



**Instituto de Previdência do Servidor Municipal de
São José dos Campos**

Relatório de Investimentos

Outubro 2020

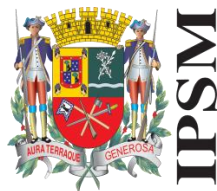


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Relatório de Investimentos: Outubro 2020

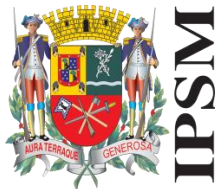
Sumário

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS: OUTUBRO DE 2020	4
ACOMPANHAMENTO DA ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS E DA RESOLUÇÃO CMN Nº 3.922 -(COM ALTERAÇÕES RESOLUÇÃO CMN 4.695 DE 28 DE NOVEMBRO DE 2018)	6
ACOMPANHAMENTO DOS ARTIGOS 13 E 14 DA RESOLUÇÃO CMN Nº 3.922 (COM ALTERAÇÕES RESOLUÇÃO CMN 4.695 DE 28 DE NOVEMBRO DE 2018)	7
DESENQUADRAMENTOS	10
ACOMPANHAMENTO POR BENCHMARK	13
DIVERSIFICAÇÃO	15
DISTRIBUIÇÃO POR FUNDOS DE INVESTIMENTO	16
ACOMPANHAMENTO DAS MOVIMENTAÇÕES	17
APRS: AUTORIZAÇÕES DE APLICAÇÃO E RESGATE	18
RENTABILIDADE POR GRUPO E META	23
ACOMPANHAMENTO DOS RENDIMENTOS	25
MONITORAMENTO DE RISCOS	27
IPCA +6%	27
IPCA	32
IDKA 2A	35
IMA-B 5+	38
IMA-B 5	41
IMA-B	44
IRF-M	47
IRF-M 1+	50
SMALL CAPS	52
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER	55
AÇÕES SETORIAIS	56
DIVIDENDOS	59
BDR	62
GLOBAIS	65
MSCI	67
IBOVESPA	68
IBOVESPA – COM FIP TERRAS BRASIL	71
S&P 500	75



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

CDI	78
CDI – OUTROS	81
DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÕES	83
LÂMINA DE INDICADORES	84
PLANO DE AÇÃO MENSAL DA ÁREA DE INVESTIMENTOS	85



**Instituto de Previdência do Servidor Municipal de
São José dos Campos**

Parecer do Comitê de Investimentos: outubro de 2020

Em 28 de março de 2019 o IPSM 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 ponto 3.2.6 do Manual do Pró-Gestão RPPS (Portaria MPS nº 185/2015, alterada pela Portaria MF nº 577/2017), apresenta-se o presente relatório, referente a outubro de 2020, que é elaborado mensalmente pela Diretoria Financeira; e trata do acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política 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.

Em 1º de julho, a Certificação Institucional nível II foi conferida ao IPSM, atestando-se o cumprimento às exigências estabelecidas no Programa de Certificação Institucional e Modernização da Gestão dos RPPS – Pró-Gestão, conforme Portaria MPS nº 185/2015, demonstrando ter adotado adequadas práticas de gestão previdenciária relativas a Controle Interno, Governança Corporativa e Educação Previdenciária. A alteração dos limites de aplicação é evidenciada no presente relatório.

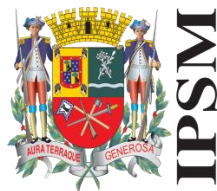
São José dos Campos, 19 de novembro de 2020,

Gláucio Lamarca Rocha
Superintendente
CPA - 20

Lídia M. R. F. Cavalcanti
Diretora Financeira
CPA - 20

Roseli da Silva Moreira Santos
Diretora de Benefícios
CPA – 20

Carla Damasceno Ramos
Chefe de Divisão Contábil e Tesouraria
CPA – 20



**Instituto de Previdência do Servidor Municipal de
São José dos Campos**

**Rose Katsanos
Economista
CPA – 20**



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Acompanhamento da Estratégia de Alocação da Política de Investimentos e da Resolução CMN nº 3.922 *-(com alterações resolução CMN 4.695 de 28 de novembro de 2018)*

RENDA FIXA	VALOR ATUAL	%	LIMITE DE APLICAÇÃO		REGRAS ESPECÍFICAS	LIMITE MAX. CONJUNTO	TIPO DE FUNDO DE INVESTIMENTO
			CI NÍVEL II	SEM CI			
ARTIGO 7º I "a"	802.023.036,66	38,46%	100%	100%	-	100%	TÍTULOS TESOUREIRO NACIONAL TPF
ARTIGO 7º I "b"			100%	100%	15% PL FI		FI REFERENCIADO TPF exceto DI
ARTIGO 7º I "c"			100%	100%	-		ETF 100% TPF exceto DI
ARTIGO 7º II	512.107.875,53	24,56%	5%	5%	-		OPERAÇÕES COMPROMISSADAS
ARTIGO 7º III "a"			70%	60%	15% PL FI		FI RF - REFERENCIADO exceto DI
ARTIGO 7º III "b"			70%	60%	-		ETF RF - REFERENCIADO exceto DI
ARTIGO 7º IV "a"			50%	40%	15% PL FI		FI RENDA FIXA
ARTIGO 7º IV "b"			50%	40%	-		ETF RENDA FIXA
ARTIGO 7º V "b"			20%	20%	-		LIG - LETRA IMOBILIÁRIA GARANTIDA
ARTIGO 7º VI "a"	7.635.964,95	0,37%	15%	15%	LIMITE FGC 250mil	25%	CDB
ARTIGO 7º VI "b"			15%	15%	-		POUPANÇA
ARTIGO 7º VII "a"			10%	5%	5% PL FI		FIDC - DIREITOS CREDITÓRIOS - COTA SEM
ARTIGO 7º VII "b"			15%	5%	5% PL FI		FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO
ARTIGO 7º VII "c"			10%	5%	5% PL FI		FIDEJUTORES DE INFRAESTRUTURA
TOTAL RENDA FIXA	1.321.766.877,14	63,38%	100%	100%		100%	
RENDA VARIÁVEL	VALOR ATUAL	%	LIMITE DE APLICAÇÃO		REGRAS ESPECÍFICAS	LIMITE MAX. CONJUNTO	TIPO DE FUNDO DE INVESTIMENTO
			CI NÍVEL II	SEM CI			
ARTIGO 8º I "a"	553.289.407,26	26,53%	40%	30%	15% PL FI	40%	FIA - ÍNDICES COM MÍNIMO DE 50 AÇÕES
ARTIGO 8º I "b"			40%	30%	-		ETF - ÍNDICES COM MÍNIMO DE 50 AÇÕES
ARTIGO 8º II "a"			30%	20%	15% PL FI		FIA (até 20% ativos no exterior)
ARTIGO 8º II "b"	17.826.284,56	0,85%	30%	20%	-		ETF AÇÕES
ARTIGO 8º III			10%	10%	5% PL FI		MULTIMERCADO (até 20% ativos no exterior)
ARTIGO 8º IV "a"	15.024.632,64	0,72%	5%	5%	5% PL FI		FIP (requisitos de governança)
ARTIGO 8º IV "b"			10%	5%	5% PL FI		FI (presença em 60% dos preçoes em 12m)
TOTAL RENDA VARIÁVEL	586.140.384,46	28,11%	40,00%	30,00%		40,00%	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	VALOR ATUAL	%	LIMITE DE APLICAÇÃO		REGRAS ESPECÍFICAS	LIMITE MAX. CONJUNTO	TIPO DE FUNDO DE INVESTIMENTO
			CI NÍVEL II	SEM CI			
ARTIGO 3º-A I	87.311.763,60	4,19%	10%	10%	15% PL FI	10,00%	Renda Fixa - Dívida Externa
ARTIGO 3º-A II					15% PL FI		Investimentos no Exterior
ARTIGO 3º-A III					15% PL FI		Ações - BDR Nível I
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	177.444.506,61	8,51%				10,00%	
TOTAL GERAL	2.085.351.768,22	100,00%				100,00%	

A Certificação Institucional nível II foi conferida ao IPSM em 1º de julho de 2019, quando se atestou o cumprimento às exigências estabelecidas no Programa de Certificação Institucional e Modernização da Gestão dos RPPS - Pró-Gestão, conforme Portaria MPS nº 185/2015, demonstrando ter adotado adequadas práticas de gestão previdenciária relativas a Controle Interno, Governança Corporativa e Educação Previdenciária

LIMITE INFERIOR	ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR
40%	43%	100%
0,0%	0,0%	1,0%
0,5%	1,0%	70%
15%	25%	50%
0,0%	0,0%	1,0%
0,0%	0,0%	1,0%
0,0%	0,5%	10%
0,0%	0,5%	15%
0,0%	0,0%	10%
70,00%		
LIMITE INFERIOR	ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR
0,5%	6%	40%
2,5%	17,5%	30%
0%	4,0%	10%
0%	1,0%	5%
0%	0,0%	10%
28,50%		
LIMITE INFERIOR	ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR
0%	0,25%	10%
0%	0,25%	10%
0%	1,0%	10%
1,50%		
100,00%		

*Última atualização da Política de Investimentos: publicação no Boletim do Município em 13 de dezembro de 2019



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Acompanhamento dos artigos 13 e 14 da Resolução CMN nº 3.922 (com alterações resolução CMN 4.695 de 28 de novembro de 2018)

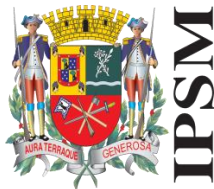
Os desenquadramentos pelo artigo 13 da Resolução CMN nº 3.922 ocorrem quando as aplicações em cotas de um mesmo fundo de investimento, fundo de investimento em cotas de fundos de investimento ou fundo de índice excederem, direta ou indiretamente, 20% (vinte por cento) das aplicações dos recursos do RPPS. Já os desenquadramentos pelo artigo 14 da Resolução ocorrem se o total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em um mesmo fundo de investimento representar mais de 15% (quinze por cento) do patrimônio líquido do fundo.

Quanto ao artigo 13, o IPSM não apresenta desenquadramentos, verificando-se a diversificação entre fundos de distintos benchmarks, administradores, gestores e estratégias.

Quanto ao artigo 14 da Resolução, observam-se desenquadramentos passivos: a relação (total das aplicações do RPPS no fundo) / (Patrimônio Líquido do fundo) é também influenciada pela manutenção de posições de outros cotistas.

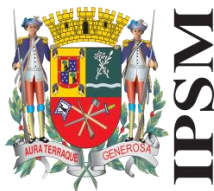
Ademais, os fundos estruturados nos quais se verificam os desenquadramentos, constituídos sob a forma de condomínio fechado, têm prazo de duração, de modo que suas cotas somente serão resgatadas ao término do prazo de duração do fundo.

A Resolução estabelece, ainda, que as aplicações que apresentem prazos para vencimento, resgate, carência ou para conversão de cotas de fundos de investimento previstas em seu regulamento então vigente poderão ser mantidas em carteira até a respectiva data. Novas aplicações também não serão feitas.



