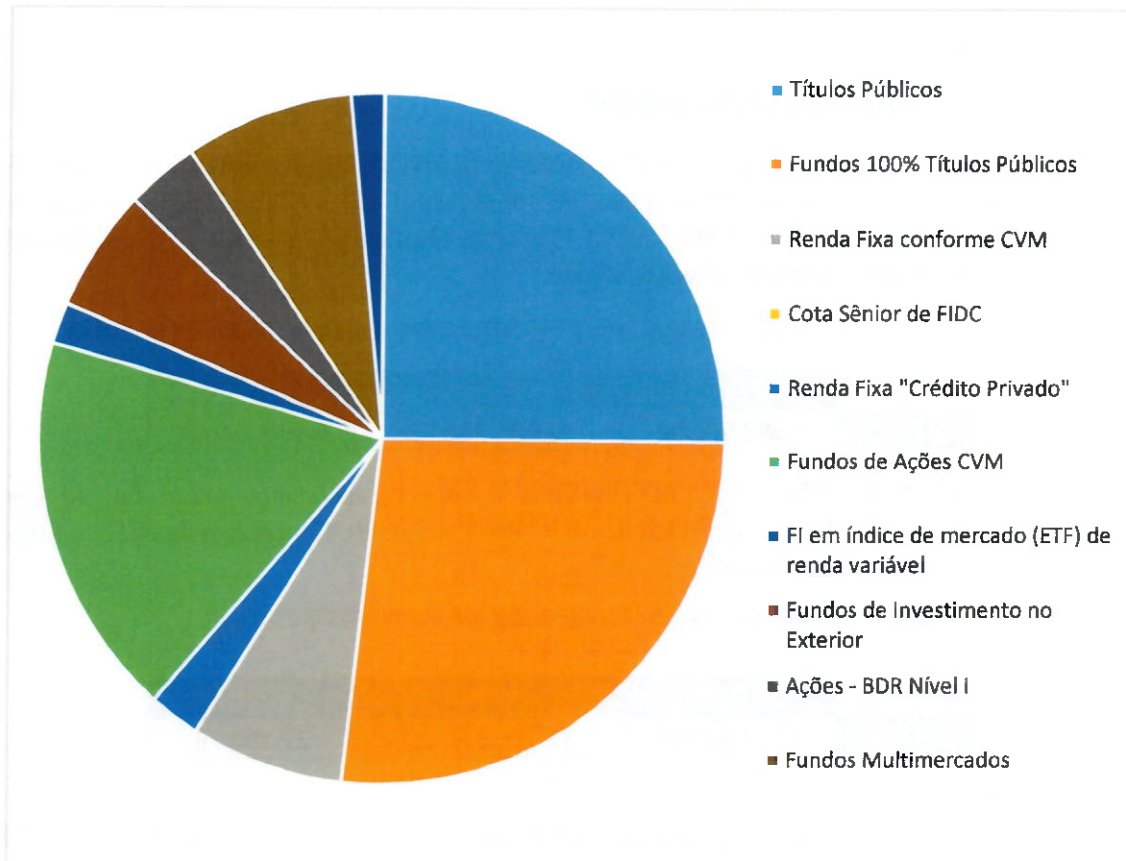
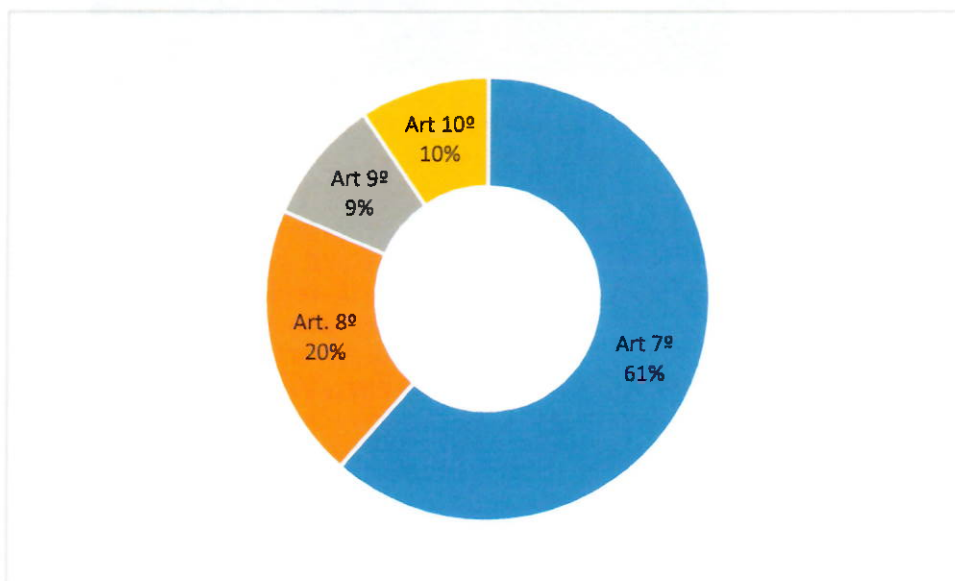


