



## **RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS**

**Fevereiro 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 Fevereiro.....	8
7. Conformidade com a Política de Investimentos.....	11
7.1. Demonstrações Gráficas.....	12
8. Fundos Estressados e Estruturados.....	13
8.1. Fundos Estressados.....	13
8.2. Fundos Estruturados (FIP).....	14
9. Alocação por Instituição.....	15
10. Risco (VaR) dos Fundos na Carteira.....	16
11. Demonstração dos fundos por segmento.....	17
11.1. Renda Fixa.....	17
11.2. Renda Variável.....	18
11.3. Exterior.....	19
12. Agenda Realizada.....	20

## 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 fevereiro 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

*ausente*

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



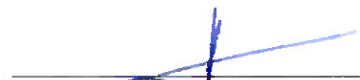
Fabiola de Melo Silva  
Assessora da Presidência - CPA-10

*ausente*

Clévio Vitor de Almeida  
Membro do CAIF - CPA - 10



Rafaela Carvalho dos Santos  
Membro do CAIF



Victor Adriano Vieira Silva  
Membro do CAIF

*ausente*

José Ricardo Vinhas

Membro do CAIF

## 2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS


---

Aos 23 dias de março 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 fevereiro 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 fevereiro de 2022.

Jacareí, 23 de março de 2022.



AMAURI ARNALDO JUNIOR  
PRESIDENTE DO CONSELHO FISCAL



VALDIR DOS SANTOS PEREIRA  
MEMBRO DO CONSELHO FISCAL

*ausente*

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 Fevereiro de 2022.

### **4. CENÁRIO ECONÔMICO**

---

Em fevereiro, a Bolsa de Valores Brasileira, IBOVESPA, fechou com alta de 1,39% finalizando o mês com 113.141,94 pontos, como trata-se de um mês curto devido ao recesso de carnaval, as atividades desta foram encerrados no dia 25, fechando então com 0,89% de ganhos que, se somados aos de janeiro, houve uma alta de 7,94% no ano.

Mesmo com o fechamento favorável, as incertezas externas fazem com que o crescimento seja discreto, com ruídos da invasão Russa à Ucrânia, que vem mobilizando a OTAN e países como EUA e França, na tentativa de conseguir um resultado diplomático ao problema existente entre os países em questão, com toda essa instabilidade geopolítica a crise mundial têm se agravado, gerando instabilidade em todos os mercados financeiros, contribuindo com a queda das principais bolsas mundiais.

Na segunda feira dia 21 de fevereiro o presidente russo Vladimir Putin anunciou formalmente o reconhecimento de independência para duas regiões separatistas da Ucrânia, causando um impacto negativo para com as negociações que já vinham sendo pautadas. Dessa forma, mesmo o real sendo uma das moedas que mais se valorizaram no mês, os ruídos de uma guerra fazem com que os investidores saiam do nosso mercado de capitais para se proteger.

Ainda, como já previsto, a taxa de juros americano também tem sido um grande problema para essa fuga de capital, já que o título público federal norte-americano é um dos mais confiáveis e resilientes do mundo. Deve-se levar em consideração também o cenário interno, tendo em vista que 2022 é um ano eleitoral no qual já existe uma instabilidade esperada pela incerteza sobre os candidatos, junto a pressão inflacionária, considerando que o IPCA – fevereiro fechou em 1,01%, sendo o maior desde 2015, quando comparado ao mesmo período.

A maioria dos índices de renda fixa encerraram o mês de fevereiro positivos: IRF-M 0,58%, IMA-B 0,54%, IMA-B5+ 0,01% e IMA-B5 1,06%, e na renda variável o ficaram positivos os índices: IBOV 0.89%e IBrX 50 1,75% e negativo o Índice Small Cap em -5,19%.

### **5. DESEMPENHO E MOVIMENTAÇÕES**

---

O patrimônio do IPMJ no fechamento do mês de fevereiro de 2022 foi de R\$ 628.769.744,75 (Seiscentos e vinte e oito milhões, setecentos e sessenta e nove mil, setecentos e quarenta e quatro reais e setenta e cinco centavos).

A carteira de renda fixa rendeu R\$ 1.607.211,24 (um milhão, seiscentos e sete mil, duzentos e onze reais e vinte quatro centavos) e R\$ 2.416.905,19 (dois milhões, quatrocentos e dezesseis mil, novecentos e cinco mil e dezenove centavos) em cupons e amortizações. Com a carteira de renda variável a rentabilidade foi de R\$-1.271.769,96 (um milhão, duzentos e setenta e um mil, setecentos e sessenta e nove reais e noventa e seis centavos negativos) e R\$ 2.117.806,90 (dois milhões, cento e dezessete mil, oitocentos e seis reais e noventa centavos) em amortizações. A carteira do exterior rendeu R\$ -3.507.997,08 (três milhões, quinhentos e sete mil, novecentos e noventa e sete reais e oito centavos negativos).

Tabela 1 Rendimento Mensal Acumulado

Acumulado 2022	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
Fev	R\$ 1.607.211,24	-R\$ 1.271.769,96	-R\$ 3.507.997,08	-R\$ 3.172.555,79
Cupons / Amortizações	R\$ 2.416.905,19	R\$ 2.117.806,90	R\$ -	R\$ 4.534.712,09
<b>Total Ano</b>	<b>R\$ 6.110.185,58</b>	<b>R\$ 5.135.802,98</b>	<b>-R\$ 12.145.262,12</b>	<b>-R\$ 899.273,55</b>

Assim, a rentabilidade da carteira, contabilizando cupons e amortizações, no mês de fevereiro de 2022 foi de R\$ 1.362.156,30 (um milhão, trezentos e sessenta e dois mil, cento e cinquenta e seis reais e trinta centavos). O rendimento acumulado no ano fechou o mês de fevereiro de 2022 em -899.273,56 (oitocentos e noventa e nove mil, duzentos e setenta e três reais e cinquenta e seis centavos negativos). Por fim, a rentabilidade da carteira no mês foi de 0,19% e no ano foi de -0,21%, atingindo 20,41% da meta atuarial mensal e -10,36% da meta atuarial anual.