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Nome do FUNDO	CNPJ	ENQUADRAMENTO	SALDO IPSM NO FUNDO/ PATRIMÔNIO DO IPSM	SALDO IPSM NO FUNDO/ PL DO FUNDO	STATUS	
BANCO DO BRASIL						
BB Prev Acoes Alocao FIA	18.270.783/0001-99	artigo 8o	inc. II a	0,896%	4,813%	OK
BB Prev RF Alocao Ativa Fcfi	25.078.994/0001-90	artigo 7o	inc. I b	3,945%	0,828%	OK
BB Prev RF Ima B 5 LP Fc	03.543.447/0001-03	artigo 7o	inc. I b	2,402%	1,135%	OK
BB Prev RF Ima B5 FI	13.327.340/0001-73	artigo 7o	inc. I b	7,387%	7,954%	OK
BB Prev RF Irf M FI	07.111.384/0001-69	artigo 7o	inc. I b	0,668%	0,290%	OK
BB Prev RF Perfil Fc	13.077.418/0001-49	artigo 7o	inc. IV a	0,090%	0,079%	OK
BB Prev RF Tit Publ VII FI	19.523.305/0001-06	artigo 7o	inc. I b	0,079%	0,690%	OK
BB Prev RF Tp IPCA V FI	19.515.016/0001-65	artigo 7o	inc. I b	0,310%	7,695%	OK
BB Prev RF Tp IPCA VI FI	19.523.306/0001-50	artigo 7o	inc. I b	2,324%	16,901%	DESENQUADRADO
BB Acoes Consumo Fc FI	08.973.942/0001-68	artigo 8o	inc. II a	1,293%	7,074%	OK
Terras Brasil FIP	19.412.474/0001-79	artigo 8o	inc. IV a	0,062%	18,634%	DESENQUADRADO
BB Prev Ações FICFIA	29.258.294/0001-38	artigo 8o	inc. II a	0,833%	2,004%	OK
BB Ações Quantitativo FIC FI	07.882.792/0001-14	artigo 8o	inc. II a	0,147%	0,995%	OK
TOTAL DO BANCO PARTICIPAÇÃO EM %				20,44%		
BANCO BRADESCO						
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5+	13.400.077/0001-09	artigo 7o	inc. IV a	0,494%	4,291%	OK
Bradesco FIA MID Small Caps	06.988.623/0001-09	artigo 8o	inc. II a	4,318%	4,643%	OK
Bradesco H FI RF RF Nilo	15.259.071/0001-80	artigo 7o	inc. IV a	6,008%	15,065%	DESENQUADRADO
Bradesco FI RF Idka Pre 2	24.022.566/0001-82	artigo 7o	inc. I b	0,057%	0,119%	OK
Bradesco FI Mult S P 500 Mais	18.079.540/0001-78	artigo 8 o	inc. III	0,239%	3,569%	OK
TOTAL DO BANCO PARTICIPAÇÃO EM %				11,12%		
BANCO C.E.F.						
Caixa FI Brasil 2024 II Tp RF	18.598.088/0001-50	artigo 7o	inc. I b	0,069%	0,743%	OK
Caixa FI Brasil 2024 IV Tp RF	20.139.595/0001-78	artigo 7o	inc. I b	1,245%	1,847%	OK
Caixa FI Brasil Ima B 5+ Tp RF LP	10.577.503/0001-88	artigo 7o	inc. I b	1,640%	1,912%	OK
Caixa FI Brasil IPCA Xvi RF Cred Priv	21.918.896/0001-62	artigo 7o	inc. VII b	0,366%	3,994%	OK
Caixa FI Brasil Irf M 1+ Tp RF LP	10.577.519/0001-90	artigo 7o	inc. I b	3,536%	2,346%	OK
Caixa FI Brasil Irf M Tp RF LP	14.508.605/0001-00	artigo 7o	inc. I b	1,516%	0,343%	OK
Caixa FIA Institucional BDR Nivel I	17.502.937/0001-68	artigo 9 o - A	inc. III	1,970%	2,448%	OK
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	23.215.097/0001-55	artigo 7o	inc. IV a	4,551%	0,696%	OK
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	11.060.913/0001-10	artigo 7o	inc. I b	0,743%	0,085%	OK
FI Caixa Brasil Ima B Tp RF LP	10.740.658/0001-93	artigo 7o	inc. I b	0,592%	0,212%	OK
Caixa FIC Acoes Valor Dividendos Rpps	15.154.441/0001-15	artigo 8 o	inc. II a	2,295%	6,033%	OK
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	14.386.926/0001-71	artigo 7o	inc. I b	0,886%	0,193%	OK
Caixa FI Ações Infraestrutura	10.551.382/0001-03	artigo 8 o	inc. II a	1,090%	4,642%	OK
Caixa FICFIA Valor RPPS	14.507.699/0001-95	artigo 8 o	inc. II a	0,761%	2,729%	OK
TOTAL DO BANCO PARTICIPAÇÃO EM %				21,26%		
BANCO ITAÚ						
Itau Instit Alocao Dinamica RF FICFI	21.838.150/0001-49	artigo 7o	inc. IV a	9,652%	4,385%	OK
Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	08.817.414/0001-10	artigo 8o	inc. I a	0,921%	2,426%	OK
KINEA PRIV EQ IV FEEDER INST I FI	27.782.774/0001-78	artigo 8o	inc. IV a	0,658%	7,678%	DESENQUADRADO
Itaú Dunamis FICFI	24.571.992/0001-75	artigo 8o	inc. II a	1,631%	1,086%	OK
Itaú RF Ima B Ativo FICFI	05.073.656/0001-58	artigo 7o	inc. IV a	3,312%	10,792%	OK
Itaú Institucional FoF Gênesis FICFI	32.665.845/0001-92	artigo 8o	inc. II a	1,076%	8,763%	OK
TOTAL DO BANCO PARTICIPAÇÃO EM %				17,25%		
BANCO SANTANDER						
Sant FICFI Ima B 5 Tit Publ RF	13.455.117/0001-01	artigo 7o	inc. I b	0,871%	1,588%	OK
Sant FICFI Ima B Inst Tit Publ RF LP	14.504.578/0001-90	artigo 7o	inc. I b	3,773%	6,507%	OK
Santander FICFI Selecao Top Acoes	02.436.763/0001-05	artigo 8 o	inc. II a	2,548%	10,305%	OK
Santander Global Equities IE	17.804.792/0001-50	artigo 9 o - A	inc. II	1,819%	4,156%	OK
Santander FICFI Soberano RF	09.577.447/0001-00	artigo 7o	inc. I b	0,166%	0,067%	OK
Santander Fc FI Institucional RF Ref DI	02.224.354/0001-45	artigo 7o	inc. IV a	0,157%	0,197%	OK
TOTAL DO BANCO PARTICIPAÇÃO EM %				9,33%		



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

WESTERN ASSET						
Western Asset FIA BDR Nivel I	19.831.126/0001-36	artigo 9 o - A	inc. III		2,352%	2,372% OK
Wa Ima Ativo FI RF	09.087.301/0001-79	artigo 7o	inc. I b		3,132%	11,115% OK
Wa Macro Opportunities Classe Dólar IE	23.872.712/0001-04	artigo 9 o - A	inc. II		0,552%	13,864% OK
Wa Macro Opportunities IE	22.282.992/0001-20	artigo 9 o - A	inc. II		0,421%	0,896% OK
TOTAL DO BANCO					6,46%	
PARTICIPAÇÃO EM %						

AZ QUEST - PRIVATIZA						
Az Quest Small Mid Caps Fc FIA	11.392.165/0001-72	artigo 8 o	inc. II a		1,449%	2,625% OK
Az Quest Ações FICFIA	07.279.657/0001-89	artigo 8 o	inc. II a		1,056%	3,064% OK
Az Quest Small Mid Caps RPPS Fc FIA	34.791.108/0001-61	artigo 8 o	inc. II a		1,117%	4,994% OK
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	37.308.394/0001-50	artigo 9 o - A	inc. II		0,047%	8,605% OK
TOTAL DO BANCO					3,67%	
PARTICIPAÇÃO EM %						

BANCO SAFRA						
Safra S P Reais Pb FI Multimercado	21.595.829/0001-54	artigo 8 o	inc. III		0,615%	2,246% OK
Safra Ima Institucional Fc FI RF	30.659.168/0001-74	artigo 7o	inc. I b		3,411%	4,308% OK
TOTAL DO BANCO					4,03%	
PARTICIPAÇÃO EM %						

XP INVESTIMENTOS						
Navi Institucional FIA	14.113.340/0001-33	artigo 8o	inc. II a		2,069%	4,519% OK
Xp Dividendos 30 Fc FIA	26.773.140/0001-96	artigo 8o	inc. II a		0,000%	0,000% OK
Moat Capital Advisory FICFIA	35.354.967/0001-56	artigo 8o	inc. II a		0,468%	0,953% OK
Axa Wf Fr Dig Econ Adv FIC FIA IE	35.002.482/0001-01	artigo 9 o - A	inc. II		1,348%	8,816% OK
Truxt I Valor Institucional FIC FIA	26.277.595/0001-10	artigo 8o	inc. II a		0,830%	4,429% OK
TOTAL DO BANCO					4,72%	
PARTICIPAÇÃO EM %						

VINCI EQUITIES						
Vinci Mosaico FIA	28.470.587/0001-11	artigo 8o	inc. II a		0,867%	1,305% OK
Vinci Selection Equities FIA	15.603.945/0001-75	artigo 8o	inc. II a		0,866%	3,967% OK
TOTAL DO BANCO					1,73%	
PARTICIPAÇÃO EM %						

Total: R\$ 2.085.351.768,22



**Instituto de Previdência do Servidor Municipal de
São José dos Campos**

Desenquadramentos

Fundo: Terras Brasil FIP

CNPJ 19.412.474/0001-79

Segmento Renda Variável- Tipo de Ativo: FI em Participações - Art. 8º, IV, a., conforme a resolução CMN nº 3.922

Data da aplicação inicial: 30/05/2014

Data prevista do vencimento do fundo: 30/05/2021

Patrimônio Líquido do fundo em 31/10/2020: R\$ 6.958.883,40

Saldo Aplicado em 31/10/2020: R\$ 1.296.686,35

O Fundo foi constituído em 12/12/2013 sob a forma de condomínio fechado, iniciou suas operações em 30/05/2014 e conforme artigo 4º do Regulamento do Fundo tem prazo de duração de 06 anos, a partir da data da integralização inicial, podendo ser prorrogado mediante assembleia geral de quotistas por até 02 períodos de um ano cada, sendo que o resgate só poderá ocorrer quando do término do prazo de duração do fundo ou na data de resgate de cada série ou em virtude de sua liquidação ou amortização integral de suas cotas, portanto não há como efetuar resgate antecipado de suas cotas. O desenquadramento ocorreu 120 dias após a alteração da Resolução CMN nº 3.922 que reduziu o limite de alocação com relação ao patrimônio líquido de Fundos de Investimento em Participações, FIPs. Na versão de 2010 da Resolução, o limite era de 25% do PL do fundo. Na versão de 19 de outubro de 2017, o limite tornou-se 5% do PL do fundo.

Em assembleia geral de cotistas realizada em 14 de maio de 2020, foi deliberada a alteração do prazo de duração do fundo pelo período de um ano, a contar de 30 de maio de 2020.



**Instituto de Previdência do Servidor Municipal de
São José dos Campos**

Fundo: BB Previdenciário RF TP IPCA VI FI

CNPJ 19.523.306/0001-50

Segmento Renda Fixa - Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b. Conforme a resolução CMN nº 3.922

Data da aplicação inicial: 24/03/2014

Data prevista do vencimento do fundo: 15/08/2024

Patrimônio Líquido do fundo em 31/10/2020: R\$ 286.802.710,47

Saldo Aplicado em 31/10/2020: R\$ 48.471.946,05

Esse desenquadramento é passivo, em relação ao PL do fundo. Conforme artigo 20 do Regulamento do Fundo, o fundo possui prazo de carência para resgate de cotas até o dia 15/08/2024. Findo este prazo, os cotistas poderão solicitar o resgate total ou parcial de suas cotas. Conforme se pode verificar, houve redução do número de cotistas de 33 para 31 entre os meses de maio e junho/2018, o que acabou resultando em desenquadramento deste RPPS em relação ao PL do Fundo. Ao questionarmos o Banco do Brasil, Administrador do Fundo, quanto à redução do número de cotistas no fundo, fomos informados de que dois cotistas saíram do fundo e efetuaram resgate, mediante decisão judicial, o que resultou na redução do PL do fundo e desenquadramento passivo deste RPPS. O Regulamento do Fundo prevê, em seu Artigo 20, que o fundo possui prazo de carência para resgate de cotas até 15/08/2024, não sendo possível portanto o resgate para regularização do enquadramento do fundo. O desenquadramento foi ocasionado por vontade alheia ao RPPS, pelo que o caso se enquadra no § 1º do artigo 21 da Resolução 3.922/2010, com as alterações implementadas pela Resolução CMN nº 4.604/17.



**Instituto de Previdência do Servidor Municipal de
São José dos Campos**

Fundo: Kinea Private Equity IV Feeder Institucional I FIP Multiestratégia

CNPJ: 27.782.774/0001-78

Segmento Renda Variável – Fundo de Investimentos em Participações – Art. 8º, IV, a.
Conforme a resolução CMN 3.922

Data da aplicação inicial: 23/04/2018

Data prevista do vencimento do fundo: 12/05/2027

Patrimônio Líquido do fundo em 31/10/2020: R\$ 175.169.355,21

Saldo Aplicado em 31/10/2020: R\$ 13.728.006,27

Esse desenquadramento é passivo, em relação ao PL do fundo. O prazo de duração do fundo é de 10 anos, contados da data de início do fundo (12/05/2017).

Conforme informado no campo “Descrição da Operação”, do regulamento do fundo, o ‘Kinea IV Institucional I Fundo de Investimento em Participações Multiestratégia’ (“FIP Feeder”) é um veículo feeder destinado a investir unicamente no ‘Kinea Private Equity Master Fundo de Investimento em Participações Multiestratégia’ (“FIP Master”). Conforme o artigo 3º do Regulamento do fundo, seu prazo de duração é de 10 anos, contados da Data de Início do Fundo, podendo ser prorrogado por deliberação da Assembleia Geral de Cotistas.

O RPPS subscreveu cotas do FIP Feeder em valor equivalente a R\$25.000.000,00, sendo que o capital a ser destinado ao FIP Master por todos os feeders da estrutura é equivalente a R\$ 1.549.737.000,00, sendo, portanto, a participação do RPPS correspondente a 1,61% do capital a ser destinado ao FIP Master. Dessa forma, em relação ao ativo final investido, nos termos dos artigos 10 e 12 da Resolução CMN 3.922, bem como conforme resposta ao item 30 da Nota Técnica SEI nº 12/2017/CGACI/SRPPS/SPREV-MF, a aplicação do RPPS no FIP Master por meio do FIP Feeder é compatível com as condições e limites previstos na Resolução CMN 3.922 e na política de investimentos do RPPS, estando aderente ao limite de concentração de 5% do FIP Master, nos termos do artigo 14, §2º, da Resolução CMN 3.922”.

