



RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Abril 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 Abril.....	7
7. Conformidade com a Política de Investimentos.....	10
7.1. Demonstrações Gráficas.....	11
8. Fundos Estressados.....	12
8.1. FIDC MULTISSETORIAL MASTER III.....	12
8.2. PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP.....	12
9. Fundos Estruturados (FIP).....	13
10. Alocação por Instituição.....	14
11. Risco (VaR) dos Fundos na Carteira.....	15
12. Demonstração dos fundos por segmento.....	16
12.1. Renda Fixa.....	16
12.2. Renda Variável.....	18
12.3. Exterior.....	20
13. Agenda Realizada.....	22

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 abril 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



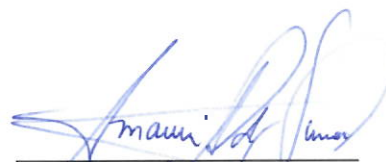
Luís Gustavo Ferreira Bonacina
Assessor da Presidência - CPA-20

**AUSÊNCIA
JUSTIFICADA**

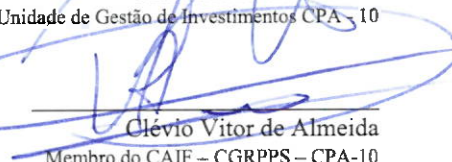
Rafaela Carvalho dos Santos
Membro do CAIF

**AUSÊNCIA
JUSTIFICADA**

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 - CGRPPS - CPA-10

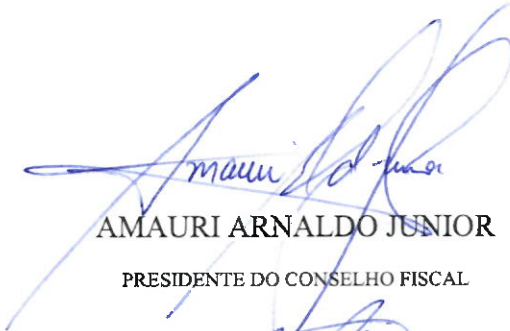


Victor Adriano Vieira Silva
Membro do CAIF - CGRPPS


2. RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Aos 25 dias de maio 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 abril 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 abril de 2022.


Jacareí, 25 de maio 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 abril de 2022.

4. CENÁRIO ECONÔMICO

Em abril o mercado doméstico começou seguindo a tendência de alta do mês anterior, em grande parte ainda, pela entrada de capital estrangeiro. No dia 1^a de abril, o Ibovespa fechou na maior pontuação em 8 meses com 121.570,15 pontos. Este foi um ponto de inflexão. Desde então, a Bolsa brasileira entrou em uma tendência de queda até fechar o mês em 107.876,16 pontos. Pesou sobre o índice a greve dos servidores do Banco Central e as incertezas sobre o comando da Petrobras, que teve as desistências de Rodolfo Landim e de Adriano Pires ao cargo de CEO da estatal, até finalmente José Mauro Ferreira Coelho tomar posse como novo presidente da Petrobras no dia 14. A inflação foi de 1,62%, maior variação para o mês de março desde 1994 e bem acima das expectativas do mercado o que traz preocupações de investidores estrangeiros no mercado brasileiro.

No mercado externo, os Estados Unidos enfrentam a maior inflação dos últimos 40 anos, o que fez com que o Banco Central Americano (FED) elevasse a taxa de Juros do país em 0,5 pontos percentuais, a maior alta em mais de 22 anos. A atividade varejista e industrial da China caiu bruscamente em abril, uma vez que os *lockdowns* contra a covid-19 confinaram trabalhadores e consumidores em suas casas e afetaram gravemente as cadeias de abastecimento, lançando uma sombra sobre as perspectivas para a segunda maior economia do mundo.

5. DESEMPENHO E MOVIMENTAÇÕES

O patrimônio do IPMJ no fechamento do mês de abril de 2022 foi de R\$ 627.835.204,98 (seiscentos e vinte e sete milhões e oitocentos e trinta e cinco mil e duzentos e quatro reais e noventa e oito centavos).

A carteira de renda fixa rendeu no mês R\$ 6.167.938,86 (seis milhões, cento e sessenta e sete reais, novecentos e trinta e oito reais e oitenta e seis centavos). Com a carteira de renda variável a rentabilidade foi de R\$ -13.239.929,61 (treze milhões e duzentos e trinta e nove mil e novecentos e vinte e nove reais e sessenta e um centavos negativos). A carteira do exterior rendeu R\$ -4.399.651,62 (quatro milhões e trezentos e noventa e nove mil e seiscentos e cinquenta e um reais e sessenta e dois 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
Abr	R\$ 6.167.938,86	-R\$ 13.239.929,61	-R\$ 4.399.651,62	-R\$ 11.471.642,38
Cupons / Amortizações	R\$ 2.416.905,19	R\$ 2.117.806,90	R\$ -	R\$ -
Total Ano	R\$ 20.172.890,86	-R\$ 291.336,39	-R\$ 18.551.018,63	R\$ 1.330.535,84

Assim, a rentabilidade da carteira, no mês de abril de 2022 foi de R\$ - 11.471.642,38 (onze milhões, quatrocentos e setenta e um mil, seiscentos e quarenta e dois reais e trinta e oito centavos negativos). O rendimento acumulado no ano fechou o mês de abril de 2022 em R\$ 1.330.535,84 (um milhão e trezentos e trinta mil e quinhentos e trinta e cinco reais e oitenta e quatro centavos). Por fim, a rentabilidade acumulada da carteira no mês foi de -1,84% e no ano foi de 0,043%, atingindo -207,48% da meta atuarial mensal e 1,12% da meta atuarial anual.

