



RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Março 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.....	6
6. Carteira de Março.....	9
7. Conformidade com a Política de Investimentos.....	12
7.1. Demonstrações Gráficas.....	13
8. Fundos Estressados e Estruturados.....	14
8.1. Fundos Estressados.....	Erro! Indicador não definido.
8.2. Fundos Estruturados (FIP).....	15
9. Alocação por Instituição.....	16
10. Risco (VaR) dos Fundos na Carteira.....	17
11. Demonstração dos fundos por segmento.....	18
11.1. Renda Fixa.....	18
11.2. Renda Variável.....	19
11.3. Exterior.....	20
12. Agenda Realizada.....	21

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 março 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



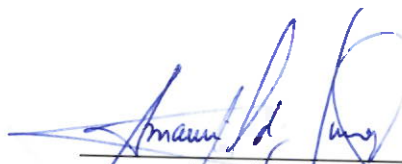
Luís Gustavo Ferreira Bonacina
Assessor da Presidência - CPA-20



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



Clevo Vitor de Almeida
Membro do CAIF - CGRPPS - CPA-10

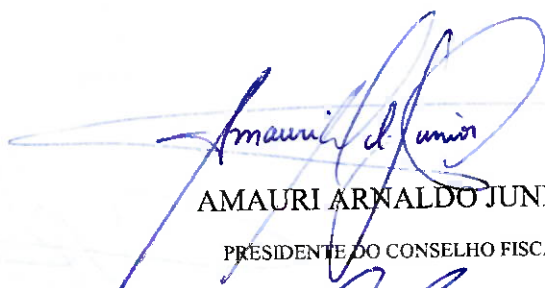


Victor Adriano Vieira Silva
Membro do CAIF - CGRPPS

2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Aos 20 dias de abril 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 março 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 março de 2022.

Jacareí, 20 de abril de 2022.



AMAURI ARNALDO JUNIOR
PRESIDENTE DO CONSELHO FISCAL



VALDIR DOS SANTOS PÉREIRA
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 março de 2022.

4. CENÁRIO ECONÔMICO

No cenário nacional, o Índice Bovespa (Ibovespa), abriu o mês no dia 2 de março com 115.173,61 pontos, fechando o mês no dia 31 com 119.999,23 pontos, o que representou uma alta de 4,19% do primeiro ao último dia de fechamento. A máxima chegou à 120.259,76 pontos e a mínima 108.959,30¹. O aumento da taxa SELIC para 11,75%², por um lado, estimula o investimento em Renda Fixa, porém, por outro lado, sinaliza aos investidores que o país está tomando ações para ter sob controle a inflação, o que faz o mercado reagir positivamente, contribuindo para o aumento do Índice Bovespa.

Olhando para o âmbito interno, na última divulgação do Novo Cadastro Geral de Empregados e Desempregados (CAGED), a criação e empregos no Brasil veio acima do esperado para o mês de fevereiro, sinalizando uma recuperação do poder de compra do consumidor, já o IPCA divulgado pelo IBGE dia 08 de abril, foi de 1,62% no mês de março, acima do previsto³ do previsto, tendo sua maior taxa para o mês desde 1994.

Os principais índices de renda fixa encerraram o mês de março positivos:

- IRF-M: 0,84%
- IMA-B: 3,07%
- IMA-B5+: 3,56% e
- IMA-B5: 2,61%,

Na renda variável os principais índices:

- IBOV: 6,06%,
- IBrX 50: 5,42%
- Small Cap: 8,81%⁴.

A boa performance do índice Bovespa, em parte, também, se deve ao cenário internacional. Devido a guerra na Ucrânia, os investidores que tinham ativos na Rússia, migraram para outros países que compõe o BRICS, aumentando a entrada de capital estrangeiro na bolsa brasileira, principalmente em papéis de commodities que se valorizam pela escassez que a guerra produz. Ainda no cenário internacional, o FED

¹ https://www.b3.com.br/pt_br/market-data-e-indices/indices/indices-amplos/indice-ibovespa-ibovespa-estatisticas-historicas.htm

² <https://www.bcb.gov.br/controleinflacao/historicotaxasjuros>

³ <https://www.ibge.gov.br/explica/inflacao.php>

⁴ <https://valor.globo.com/valor-data/aplicacoes/>

resolveu em sua última reunião aumentar a taxa de juros base da economia americana em 0,25 pontos⁵ para tentar controlar a inflação.

5. DESEMPENHO E MOVIMENTAÇÕES

O patrimônio do IPMJ no fechamento do mês de março de 2022 foi de R\$ 639.778.742,51 (Seiscentos e trinta e nove milhões, setecentos e setenta e oito mil, setecentos e quarenta e dois reais e cinquenta e um centavos).