Tabela 2 Investimento - Saldo mensal

Acumulado 2022	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
Fev	R\$ 390.832.814,82	R\$ 184.181.358,67	R\$ 53.755.571,26	R\$ 628.769.744,75

Tabela 3 Relatório Mensal de Investimentos – fevereiro

Tipo de Aplicação	Renda Fixa	Renda Variável	Exterior	Total
Saldo mês anterior	R\$ 386.794.806,56	R\$ 185.453.128,63	R\$ 57.263.568,34	R\$ 629.511.503,52
Aplicações no mês	R\$ 31.595.685,67	R\$ -	R\$ -	R\$ 31.595.685,67
Resgates no mês	-R\$ 29.164.889,17	R\$ -	R\$ -	-R\$ 29.164.889,17
Rendimento no mês	R\$ 1.607.211,24	-R\$ 1.271.769,96	-R\$ 3.507.997,08	-R\$ 3.172.555,79
Cupons e Amortizações (mês)	R\$ 2.416.905,19	R\$ 2.117.806,90	R\$ -	R\$ 4.534.712,09
Saldo final do mês	R\$ 390.832.814,82	R\$ 184.181.358,67	R\$ 53.755.571,26	R\$ 628.769.744,75
Rendimento no mês %	1,03%	0,46%	-6,53%	0,19%

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

- 02 de fevereiro de 2022:

NTN-B 2023, PU 3.829,61600900, taxa indicativa de IPCA + 6,56, quantidade 523, de valor total R\$ 2.002.889,17;

- 11 de fevereiro de 2022:

NTN-B 2022, PU 3.901,30174300, taxa indicativa de IPCA + 7,13, quantidade 1281, de valor total R\$ 4.997.567,53;



## 6. CARTEIRA DE FEVEREIRO

CARTERA DE INVESTIMENTOS Posição: 25/02/2022												
CDI ACUMULADO												
DESEMPENHO DA CARTEIRA												
META ATUARIAL (IPCA + 5,50%)												
RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL												
PATRIMÔNIO LÍQUIDO												
BANCO / FUNDO	Patrimônio (R\$)	% PATRIMÔNIO	LIMITE de Resolução 4963/2021	Política de Investimentos 2022		Amortizações e Cupons	Rentabilidade (R\$) dos fundos		Rentabilidade (%) dos fundos		Fundo x Meta	
				ALVO	MÁXIMO		Mês (R\$)	Ano (R\$)	Mês (%)	Ano (%)	Mês (%)	Ano (%)
TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TM (Selic)	164.618.937,47	26,18%	Art. 7º I a 100%	44,60%	70,00%	2.416.905,19	-441.183,61	1.028.553,29	1,08	1,14	114,769	57,220
CAIXA BRASIL IM-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	92.723.701,97	14,75%	Art. 7º I b 100%	6,80%	70%	-	1.056.410,40	1.152.726,92	1,05	1,14	111,816	57,430
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI	56.793.250,10	9,03%		23,76%		-	626.302,89	675.247,37	1,05	1,13	112,18	56,91
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA (T.A)	14.046.614,93	2,23%	Art. 7º III a 90%	6,00%	30%	-	129.227,12	207.548,84	0,93	1,46	98,793	73,191
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	8.894.136,45	1,41%				-	36.135,05	-29.928,14	0,40	-0,34	42,197	-16,861
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	31.539.867,75	5,02%		9,76%		-	219.674,46	361.160,91	0,82	1,62	87,35	81,64
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI (T.A)	1.604.045,38	0,26%				-	13.686,60	26.379,85	0,82	1,82	87,35	81,64
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	5.261.245,11	0,84%				-	40.573,86	31.505,86	0,78	0,60	82,69	30,29
MASTER III FIDC MLI TISSETORIAL SÊNIOR	31.967,53	0,005%	Art. 7º V a 5%	0,90%	2,0%	-	615,67	1.251,66	1,96	4,07	208,9	204,9
PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	15.319.046,13	2,436%	Art. 7º V b 5%	3,00%	5,0%	-	124.770,80	244.833,82	0,82	1,62	87,4	81,7
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>399.832.614,92</b>	<b>62,18%</b>				<b>2.416.905,19</b>	<b>1.607.211,24</b>	<b>6.110.165,68</b>				