Tabela 2 Investimento - Saldo mensal

	Renda Fixa	Renda Variável	Exterior	Total
Janeiro	R\$ 386.794.806,56	R\$ 185.453.128,63	R\$ 57.263.568,34	R\$ 629.511.503,52
Fevereiro	R\$ 390.832.814,82	R\$ 184.181.358,67	R\$ 53.755.571,26	R\$ 628.769.744,75
Março	R\$ 396.035.127,30	R\$ 191.994.148,83	R\$ 51.749.466,38	R\$ 639.778.742,51
Abril	R\$ 408.784.366,36	R\$ 171.701.023,85	R\$ 47.349.814,79	R\$ 627.835.204,98

Tabela 3 Relatório Mensal de Investimentos – abril

Tipo de Aplicação	Renda Fixa	Renda Variável	Exterior	Total
Saldo mês anterior	R\$ 396.035.127,30	R\$ 191.994.148,88	R\$ 51.749.466,83	R\$ 639.778.742,51
Aplicações no mês	R\$ 14.915.100,00	R\$ 6.000.000,00	R\$ -	R\$ 20.915.100,00
Resgates no mês	-R\$ 8.333.800,00	-R\$ 13.053.195,39	R\$ -	-R\$ 21.386.995,39
Rendimento no mês	R\$ 6.167.938,86	-R\$ 13.239.929,61	-R\$ 4.399.651,62	-R\$ 11.471.642,38
Cupons e Amortizações (mês)	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -
Saldo final do mês	R\$ 408.784.366,36	R\$ 171.701.023,85	R\$ 47.349.814,77	R\$ 627.835.204,97
Rendimento no mês %	1,51%	-7,71%	-9,29%	2,13%

Em relação as movimentações, considerando o risco de queda do Ibovespa, optou-se pelo resgate total do fundo IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11, que é um fundo que é atrelado ao índice da bolsa brasileira. O resgate foi solicitado no pregão de 04/04/2022 com o Ibovespa atingindo os 121.279,51 pontos. Considerando a necessidade de produtos descorrelacionados para diversificação da carteira, foi aplicado R\$ 6.000.000,00 (seis milhões de reais) no fundo TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS FIC AÇÕES.

6. CARTEIRA DE ABRIL

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

Posição: 29/04/2022

		MÊS	ANO
CDI ACUMULADO:		0,83%	3,29%
DESEMPENHO DA CARTEIRA:		-1,84%	0,043%
META ATUARIAL (IPCA + 4,83%):		0,89%	3,85%
RENTABILIDADE DA CARTEIRA x META ATUARIAL:		-207,48	1,12
PATRIMÔNIO LÍQUIDO:		R\$	627.835.204,98

BANCO / FUNDO	Patrimônio IPMJ (R\$)	% PATRIMÔNIO	LIMITE da 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 (R\$)	Ano (R\$)	Mês (%)	Ano (%)	Mês (%)	Ano (%)
				Art. 7º I a 100%	44,50%	70,00%							
TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN (Selic)				30,75%	30,75%	-	2.416.905,19	3.331.076,84	7.512.216,85	1,75	1,89	196,629	49,172
				Art. 7º I b 100%	6,50%	70%							
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP				15,38%	24,80%	-	-	1.460.881,69	5.011.756,21	1,54	5,35	172,761	139,178
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI				9,42%		-	-	889.876,97	3.029.647,44	1,53	5,32	171,82	138,47
				Art. 7º III a 60%	6,00%	30%							
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA (T.A)				2,28%	7,06%	-	-	110.301,51	475.248,20	0,78	3,43	87,317	89,271
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA				1,47%		-	-	56.611,16	295.791,04	0,62	3,31	69,496	86,200
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI				2,21%		-	-	116.381,40	603.880,56	0,83	3,45	93,29	89,73
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI				0,23%		-	-	11.953,50	52.793,24	0,83	3,45	93,29	89,73
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP				0,87%		-	-	59.638,63	242.406,72	1,10	4,64	123,95	120,54
				Art. 7º V a 5%	0,50%	2,0%							
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR				0,004%	0,004%	-	-	-4.376,82	-4.229,93	-14,18	-13,77	-1595,3	-358,1
				Art. 7º V b 5%	1,50%	5,0%							
PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO				2,486%	2,49%	-	-	135.593,98	536.475,56	0,88	3,56	98,6	92,6
TOTAL RENDA FIXA*		408.784.366,36	65,11%				2.416.905,19	6.167.938,86	17.755.985,67				

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

Posição: 29/04/2022

		MÊS	ANO
CDI ACUMULADO:		0,83%	3,29%
DESEMPENHO DA CARTEIRA:		-1,84%	0,043%
META ATUARIAL (IPCA + 4,83%):		0,89%	3,85%
RENTABILIDADE DA CARTEIRA x META ATUARIAL:		-207,48	1,12
PATRIMÔNIO LÍQUIDO:		R\$	627.835.204,98