A carteira de renda fixa rendeu no mês R\$ 7.590.328,81 (sete milhões e quinhentos e noventa mil e trezentos e vinte e oito reais e oitenta e um centavos). Com a carteira de renda variável a rentabilidade foi de R\$ 7.812.790,23 (sete milhões e oitocentos e doze mil e setecentos e noventa reais e vinte e três centavos). A carteira do exterior rendeu R\$ -2.006.104,89 (dois milhões e seis mil e cento e quatro reais e oitenta e nove 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
Mar	R\$ 7.894.766,43	R\$ 7.812.790,23	-R\$ 2.006.104,89	R\$ 13.701.451,77
Cupons / Amortizações	R\$ 2.416.905,19	R\$ 2.117.806,90	R\$ -	R\$ 4.534.712,09
Total Ano	R\$ 14.004.952,01	R\$ 12.948.593,22	-R\$ 14.151.367,01	R\$ 12.802.178,22

Assim, a rentabilidade da carteira, no mês de março de 2022 foi de R\$ 13.701.451,77 (treze milhões e setecentos e um mil e quatrocentos e cinquenta e um reais e setenta e sete centavos). O rendimento acumulado no ano fechou o mês de março de 2022 em R\$12.802.178,22 (doze milhões e oitocentos e dois mil e cento e setenta e oito reais e vinte e dois centavos). Por fim, a rentabilidade acumulada da carteira no mês foi

⁵<https://www.cnnbrasil.com.br/business/eua-elevam-juros-em-025-ponto-percentageal-na-primeira-alta-desde-2018/>

de 2,13% e no ano foi de 1,92%, atingindo 207,1% da meta atuarial mensal e 65,62% 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
Mar	R\$ 396.035.127,30	R\$ 191.994.148,83	R\$ 51.749.466,38	R\$ 639.778.742,51

Tabela 3 Relatório Mensal de Investimentos – março

Tipo de Aplicação	Renda Fixa	Renda Variável	Exterior	Total
Saldo mês anterior	R\$ 390.832.814,82	R\$ 184.181.358,67	R\$ 53.755.571,26	R\$ 628.769.744,75
Aplicações no mês	R\$ 28.811.546,64	R\$ -	R\$ -	R\$ 28.811.546,64
Resgates no mês	-R\$ 31.504.000,00	R\$ -	R\$ -	-R\$ 31.504.000,00
Rendimento no mês	R\$ 7.894.766,43	R\$ 7.812.790,23	-R\$ 2.006.104,89	R\$ 13.701.451,77
Cupons e Amortizações (mês)	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -
Saldo final do mês	R\$ 396.035.127,30	R\$ 191.994.148,88	R\$ 51.749.466,83	R\$ 639.778.742,51
Rendimento no mês %	1,99%	4,07%	-3,88%	2,13%

Ressalta-se ainda que, no mês de março, foram realizadas as seguintes compras de títulos públicos, no valor total de R\$ 21.986.846,64, descritos abaixo:

- 08 de março de 2022:

NTN-B 2025, PU 3.930,06724700, taxa indicativa de IPCA + 5,81, quantidade 254, de valor total R\$ 998.237,08;

NTN-B 2028, PU 3.890,48020300, taxa indicativa de IPCA + 5,81, quantidade 771, de valor total R\$ 2.999.560,24;

NTN-B 2026, PU 3.892,77071200, taxa indicativa de IPCA + 5,71, quantidade 770, de valor total R\$ 2.997.433,45;

NTN-B 2055, PU 3.993,79862700, taxa indicativa de IPCA + 5,86, quantidade 500, de valor total R\$ 1.996.899,31;

NTN-B 2040, PU 3.917,78597900, taxa indicativa de IPCA + 5,8550, quantidade 765, de valor total R\$ 2.997.106,27;

NTN-B 2045, PU 3.981,85115100, taxa indicativa de IPCA + 5,86, quantidade 502, de valor total R\$ 1.998.889,28;

NTN-B 2030, PU 3.895,76717200, taxa indicativa de IPCA + 5,8350, quantidade 770, de valor total R\$ 2.999.740,72;

NTN-B 2035, PU 3.963,03598800, taxa indicativa de IPCA + 5,8550, quantidade 757, de valor total R\$ 3.000.018,24;

NTN-B 2024, PU 3.859,0001010, taxa indicativa de IPCA + 5,9120, quantidade 518, de valor total R\$ 1.998.962,05;