CARTERA DE INVESTIMENTOS											
Posição: 25/02/2022											
C/D ACUMULADO:											
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 4953/2021	Política de Investimentos 2022		Amortizações e Cupons	Rentabilidade (R\$) dos fundos	Rentabilidade (%) dos fundos	Fundo x Meta		
				ALVO	MAXIMO						
			Art. 8º I 36%	18,00%	30%						
OCCAM FIC AÇÕES	30.067.496,32	4,78%					311.667,91	1,05	7,64	111,51	394,03
INDIE FIC AÇÕES	3.839.851,97	0,61%					-200.367,34	-4,98	-4,14	-527,86	-206,02
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.278.990,47	0,84%					-112.367,09	-2,08	2,82	221,75	147,54
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	7.961.228,15	1,27%					-268.442,14	-3,24	2,16	-344,55	106,84
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	11.836.954,84	1,88%					-145.212,22	-1,21	0,11	-128,82	5,73
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	5.335.050,03	0,85%		17,99%			94.466,31	1,80	8,89	191,79	447,03
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	35.141.040,66	5,59%					-142.605,68	-0,40	6,10	-43,00	306,45
META VALOR FI AÇÕES	2.484.973,03	0,40%					-53.579,84	-2,11	7,43	-224,57	373,46
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	6.252.486,69	0,99%					296.466,13	4,98	6,39	529,61	321,14
SULAMERICA SELECTION FIC AÇÕES	4.709.817,07	0,75%					-374.315,90	-7,96	-3,38	-783,34	-180,06
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE INDICE - BOWV11	12.202.681,28	1,94%	Art. 8º II	6,50%	10%		129.428,86	1,07	8,29	114,06	416,63
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	42.676.938,28	6,79%	Art. 19º I	8,00%	16%		-910.578,18	-2,09	-7,19	-222,27	-361,37
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	6.171.448,69	0,98%		7,77%			-133.755,20	-2,12	-7,22	-226,67	-362,77
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICIP	26.897,32	0,004%	Art. 16º II	1,00%	5,0%		-263,47	-1,08	-0,9	-114,83	-48,59
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTISTRATÉGIA FIP	10.100.503,56	1,621%		1,63%			235.465,90	2,4	6,574	251,62	330,54
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>184.181.355,67</b>	<b>29,29%</b>					<b>-1.271.709,95</b>				
							<b>2.117.896,90</b>				
							<b>2.117.896,90</b>				

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS Posição: 25/02/2022											
CDI ACUMULADO											
		MES	ANO								
		0,92%	1,68%								
		0,19%	-0,31%								
		0,94%	1,99%								
		20,41	-10,36								
		R\$	628.789.744,78								
DESEMPENHO DA CARTEIRA											
META ATUARIAL (IPCA + 5,50%)											
RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL											
PATRIMONIO LIQUIDO:											
BANCO / FUNDO	Patrimônio (R\$)	% PATRIMONIO	LIMITE da Resolução 4963/2021	Política de Investimentos 2022		Amortizações e Cupons	Rentabilidade (R\$) dos fundos	Rentabilidade (%) dos fundos	Fundo x Meta		
				ALVO	MÁXIMO						
			Art. 8º II	1,00%	10%						
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	16.161.333,01	2,57%				-	-876.070,51	-5,14	-13,78	-546,51	-692,71
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	3.417.342,52	0,54%				-	-58.154,73	-1,67	-22,24	-178,03	-1118,07
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	2.995.662,31	0,46%				-	-314.025,02	-9,75	-25,67	-1037,72	-1300,78
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	3.137.385,44	0,50%	5,38%			-	-137.203,31	-4,19	-18,22	-445,69	-918,18
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	2.747.205,90	0,44%				-	-238.464,55	-7,99	-33,87	-849,79	-1702,78
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	5.353.221,40	0,86%				-	-312.500,61	-5,52	-16,94	-598,94	-608,96
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	20.033.390,67	3,19%	Art. 8º III	5,00%	10%	-	-1.572.528,34	-7,28	-15,15	-774,38	-912,57
<b>TOTAL EXTERIOR</b>	<b>63.768.671,26</b>	<b>8,85%</b>					<b>-3.507.997,08</b>			<b>-13.145.363,12</b>	
<b>TOTAL PATRIMONIO LIQUIDO</b>	<b>628.789.744,78</b>	<b>100%</b>									
RENDIMENTO NO MES	1.382.136,30										
RENDIMENTO ANUALIZADO*	369.171,59										

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



## 7. CONFORMIDADE COM A POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

A Tabela 4 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 4.963

Enquadramento	Tipo de Ativo	Alocação Objetivo	Limite Superior	Alocado	Total
Art. 7º, I, "a"	<b>Títulos Públicos</b>	44,50%	70%	26,18%	62,17%
Art. 7º, I, "b"	<b>Fundos 100% Títulos Públicos</b>	6,50%	70%	23,78%	
Art. 7º, I, "c"	<b>FI em Índice de Mercado (ETF) de RF</b>	0,00%	20%	0,00%	
Art. 7º, II	<b>Operações Compromissadas</b>	0,00%	1%	0,00%	
Art. 7º, III, "a"	<b>Renda Fixa conforme CVM</b>	6,00%	40%	9,76%	
Art. 7º, III, "b"	<b>ETF RF CVM</b>	0,00%	1%	0,00%	
Art. 7º, IV	<b>Ativos de renda fixa de emissão com obrigação ou coobrigação de instituições financeiras (BACEN)*</b>	4,00%	20%	0,00%	
Art. 7º, V, "a"	<b>Cota Sênior de FIDC</b>	0,50%	2%	0,005%	
Art. 7º, V, "b"	<b>Renda Fixa "Crédito Privado"</b>	1,50%	5%	2,44%	
Art. 7º, V, "c"	<b>Fundo de Debêntures</b>	0,00%	1%	0,00%	
Art. 8º, I, "a"	<b>Fundos de Ações CVM</b>	18,00%	30%	17,96%	
Art. 8º, I, "b"	<b>FI em índice de mercado (ETF) de renda variável</b>	0,50%	10%	1,94%	
Art. 9º, I	<b>Renda Fixa - Dívida Externa</b>	0,00%	1%	0,00%	8,55%
Art. 9º, II	<b>Fundos de Investimento no Exterior</b>	3,00%	10%	5,36%	
Art. 9º, III	<b>Ações - BDR Nível I</b>	5,00%	10%	3,19%	
Art. 10º, I, "a"	<b>Fundos Multimercados</b>	8,00%	10%	7,77%	9,40%
Art. 10º, I, "b"	<b>Fundos de Participações</b>	2,00%	5%	1,63%	
Art. 10º, I, "c"	<b>Fundos de Ações - Mercado de Acesso</b>	0,00%	1%	0,00%	
Art. 11º	<b>Fundos de Investimentos Imobiliários</b>	0,50%	5%	0,00%	0,00%
Art. 12º	<b>Empréstimos Consignados</b>	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