Gráfico 2 Distribuição do Patrimônio por Artigo



8. FUNDOS ESTRESSADOS E ESTRUTURADOS

Ressalta-se que acompanhamentos completos sobre esses fundos são realizados pela equipe do instituto ao longo do ano.

8.1. Fundos Estressados

Em janeiro de 2022, o fundo FIDC MULTISSETORIAL MASTER III apresentava um prejuízo de R\$ - 428.808,23 e, numa somatória junto ao rendimento, R\$ - 1.806.792,15, o total de amortizações já entregue é de R\$ 6.908.769,93. O acompanhamento é realizado de forma mensal, os demais dados se encontram na tabela 6, abaixo.

Tabela 5 Acompanhamento geral FIDC MULTISSETORIAL MASTER III

FIDC	Total Aplicado	Rendimento	Amortizações
TOTAIS :	7.368.930,01	(1.806.792,15)	6.908.769,93

O Fundo PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP, apresentou até o fim de suas integralizações, em 02/10/2017, um rendimento de R\$ 654.066,90. Em janeiro de 2022, o fundo apresentava aproximadamente os valores abaixo.

Tabela 6 Resultado Setembro PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP

PÁTRIA	Total Aplicado	Rendimento Total	Saldo
TOTAIS :	2.823.363,14	(2.796.171,79)	27.190,78

No acompanhamento do ano vigente, em janeiro de 2022, o fundo possuía R\$ 27.190,78, aproximadamente 0,004% do patrimônio do IPMJ

Tabela 7 Acompanhamento mensal Pátria

		PÁTRIA
2022	Janeiro	R\$ 41,89

8.2. Fundos Estruturados (FIP)

O fundo KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTIESTRATÉGIA FIP, apresentava R\$ 9.958.007,66, cerca de 1,582% do patrimônio líquido. Apresentando, os seguintes números:

Tabela 8 Acompanhamento geral KINEA (Dez/2021)

KINEA	Total Aplicado	Rendimento Total	Amortizações
TOTAIS :	7.537.557,00	2.420.450,74	997.681,60

Abaixo o acompanhamento de rendimentos ao longo do ano

Tabela 9 Acompanhamento mensal Kinea

		KINEA
2022	Janeiro	R\$ 393.320,06

9. ALOCAÇÃO POR INSTITUIÇÃO

A seguir, serão apresentadas as demonstrações de alocação por instituição no mês.