6. CARTEIRA DE MARÇO

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS Posto do: 31/03/2022													
BANCO / FUNDO	Patrimônio IPMJ (R\$)	% PATRIMÔNIO	LIMITE da Resolução 496/2021	Política de Investimentos 2022		Amortizações e Cupons		Rentabilidade (R\$) dos fundos		Rentabilidade (%) dos fundos		Fundo a Meta	
				ALVO	MAXIMO	Mês (R\$)	Ano (R\$)	Mês (%)	Ano (%)	Mês (%)	Ano (%)	Mês (%)	Ano (%)
COI ACUMULADO													
DESEMPENHO DA CARTEIRA													
META ATUARIAL (RCA + 4.93%)													
RENTABILIDADE DA CARTEIRA + META ATUARIAL													
PATRIMÔNIO LÍQUIDO													
	189.758.370,11	29,66%	Art. 7º I a 100%	29,66%	44,80%	70,00%	2.416.905,19	4.181.139,85	1,68	1,14	162,912	57,220	
TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN (S&P)	95.121.649,58	34,87%	Art. 7º I b - 100%	6,50%	23,97%	70%	-	2.398.147,61	3.550.874,53	2,59	3,76	251,088	128,257
CAIXA BRASILEIRA - B-5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	58.257.770,20	9,11%	Art. 7º II a 60%	6,00%	3,0%	30%	-	1.404.523,08	2.139.770,46	2,58	3,74	250,34	127,63
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5 LP FIC FI	14.210.012,78	2,22%					-	163.397,85	364.946,69	1,16	2,84	172,931	89,059
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA (IT A)	9.163.246,46	1,43%			5,84%		-	269.108,02	239.179,88	3,03	2,68	293,738	91,468
BRANCO H NILO FI RENDA FIXA	7.083.705,96	1,11%					-	126.338,24	487.499,16	0,96	2,60	93,20	88,71
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI (IT A)	1.521.705,24	0,24%					-	14.459,88	49.839,74	0,96	2,60	93,20	88,71
AP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	5.417.507,34	0,85%					-	151.262,23	162.764,09	2,68	3,49	279,11	119,27
MASTER III FIC MULTISECTORIAL SENIOR	30.862,76	0,00%	Art. 7º V a 9%	0,00%	2,0%	2,0%	-	-1.094,76	148,89	-3,46	0,48	-336,5	16,3
PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CREDITO PRIVADO	15.475.093,80	2,41%	Art. 7º V b 9%	8,00%	5,0%	5,0%	-	156.047,76	400.881,58	1,02	2,69	88,9	90,8
TOTAL RENDA FIXA	396.038.127,39	61,90%					2.416.905,19	7.894.764,43	11.688.048,62				

CARTERA DE INVESTIMENTOS											
Posição: 31/03/2022											
BANCO / FUNDO	Patrimônio (R\$)	Patrimônio (%)	LIMITE da Resolução 494/2021	Política de Investimentos 2022		Amortizações e Cupons	Rentabilidade (R\$) dos fundos	Rentabilidade (%) dos fundos	Fundo x Meta		
				ALVO	MAXIMO						
COI ACUMULADO:											
DESEMPENHO DA CARTERA:											
META ATUARIAL (PCA - 4.83%):											
RENTABILIDADE DA CARTERA X META ATUARIAL:											
PATRIMÔNIO LÍQUIDO:											
			Art. 8º I 30%	18.00%	30%						
COIAM FIC AÇÕES	31.226.750,08	4,86%				-	1.159.293,75	3,86	11,29	374,31	402,31
INDIE FIC AÇÕES	3.870.381,14	0,60%				-	30.509,18	0,79	12,10	77,14	413,01
BTG FUNDACIONAL INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.641.687,91	0,89%				-	362.987,43	6,45	9,89	667,56	337,35
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIC AÇÕES	8.547.687,95	1,34%				-	586.239,81	7,36	9,09	714,68	330,03
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	12.495.197,52	1,95%				-	656.152,68	5,54	5,66	538,06	193,25
BRADESCO INSTITUCIONAL IRIX ALPHA FIC AÇÕES	5.639.740,59	0,88%	18,48%			-	304.080,55	5,71	15,11	554,44	515,08
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	35.818.753,99	5,60%				-	677.713,34	1,93	8,14	187,23	277,85
META VALOR FIC AÇÕES	2.669.900,54	0,42%				-	184.927,81	7,44	15,42	722,47	520,36
TARFON GT 30 FIC AÇÕES	6.751.753,55	1,06%				-	499.260,85	7,99	0,40	775,21	13,56
SULAMERICA SELECTION FIC AÇÕES	5.066.234,64	0,79%				-	356.417,57	7,57	3,72	734,67	128,79
TOTAL											
	12.910.766,20	2,02%	Art. 8º II	0,50%	10%	-	768.114,82	6,60	14,57	563,36	497,20
IFNON BOVESPA FUNDO DE INDICE - BOVV11:											
	44.630.960,54	6,98%	Art. 19º I	8,00%	10%	-	1.954.022,27	4,58	2,84	444,50	-300,27
WESTERN ASSET US INDEX 500 FIMULTIMERCADO											
	6.459.199,87	1,01%		7,99%		-	267.720,88	4,08	3,88	452,61	-68,62
BTG FUNDACIONAL S&P 500 BRIL FIMULTIMERCADO											
	13.708,69	0,002%	Art. 19º II	2,00%	8,0%	-	-13.186,62	-13,440,20	-49,03	-4760,23	-1089,52
PATRA SPECIAL OPPORTUNITIES IFCEIP											
	10.251.415,06	1,632%		1,64%		-	57.912,12	0,6	7,180	55,15	245,03
WNECA PRIVATE EQUITY N FEEDER INSTITUCIONAL MULTISTRATEGIA FP											
	191.994.148,83	30,91%				-	2.117.804,90	1,1			
TOTAL RENDA VARIÁVEL*											
	191.994.148,83	30,91%				-	2.117.804,90	1,1			