BANCO / FUNDO	Patrimônio IPMJ (R\$)	% PATRIMÔNIO	LIMITE da 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 (R\$)	Ano (R\$)	Mês (%)	Ano (%)	Mês (%)	Ano (%)
				Art. 8º I	30%	18,00%	30%						
OCCAM FIC AÇÕES	28.510.992,47	4,54%	18,31%			-	-	-2.715.797,59	577.140,39	-8,70	2,07	-978,32	53,73
INDIE FIC AÇÕES	3.435.900,72	0,55%				-	-	-434.460,42	-450.580,20	-11,23	-0,48	-1262,73	-12,54
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.023.627,29	0,80%				-	-	-618.360,62	-110.823,71	-10,96	-2,16	-1232,88	-56,13
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FI AÇÕES	6.164.886,50	0,98%						164.886,50	164.886,50	0,45	0,45	50,08	11,58
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	8.096.049,69	1,29%				-	-	-451.418,26	303.510,53	-5,28	3,89	-594,09	101,29
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	11.706.091,38	1,86%				-	-	-789.016,14	-119.395,57	-6,31	-1,01	-710,32	-26,26
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	5.069.807,64	0,81%				-	-	-569.932,95	170.378,04	-10,11	3,48	-1136,78	90,44
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	33.454.754,15	5,33%				-	-	-2.363.999,84	332.581,80	-6,60	1,00	-742,42	26,11
META VALOR FIC AÇÕES	2.394.677,00	0,38%				-	-	-275.223,54	81.534,81	-10,31	3,52	-1159,58	91,67
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	6.319.454,92	1,01%				-	-	-432.298,63	442.357,96	-6,40	-6,03	-720,24	-156,84
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	4.752.572,27	0,76%			-	-	-313.662,37	-132.187,26	-6,19	-2,71	-696,45	-70,38	
Art. 8º II				0,50%	10%								
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	0,00	0,00%		0,00%			-	-	142.399,19	1,29	16,05	1387,64	530,46
Art. 10º I				8,00%	10%								
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	40.713.600,73	6,48%		7,42%			-	-	-3.917.359,81	-8,78	-11,46	-987,34	-297,96
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	5.892.913,01	0,94%					-	-	-566.256,86	-8,77	-11,40	-986,16	-296,55
Art. 10º II				2,00%	5,0%								
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	13.735,33	0,002%		1,62%			-	-	26,64	0,19	-49,4	21,85	-1284,92
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTISTRATÉGIA FIP	10.151.960,75	1,617%				-	2.117.806,90	-99.454,90	587.273,18	-1,0	-0,970	-109,13	-25,23
TOTAL RENDA VARIÁVEL¹	171.701.023,85	27,35%				2.117.806,90	-13.239.929,61	-2.409.143,29					

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS													
Posição: 29/04/2022													
												MÊS	ANO
CDI ACUMULADO:												0,83%	3,29%
DESEMPENHO DA CARTEIRA:												-1,84%	0,043%
META ATUARIAL (IPCA + 4,83%):												0,89%	3,85%
RENTABILIDADE DA CARTEIRA x META ATUARIAL:												-207,48	1,12
PATRIMÔNIO LÍQUIDO:												R\$	627.835.204,98
BANCO / FUNDO	Patrimônio IPMJ (R\$)	% PATRIMÔNIO	LIMITE da 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 (R\$)	Ano (R\$)	Mês (%)	Ano (%)	Mês (%)	Ano (%)
				Art. 9º II		3,00%	10%						
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	14.575.684,69	2,32%	4,72%	-	-	-	-	-1.785.763,05	-4.168.109,98	-10,91	-22,24	-1227,76	-578,32
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	2.976.531,25	0,47%		-	-	-	-	-329.240,55	-1.418.090,79	-9,96	-32,27	-1120,34	-839,20
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	2.429.192,85	0,39%		-	-	-	-	-239.154,79	-1.490.628,37	-8,96	-38,03	-1008,20	-988,98
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	2.545.635,04	0,41%		-	-	-	-	-61.382,36	-1.290.864,94	-2,35	-33,85	-264,86	-875,04
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	2.219.605,10	0,35%		-	-	-	-	-378.229,30	-1.934.500,24	-14,56	-46,57	-1637,77	-1211,08
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	4.910.410,85	0,78%		-	-	-	-	-172.045,70	-1.465.669,63	-3,39	-22,99	-380,79	-597,81
				Art. 9º III		5,00%	10%						
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	17.692.754,99	2,82%	2,82%	-	-	-	-	-1.433.835,86	-6.783.154,68	-7,50	-27,71	-843,28	-720,74
TOTAL EXTERIOR*	47.349.814,79	7,54%						-4.399.651,62	-18.551.018,63				
TOTAL PATRIMÔNIO LÍQUIDO	627.835.204,98	100%											
RENDIMENTO NO MÊS	-11.471.642,38												
RENDIMENTO ANUALIZADO*	1.330.535,84												

* 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 4.963/2021

Enquadramento	Tipo de Ativo	Alocação Objetivo	Limite Superior	Alocado	Total
Art. 7º, I, "a"	Títulos Públicos	44,50%	70%	30,75%	65,11%
Art. 7º, I, "b"	Fundos 100% Títulos Públicos	6,50%	70%	24,80%	
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%	7,06%	
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%	0,004%	
Art. 7º, V, "b"	Renda Fixa "Crédito Privado"	1,50%	5%	2,49%	
Art. 7º, V, "c"	Fundo de Debêntures	0,00%	1%	0,00%	
Art. 8º, I	Fundos de Ações CVM	18,00%	30%	18,31%	
Art. 8º, II	FI em índice de mercado (ETF) de renda variável	0,50%	10%	0,00%	
Art. 9º, I	Renda Fixa - Dívida Externa	0,00%	1%	0,00%	7,54%
Art. 9º, II	Fundos de Investimento no Exterior	3,00%	10%	4,72%	
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	5,00%	10%	2,82%	
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	8,00%	10%	7,42%	9,04%
Art. 10º, II	Fundos de Participações	2,00%	5%	1,62%	
Art. 10º, III	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 Anual de Investimentos.