Tabela 10 Alocação por gestora, em Dezembro

Patrimônio x Gestoras (Posição: 31/01/2022)		
GESTORES	PL do IPMJ	%
TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN (Selic)	158.259.663,80	25,1%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	106.667.291,57	16,9%
BANCO DO BRASIL S/A	61.164.949,21	9,7%
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM	43.587.516,46	6,9%
ITÁU UNIBANCO S/A.	37.974.807,30	6,0%
NAVI CAPITAL ADM. GESTORA RF LTDA.	35.283.646,36	5,6%
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA.	32.791.600,18	5,2%
OCCAM BRASIL	29.755.628,41	4,7%
BANCO J. SAFRA S.A	21.605.919,01	3,4%
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS	17.480.212,31	2,8%
PORTO SEGURO	15.194.275,33	2,4%
BRAM BRADESCO ASSET M. SA. DTVM	14.099.587,13	2,2%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	11.696.541,75	1,9%
KINEA PRIVATE EQUITY INVEST. S.A.	9.958.007,66	1,582%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL LTDA.	8.227.670,28	1,307%
TARPON INVESTIMENTOS	5.956.018,56	0,946%
SCHRODER INVESTMENT BRASIL LTDA.	5.665.772,02	0,900%
SUL AMÉRICA INVEST. GESTORA REC. S.A.	5.084.132,97	0,808%
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	3.475.497,25	0,552%
GENIAL INVESTIMENTOS	2.985.670,45	0,474%
META ASSET MANAGEMENT LTDA	2.538.552,87	0,403%
BRPP GESTÃO PROD. ESTRUT. LTDA.	31.351,85	0,005%
PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.	27.190,78	0,004%
TOTAL PATRIMÔNIO LÍQUIDO	629.484.312,74	100,0%

10. RISCO (VaR) DOS FUNDOS NA CARTEIRA

Nome	VaR 95% MV 21 du (12 meses)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	9,00%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,32%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	11,93%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	3,05%
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	9,48%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11,45%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	6,49%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,31%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	17,80%
INDIE FIC AÇÕES	12,74%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	9,65%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	8,49%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,53%
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	10,96%
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	10,10%
META VALOR FI AÇÕES	10,95%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	10,77%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9,75%
OCCAM FIC AÇÕES	9,11%
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	147,84%
PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,11%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8,04%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,09%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	8,02%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	10,75%
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	8,58%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6,46%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1,82%

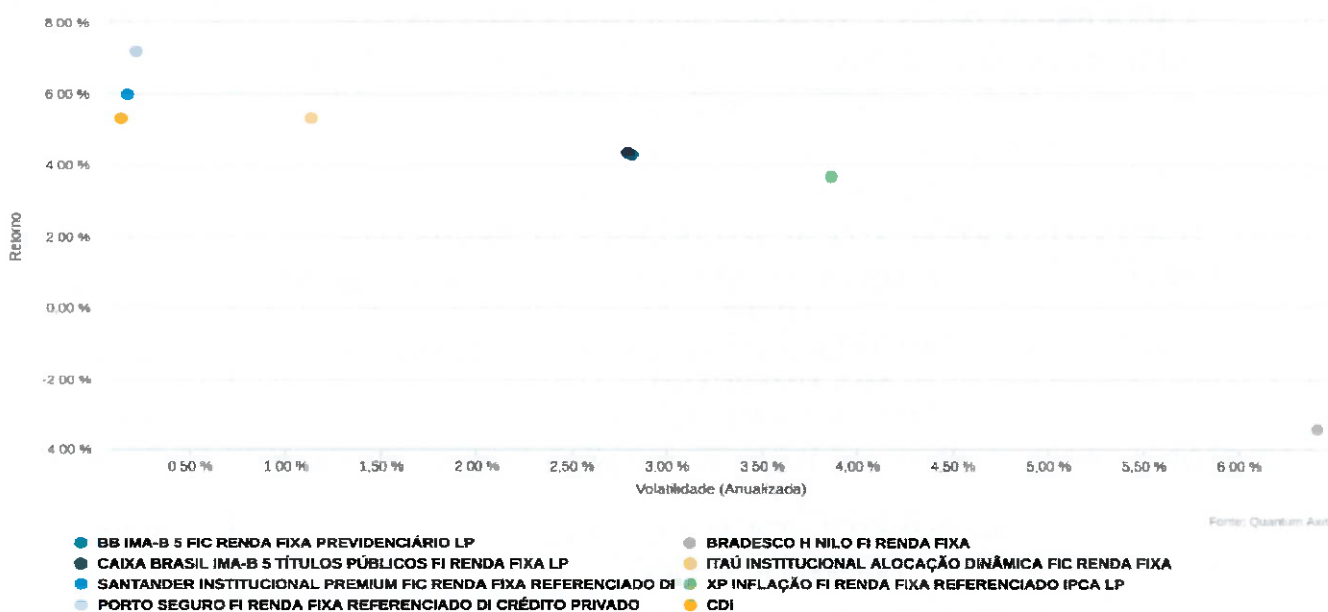
Os Fundos Master III FIDC Multissetorial Sênior e Kinea Private Equity IV Feeder Institucional I Fip Multiestratégia não entram nessa seção devido a sua natureza e seu acompanhamento individual.