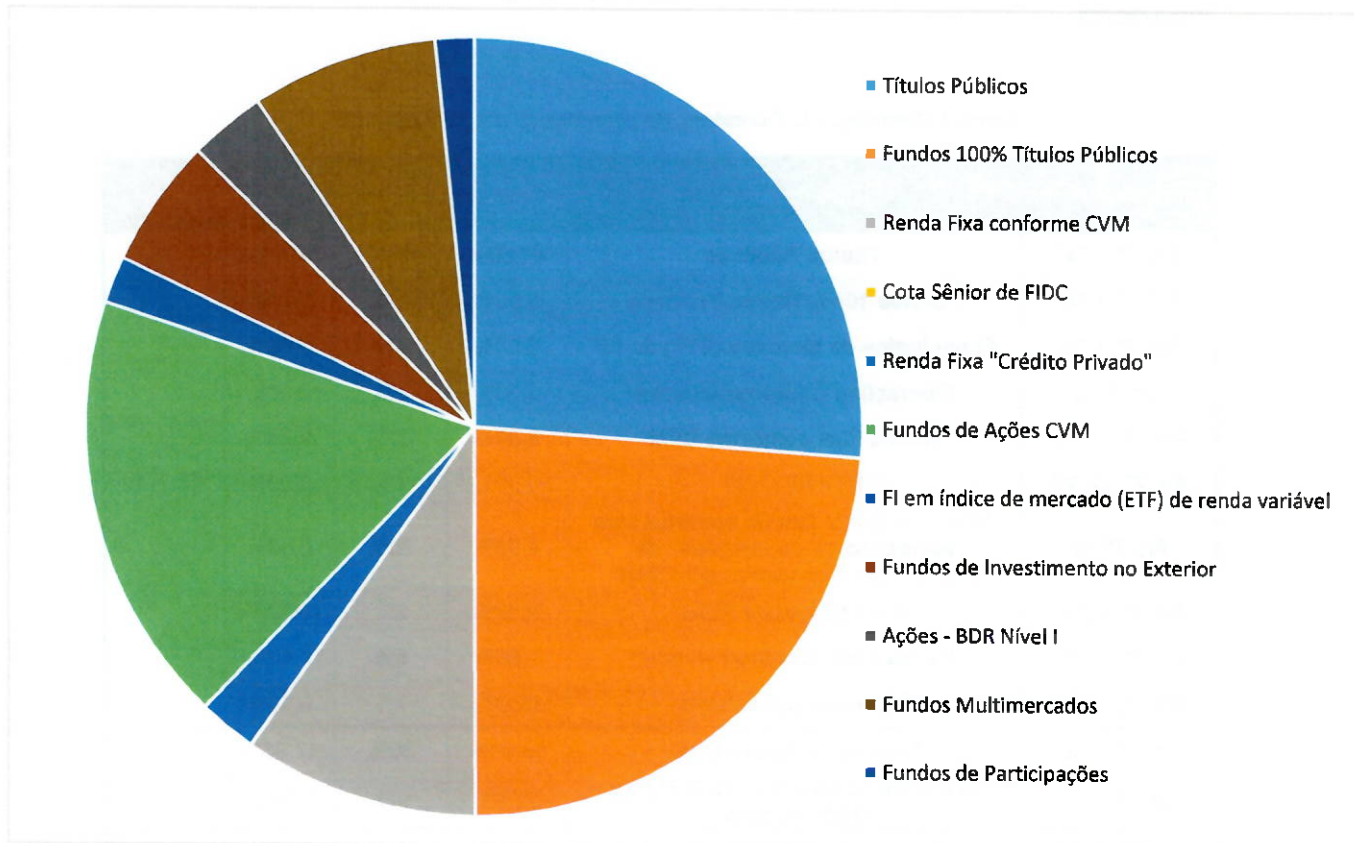
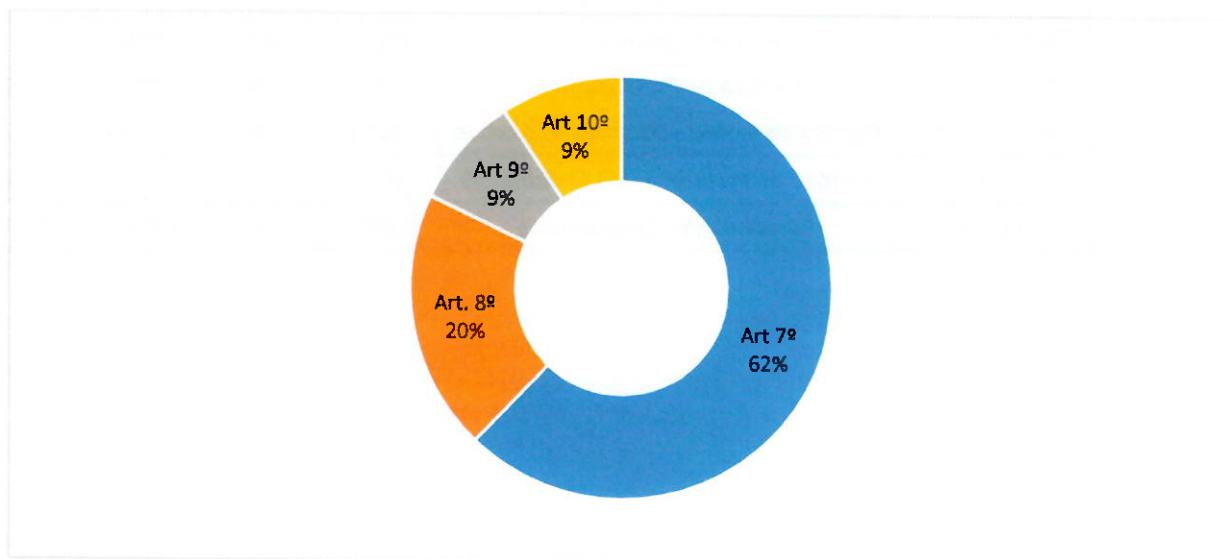