Acompanhamento por Benchmark

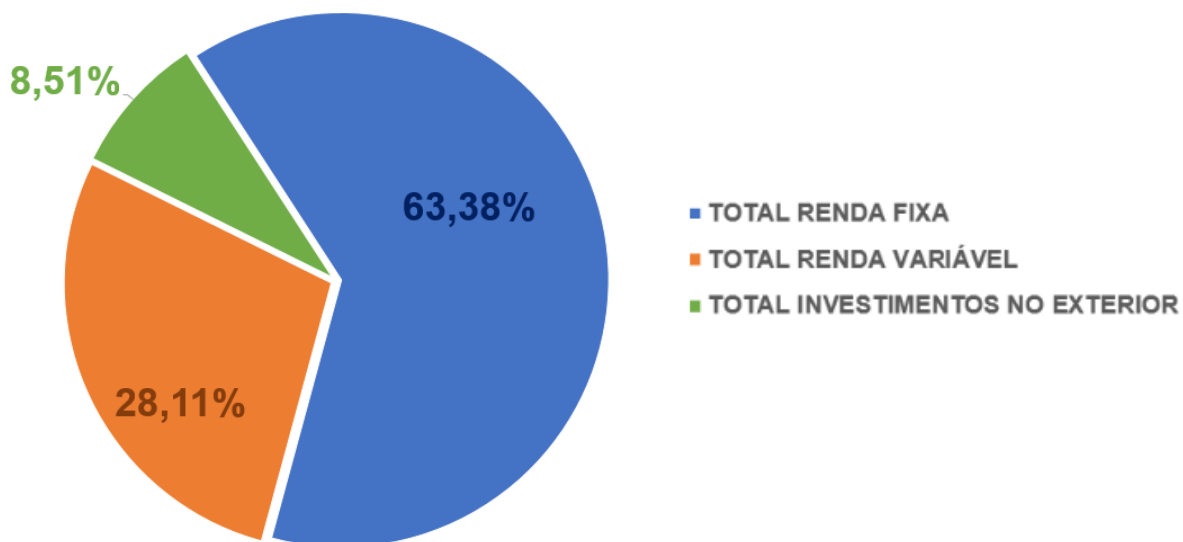
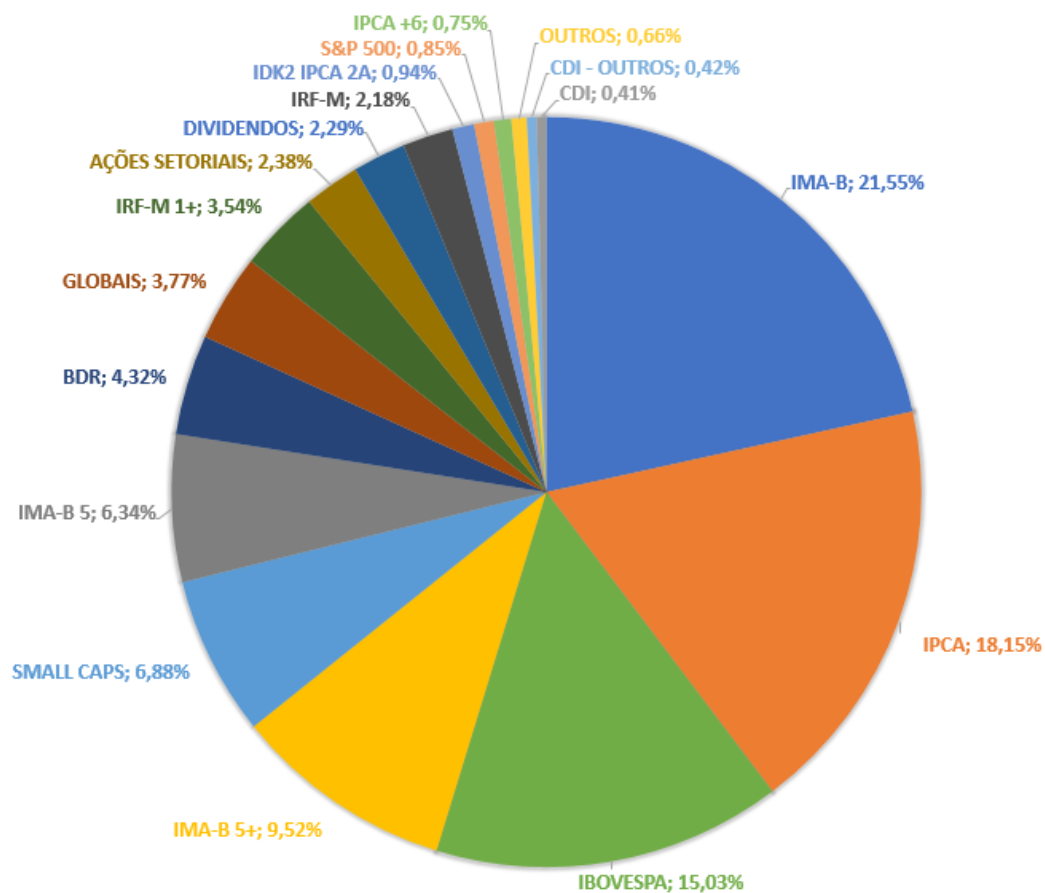
TIPO DE FUNDO	C.N.P.J.	ENQUADRAMENTO 3922	%	TOTAL %
IPCA +6				
BB Prev RF Tp IPCA V FI	19.515.016/0001-65	artigo 7º inc. I b	0,3103%	0,75%
Caixa FI Brasil 2024 II Tp RF	18.598.088/0001-50	artigo 7º inc. I b	0,0693%	
Caixa FI Brasil IPCA Xvi RF Cred Priv	21.918.896/0001-62	artigo 7º inc. VII b	0,3662%	
SMALL CAPS				
Bradesco FIA MID Small Caps	06.988.623/0001-09	artigo 8º inc. II a	4,3184%	6,88%
Az Quest Small Mid Caps Fc FIA	11.392.165/0001-72	artigo 8º inc. II a	1,4489%	
Az Quest Small Mid Caps RPPS Fc FIA	34.791.108/0001-61	artigo 8º inc. II a	1,1170%	
IDKA2 IPCA 2A				
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	14.386.926/0001-71	artigo 7º inc. I b	0,8855%	0,94%
Bradesco FI RF Idka Pre 2	24.022.566/0001-82	artigo 7º inc. I b	0,0571%	
IMA-B 5+				
BB Prev RF Ima B5 FI	13.327.340/0001-73	artigo 7º inc. I b	7,3867%	9,52%
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5+	13.400.077/0001-09	artigo 7º inc. IV a	0,4942%	
Caixa FI Brasil Ima B 5+ Tp RF LP	10.577.503/0001-88	artigo 7º inc. I b	1,6405%	
IMA-B 5				
BB Prev RF Ima B 5 LP Fc	03.543.447/0001-03	artigo 7º inc. I b	2,4016%	6,34%
BB Prev RF Tp IPCA VI FI	19.523.306/0001-50	artigo 7º inc. I b	2,3244%	
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	11.060.913/0001-10	artigo 7º inc. I b	0,7434%	
Sant FICFI Ima B 5 Tit Publ RF	13.455.117/0001-01	artigo 7º inc. I b	0,8707%	
IMA-B				
BB Prev RF Tit Publ VII FI	19.523.305/0001-06	artigo 7º inc. I b	0,0795%	21,55%
Bradesco H FI RF LP Nilo	15.259.071/0001-80	artigo 7º inc. IV a	6,0076%	
Caixa FI Brasil 2024 IV Tp RF	20.139.595/0001-78	artigo 7º inc. I b	1,2445%	
FI Caixa Brasil Ima B Tp RF LP	10.740.658/0001-93	artigo 7º inc. I b	0,5919%	
Sant FICFI Ima B Inst Tit Publ RF LP	14.504.578/0001-90	artigo 7º inc. I b	3,7733%	
Wa Ima Ativo Fi RF	09.087.301/0001-79	artigo 7º inc. Ib	3,1317%	
Safra Ima Institucional Fc FI RF	30.659.168/0001-74	artigo 7º inc. I b	3,4108%	
Itaú RF Ima B Ativo FICFI	05.073.656/0001-58	artigo 7º inc. IV a	3,3122%	
IRF-M				
BB Prev RF Irf M FI	07.111.384/0001-69	artigo 7º inc. I b	0,6679%	2,18%
Caixa FI Brasil Irf M Tp RF LP	14.508.605/0001-00	artigo 7º inc. I b	1,5162%	
IRF-M 1+				
Caixa FI Brasil Irf M 1+ Tp RF LP	10.577.519/0001-90	artigo 7º inc. I b	3,5356%	3,54%



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

DIVIDENDOS - IDIV				
Caixa FIC Acoes Valor Dividendos Rpps	15.154.441/0001-15	artigo 8º inc. II a	2,2947%	
Xp Dividendos 30 Fc FIA	26.773.140/0001-36	artigo 8º inc. II a	0,0000%	2,29%
IPCA				
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	23.215.097/0001-55	artigo 7º inc. IV a	4,5508%	
Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	21.838.150/0001-49	artigo 7º inc. IV a	9,6522%	
BB Prev RF Alocacao Ativa FcFI	25.078.994/0001-90	artigo 7º inc. I b	3,9453%	18,15%
OUTROS				
KINEA PRIV EQ IV FEEDER INST I FI	27.782.774/0001-78	artigo 8º inc. IV a	0,6583%	0,66%
AÇÕES OUTROS				
BB Acoes Consumo Fc FI	08.973.942/0001-68	artigo 8º inc. II a	1,2930%	
Caixa FI Ações Infraestrutura	10.551.382/0001-03	artigo 8º inc. II a	1,0904%	2,38%
BDR				
Caixa FIA Institucional BDR Nivel I	17.502.937/0001-68	artigo 9º - A inc. III	1,9701%	
Western Asset FIA BDR Nivel I	19.831.126/0001-36	artigo 9º - A inc. III	2,3521%	4,32%
GLOBAIS				
Santander Global Equities IE	17.804.792/0001-50	artigo 9º - A inc. II	1,8186%	
Wa Macro Opportunities Classe Dólar IE	23.872.712/0001-04	artigo 9º - A inc. II	0,5520%	
Axa Wl Fr Dig Econ Adv FIC FIA IE	35.002.482/0001-01	artigo 9º - A inc. II	1,3483%	
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	37.308.394/0001-50	artigo 9º - A inc. II	0,0472%	3,77%
IBOVESPA				
Itau FOF Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	08.817.414/0001-10	artigo 8º inc. I a	0,9214%	
Itaú Institucional FoF Gênese FICFI	32.665.845/0001-92	artigo 8º inc. II a	1,0756%	
Santander FICFI Selecao Top Acoes	02.436.763/0001-05	artigo 8º inc. II a	2,5482%	
Itaú Dunamis FICFI	24.571.992/0001-75	artigo 8º inc. II a	1,6308%	
BB Prev Ações FICFIA	29.258.294/0001-38	artigo 8º inc. II a	0,8325%	
Caixa FICFIA Valor RPPS	14.507.699/0001-95	artigo 8º inc. II a	0,7610%	
Az Quest Ações FICFIA	07.279.657/0001-89	artigo 8º inc. II a	1,0561%	
Vinci Mosaico FIA	28.470.587/0001-11	artigo 8º inc. II a	0,8673%	
Moat Capital Advisory FICFIA	35.354.967/0001-56	artigo 8º inc. II a	0,4679%	
BB Prev Acoes Alocacao FIA	18.270.783/0001-99	artigo 8º inc. II a	0,8960%	
Terras Brasil FIP	19.412.474/0001-79	artigo 8º inc. IV a	0,0622%	
Trust I Valor Institucional FIC FIA	26.277.595/0001-10	artigo 8º inc. II a	0,8297%	
Vinci Selection Equities FIA	15.603.945/0001-75	artigo 8º inc. II a	0,8664%	
Navi Institucional FIA	14.113.340/0001-33	artigo 8º inc. II a	2,0694%	
BB Ações Quantitativo FIC FI	07.882.792/0001-14	artigo 8º inc. II a	0,1475%	15,03%
S&P 500				
Safrs S P Reais Pb FI Multimercado	21.595.829/0001-54	artigo 8º inc. III	0,6155%	
Bradesco FI Mult S P 500 Mais	18.079.540/0001-78	artigo 8º inc. III	0,2394%	0,85%
CDI - Outros				
Wa Macro Opportunities IE	22.282.992/0001-20	artigo 9º - A inc. II	0,4209%	0,42%
CDI				
BB Prev RF Perfil Fc	13.077.418/0001-49	artigo 7º inc. IV a	0,0904%	
Santander FICFI Soberano RF	09.577.447/0001-00	artigo 7º inc. I b	0,1664%	
Santander Fc FI Institucional RF Ref DI	02.224.354/0001-45	artigo 7º inc. IV a	0,1572%	0,41%
TOTAL			100,00%	100,00%