11. DEMONSTRAÇÃO DOS FUNDOS POR SEGMENTO

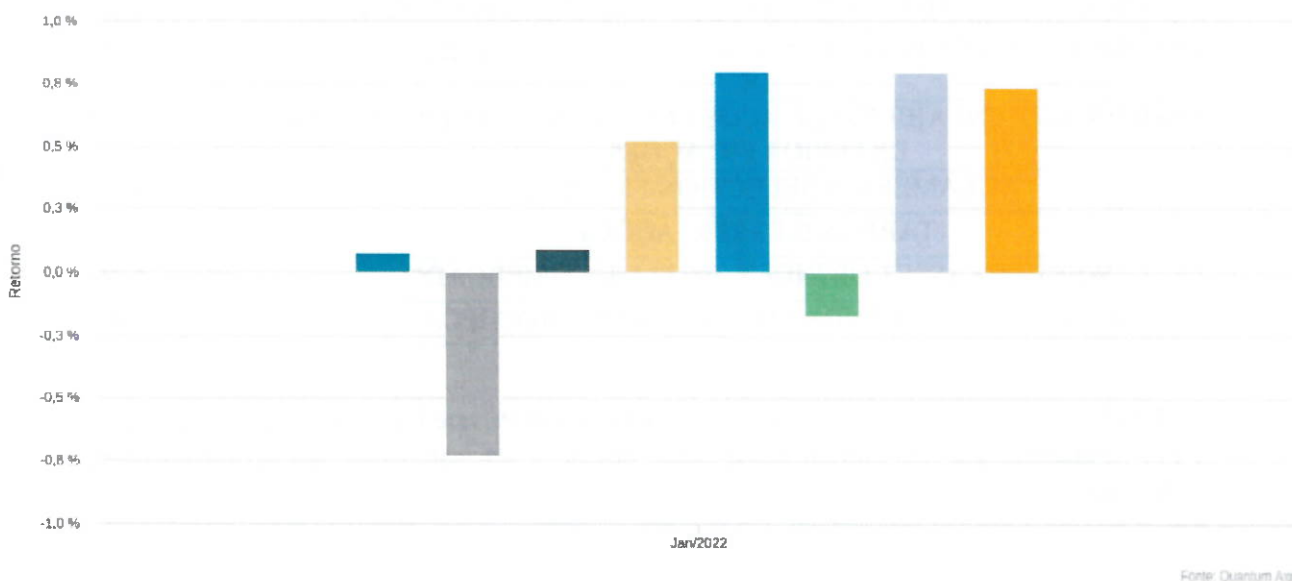
Esta seção retrata a demonstração dos fundos na carteira no ano vigente, desta forma, com relação ao retorno efetivo mensal, para um fundo que entrou na carteira após o início deste, deve-se considerar a partir do mês fechado subsequente. Acompanhamentos Individuais de retorno são realizados pelo instituto e aqui apresentados na carteira na seção 4.