Gráfico 2 Distribuição do Patrimônio por Artigo



## 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 fevereiro de 2022, o fundo FIDC MULTISSETORIAL MASTER III apresentava um prejuízo de R\$ - 428.192,56 e, numa somatória junto ao rendimento, R\$ - 1.805.560,81, 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 5, abaixo.

Tabela 5 Acompanhamento geral FIDC MULTISSETORIAL MASTER III

FIDC	Total Aplicado	Rendimento	Amortizações
<b>TOTAIS :</b>	<b>R\$ 7.368.930,01</b>	<b>-R\$ 1.805.560,81</b>	<b>R\$ 6.908.769,93</b>

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 fevereiro de 2022, o fundo apresentava aproximadamente os valores abaixo.

Tabela 6 Acompanhamento geral PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP

PÁTRIA	Total Aplicado	Rendimento Total	Saldo
<b>TOTAIS :</b>	<b>R\$ 2.823.363,14</b>	<b>-R\$ 2.796.465,26</b>	<b>R\$ 26.897,32</b>

No acompanhamento do ano vigente, em fevereiro 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
	Fevereiro	-R\$ 293,47



## 8.2. Fundos Estruturados (FIP)

O fundo KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTIESTRATÉGIA FIP, apresentava R\$ 10.193.503,56, cerca de 1,621% do patrimônio líquido do Instituto. Tendo-se, os seguintes números:

*Tabela 8 Acompanhamento geral KINEA (Jan/2022)*

KINEA	Total Aplicado	Rendimento Total	Amortizações
<b>TOTAIS :</b>	<b>R\$ 7.537.557,00</b>	<b>R\$ 2.655.946,64</b>	<b>R\$ 3.115.488,50</b>

Abaixo o acompanhamento de rendimentos ao longo do ano

*Tabela 9 Acompanhamento mensal Kinea*

		KINEA
2022	Janeiro	R\$ 393.320,06
	Fevereiro	R\$ 235.495,90

## 9. ALOCAÇÃO POR INSTITUIÇÃO

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

Tabela 10 Alocação por gestora, em Fevereiro

Patrimônio x Gestoras (Posição: 25/02/2022)		
GESTORES	PL do IPMJ	%
TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN (Selic)	164.618.937,47	26,2%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	92.723.701,97	14,7%
BANCO DO BRASIL S/A	56.793.250,10	9,0%
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM	42.676.938,28	6,8%
ITÁU UNIBANCO S/A.	38.088.251,06	6,1%
NAVI CAPITAL ADM. GESTORA RF LTDA.	35.141.040,66	5,6%
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS	33.143.913,13	5,3%
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA.	31.305.507,85	5,0%
OCCAM BRASIL	30.067.496,32	4,8%
BANCO J. SAFRA S.A	20.033.390,67	3,2%
PORTO SEGURO	15.319.046,13	2,4%
BRAM BRADESCO ASSET M. SA. DTVM	14.229.188,48	2,3%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	11.450.439,46	1,8%
KINEA PRIVATE EQUITY INVEST. S.A.	10.193.503,56	1,621%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL LTDA.	7.961.228,15	1,266%
TARPON INVESTIMENTOS	6.252.486,69	0,994%
SCHRODER INVESTMENT BRASIL LTDA.	5.353.221,40	0,851%
SUL AMÉRICA INVEST. GESTORA REC. S.A.	4.709.817,07	0,749%
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	3.417.342,52	0,544%
GENIAL INVESTIMENTOS	2.747.205,90	0,437%
META ASSET MANAGEMENT LTDA	2.484.973,03	0,395%
BRPP GESTÃO PROD. ESTRUT. LTDA.	31.967,53	0,005%
PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.	26.897,32	0,004%
<b>TOTAL PATRIMÔNIO LÍQUIDO</b>	<b>628.742.847,43</b>	<b>100,0%</b>

## 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	9,26%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,32%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	11,73%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	3,00%
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	9,05%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11,40%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	6,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,30%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	18,91%
INDIE FIC AÇÕES	12,65%
IT NOW IBOVSPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	9,16%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	8,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,55%
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	10,65%
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	10,95%
META VALOR FI AÇÕES	10,79%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	11,71%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9,30%
OCCAM FIC AÇÕES	8,65%
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	8,71%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,09%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	8,57%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	10,81%
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	8,39%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6,77%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1,81%