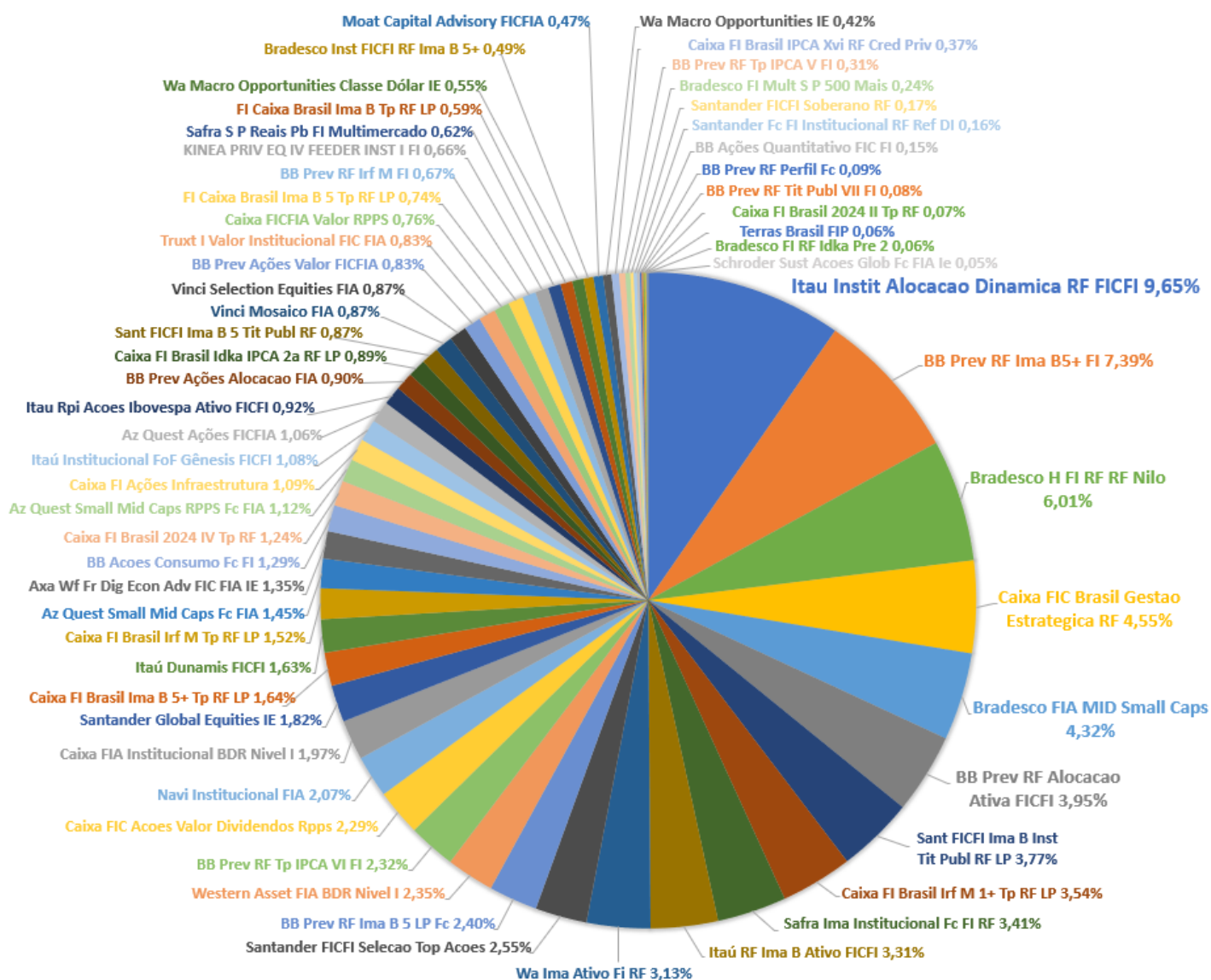
Diversificação





Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Distribuição por Fundos de Investimento





Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Acompanhamento das Movimentações

FUNDO DE INVESTIMENTO		Resgates Grupo 1	Resgates Grupo 2	Total Resgates	Aplicações Grupo 1	Aplicações Grupo 2	Total Aplicações
BB Prev Ações Alocação FIA	18.270.783/0001-99	0,00	5.631.195,26	5.631.195,26	0,00	0,00	0,00
BB Prev RF Ima B 5 LP Fc	03.543.447/0001-03	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB Prev RF Ima B5+ FI	13.327.340/0001-73	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB Prev RF Alocação Ativa FICFI	25.078.994/0001-90	55.000.000,00	1.000.000,00	56.000.000,00	0,00	0,00	0,00
BB Prev RF Irf M FI	07.111.384/0001-69	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB Prev RF Perfil Fc	13.077.418/0001-49	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB Prev RF Tit Publ VII FI	19.523.305/0001-06	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB Prev RF Tp IPCA V FI	19.515.016/0001-65	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB Prev RF Tp IPCA VI FI	19.523.306/0001-50	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Terras Brasil FIP	19.412.474/0001-79	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB Acoes Consumo Fc FI	08.973.942/0001-68	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB Prev Ações Valor FICFIA	29.258.294/0001-38	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB Ações Quantitativo FIC FI	07.882.792/0001-14	0,00	0,00	0,00	3.179.258,68	0,00	3.179.258,68
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5+	13.400.077/0001-09	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Bradesco H FI RF RF Nilo	15.259.071/0001-80	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Bradesco FIA MID Small Caps	06.988.623/0001-09	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Bradesco FI RF Idka Pre 2	24.022.566/0001-82	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Bradesco FI Mult S P 500 Mais	18.079.540/0001-78	0,00	0,00	0,00	5.000.000,00	0,00	5.000.000,00
Caixa FI Brasil 2024 II Tp RF	18.598.088/0001-50	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Caixa FIC Acoes Valor Dividendos Rpps	15.154.441/0001-15	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Caixa FI Brasil 2024 IV Tp RF	20.139.595/0001-78	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Caixa FI Brasil Ima B 5+ Tp RF LP	10.577.503/0001-88	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Caixa FI Brasil IPCA Xvi RF Cred Priv	21.918.896/0001-62	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Caixa FIA Institucional BDR Nivel I	17.502.937/0001-68	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Caixa FI Brasil Irf M Tp RF LP	14.508.605/0001-00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	11.060.913/0001-10	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FI Caixa Brasil Ima B Tp RF LP	10.740.658/0001-93	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	23.215.097/0001-55	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Caixa FI Brasil Irf M+ Tp RF LP	10.577.519/0001-90	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	14.386.326/0001-71	0,00	0,00	0,00	0,00	4.270.303,84	4.270.303,84
Caixa FI Ações Infraestrutura	10.551.382/0001-03	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Caixa FICFIA Valor RPPS	14.507.699/0001-95	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Itaú Instit Alocação Dinamica RF FICFI	21.838.150/0001-49	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Itaú Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	08.817.414/0001-10	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
KINEA PRIV EQ IV FEEDER INST I FI	27.782.774/0001-78	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Itaú Dunamis FICFI	24.571.992/0001-75	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Itaú RF Ima B Ativo FICFI	05.073.656/0001-58	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Itaú Institucional FoF Gênesis FICFI	32.665.845/0001-92	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Sant FICFI Ima B 5 Tit Publ RF	13.455.117/0001-01	0,00	0,00	0,00	0,00	6.318,86	6.318,86
Sant FICFI Ima B Inst Tit Publ RF LP	14.504.578/0001-90	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Santander FICFI Selecao Top Acoes	02.436.763/0001-05	10.000.000,01	3.457.892,29	13.457.892,30	0,00	0,00	0,00
Santander Global Equities IE	17.804.792/0001-50	0,00	0,00	0,00	6.224.610,34	0,00	6.224.610,34
Santander FICFI Soberano RF	09.577.447/0001-00	6.000.000,00	0,00	6.000.000,00	0,00	0,00	0,00
Santander Fc FI Institucional RF Ref DI	02.224.354/0001-45	4.353.372,90	0,00	4.353.372,90	7.628.642,05	0,00	7.628.642,05
Xp Dividendos 30 Fc FIA	26.773.140/0001-96	2.613.931,19	0,00	2.613.931,19	0,00	0,00	0,00
Moat Capital Advisory FICFIA	35.354.967/0001-56	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Navi Institucional FIA	14.113.340/0001-33	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Axa Wf Fr Dig Econ Adv FIC FIA IE	35.002.482/0001-01	0,00	0,00	0,00	21.010.456,50	0,00	21.010.456,50
Trust I Valor Institucional FIC FIA	26.277.595/0001-10	0,00	0,00	0,00	5.000.000,00	867.500,00	5.867.500,00
Vinci Mosaico FIA	28.470.587/0001-11	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Vinci Selection Equities FIA	15.603.945/0001-75	0,00	0,00	0,00	5.000.000,00	0,00	5.000.000,00
Western Asset FIA BDR Nivel I	19.831.126/0001-36	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Wa Ima Ativo Fi RF	09.087.301/0001-79	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Wa Macro Opportunities Classe Dólar IE	23.872.712/0001-04	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Wa Macro Opportunities IE	22.282.992/0001-20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Safrs S P Reais Pb FI Multimercado	21.595.829/0001-54	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Safrs Ima Institucional Fc FI RF	30.659.168/0001-74	0,00	0,00	0,00	0,00	9.083.087,55	9.083.087,55
Az Quest Small Mid Caps Fc FIA	11.392.165/0001-72	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Az Quest Ações FICFIA	07.279.657/0001-89	0,00	0,00	0,00	5.000.000,00	0,00	5.000.000,00
Az Quest Small Mid Caps RPPS Fc FIA	34.791.108/0001-61	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	37.308.394/0001-50	0,00	0,00	0,00	1.000.000,00	0,00	1.000.000,00
		77.967.304,10	10.089.087,55	88.056.391,65	59.042.967,57	14.227.210,25	73.270.177,82

APLICAÇÕES (-) RESGATES	
GRUPO I	-R\$ 18.924.336,53
GRUPO II	R\$ 4.138.122,70
GRUPO I E GRUPO II	-R\$ 14.786.213,83



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

APRs: Autorizações de Aplicação e Resgate

Nos termos da Portaria MPS Nº 519/2011, alterada pela Portaria MPS nº 170/2012, todas as aplicações ou resgates com os recursos do RPPS – Regime Próprio de Previdência Social deverão ser acompanhados do formulário APR – Autorização de Aplicação e Resgate.

APR 405: Aplicação na conta do Banco Santander, referente ao repasse dos acordos de parcelamento das parcelas nº 250 (processo interno CADPREV nº 00004/1999) e nº 37 (processo interno CADPREV nº 01023/2017) repassados pela Prefeitura Municipal de São José dos Campos, conforme carta MB 514/DF/2020. SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULTIM. IE - GRUPO 01. FIC - Aberto - Investimento no Exterior - Art 9º, II VALOR: 1.443.981,22.

APR 406: Aplicação realizada no fundo AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE, referente a recurso advindo do fundo XP DIVIDENDOS FIA, conforme carta MB 515/DF/2020. AXA WF FRAM. DIG. EC. ADV. FIC FIA IE - GRUPO I FIC - Aberto - Investimento no Exterior - Art 9º, II VALOR: 13.396.525,31.

APR 407: Aplicação na conta aplicação do Banco Caixa Econômica Federal, referente a parte do repasse da contribuição previdenciária do mês de setembro/2020, repassados pela Prefeitura Municipal de São José dos Campos e pela Câmara Municipal de São José dos Campos, conforme carta MB 524/DF/2020. CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TPRF GRUPO 02 FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" VALOR: 4.270.303,84

APR 408: Aplicação na conta aplicação no Banco do Brasil, referente à compensação previdenciária, conforme carta MB 526/DF/2020. BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI - GRUPO 01 Títulos Públicos de emissão do TN - Art. 7º, I, "a" VALOR: 1.644.282,84

APR 409: Aplicação na conta aplicação do banco Santander, referente a parte do repasse da contribuição previdenciária do mês de setembro/2020, repassados pela Prefeitura Municipal de São José dos Campos e Câmara Municipal de São José dos Campos, conforme carta MB 527/DF/2020. SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULTIM. IE - GRUPO 01 FIC - Aberto - Investimento no Exterior - Art 9º, II VALOR: 4.106.085,18

APR 410: Aplicação na conta aplicação do banco Santander, referente à receita de aluguel, conforme carta MB 531/DF/2020. SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULTIM. IE - GRUPO 01 FIC - Aberto - Investimento no Exterior - Art 9º, II VALOR: 157.198,66



**Instituto de Previdência do Servidor Municipal de
São José dos Campos**

APR 411: Aplicação na conta aplicação do banco Santander, referente à receita de aluguel, conforme carta MB 533/DF/2020. SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULTIM. IE - GRUPO 01 FIC - Aberto - Investimento no Exterior - Art 9º, II VALOR: 64.850,97

APR 412: Resgate total realizado na conta aplicação do banco Santander, para ser aplicado no fundo SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI, conforme carta MB 488/DF/2020. SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES - GRUPO 02 FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a" VALOR: 3.457.892,29

APR 413: Aplicação na conta aplicação do banco Safra, referente a recursos oriundos do fundo SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES, conforme cartas MB 489/DF/2020 e 490/DF/2020. SAFRA IMA INST. FIC FI RF - GRUPO 02 FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" VALOR: 3.457.892,29

APR 414: Resgate total realizado na conta aplicação do Banco do Brasil, referente a aplicação no fundo SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI e para pagamento da folha de adiantamento do mês de outubro/2020, conforme carta MB 525/DF/2020. BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA - GRUPO 02 FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a" VALOR: 5.631.195,26.

APR 415: Aplicação na conta aplicação do banco Safra, referente a recurso oriundo do fundo BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA, conforme cartas MB 536/DF/2020 e 537/DF/2020. SAFRA IMA INST. FIC FI RF - GRUPO 02 FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" VALOR: 5.625.195,26.

APR 416: Resgate da conta aplicação do banco Santander, para pagamento da folha de adiantamento do mês de outubro/2020, conforme carta MB 528/DF/2020. SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES - GRUPO 01 FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a" VALOR: 10.000.000,01.