11.1. Renda Fixa

Risco X Retorno de 17/02/2021 até 11/02/2022 (diária)

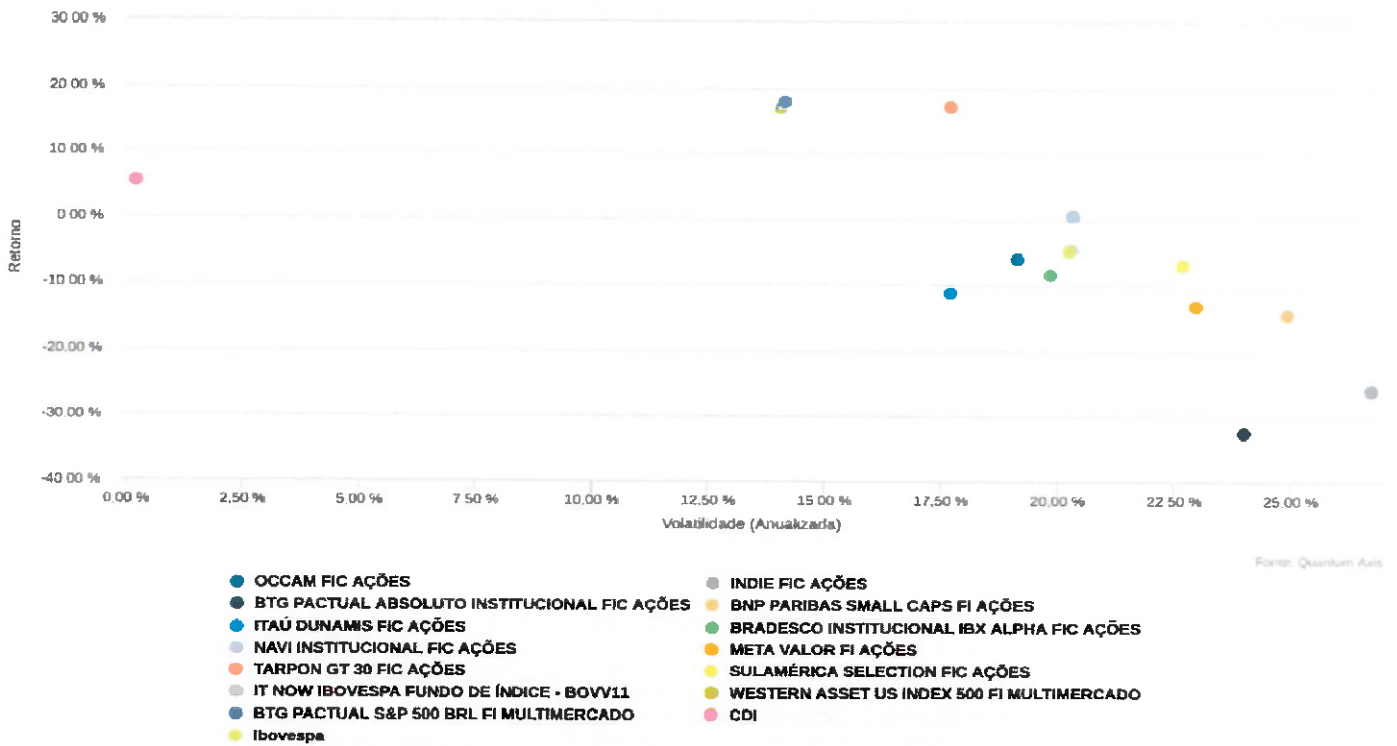


Retorno efetivo mensal de Jan/2022 até Jan/2022 (mensal)