Gráfico 1 Demonstração Gráfica Alocação por tipo de ativo

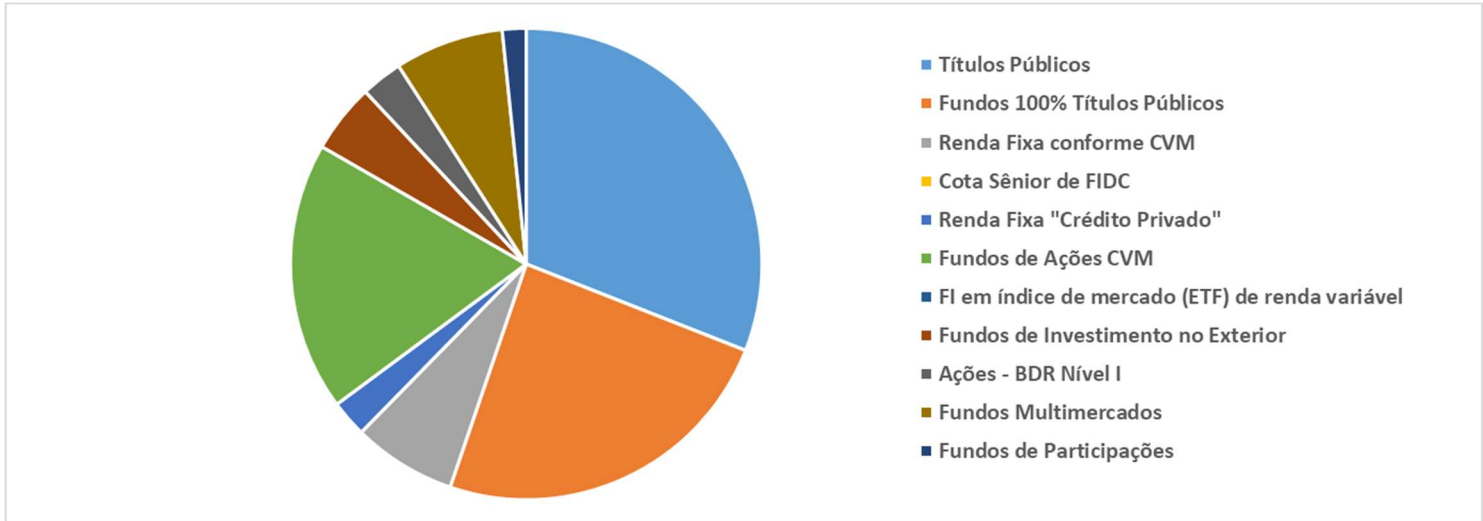
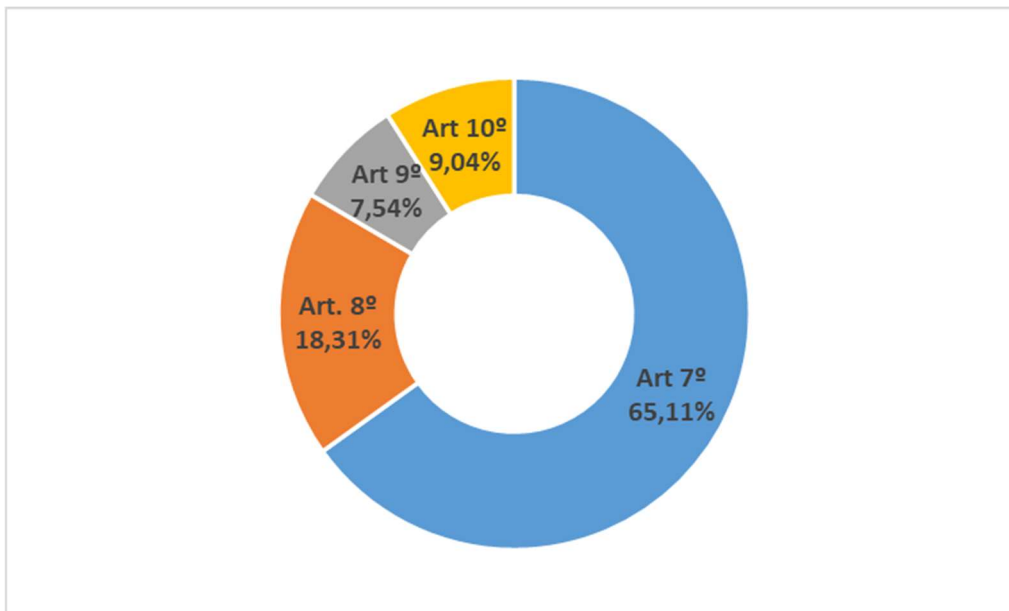


Gráfico 2 Distribuição do Patrimônio por Artigo



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 abril de 2022, o fundo FIDC MULTISSETORIAL MASTER III apresentava um prejuízo de R\$ - 429.297,33 e numa somatória junto ao rendimento negativo, 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. PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP

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 abril 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\$ 2.809.627,24	R\$ 13.735,34