APR 417: Aplicação na conta aplicação do banco Santander, referente a realocação de recurso não utilizado para pagamento da folha de adiantamento do mês de outubro/2020, conforme carta MB 538/DF/2020. SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULTIM. IE - GRUPO 01 FIC - Aberto - Investimento no Exterior - Art 9º, II VALOR: 370.000,00.

APR 418: Aplicação na conta aplicação do banco Santander, referente à contribuição de rescisão repassado pela Prefeitura Municipal de São José dos Campos, conforme carta MB 539/DF/2020. SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULTIM. IE - GRUPO 01 FIC - Aberto - Investimento no Exterior - Art 9º, II VALOR: 82.494,31.

APR 419: Aplicação na conta aplicação do banco Santander, referente ao repasse de contribuição previdenciária de rescisão, repassado pela Prefeitura Municipal de São José dos Campos, conforme carta MB 540/DF/2020. SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TP RF - GRUPO 02 FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" VALOR: 6.318,86.



**Instituto de Previdência do Servidor Municipal de
São José dos Campos**

APR 420: Resgate da conta aplicação do banco Santander, referente à transferência para o fundo SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE, relativo ao resgate total do fundo ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FIC FI realizado em 26/08/2020, conforme carta MB 438/DF/2020 e carta MB 542/DF/2020. SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI - GRUPO 01 FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" VALOR: 1.000.000,00.

APR 421: Aplicação na conta aplicação do fundo SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FI, referente à transferência oriunda do resgate total ocorrido no fundo ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FIC FI, conforme carta MB 438/DF/2020 e carta MB 543/DF/2020. SCHRODER SUST. AÇÕES GLOBAIS FIC FIA IE - GRUPO 01 FIC - Aberto - Investimento no Exterior - Art 9º, II VALOR: 1.000.000,00.

APR 422: Resgate da conta aplicação do banco Santander, referente à transferência para o fundo AZ QUEST AÇÕES FIC FIA, relativo ao resgate total do fundo ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FIC FI realizado em 26/08/2020, conforme carta MB 438/DF/2020 e carta MB 547/DF/2020. SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI - GRUPO 01 FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a" VALOR: 5.000.000,00.

APR 423: Aplicação na conta aplicação do fundo AZ QUEST AÇÕES FIC FIA, referente à transferência oriunda do resgate total ocorrido no fundo ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FIC FI, conforme carta MB 438/DF/2020 e carta MB 548/DF/2020. AZ QUEST AÇÕES FIC FIA - GRUPO 01 FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a" VALOR: 5.000.000,00.

APR 424: Resgate na conta aplicação do Banco do Brasil, sendo R\$ 21.534.975,84 referente a realocação de recursos, R\$ 25.000.000,00 para o pagamento da folha de pagamento do mês de outubro taxa de administração e despesas consignatórias e R\$ 8.465.024,16 para o pagamento de precatórios judiciais, conforme Carta MB 541/DF/2020. BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI - GRUPO 01 FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" VALOR: 55.000.000,00.

APR 425: Resgate na conta aplicação do Banco do Brasil, referente à transferência no valor de R\$ 867,500,00 para o fundo TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA e para o pagamento da folha de pagamento do mês de outubro/2020 taxa e despesas consignatórias, conforme carta MB 541/DF/2020. BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI - GRUPO 02 FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" VALOR: 1.000.000,00.

APR 426: Aplicação realizada no fundo AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE referente a realocação de recurso vindo do Banco do Brasil, conforme Carta MB 552/DF/2020. AXA WF FRAM. DIG. EC. ADV. FIC FIA IE - GRUPO I FIC - Aberto - Investimento no Exterior - Art 9º, II VALOR: 5.000.000,00.

APR 427: Aplicação realizada no fundo TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA referente a realocação de recurso vindo do Banco do Brasil, conforme Carta MB 553/DF/2020. TRUXT I VALOR INST. FIC FIA - GRUPO I FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a" VALOR: 5.000.000,00.



**Instituto de Previdência do Servidor Municipal de
São José dos Campos**

APR 428: Aplicação realizada no fundo VINCI SELECTION EQUITIES FIA referente a realocação de recurso vindo do Banco do Brasil, conforme Carta MB 554/DF/2020. VINCI SELECTION EQUITIES FIA - GRUPO 01 FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a" VALOR: 5.000.000,00.

APR 429: Aplicação realizada na conta aplicação do Banco do Brasil referente a realocação de recursos, conforme Carta MB 557/DF/2020. BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI - GRUPO 01 Títulos Públicos de emissão do TN - Art. 7º, I, "a" VALOR: 1.534.975,84.

APR 430: Aplicação na conta aplicação do Banco Santander, referente à reserva para o pagamento de despesas consignatárias da folha de pagamento do mês de outubro bem como o pagamento dos empréstimos consignados, conforme Carta MB 561/DF/2020. SANTANDER FIC FI INST RF REF DI - GRUPO 01 FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a" VALOR: 5.797.605,39.

APR 431: Resgate total realizado no fundo XP DIVIDENDOS 30 FIC FIA para posterior aplicação no fundo AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE, conforme Carta MB 491/DF/2020. XP DIVIDENDOS 30 FIC FIA - GRUPO 01 FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a" VALOR: 2.613.931,19.

APR 432: Aplicação no fundo AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE, referente a recurso vindo do fundo XP DIVIDENDOS 30 FIC FIA, conforme Carta MB 560/DF/2020. AXA WF FRAM. DIG. EC. ADV. FIC FIA IE - GRUPO I FIC - Aberto - Investimento no Exterior - Art 9º, II VALOR: 2.613.931,19.

APR 433: Aplicação realizada no fundo TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA referente realocação de recurso advindo do Banco do Brasil, conforme Carta MB 559/DF/2020. TRUXT I VALOR INST. FIC FIA - GRUPO 02 Títulos Públicos de emissão do TN - Art. 7º, I, "a" VALOR: 867.500,00.

APR 434: Aplicação realizada na conta aplicação do Banco Bradesco referente a realocação de recurso advindo do Banco do Brasil, conforme Carta MB 556/DF/2020. BRADESCO FIM S&P 500 MAIS - GRUPO 01 Títulos Públicos de emissão do TN - Art. 7º, I, "a" VALOR: 5.000.000,00.

APR 435: Resgate na conta aplicação do Banco Santander, para o pagamento de despesas consignatárias da folha de pagamento do mês de outubro/2020, conforme Carta MB 562/DF/2020. SANTANDER FIC FI INST RF REF DI - GRUPO 01 FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a" VALOR: 4.353.372,90.

APR 436: Aplicação na conta aplicação do Banco Santander referente a valores recebidos de LSV na segunda quinzena de outubro/2020, conforme Carta MB 566/DF/2020. SANTANDER FIC FI INST RF REF DI - GRUPO 01 FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a" VALOR: 10.925,30.



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

APR 437: Aplicação na conta do Banco Santander, referente a valor restante da folha de pagamento de outubro/2020 e ao repasse dos acordos de parcelamento das parcelas nº 251 (processo interno CADPREV nº 00004/1999) e nº 38 (processo interno CADPREV nº 01023/2017) repassados pela Prefeitura Municipal de São José dos Campos, conforme carta MB 567/DF/2020. SANTANDER FIC FI INST RF REF DI - GRUPO 01 FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, "a" VALOR: 1.820.111,36.



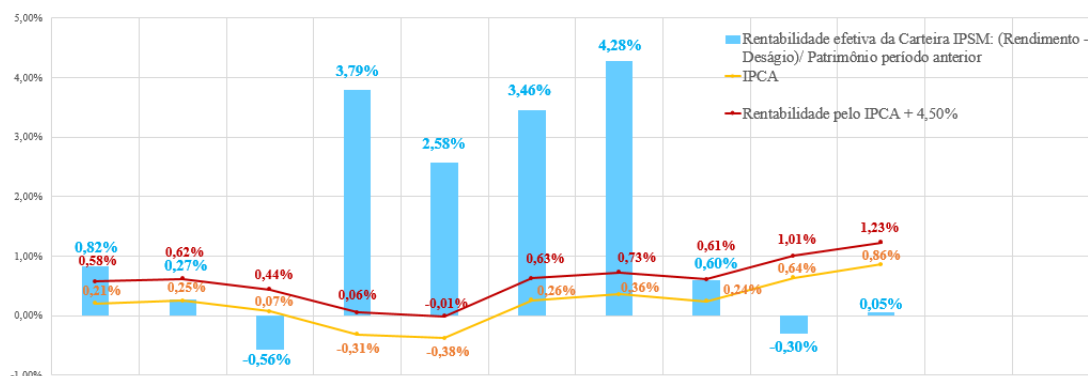
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Rentabilidade por Grupo e Meta

**Rentabilidade e Meta: Grupos Previdenciário e Financeiro
Outubro 2020**

**RENTABILIDADE
EFETIVA CARTEIRA
IPSM NO ANO:**
15,87%

**META
IPCA + 4,50%
2020:**
6,03%



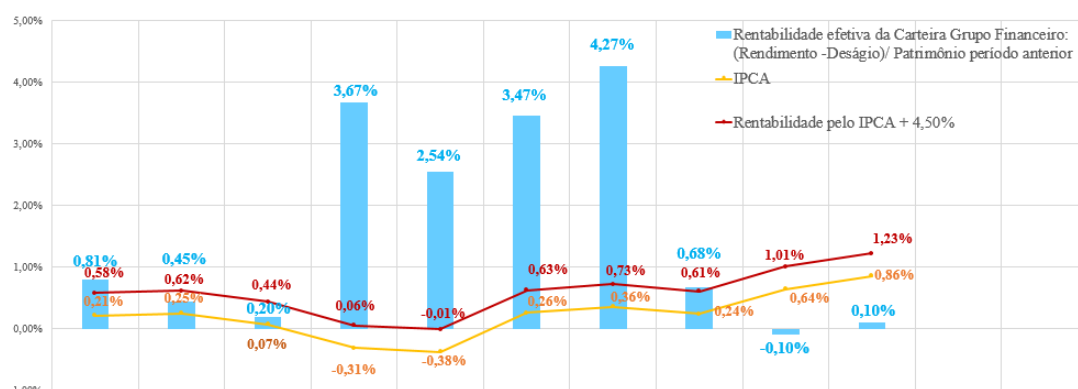
2020	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Mai	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
IPCA	0,21%	0,25%	0,07%	-0,31%	-0,38%	0,26%	0,36%	0,24%	0,64%	0,86%		
IPCA acumulado	0,21%	0,46%	0,53%	0,22%	-0,16%	0,10%	0,46%	0,70%	1,34%	2,22%		
Rentabilidade pelo IPCA + 4,50%	0,58%	0,62%	0,44%	0,06%	-0,01%	0,63%	0,73%	0,61%	1,01%	1,23%		
Meta acumulada	0,58%	1,20%	1,64%	1,70%	1,69%	2,33%	3,07%	3,70%	4,74%	6,03%		
Rentabilidade efetiva da Carteira IPSM: (Rendimento - Deságio)/ Patrimônio período anterior	0,82%	0,27%	-0,56%	3,79%	2,58%	3,46%	4,28%	0,60%	-0,30%	0,05%		
Rentabilidade acumulada	0,82%	1,10%	0,53%	4,34%	7,03%	10,73%	15,46%	16,16%	15,81%	15,87%		

Os deságios do Grupo Financeiro estão lançados conforme previsto no Decreto nº 17.984/2018 de 19/10/2018.

**Rentabilidade e Meta: Grupo Financeiro
Outubro 2020**

**RENTABILIDADE
EFETIVA CARTEIRA
GRUPO
FINANCEIRO NO
ANO:**
17,15%

**META
IPCA + 4,50%
2020:**
6,03%



2020	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Mai	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
IPCA	0,21%	0,25%	0,07%	-0,31%	-0,38%	0,26%	0,36%	0,24%	0,64%	0,86%		
IPCA acumulado	0,21%	0,46%	0,53%	0,22%	-0,16%	0,10%	0,46%	0,70%	1,34%	2,22%		
Rentabilidade pelo IPCA + 4,50%	0,58%	0,62%	0,44%	0,06%	-0,01%	0,63%	0,73%	0,61%	1,01%	1,23%		
Meta acumulada	0,58%	1,20%	1,64%	1,70%	1,69%	2,33%	3,07%	3,70%	4,74%	6,03%		
Rentabilidade efetiva da Carteira Grupo Financeiro: (Rendimento - Deságio)/ Patrimônio período anterior	0,81%	0,45%	0,20%	3,67%	2,54%	3,47%	4,27%	0,68%	-0,10%	0,10%		
Rentabilidade acumulada	0,81%	1,25%	1,46%	5,18%	7,86%	11,60%	16,36%	17,03%	17,03%	17,15%		

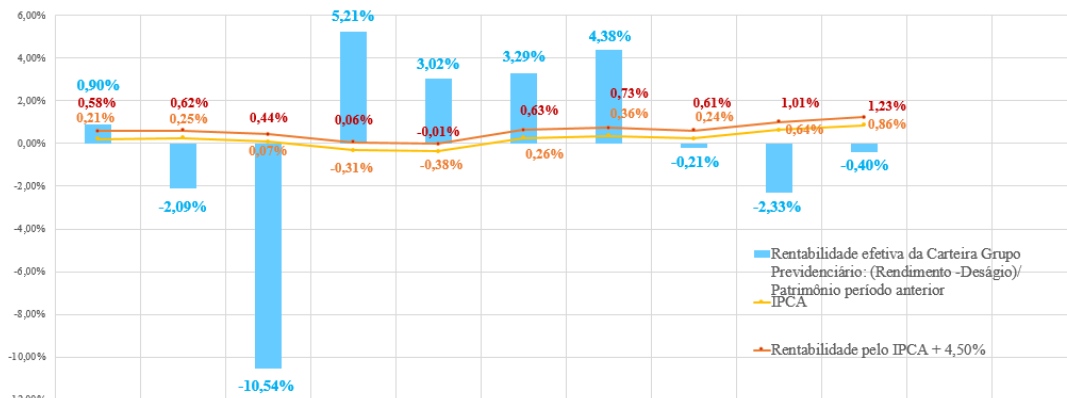
Os deságios do Grupo Financeiro estão lançados conforme previsto no Decreto nº 17.984/2018 de 19/10/2018.

Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

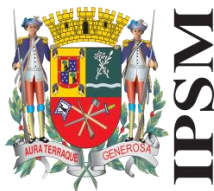
Rentabilidade e Meta: Grupo Previdenciário Outubro 2020

RENTABILIDADE EFETIVA CARTEIRA GRUPO PREVIDENCIÁRIO NO ANO:
0,25%

META IPCA + 4,5% 2020:
6,03%



2020	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
IPCA	0,21%	0,25%	0,07%	-0,31%	-0,38%	0,26%	0,36%	0,24%	0,64%	0,86%		
IPCA acumulado	0,21%	0,46%	0,53%	0,22%	-0,16%	0,10%	0,46%	0,70%	1,34%	2,22%		
Rentabilidade pelo IPCA + 4,50%	0,58%	0,62%	0,44%	0,06%	-0,01%	0,63%	0,73%	0,61%	1,01%	1,23%		
Meta acumulada	0,58%	1,20%	1,64%	1,70%	1,69%	2,33%	3,07%	3,70%	4,74%	6,03%		
Rentabilidade efetiva da Carteira Grupo Previdenciário: (Rendimento - Deságio) / Patrimônio período anterior	0,90%	-2,09%	-10,54%	5,21%	3,02%	3,29%	4,38%	-0,21%	-2,33%	-0,40%		
Rentabilidade acumulada	0,90%	-1,21%	-11,62%	-7,02%	-4,22%	-1,06%	3,27%	3,05%	0,66%	0,25%		



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Acompanhamento dos Rendimentos

31 DE OUTUBRO DE 2020

Nome	CNPJ	Retorno do fechamento de 30Set20 até 30Out20	Rendimento Período GRUPO FINANCEIRO (R\$)	Rendimento Período GRUPO PREVIDENCIÁRIO (R\$)	Rendimento Período Grupos Financeiro e Previdenciário (R\$)
BB Prev Ações Alocação FIA	18.270.783/0001-99	(0,86)	-162.996,74	184.788,86	21.792,12
BB Prev RF Ima B 5 LP Fc	03.543.447/0001-03	0,19	88.372,20	4.941,90	93.314,10
BB Prev RF Ima B5+ FI	13.327.340/0001-73	0,20	296.193,23	18.651,05	314.844,28
BB Prev RF Alocação Ativa FICFI	25.078.994/0001-90	(0,07)	-69.828,41	-3.324,31	-73.152,72
BB Prev RF Irf M FI	07.111.384/0001-69	(0,31)	-43.857,79	0,00	-43.857,79
BB Prev RF Perfil Fc	13.077.418/0001-49	0,16	3.001,15	0,00	3.001,15
BB Prev RF Tit Publ VII FI	19.523.305/0001-06	0,49	8.120,85	0,00	8.120,85
BB Prev RF Tp IPCA V FI	19.515.016/0001-65	(0,37)	-24.232,59	0,00	-24.232,59
BB Prev RF Tp IPCA VI FI	19.523.306/0001-50	0,26	127.955,21	0,00	127.955,21
Terras Brasil FIP	19.412.474/0001-79	4,24	52.709,03	0,00	52.709,03
BB Acoes Consumo Fc FI	08.973.942/0001-68	(2,96)	-767.883,05	-54.299,09	-822.182,14
BB Prev Ações Valor FICFIA	29.258.294/0001-38	2,22	377.732,39	0,00	377.732,39
BB Ações Quantitativo FIC FI	07.882.792/0001-14	(0,66)	-103.753,51	0,00	-103.753,51
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5+	13.400.077/0001-09	0,21	21.166,41	0,00	21.166,41
Bradesco H FI RF RF Nilo	15.253.071/0001-80	0,06	62.360,29	14.744,27	77.104,56
Bradesco FIA MID Small Caps	06.988.623/0001-09	(2,46)	-2.033.744,97	-241.270,17	-2.275.015,14
Bradesco FI RF Idka Pre 2	24.022.566/0001-82	(0,74)	-586,04	-8.314,72	-8.900,76
Bradesco FI Mult S P 500 Mais	18.079.540/0001-78	(2,31)	-8.404,27	0,00	-8.404,27
Caixa FI Brasil 2024 II Tp RF	18.598.088/0001-50	1,31	18.629,00	0,00	18.629,00
Caixa FIC Acoes Valor Dividendos Rpps	15.154.441/0001-15	0,05	23.082,46	1.726,17	24.808,63
Caixa FI Brasil 2024 IV Tp RF	20.139.595/0001-78	(0,18)	-47.668,00	0,00	-47.668,00
Caixa FI Brasil Ima B 5+ Tp RF LP	10.577.503/0001-88	0,22	54.505,18	19.853,45	74.358,63
Caixa FI Brasil IPCA Xvi RF Cred Priv	21.918.896/0001-62	(0,13)	-9.905,02	0,00	-9.905,02
Caixa FIA Institucional BDR Nivel I	17.502.937/0001-68	(1,77)	-574.641,98	-166.419,66	-741.061,64
Caixa FI Brasil Irf M Tp RF LP	14.508.605/0001-00	(0,36)	-113.839,69	0,00	-113.839,69
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	11.060.913/0001-10	0,18	25.046,93	3.000,13	28.047,06
FI Caixa Brasil Ima B Tp RF LP	10.740.658/0001-93	0,19	23.840,49	0,00	23.840,49
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	23.215.097/0001-55	(0,11)	-81.333,67	-21.090,99	-102.424,66
Caixa FI Brasil Irf M 1+ Tp RF LP	10.577.519/0001-90	(0,56)	-415.858,40	0,00	-415.858,40
Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	14.386.926/0001-71	0,15	21.630,70	15.784,33	37.415,03
Caixa FI Ações Infraestrutura	10.551.382/0001-03	(2,24)	-480.151,50	-39.902,68	-520.054,18
Caixa FICFIA Valor RPPS	14.507.699/0001-95	(1,78)	-288.409,83	0,00	-288.409,83
Itau Instit Alocação Dinamica RF FICFI	21.838.150/0001-49	0,08	152.847,78	3.229,70	156.077,48
Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	08.817.414/0001-10	(1,33)	-258.673,42	0,00	-258.673,42
KINEA PRIV EQ IV FEEDER INST I FI	27.782.774/0001-78	-	-284.896,86	0,00	-284.896,86
Itaú Dunamis FICFI	24.571.992/0001-75	0,50	145.995,75	22.500,17	168.495,92
Itaú RF Ima B Ativo FICFI	05.073.656/0001-58	(0,00)	-324,41	-20,36	-344,77
Itaú Institucional FoF Gênesis FICFI	32.665.845/0001-92	(0,57)	-89.280,24	-38.353,93	-127.634,17

Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

31 DE OUTUBRO DE 2020

Nome	CNPJ	Retorno do fechamento de 30Set20 até 30Out20	Rendimento Período GRUPO FINANCEIRO (R\$)	Rendimento Período GRUPO PREVIDENCIÁRIO (R\$)	Rendimento Período Grupos Financeiro e Previdenciário (R\$)
Sant FICFI Ima B 5 Tit Publ RF	13.455.117/0001-01	0,18	9.272,46	23.430,29	32.702,75
Sant FICFI Ima B Inst Tit Publ RF LP	14.504.578/0001-90	0,19	138.989,33	8.389,14	147.378,47
Santander FICFI Selecao Top Acoes	02.436.763/0001-05	(1,95)	-847.597,72	71.634,11	-775.963,61
Santander Global Equities IE	17.804.792/0001-50	(0,61)	-360.353,37	-3.620,45	-363.973,82
Santander FICFI Soberano RF	09.577.447/0001-00	0,07	6.031,91	17,32	6.049,23
Santander Fc FI Institucional RF Ref DI	02.224.354/0001-45	0,19	2.607,68	0,00	2.607,68
Xp Dividendos 30 Fc FIA	26.773.140/0001-96	(3,09)	133.388,40	0,00	133.388,40
Navi Institucional FIA	14.113.340/0001-33	(2,89)	-1.286.097,58	0,00	-1.286.097,58
Moat Capital Advisory FICFIA	35.354.967/0001-56	(1,91)	-189.995,46	0,00	-189.995,46
Axa Wf Fr Dig Econ Adv FIC FIA IE	35.002.482/0001-01	(1,58)	-652.539,84	0,00	-652.539,84
Truxt I Valor Institucional FIC FIA	26.277.595/0001-10	(0,06)	-160.627,67	-26.704,29	-187.331,96
Vinci Mosaico FIA	28.470.587/0001-11	(1,81)	-243.102,53	-89.433,86	-332.536,39
Vinci Selection Equities FIA	15.603.945/0001-75	(1,14)	-253.755,50	-11.406,30	-265.161,80
Western Asset FIA BDR Nivel I	19.831.126/0001-36	(2,23)	-870.341,18	-247.157,59	-1.117.498,77
Va Ima Ativo Fi RF	09.087.301/0001-79	(0,28)	-135.631,12	-45.431,66	-181.062,78
Va Macro Opportunities Classe Dólar IE	23.872.712/0001-04	0,67	76.606,90	0,00	76.606,90
Va Macro Opportunities IE	22.282.992/0001-20	(1,27)	-112.524,86	0,00	-112.524,86
Safr S P Reais Pb FI Multimercado	21.595.829/0001-54	(2,30)	-301.479,72	0,00	-301.479,72
Safr Ima Institucional Fc FI RF	30.659.168/0001-74	(0,26)	-134.458,79	-95.722,67	-230.181,46
Az Quest Small Mid Caps Fc FIA	11.392.165/0001-72	(2,00)	-618.089,85	0,00	-618.089,85
Az Quest Ações FICFIA	07.279.657/0001-89	(0,62)	-169.146,20	-19.748,69	-188.894,89
Az Quest Small Mid Caps RPPS Fc FIA	34.791.108/0001-61	(2,01)	-419.887,64	-58.855,47	-478.743,11
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	37.308.394/0001-50	2,46	-16.138,17	0,00	-16.138,17

TOTAIS	-R\$ 10.761.951,86	-R\$ 778.386,00	-R\$ 11.540.337,86
--------	--------------------	-----------------	--------------------

ÁGIOS	1.870.085,73	392.690,89	2.262.776,62
DESÁGIOS	-12.639.108,88	-1.171.076,89	-13.810.185,77
	-R\$ 10.769.023,15	-R\$ 778.386,00	-R\$ 11.547.409,15



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Monitoramento de Riscos

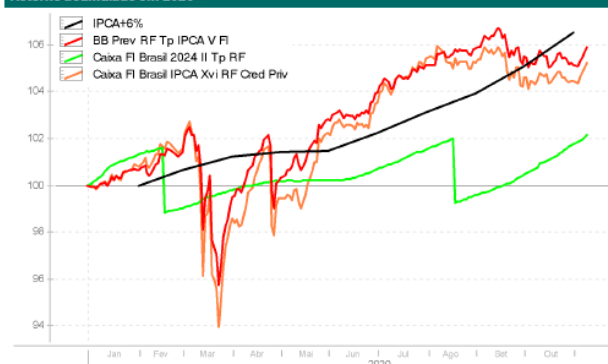
IPCA +6%

Dados Gerais										
Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Nº Cotistas	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark
● IPCA+6%	-	-	-	28/12/1979	-	-	-	-	-	-
● BB Prev RF Tp IPCA V FI	BB Dtwm S.A	Renda Fixa Índices	83.253	25/02/2014	0,20	23	300.000	D+000	Não	-
● Caixa FI Brasil 2024 II Tp RF	Caixa	Renda Fixa Índices	192.023	25/02/2014	0,20	38	1.000.000	D+000	Não	-
● Caixa FI Brasil IPCA Xvi RF Cred Priv	Caixa	Renda Fixa Duração Liv...	184.902	17/04/2015	0,20	74	1.000	D+000	Não se Aplica	OUTROS