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS Posição: 31/03/2022									
COI ACUMULADO									
DESEMPENHO DA CARTEIRA									
META ATUARIAL (PCA = 4,85%)									
RENTABILIDADE DA CARTEIRA x META ATUARIAL									
PATRIMÔNIO LÍQUIDO									
BANCO / FUNDO	Patrimônio (R\$)	% PATRIMÔNIO	LIMITE da Resolução 4882/2021 Art. 8º II	Política de Investimentos 2022		Amortizações e Cupons	Rentabilidade (R\$) dos fundos	Rentabilidade (%) dos fundos	Fundo x Meta
				ALVO	MAXIMO				
	19.381.447,74	2,59%		3,00%	10%		280.114,74	1,24	120,21
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	3.305.771,80	0,52%					-111.570,73	-3,28	-314,98
M&G GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	2.658.347,54	0,42%					-237.334,68	-8,93	-782,96
MIS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	2.607.017,40	0,41%	4,10%				-530.378,04	-18,91	-1.641,17
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	2.597.834,40	0,41%					-149.371,50	-5,74	-527,85
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	5.082.458,55	0,78%					-270.704,88	-5,36	-491,04
SAPTA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	19.128.590,85	2,99%		5,00%	10%		-600.799,83	-3,18	-339,43
TOTAL EXTERIOR	81.729.466,38	8,09%		2,95%			2.896.194,29	-4,53	-339,43
TOTAL PATRIMÔNIO LÍQUIDO	819.718.742,81	100%							
RENDIMENTO NO MÊS	11.791.451,77								
RENDIMENTO ANUALIZADO	11.892.178,32								

* 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"	Títulos Públicos	44,50%	70%	29,66%	61,89%
Art. 7º, I, "b"	Fundos 100% Títulos Públicos	6,50%	70%	23,97%	
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%	5,84%	
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%	2,42%	
Art. 7º, V, "c"	Fundo de Debêntures	0,00%	1%	0,00%	
Art. 8º, I, "a"	Fundos de Ações CVM	18,00%	30%	18,40%	20,42%*
Art. 8º, I, "b"	FI em índice de mercado (ETF) de renda variável	0,50%	10%	2,02%	
Art. 9º, I	Renda Fixa - Dívida Externa	0,00%	1%	0,00%	8,09%
Art. 9º, II	Fundos de Investimento no Exterior	3,00%	10%	5,10%	
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	5,00%	10%	2,99%	
Art. 10º, I, "a"	Fundos Multimercados	8,00%	10%	7,99%	9,59%*
Art. 10º, I, "b"	Fundos de Participações	2,00%	5%	1,60%	
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%

* Nota-se o desenquadramento passivo do limite global que abrange o Artº 8 e Art 10º, os quais apresentavam uma somatória de 30,01% no mês de março.

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

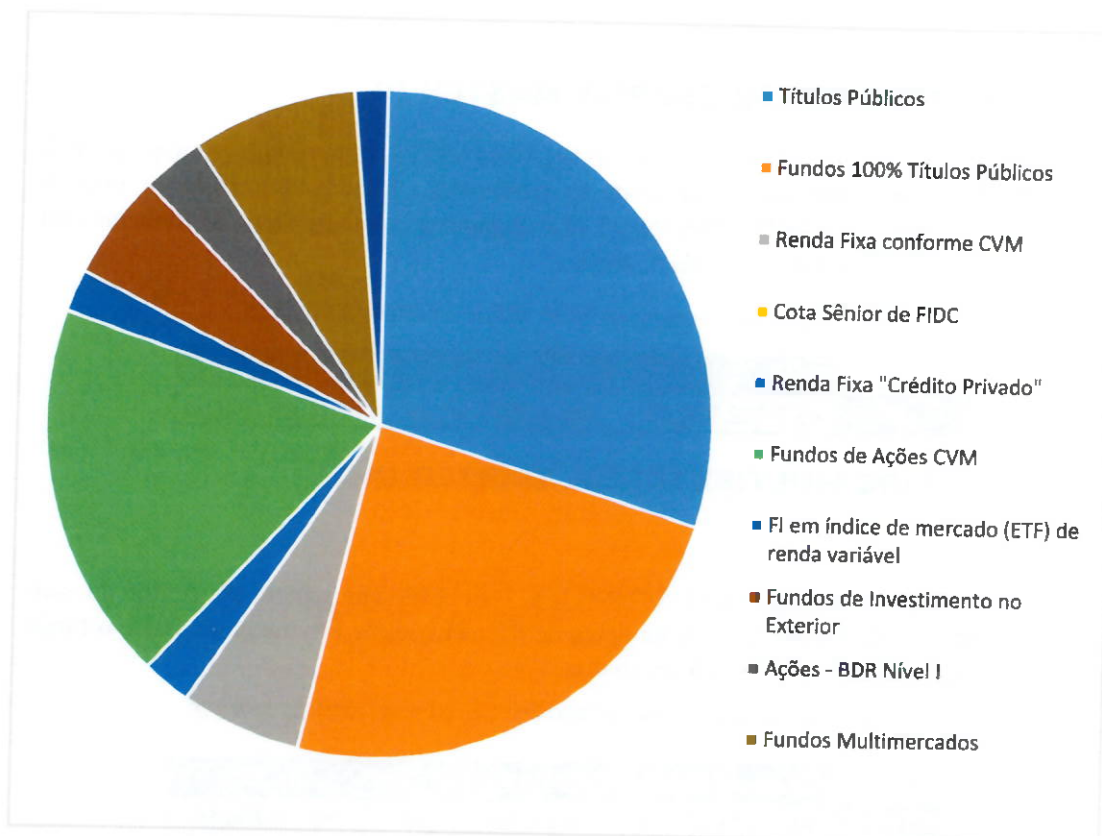
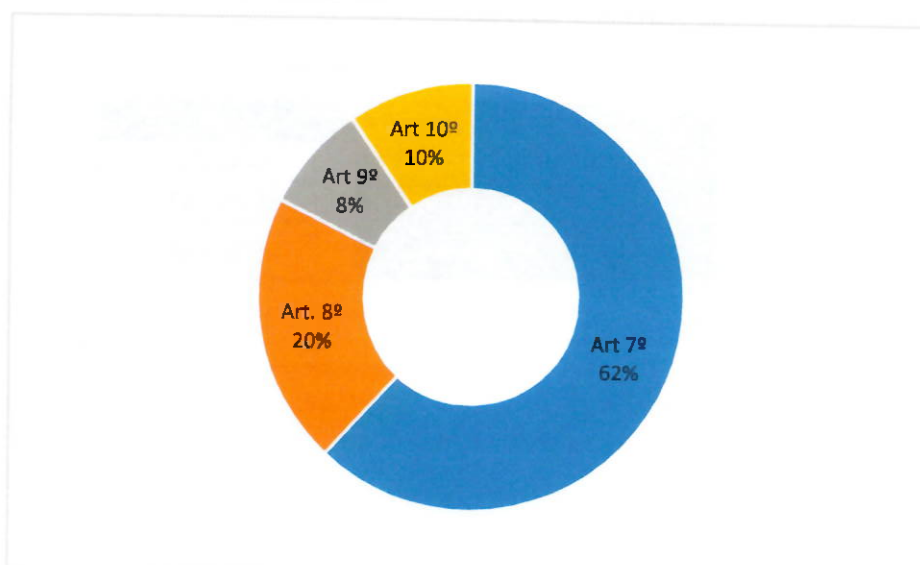