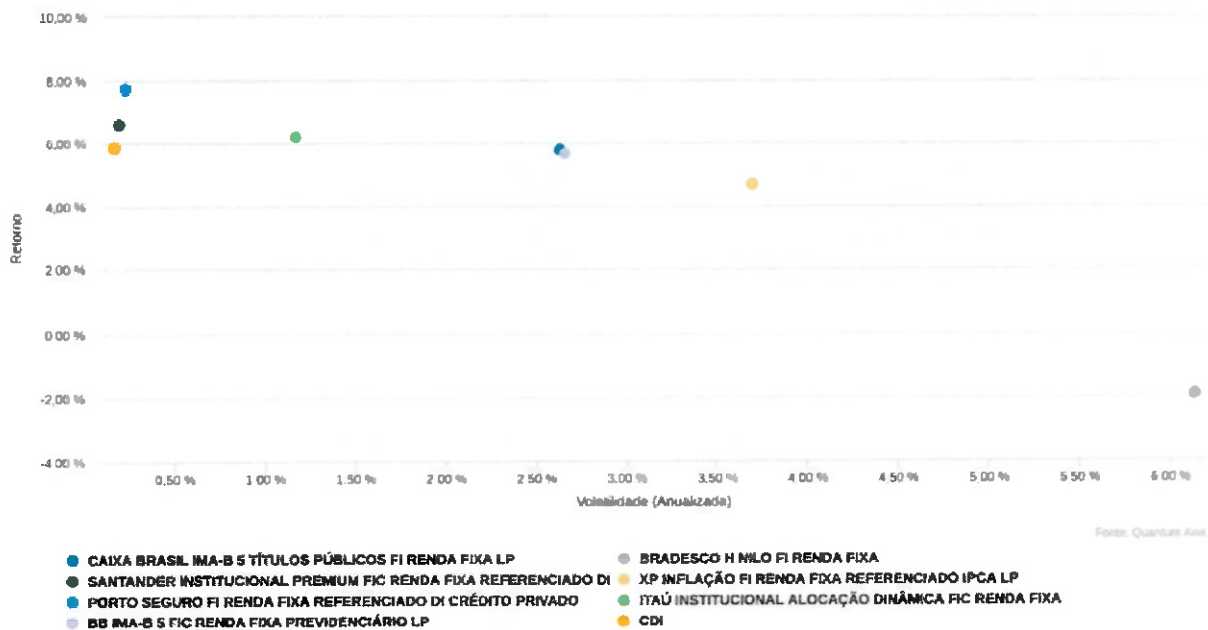
Os Fundos Master III FIDC Multissetorial Sênior e Kinea Private Equity IV Feeder Institucional I Fip Multiestratégia não entram nessa seção devido a sua natureza e seu acompanhamento individual.

## 11. DEMONSTRAÇÃO DOS FUNDOS POR SEGMENTO

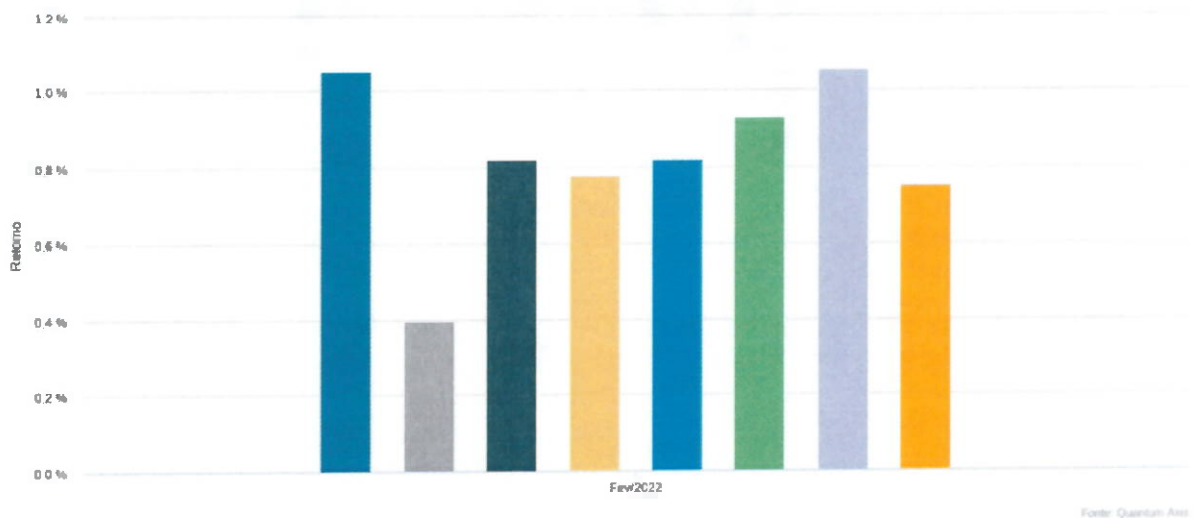
Esta seção retrata a demonstração dos fundos na carteira no ano vigente, desta forma, com relação ao retorno efetivo mensal, para um fundo que entrou na carteira após o início deste, deve-se considerar a partir do mês fechado subsequente. Acompanhamentos Individuais de retorno são realizados pelo instituto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