No acompanhamento do ano vigente, em abril de 2022, o fundo possuía R\$ 13.735,34 aproximadamente 0,002% do patrimônio do IPMJ

Tabela 7 Acompanhamento mensal Pátria

		PÁTRIA
2022	Janeiro	R\$ 41,89
	Fevereiro	-R\$ 293,47
	Março	-R\$ 13.188,62
	Abril	R\$ 26,63

9. FUNDOS ESTRUTURADOS (FIP)

O fundo KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTISTRATÉGIA FIP, apresentava R\$ 10.151.960,75, cerca de 1,617% do patrimônio líquido do Instituto. Tendo-se, os seguintes números:

Tabela 8 Acompanhamento geral KINEA (abril/2022)

KINEA	Total Aplicado	Rendimento Total	Amortizações
TOTAIS :	R\$ 7.537.557,00	R\$ 2.027.130,68	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
	Abril	-R\$ 99.454,90

10. ALOCAÇÃO POR INSTITUIÇÃO

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

Tabela 10 Alocação por gestora, em abril

Patrimônio x Gestoras (Posição: 29/04/2022)		
GESTORES	PL do IPMJ	%
TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN (Selic)	193.089.447,13	30,75%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	96.582.731,27	15,38%
BANCO DO BRASIL S/A	59.147.650,17	9,42%
WESTERN ASSET MANAGEMENT DTVM	40.713.600,73	6,48%
NAVI CAPITAL ADM. GESTORA RF LTDA.	33.454.754,15	5,33%
OCCAM BRASIL	28.510.992,47	4,54%
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA.	28.458.559,27	4,53%
ITÁU UNIBANCO S/A.	26.026.405,67	4,15%
BANCO J. SAFRA S.A	17.692.754,99	2,82%
PORTO SEGURO	15.610.687,86	2,49%
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS	15.315.046,10	2,44%
BRAM BRADESCO ASSET M. SA. DTVM	14.289.665,27	2,28%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	10.916.540,31	1,74%
KINEA PRIVATE EQUITY INVEST. S.A.	10.151.960,75	1,62%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL LTDA.	8.096.049,69	1,29%
TARPON INVESTIMENTOS	6.319.454,92	1,01%
TRÍGONO CAPITAL LTDA.	6.164.886,50	0,98%
SCHRODER INVESTMENT BRASIL LTDA.	4.910.410,85	0,78%
SUL AMÉRICA INVEST. GESTORA REC. S.A.	4.752.572,27	0,76%
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	2.976.531,25	0,47%
META ASSET MANAGEMENT LTDA	2.394.677,00	0,38%
GENIAL INVESTIMENTOS	2.219.605,10	0,35%
BRPP GESTÃO PROD. ESTRUT. LTDA.	26.485,94	0,004%
PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.	13.735,33	0,002%
TOTAL PATRIMÔNIO LÍQUIDO	627.835.204,98	100,0%

11. RISCO (VAR) DOS FUNDOS NA CARTEIRA

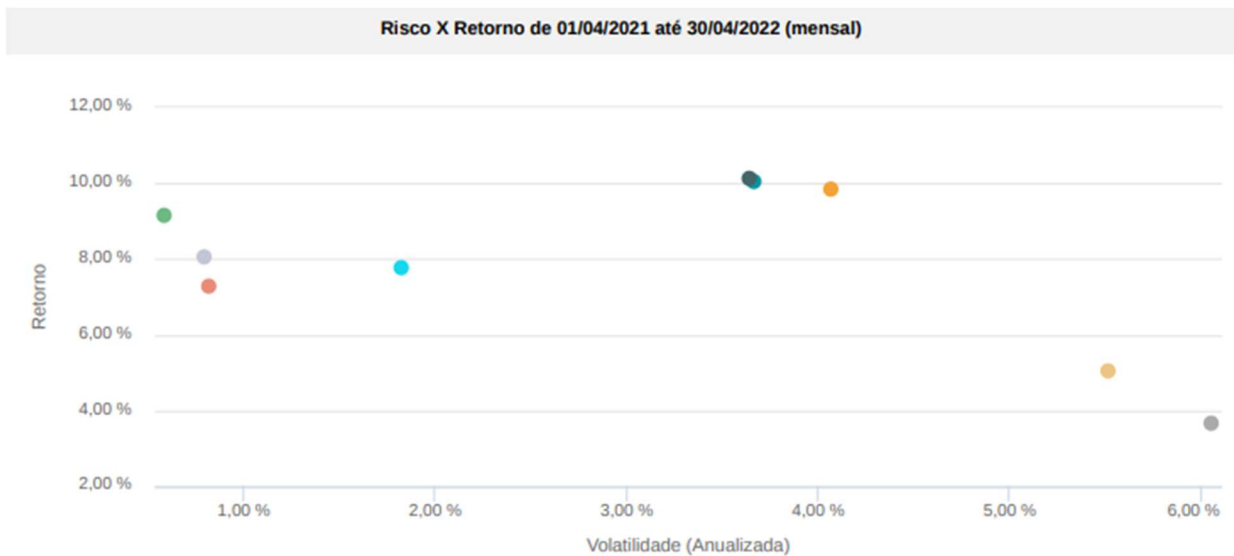
Nome	VaR 95% MV 21 du (12 meses)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	15,38%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,02%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	8,85%
BRADERCO H NILO FI RENDA FIXA	2,50%
BRADERCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	8,56%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,36%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	12,88%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,01%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,27%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	20,98%
INDIE FIC AÇÕES	10,98%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,06%
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	14,92%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	-
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	13,88%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-
META VALOR FI AÇÕES	9,47%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	14,87%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7,06%
OCCAM FIC AÇÕES	7,46%
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	0,67%
PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,01%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	14,20%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,02%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	11,55%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	9,34%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	8,91%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,77%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	12,80%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1,61%

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.