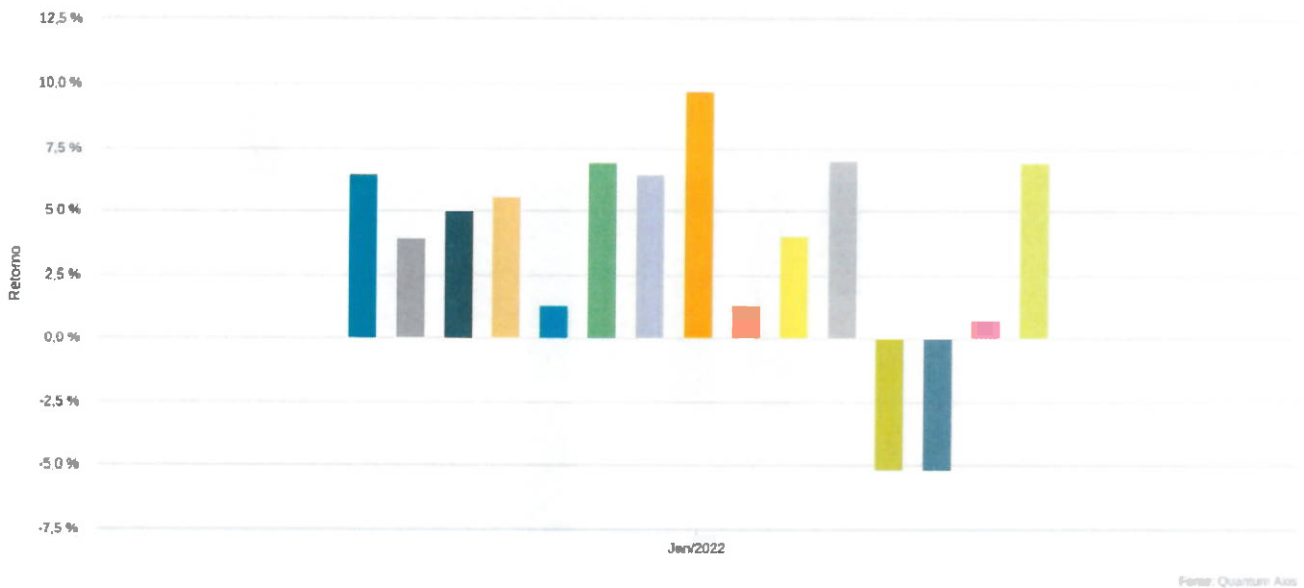


11.2. Renda Variável

Risco X Retorno de 17/02/2021 até 11/02/2022 (diária)