Gráfico 2 Distribuição do Patrimônio por Artigo



8. FUNDOS ESTRESSADOS

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

8.1. FIDC MULTISSETORIAL MASTER III

Em março de 2022, o fundo FIDC MULTISSETORIAL MASTER III apresentava um prejuízo de R\$ - 429.297,33 e, numa somatória junto ao rendimento, R\$ - 1.807.770,35, 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
TOTAIS :	R\$ 7.368.930,01	-R\$ 1.807.770,35	R\$ 6.908.769,93

8.2. FIDC MULTISSETORIAL MASTER III

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

Tabela 6 Acompanhamento geral PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP

PÁTRIA	Total Aplicado	Rendimento Total	Saldo
TOTAIS :	R\$ 2.823.363,14	-R\$ 2.809.653,88	R\$ 13.708,69

No acompanhamento do ano vigente, em março de 2022, o fundo possuía R\$ 13.708,69, aproximadamente 0,002% do patrimônio do IPMJ

Tabela 7 Acompanhamento mensal Pátria

		PÁTRIA
2022	Janeiro	R\$ 41,89
	Fevereiro	-R\$ 293,47
	Março	-R\$ 13.189

8.3. Fundos Estruturados (FIP)

O fundo KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTISTRATÉGIA FIP, apresentava R\$ R\$ 10.251.415,65, cerca de 1,602% do patrimônio líquido do Instituto. Tendo-se, os seguintes números:

Tabela 8 Acompanhamento geral KINEA (Mar/2022)

KINEA	Total Aplicado	Rendimento Total	Amortizações
TOTAIS :	R\$ 7.537.557,00	R\$ 2.713.858,76	R\$ 3.115.488,50

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
	Março	R\$ 57.912,12

9. ALOCAÇÃO POR INSTITUIÇÃO

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

Tabela 10 Alocação por gestora, em março

Patrimônio x Gestoras (Posição: 31/03/2022)		
GESTORES	PL do IPMJ	%
TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN (Selic)	189.758.370,11	29,7%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	95.121.849,58	14,9%
BANCO DO BRASIL S/A	58.257.773,20	9,1%
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM	44.630.960,54	7,0%
ITÁU UNIBANCO S/A.	39.615.916,49	6,2%
NAVI CAPITAL ADM. GESTORA RF LTDA.	35.818.753,99	5,6%
OCCAM BRASIL	31.226.790,06	4,9%
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA.	30.919.681,26	4,8%
BANCO J. SAFRA S.A	19.126.590,85	3,0%
PORTO SEGURO	15.475.093,88	2,4%
BRAM BRADESCO ASSET M. SA. DTVM	14.802.987,07	2,3%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	12.101.157,78	1,9%
KINEA PRIVATE EQUITY INVEST. S.A.	10.251.415,65	1,6%
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS	8.605.411,20	1,345%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL LTDA.	8.547.467,95	1,336%
TARPON INVESTIMENTOS	6.751.753,55	1,055%
SCHRODER INVESTMENT BRASIL LTDA.	5.082.456,55	0,794%
SUL AMÉRICA INVEST. GESTORA REC. S.A.	5.066.234,69	0,792%
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	3.305.771,80	0,517%
META ASSET MANAGEMENT LTDA	2.669.900,54	0,417%
GENIAL INVESTIMENTOS	2.597.834,40	0,406%
BRPP GESTÃO PROD. ESTRUT. LTDA.	30.862,76	0,005%
PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.	13.708,69	0,002%
TOTAL PATRIMÔNIO LÍQUIDO	639.765.033,89	100,0%