12. DEMONSTRAÇÃO DOS FUNDOS POR SEGMENTO

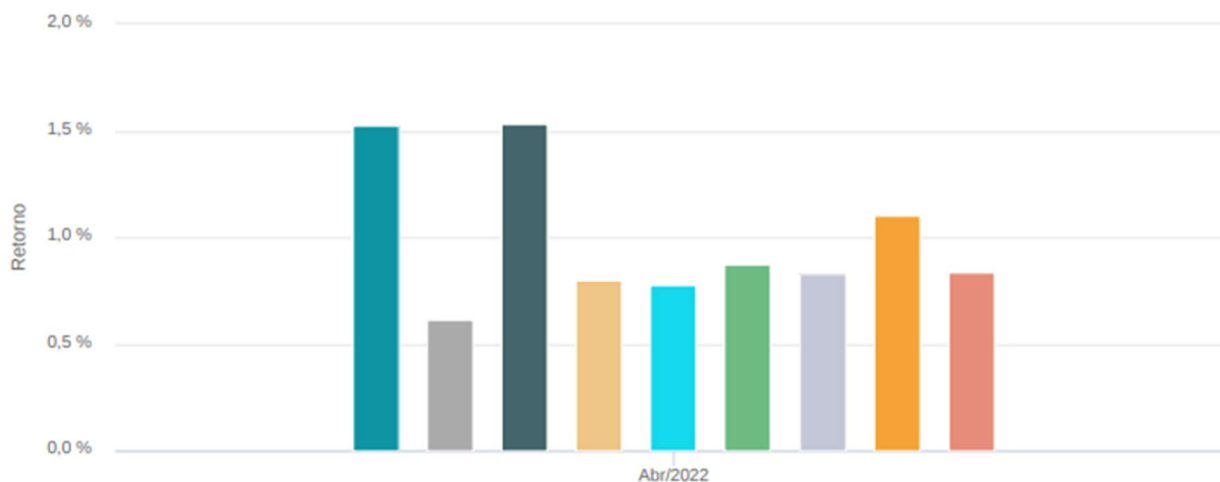
Esta seção retrata a demonstração dos fundos na carteira nos últimos 12 meses, desta forma, com relação ao retorno efetivo mensal, para um fundo que entrou na carteira após o início deste, deve-se considerar a partir do mês fechado subsequente. Acompanhamentos individuais de retorno são realizados pelo Instituto e aqui apresentados na carteira na seção 4.

12.1. Renda Fixa



Ativo	Retorno	Volatilidade (Anualizada)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	10,04 %	3,67 %
BRADERCO H NILO FI RENDA FIXA	3,68 %	6,05 %
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10,15 %	3,64 %
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,07 %	5,52 %
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	7,75 %	1,82 %
PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	9,16 %	0,59 %
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8,05 %	0,79 %
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	9,85 %	4,07 %
CDI	7,30 %	0,82 %

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



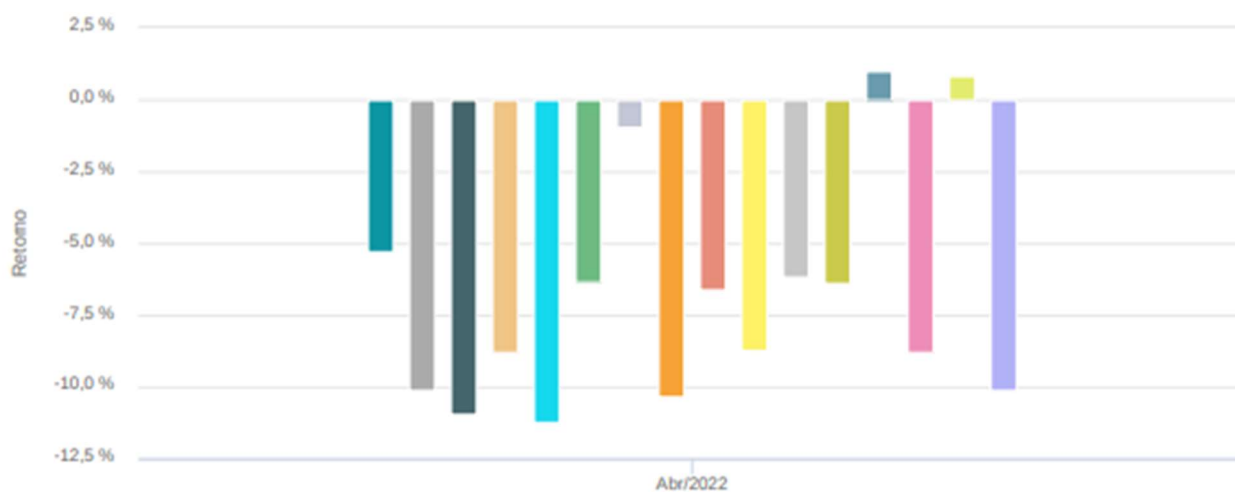
Ativo	Retorno	Retorno YTD*	Mínimo	Máximo
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,53 %	5,32 %	1,53 %	1,53 %
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	0,62 %	3,31 %	0,62 %	0,62 %
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,54 %	5,35 %	1,54 %	1,54 %
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80 %	3,65 %	0,80 %	0,80 %
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,78 %	3,43 %	0,78 %	0,78 %
PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,88 %	3,56 %	0,88 %	0,88 %
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,83 %	3,45 %	0,83 %	0,83 %
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1,10 %	4,64 %	1,10 %	1,10 %
CDI	0,83 %	3,28 %	0,83 %	0,83 %