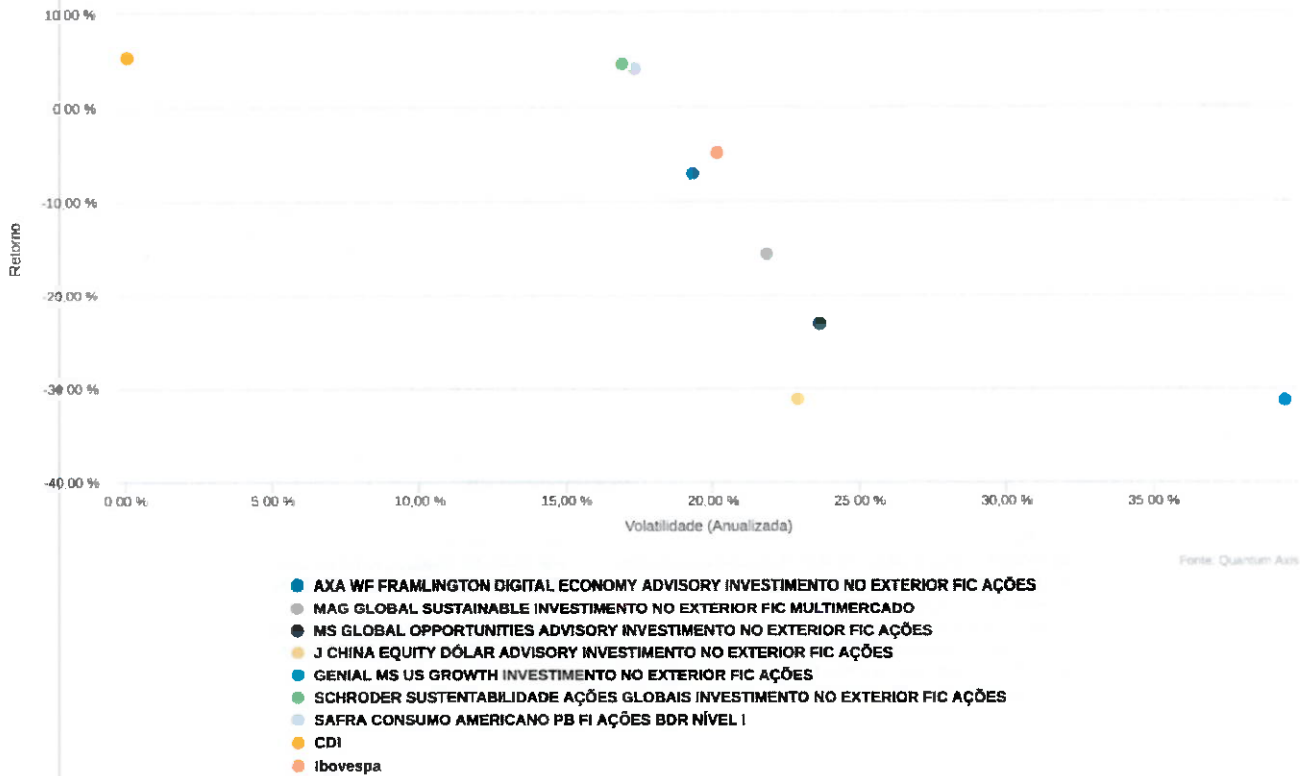


Retorno efetivo mensal de Jan/2022 até Jan/2022 (mensal)

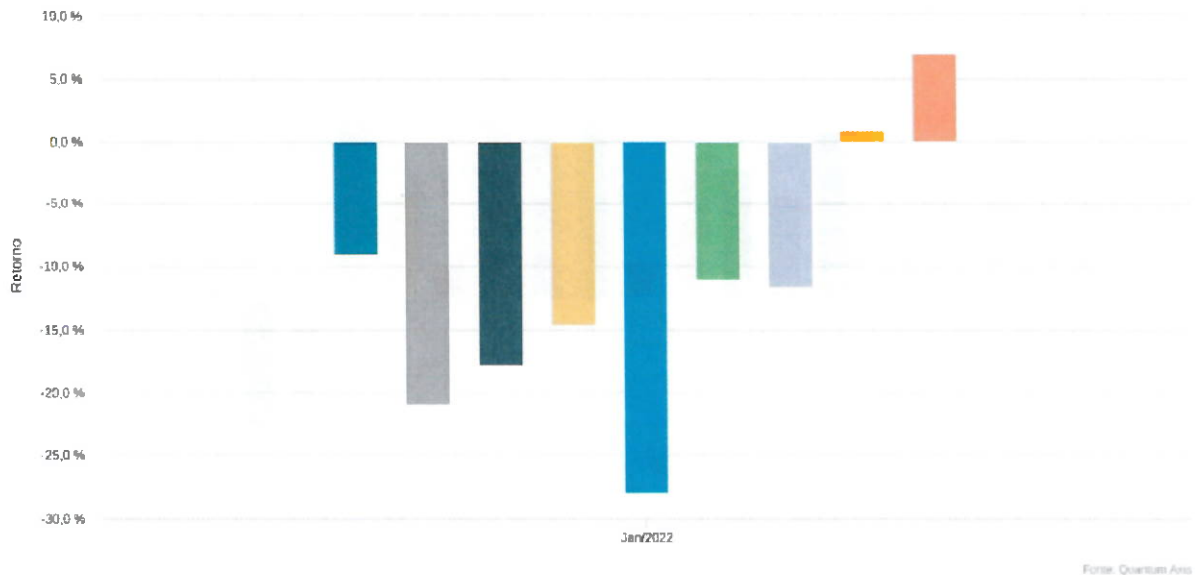


11.3. Exterior

Risco X Retorno de 17/02/2021 até 11/02/2022 (diária)