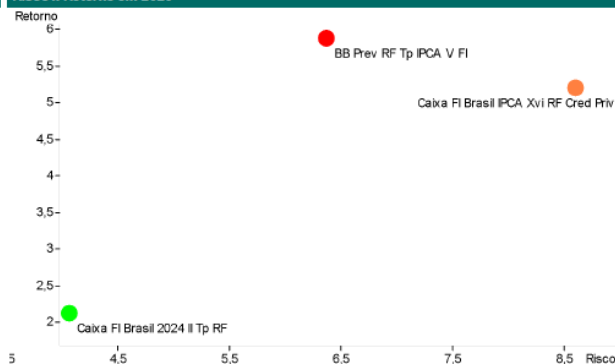
Retornos (%) (até 05/11/2020)																												
	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	nov 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m	24m	36m	48m						
● IPCA+6%	1,60	0,72	0,67	0,58	0,15	0,08	0,75	0,90	0,73	1,13	1,35	-	9,79	10,46	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
● BB Prev RF Tp IPCA V FI	1,44	0,66	0,77	-1,89	0,82	2,49	1,14	1,11	0,65	-0,31	-0,37	0,33	19,21	15,61	5,46	0,18	0,33	4,79	6,32	24,00	47,42	60,50	-	-	-	-	-	
● Caixa FI Brasil 2024 II Tp RF	1,35	1,31	-2,26	0,77	0,38	0,04	0,48	0,86	-1,95	0,89	1,31	0,19	4,18	4,10	1,96	1,35	0,28	1,76	4,00	7,04	12,16	15,22	-	-	-	-	-	
● Caixa FI Brasil IPCA Xvi RF Cred Priv	1,47	0,81	0,74	-2,91	0,87	2,82	1,26	1,86	-0,22	-0,63	-0,13	0,36	7,73	16,48	4,82	0,34	-0,54	5,26	5,23	23,55	32,47	46,22	-	-	-	-	-	

Tabela de Riscos (até 05/11/2020)									
Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Mín 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos
● IPCA+6%	-	-	-	-	0,00	1,60	0,08	-	-
● BB Prev RF Tp IPCA V FI	6,13	0,54	2,89	9,99	-6,58	2,49	-1,89	9	3
● Caixa FI Brasil 2024 II Tp RF	3,95	0,23	1,85	6,40	-2,74	1,35	-2,26	10	2
● Caixa FI Brasil IPCA Xvi RF Cred Priv	8,23	0,29	3,87	13,41	-8,53	2,82	-2,91	8	

Retorno acumulado em 2020



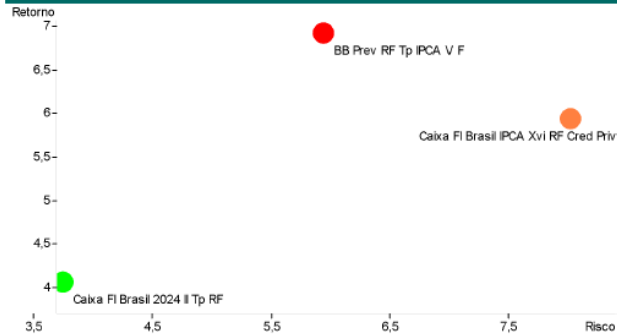
Risco x Retorno em 2020

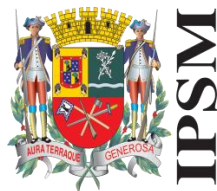


Retorno acumulado (Últ. 12 meses)



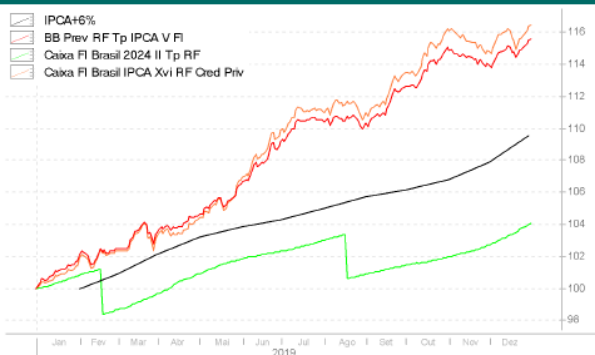
Risco x Retorno (Últ. 12 meses)



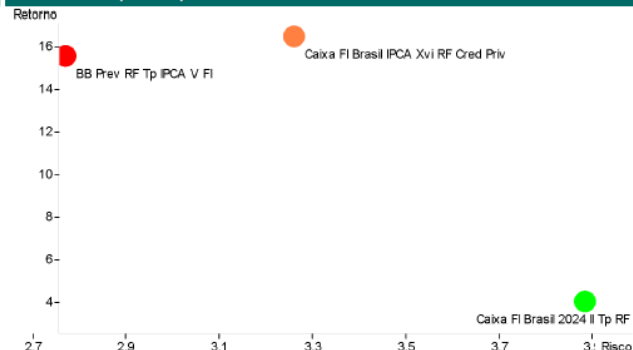


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

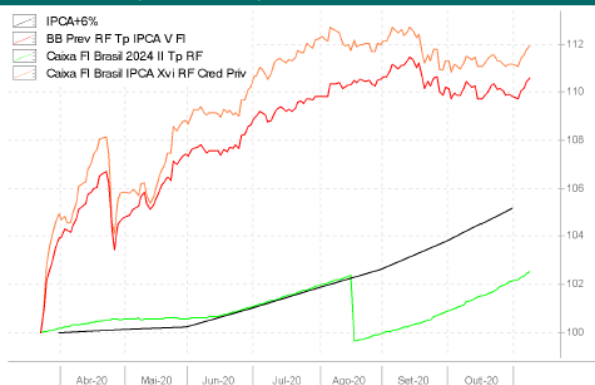
Retorno Acumulado (em 2019)



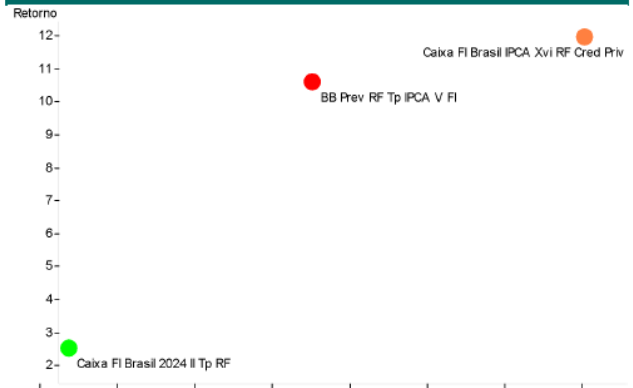
Risco x Retorno (em 2019)



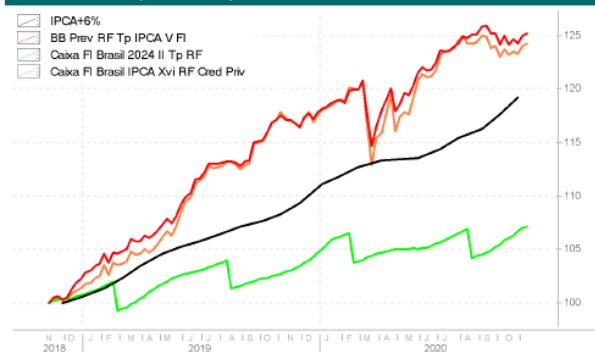
Retorno acumulado (desde 23/03/2020)



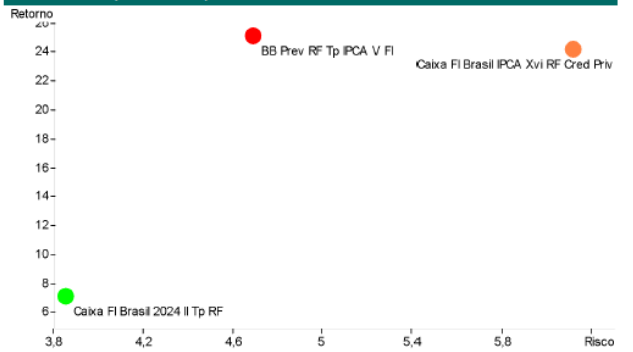
Risco x Retorno (desde 23/03/2020)



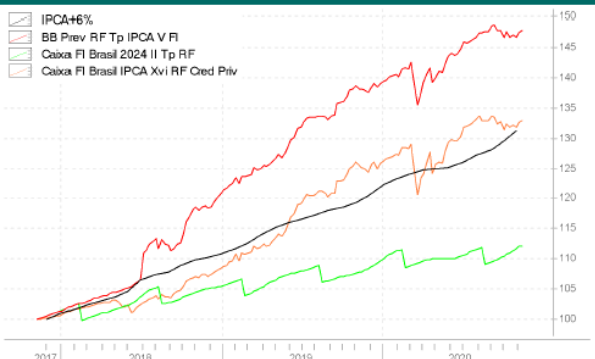
Retorno acumulado (Últ. 24 meses)



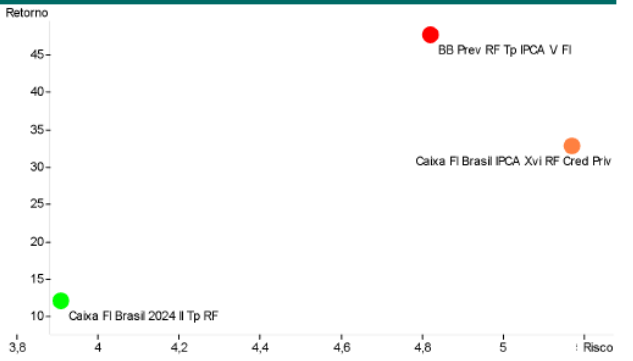
Risco x Retorno (Últ. 24 meses)

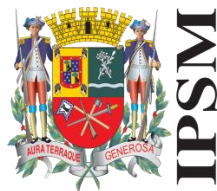


Retorno acumulado (Últ. 36 meses)



Risco x Retorno 36 meses





Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Perfil da Carteira - Maiores Investimentos						
Nome	Data Ult. Cart. Aberta	% 1º Maior Invest.	Nome 1º Maior Investimento	% 2º Maior Invest.	Nome 2º Maior Investimento	
● IPCA+6%	30/10/2020	100,00	IPCA Ibgc Acumul	-	-	
● BB Prev RF Tp IPCA V FI	31/10/2020	99,92	NTN-B 760199 2023-05-15 - Títulos públicos	0,07	NTN-B 760199 2045-05-15 - Operações compromissadas	
● Caixa FI Brasil 2024 II Tp RF	31/10/2020	99,80	NTN-B 760199 2024-08-15 - Títulos públicos	0,20	LTN 100000 2021-10-01 - Operações compromissadas	
● Caixa FI Brasil IPCA Xvi RF Cred...	31/10/2020	32,28	NTN-B 760199 2024-08-15 - Títulos públicos	21,99	NTN-B 760199 2023-05-15 - Títulos públicos	

Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)													
Nome	% Ações a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debên.	% Depósitos	% Oper. Comprom.	% Tít. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
● IPCA+6%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	30/10/2020	0,00	0,00	0,00
● BB Prev RF Tp IPCA V FI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,07	99,92	31/10/2020	0,00	99,99	0,00
● Caixa FI Brasil 2024 II Tp RF	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,20	99,80	31/10/2020	0,00	100,00	0,00
● Caixa FI Brasil IPCA Xvi RF Cr...	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	6,41	10,60	82,99	31/10/2020	0,00	100,00	0,00

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

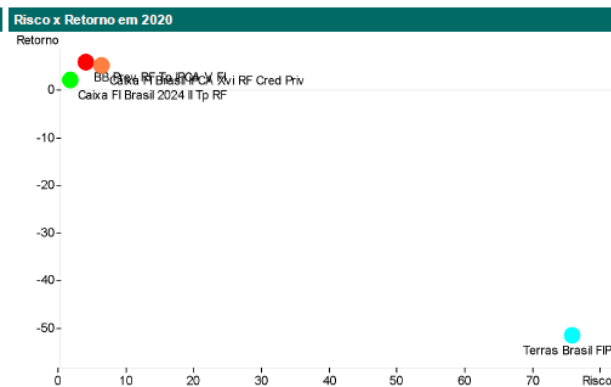
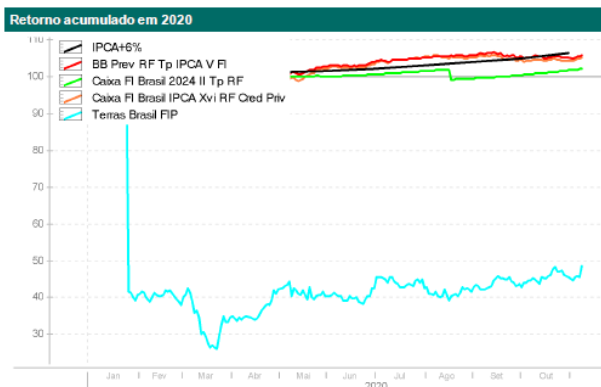
Fonte: Economatica

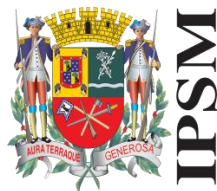
IPCA+ 6% (com Terras Brasil)

Dados Gerais													
Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Nº Cotistas	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark			
● IPCA+6%	-	-	-	28/12/1979	-	-	-	-	-	-			
● BB Prev RF Tp IPCA V FI	BB Dtvn S.A.	Renda Fixa Índices	83.253	25/02/2014	0,20	23	300.000	D+000	Não	-			
● Caixa FI Brasil 2024 II Tp RF	Caixa	Renda Fixa Índices	192.023	25/02/2014	0,20	38	1.000.000	D+000	Não	-			
● Caixa FI Brasil IPCA Xvi RF Cred...	Caixa	Renda Fixa Duração Liv...	184.902	17/04/2015	0,20	74	1.000	D+000	Não se Aplica	OUTROS			
● Terras Brasil FIP	BRZ Investimentos Ltda	Fundos de Participações	7.121	30/05/2014	2,00	8	1.000.000	Não se aplica	Não se Aplica	Não se Aplica			