12.2. Renda Variável



Ativo	Retorno	Volatilidade (Anualizada)
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-11,31 %	21,91 %
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	-10,11 %	19,38 %
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-32,27 %	21,79 %
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	10,73 %	16,95 %
INDIE FIC AÇÕES	-30,73 %	22,07 %
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-10,42 %	15,91 %
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,75 %	5,68 %
META VALOR FI AÇÕES	-17,29 %	22,34 %
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,56 %	18,01 %
OCCAM FIC AÇÕES	-8,47 %	16,61 %
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	-11,36 %	25,51 %
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	20,10 %	20,83 %
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	21,25 %	24,74 %
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	9,98 %	16,88 %
CDI	7,30 %	0,82 %
Ibovespa	-7,51 %	18,66 %

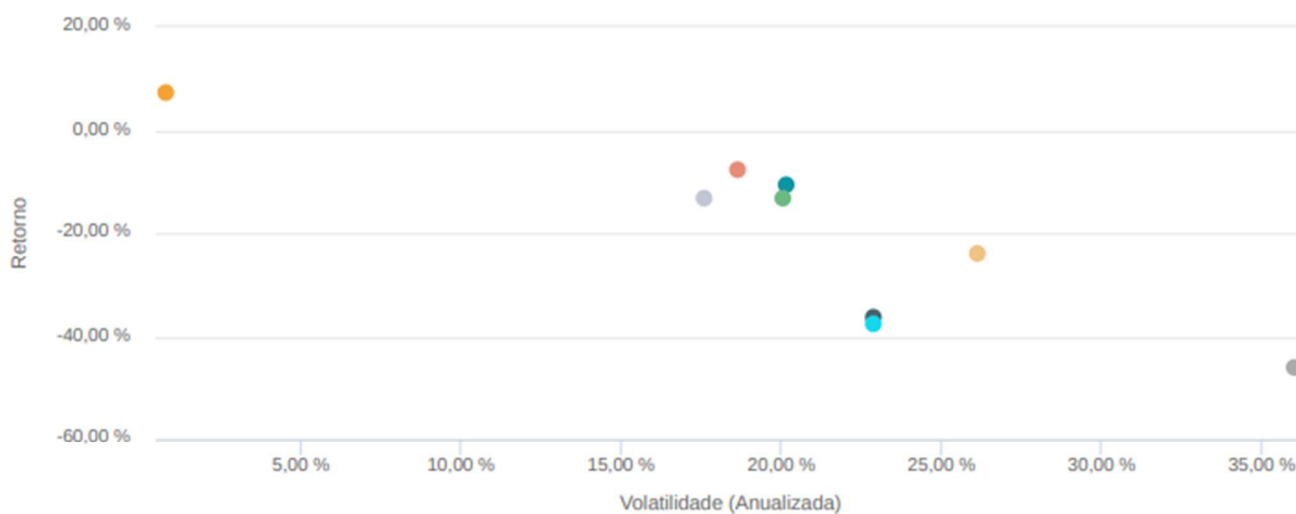
Retorno efetivo mensal de Abr/2022 até Abr/2022 (mensal)



Ativo	Retorno	Retorno YTD*	Mínimo	Máximo
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-5,28 %	3,89 %	-5,28 %	-5,28 %
BRADERCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	-10,11 %	3,48 %	-10,11 %	-10,11 %
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-10,96 %	-2,16 %	-10,96 %	-10,96 %
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-8,77 %	-11,40 %	-8,77 %	-8,77 %
INDIE FIC AÇÕES	-11,23 %	-11,59 %	-11,23 %	-11,23 %
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-6,31 %	-1,01 %	-6,31 %	-6,31 %
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,97 %	6,14 %	-0,97 %	-0,97 %
META VALOR FI AÇÕES	-10,31 %	3,52 %	-10,31 %	-10,31 %
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-6,60 %	1,00 %	-6,60 %	-6,60 %
OCCAM FIC AÇÕES	-8,70 %	2,07 %	-8,70 %	-8,70 %
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	-6,19 %	-2,71 %	-6,19 %	-6,19 %
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-6,40 %	7,53 %	-6,40 %	-6,40 %
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,98 %	0,82 %	0,98 %	0,98 %
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-8,78 %	-11,46 %	-8,78 %	-8,78 %
CDI	0,83 %	3,28 %	0,83 %	0,83 %
Ibovespa	-10,10 %	2,91 %	-10,10 %	-10,10 %