10. RISCO (VaR) DOS FUNDOS NA CARTEIRA

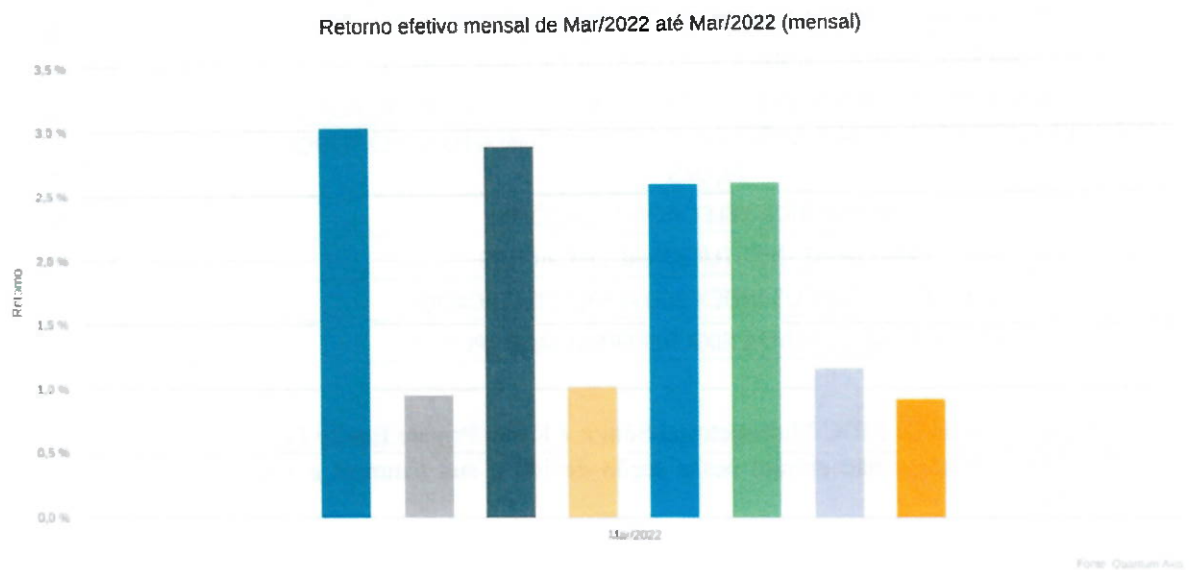
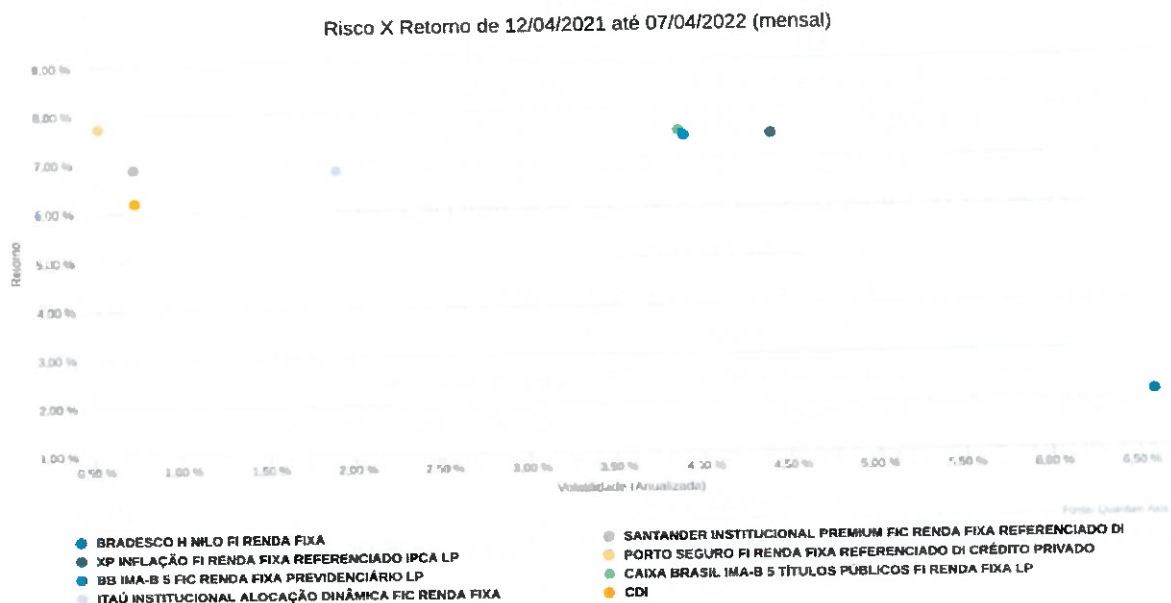
Nome	VaR 95% MV 21 du (12 meses)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	9,97%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,29%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	11,64%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	2,98%
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	8,93%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11,47%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	7,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,27%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	20,07%
INDIE FIC AÇÕES	12,86%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	9,02%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	8,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,55%
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	11,04%
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	11,08%
META VALOR FI AÇÕES	10,84%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	12,71%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9,41%
OCCAM FIC AÇÕES	8,52%
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	-
PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,10%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8,70%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,09%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	8,52%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	11,45%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	8,47%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7,11%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1,79%

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.