### 11.1. Renda Fixa

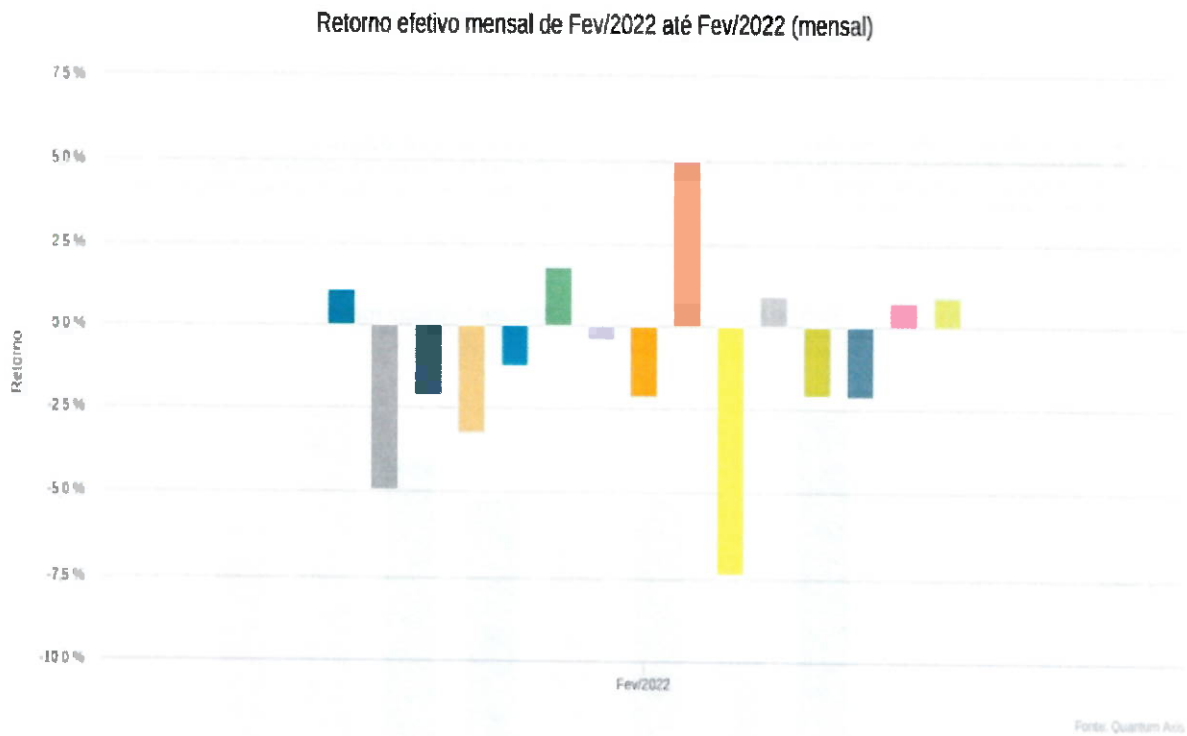
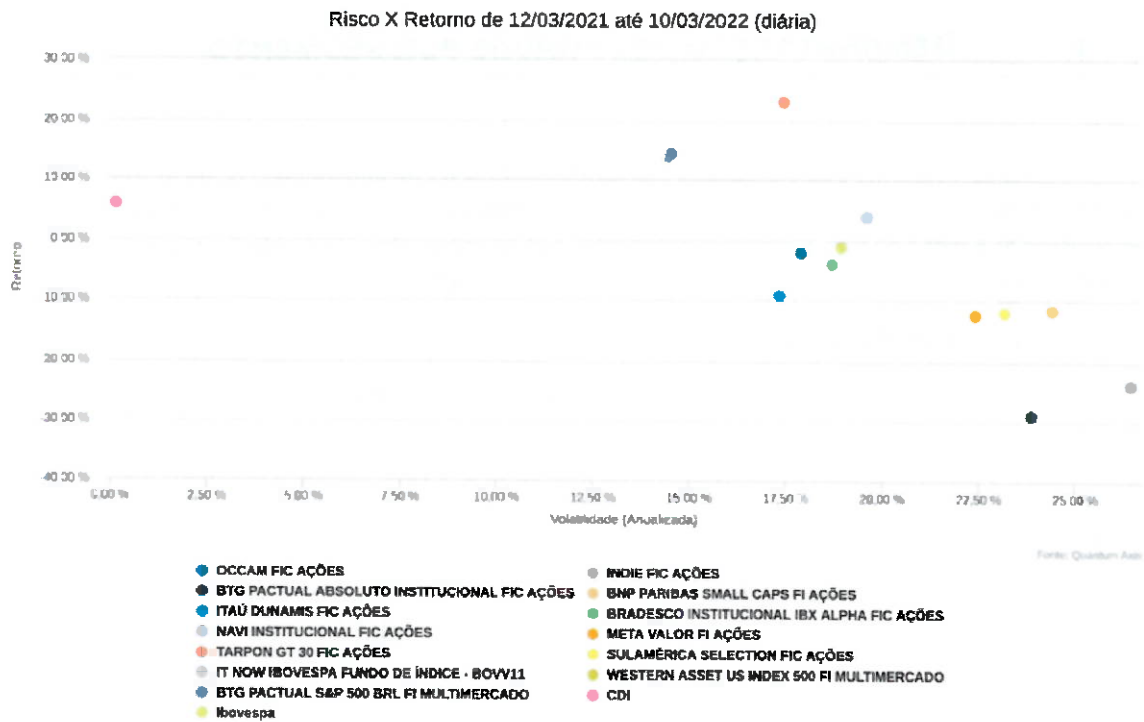
Risco X Retorno de 12/03/2021 até 10/03/2022 (diária)