Retorno efetivo mensal de Jan/2022 até Jan/2022 (mensal)



12. AGENDA REALIZADA

- 05 de janeiro:

Reunião com os representantes da SPREV referente ao fundo Pátria Special Opportunies I - FIC FIP, realizada on-line onde estavam participando José Wilson da Silva Neto coordenador contábil da SPREV, Valter Correa representante do IPRED Instituto de Diadema, Luiz Gonzaga Filho SPREV, Armando Rodrigues representante do RPPS de Paraguaçu Paulista, Vanderlei Massarioli (Gestor de investimentos) e Amauri (Supervisor de investimentos). A reunião foi realizada através do aplicativo “Microsoft Teams”. Houve apresentação de cada Instituto e relembro o histórico dos rendimentos dos fundos e a informação de que o primeiro sinal de alerta ocorreu em janeiro/2020 quando da informação da desvalorização ocorrida em dezembro/2019, o segundo impacto ocorreu em junho/2020 com a desvalorização de mais de 99%. A SPREV, informou que o processo de análise desse fundo passa por receber as informações levantadas pelos RPPS, análise dos documentos e informar a CVM. A SPREV informou que nos casos de FIP’s existe uma boa possibilidade de se recuperação de ativos. Houve preocupação por parte dos RPPS com recuperação do investimento realizado. Solicitaram orientação sobre como os gestores devem agir para demonstrar suas preocupações. A SPREV orienta que existem dois pontos que serão auditados, o primeiro diz respeito ao processo de tomada de decisão na hora dos investimentos e o segundo de monitoramento e acompanhamento do mesmo.

- 12 de janeiro:

Reunião Sulamérica, realizada on-line com Wagner Kladt e João Saldanha, gestor do fundo Sulamérica Selection foi exposto qual será a estratégia do gestor para esse ano de eleição, o mesmo nos apresentou sua visão macro e micro econômica para esse ano, e quais serão os maiores desafios para 2022.

- 13 de janeiro:

Reunião com Instituto de Barueri às 10 horas, realizada on-line para esclarecimento de dúvida para o acompanhamento e aquisições de Títulos Públicos LFTs e outros títulos disponíveis para aquisições dos RPPS, para diversificação de carteira a título de proteção da mesma, para melhor se posicionar no mercado instável.

Reunião com o representante do Banco Safra, o senhor Edmilson às 16 horas, realizada presencialmente, na ocasião nos foi apresentado a visão para o ano de 2022 e o impacto no fundo do Safra Consumo Americano, qual a estratégia e quais papeis a instituição trabalha para compor o mesmo.

- 19 de janeiro:

357ª reunião do CAIF, realizada presencialmente, pauta da reunião:

- 1) Apresentação dos novos membros do CAIF;
- 2) Apresentação do fechamento da carteira de dezembro de 2021;
- 3) Análise parcial carteira janeiro até 17/01;
- 4) Reunião virtual com a NAVI CAPITAL ADMINISTRADORA E GESTORA DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA;
- 5) Credenciamentos;
- 6) Estudo de Estratégias da Carteira IPMJ e Realocações;
- 7) Assuntos Diversos.

- 26 de janeiro:

358ª reunião do CAIF, realizada online, pauta da reunião: 1) Reunião com o Banco do Brasil; 2) Análise parcial carteira janeiro até 21/01; 3) Assuntos Diversos