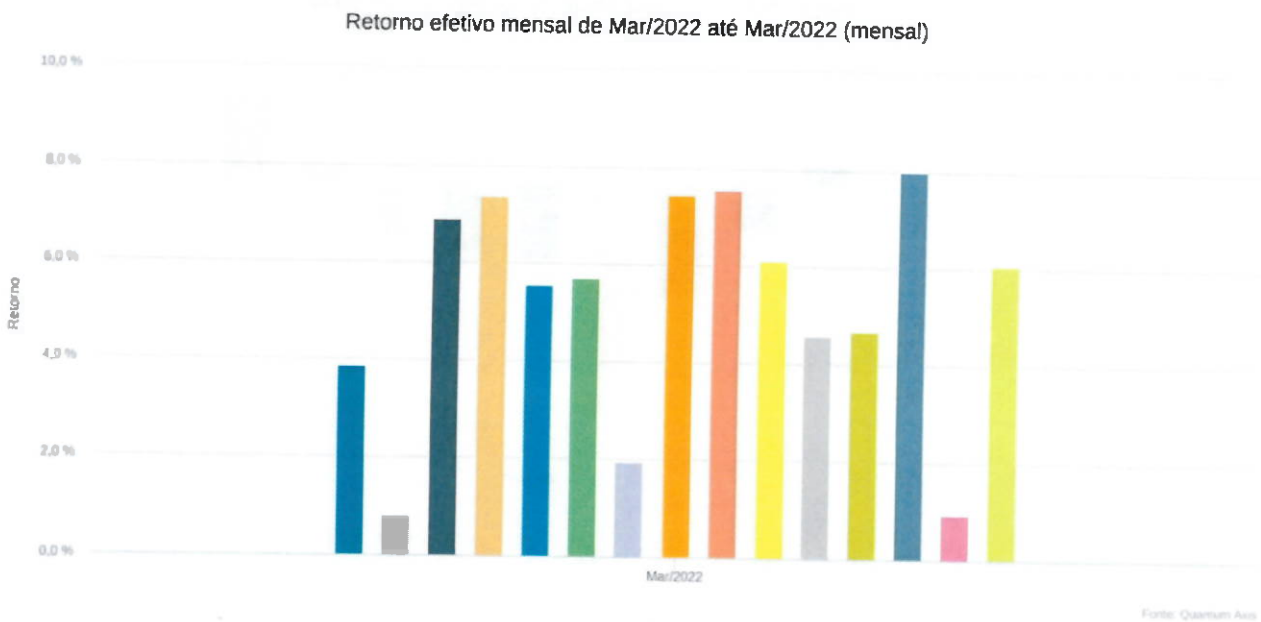
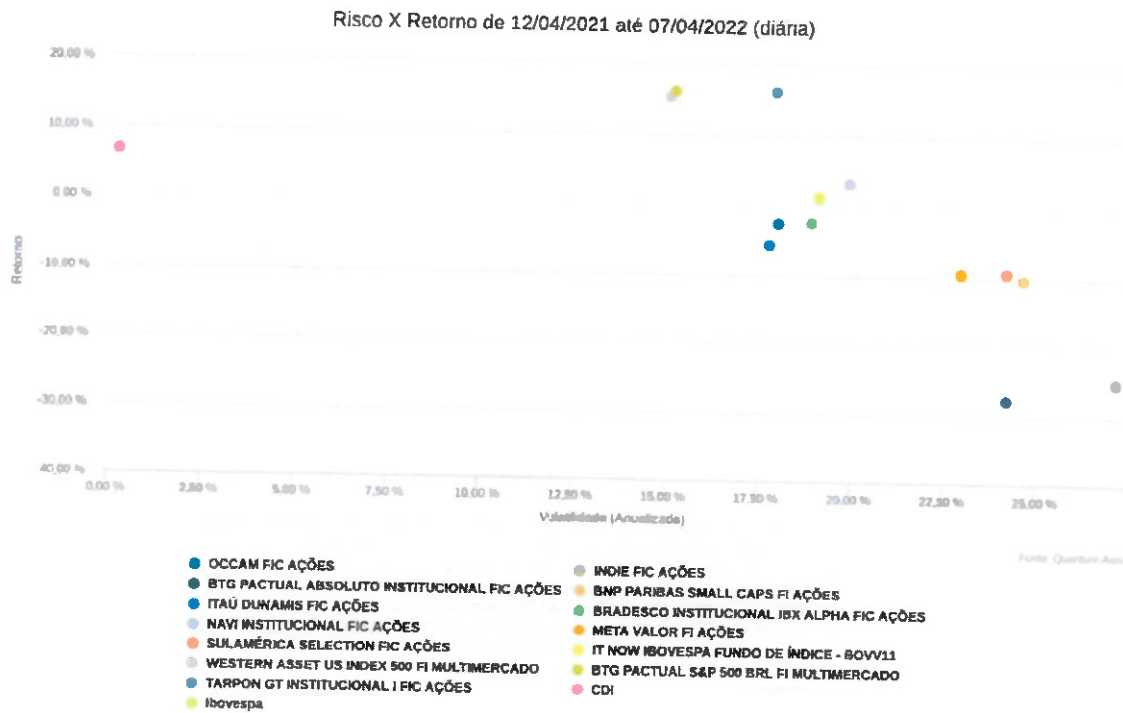
11. DEMONSTRAÇÃO DOS FUNDOS POR SEGMENTO

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.