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

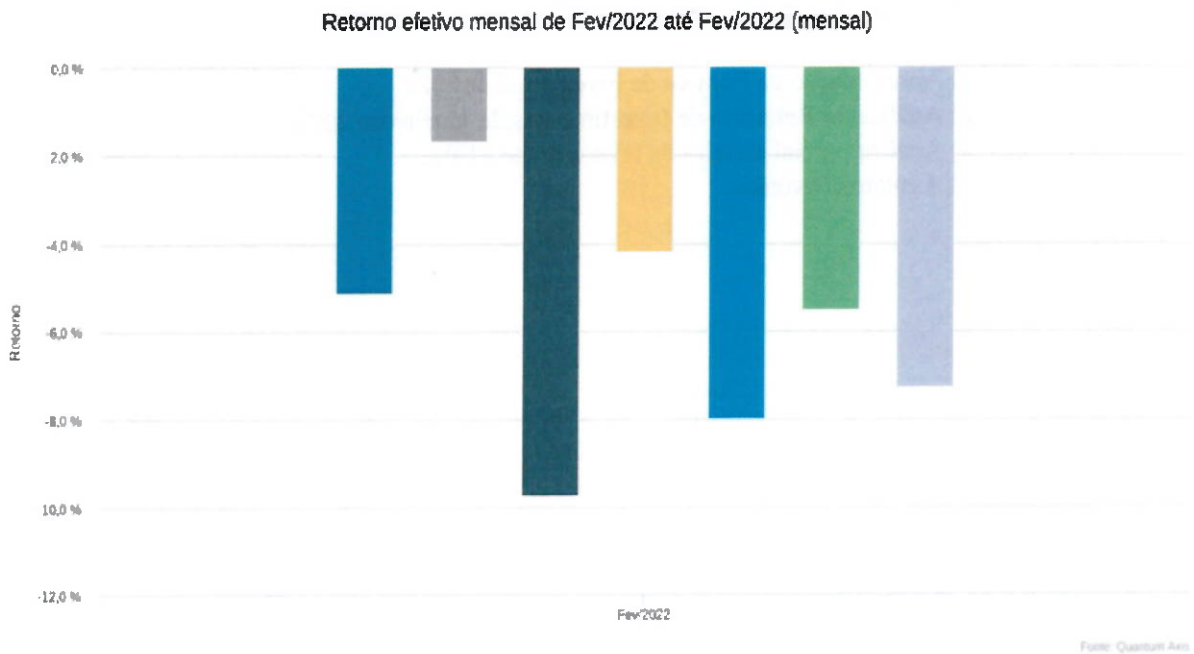
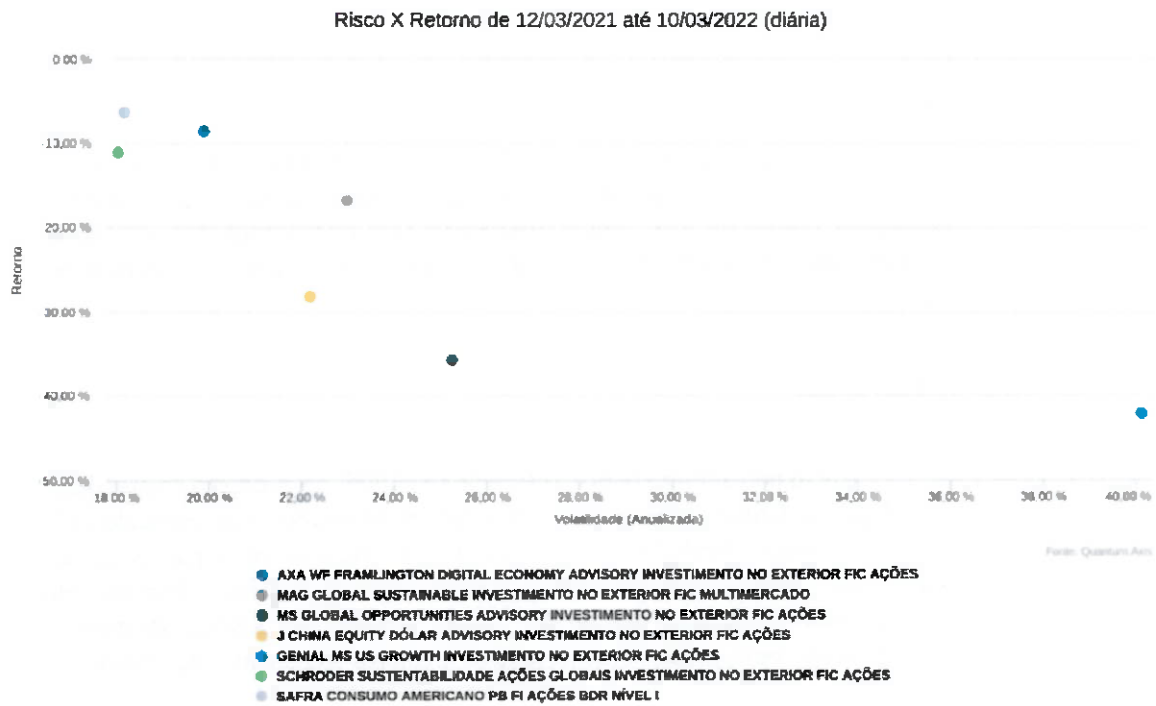


## 11.2. Renda Variável





### 11.3. Exterior



## **12. AGENDA REALIZADA**

---

- 15 de fevereiro:

Visita realizada ao instituto RPPS de Jundiaí, o instituto de Jacareí sendo representado pela presidente Rossana Vasques, o então gestor de investimentos Vanderlei Massarioli e o Amauri supervisor de investimentos, foi um dia de apresentações da ABIPEM mostrando estratégias de alocação de recursos em títulos.

- 16, 17 e 18 fevereiro:

Curso preparatório para certificação CGRPPS, no auditório da prefeitura de Mogi das Cruzes, patrocinado pela Grid Investimentos e apresentado pelo Ronaldo Fonseca, fundador da MaisValia, fizeram parte do curso para educação continuada, Amauri Arnaldo Junior, Clévio Vitor de Almeida, José Ricardo Vinhas, Rafaela Carvalho dos Santos e Victor Adriano Vieira Silva. Mostrando-se importantíssimo, principalmente para os membros ainda não certificados.

- 23 de fevereiro:

359ª reunião do CAIF, realizada on-line, pauta da reunião:

- 1) Apresentação da Política de Investimentos 2022;
- 2) Análise do Relatório de Investimentos de Janeiro de 2022;
- 3) Análise parcial carteira de fevereiro até 21/02;
- 4) Assuntos Diversos.