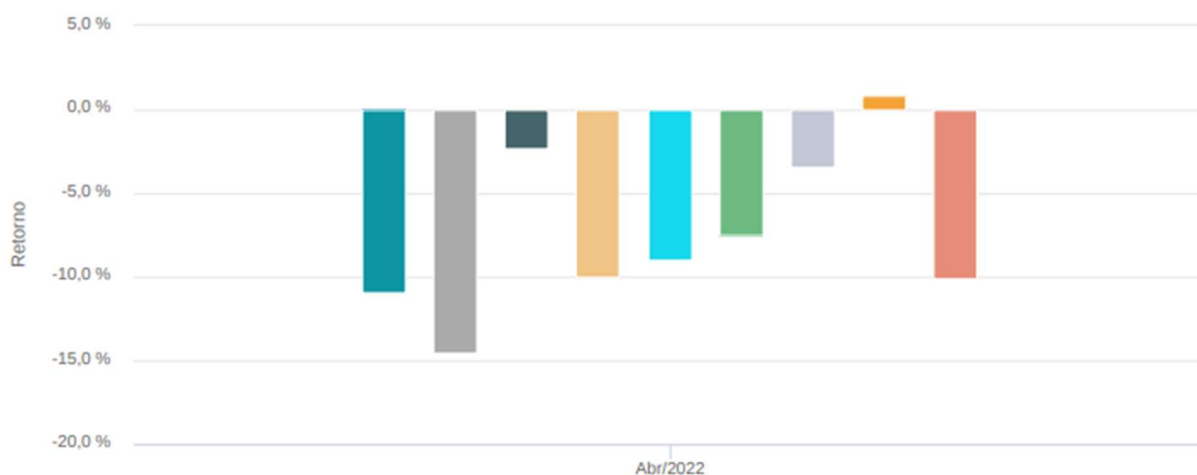
12.3. Exterior

Risco X Retorno de 01/04/2021 até 29/04/2022 (mensal)



Ativo	Retorno	Volatilidade (Anualizada)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-10,64 %	20,15 %
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-45,98 %	36,02 %
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-36,19 %	22,87 %
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	-23,94 %	26,13 %
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-37,64 %	22,91 %
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-13,31 %	20,09 %
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-13,29 %	17,59 %
CDI	7,30 %	0,82 %
Ibovespa	-7,51 %	18,66 %

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



Ativo	Retorno	Retorno YTD*	Mínimo	Máximo
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-10,91 %	-22,24 %	-10,91 %	-10,91 %
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-14,56 %	-46,57 %	-14,56 %	-14,56 %
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-2,35 %	-33,65 %	-2,35 %	-2,35 %
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	-9,96 %	-32,27 %	-9,96 %	-9,96 %
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-8,96 %	-38,03 %	-8,96 %	-8,96 %
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,50 %	-27,71 %	-7,50 %	-7,50 %
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-3,39 %	-22,99 %	-3,39 %	-3,39 %
CDI	0,83 %	3,28 %	0,83 %	0,83 %
Ibovespa	-10,10 %	2,91 %	-10,10 %	-10,10 %

13. AGENDA REALIZADA

- **04 de abril:**

10h00: Reunião presencial com Anete Barbosa Ribas Chaves representando a instituição Banco Santander, foi apresentado o ponto de vista macro econômica, quais os impactos que a guerra no leste europeu, no ambiente interno quais os impactos das subidas da taxa básica de juros a SELIC, a visão da melhor estratégia para o novo cenário levando em consideração que é ano eleitoral. A reunião contou com a presença Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Assessor da Presidência, Luís Gustavo Ferreira Bonacina e a presidente Rossana Vasques.

15h00: Reunião presencial com Ubirajara Macieira representando a distribuidora Privatiza Investimentos, foi apresentado o ponto de vista macro econômica, quais os impactos que a guerra no leste europeu, no ambiente interno quais os impactos das subidas da taxa básica de juros a SELIC, a visão da melhor estratégia para o novo cenário levando em consideração que é ano eleitoral. A reunião contou com a presença Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Assessor da Presidência, Luís Gustavo Ferreira Bonacina e a presidente Rossana Vasques.

- **05 de abril:**

10h00: Visita a cede da XP Investimentos representado por Eduardo Reichert com as presenças de Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Assessor da Presidência, Luís Gustavo Ferreira Bonacina e a presidente Rossana Vasques.

- **13 de abril:**

9h00: 362ª reunião do CAIF iniciada às 9h09 na modalidade presencial. Apresentação da carteira fechada de março de 2022, contou com as presenças de Renata de Souza Santos Esteves – Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Amauri Arnaldo Júnior – Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos, Rafaela Carvalho dos Santos, Victor Adriano Vieira Silva, Clévio Vitor de Almeida e Luís Gustavo Ferreira Bonacina. 10 horas iniciou a reunião com a gestora BRAM, para algumas informações sobre os fundos ao qual o instituto tem em carteira, o mesmo explicou quais as estratégias estão sendo tomadas para proteção e manutenção do fundo.

- **26 a 28 de abril:**

18º Congresso Estadual de Previdência da APEPREM, realizado em Águas de Lindóia, esteve presente, Victor Adriano Vieira Silva e Luís Gustavo Ferreira Bonacina, ambos membros de CAIF em companhia da presidente

Rossana Vasques, evento realizado pela APEPREM, para esclarecimentos da nova resolução e demais assuntos.

- **27 de abril:**

9h00: 363ª reunião do CAIF iniciada às 9h25 na modalidade híbrida, apresentada carteira parcial de abril até o dia 22, 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 participaram da reunião presencial, Victor Adriano Vieira Silva e Luís Gustavo Ferreira Bonacina na modalidade online. 10 horas iniciou a reunião com o Bernardo Guimarães representando a gestora BTG Pactual, para tirar dúvidas sobre aquisições de Letras Financeiras (LF) e esclarecimentos sobre os fundos da carteira do Instituto BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO e BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS EM AÇÕES.