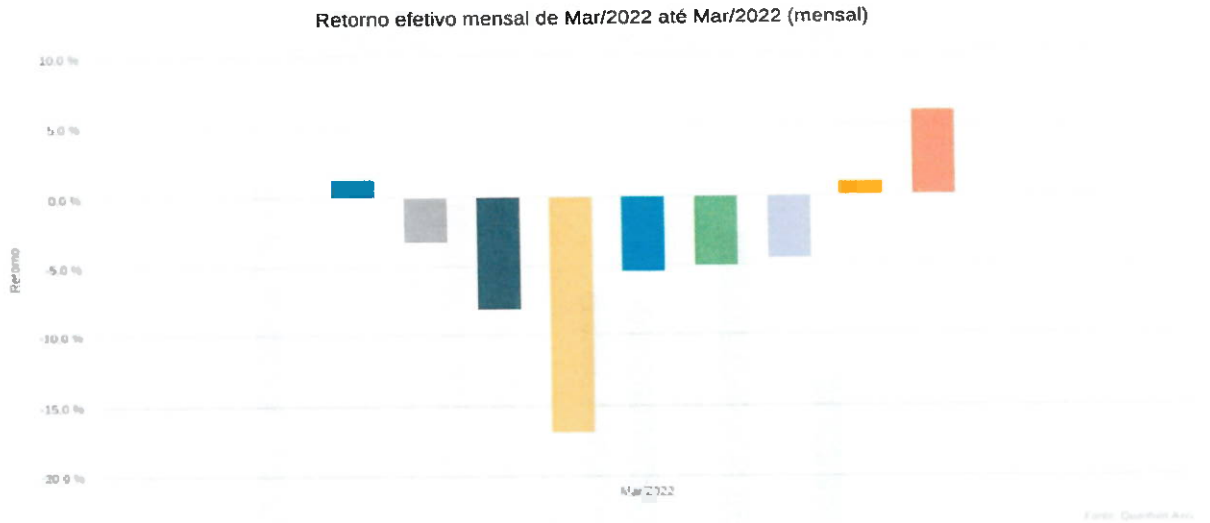
11.1. Renda Fixa



11.2. Renda Variável



11.3. Exterior



12. AGENDA REALIZADA

- 09 a 11 março:

4º Congresso Brasileiro de Investimentos de RPPS, realizado em Florianópolis, esteve presente Amauri Arnaldo Junior e Rafaela Carvalho dos Santos ambos membros de CAIF em companhia da presidente Rossana Vasques, evento realizado pela ABIPEM, para esclarecimentos da nova resolução e demais assuntos.

- 16 março:

360ª reunião do CAIF, iniciada às 9 horas da manhã na modalidade presencial, contou com as presenças dos membros do Comitê de Investimentos Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Fabíola de Melo Silva - Assessora da Presidência e Gestora dos Recursos no mês de março, Rafaela Carvalho dos Santos e Victor Adriano Vieira Silva, na qual realizaram a análise parcial da carteira do mês de março e a carteira fechada de fevereiro. Na presente reunião a presidente Rossana Vasques aproveitou para apresentar o recém nomeado Assessor da Presidência, Luís Gustavo Ferreira Bonacina em substituição ao Sr. Vanderlei Massarioli exonerado em 28 de fevereiro de 2022.

- 21 de março:

11ª reunião extraordinária do CAIF, iniciada as 12:01 horas da tarde na modalidade on-line , fez se necessária para alteração da meta da Política de Investimentos 2022 de IPCA +5,50 para IPCA +4,83, em resposta à consulta solicitada junto a GesCon no dia 10 de março de 2022, contou com a presença Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Clévio Vitor de Almeida, Rafaela Carvalho dos Santos, Victor Adriano Vieira Silva e José Ricardo Vinhas. Participaram da reunião a Assessora da Presidência a Sr. Fabiola de Melo Silva.

- 25 de março:

361ª reunião do CAIF iniciada as 9:09 horas da manhã na modalidade presencial, apresentada carteira parcial de março até o dia 22, contou com a presença Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Rafaela Carvalho dos Santos, Victor Adriano Vieira Silva. Participaram da reunião a Assessora da Presidência a Sr. Fabiola de Melo Silva, as 10 horas iniciou a reunião com o representante da gestora da Trígono Capital, para apresentação dos fundos de investimentos para RPPS, contou com a participação da presidente Rossana Vasques e do Assessor Luís Gustavo Ferreira Bonacina.