Retornos (%) (até 05/11/2020)																							
	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	nov 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m	24m	36m	48m	
● IPCA+6%	1,60	0,72	0,67	0,58	0,15	0,08	0,75	0,90	0,73	1,13	1,35	-	9,79	10,46	-	-	-	-	-	-	-	-	
● BB Prev RF Tp IPCA V FI	1,44	0,66	0,77	-1,89	0,82	2,49	1,14	1,11	0,65	-0,31	-0,37	0,33	19,21	15,61	5,46	0,18	0,33	4,79	6,32	24,00	47,42	60,50	
● Caixa FI Brasil 2024 II Tp RF	1,35	1,31	-2,26	0,77	0,38	0,04	0,48	0,86	-1,95	0,89	1,31	0,19	4,18	4,10	1,96	1,35	0,28	1,76	4,00	7,04	12,16	15,22	
● Caixa FI Brasil IPCA Xvi RF Cred Priv	1,47	0,81	0,74	-2,91	0,87	2,82	1,26	1,86	-0,22	-0,63	-0,13	0,36	7,73	16,48	4,82	0,34	-0,54	5,26	5,23	23,55	32,47	46,22	
● Terras Brasil FIP	-0,36	-59,39	-6,58	-8,38	21,19	-4,24	5,87	-0,17	-2,36	5,26	4,24	0,35	49,29	-7,24	-54,17	3,76	11,49	6,41	-54,59	-57,76	-37,06	-40,22	

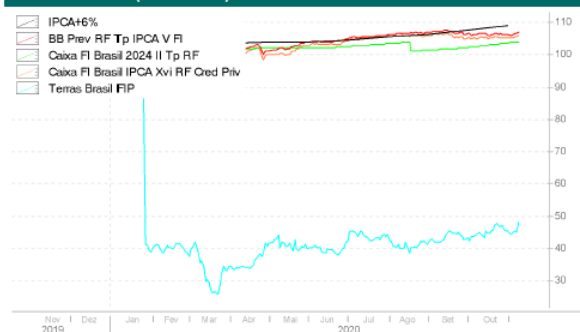
Tabela de Riscos (até 05/11/2020)										
Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Min 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos	
● IPCA+6%	-	-	-	-	0,00	1,60	0,08	-	-	
● BB Prev RF Tp IPCA V FI	6,13	0,54	2,89	9,99	-6,58	2,49	-1,89	9	3	
● Caixa FI Brasil 2024 II Tp RF	3,95	0,23	1,85	6,40	-2,74	1,35	-2,26	10	2	
● Caixa FI Brasil IPCA Xvi RF Cred Priv	8,23	0,29	3,87	13,41	-8,53	2,82	-2,91	8	4	
● Terras Brasil FIP	97,14	-0,50	34,06	117,99	-74,04	21,19	-59,39	5	7	



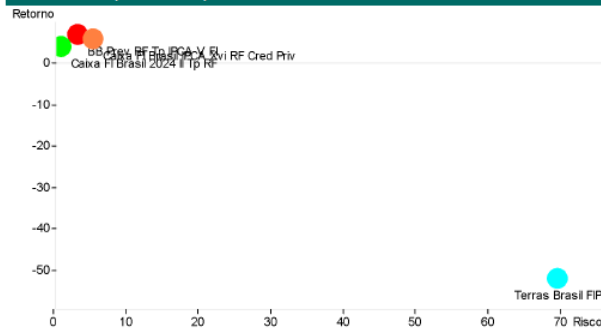


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

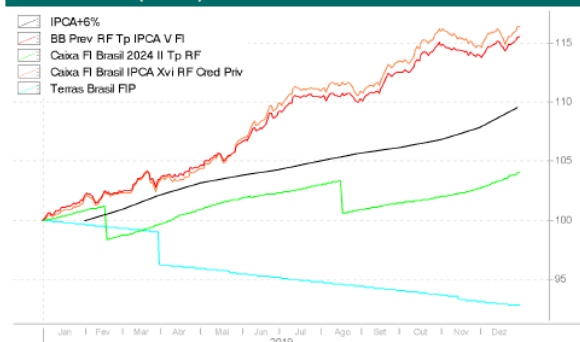
Retorno acumulado (Últ. 12 meses)



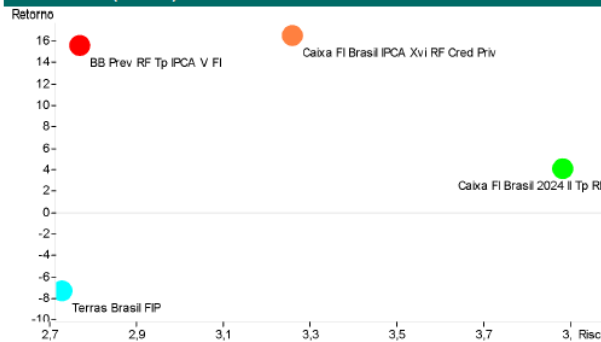
Risco x Retorno (Últ. 12 meses)



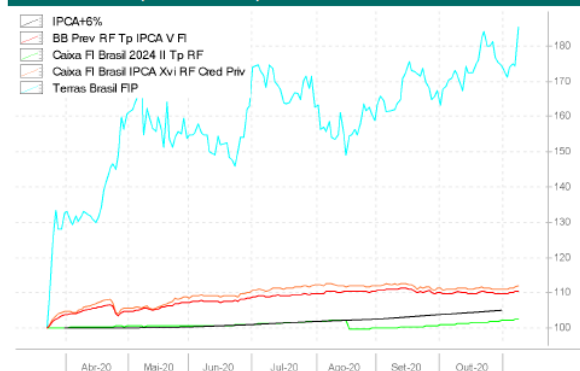
Retorno Acumulado (em 2019)



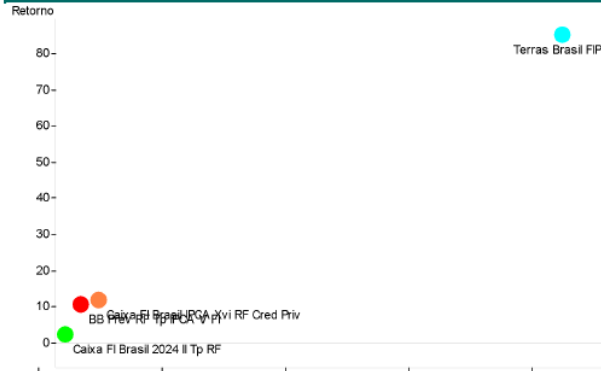
Risco x Retorno (em 2019)



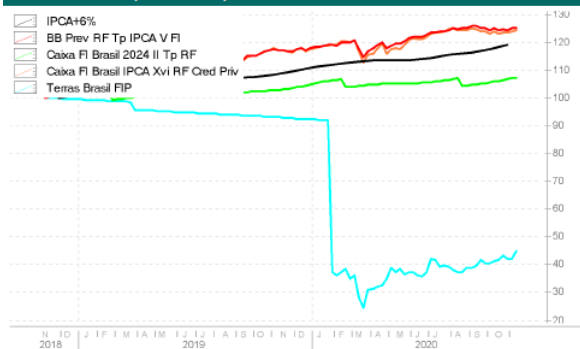
Retorno acumulado (desde 23/03/2020)



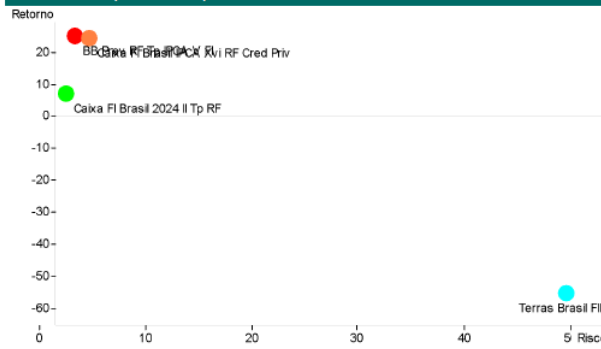
Risco x Retorno (desde 23/03/2020)

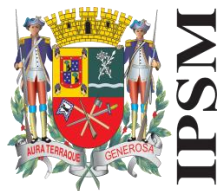


Retorno acumulado (Últ. 24 meses)

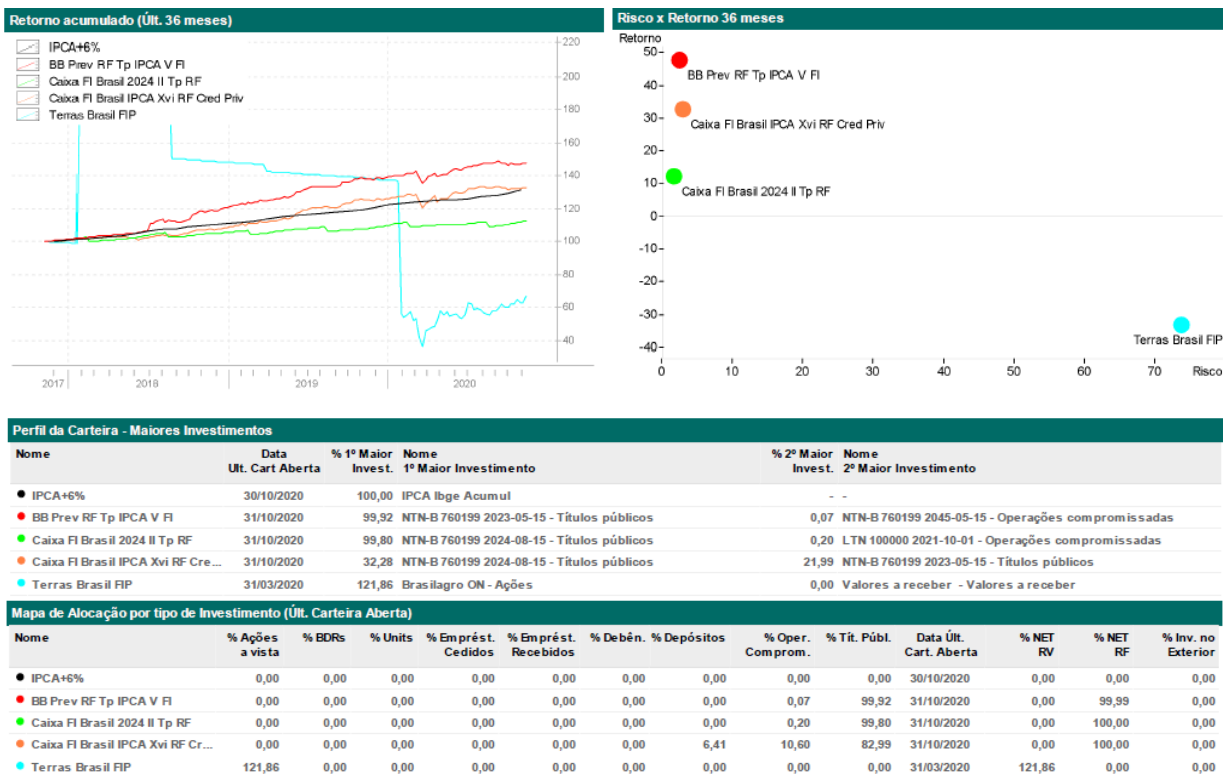


Risco x Retorno (Últ. 24 meses)



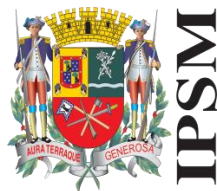


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos



As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

Fonte: Economatica



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

IPCA

Dados Gerais

Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Nº Cotistas	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark
● IPCA Ibge	-	-	-	28/12/1979	-	-	-	-	-	-
● Caixa FIC Brasil Gestao Estrateg...	Caixa	Renda Fixa Duração Liv...	12.021.109	04/11/2016	0,20	875	1.000	D+000	Não se Aplica	Não se Aplica
● BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfl	BB Dtvn S.A	Renda Fixa Duração Liv...	10.478.602	31/08/2016	0,50	590	1.000.000	D+003	Não se Aplica	IMA-GERAL...
● Itau Instit Alocacao Dinamica RF...	Itau Unibanco SA	Renda Fixa Duração Liv...	5.007.217	01/06/2015	0,40	276	5.000	D+001	Não se Aplica	OUTROS

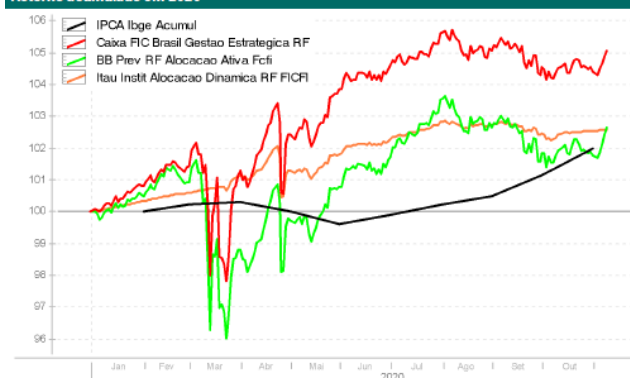
Retornos (%) (até 05/11/2020)

	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	nov 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m	24m	36m	48m
● IPCA Ibge	1,15	0,21	0,25	0,07	-0,31	-0,38	0,26	0,36	0,24	0,64	0,86	-	3,75	4,31	-	-	-	-	-	-	-	-
● Caixa FIC Brasil Gestao Estrategic...	0,59	0,82	0,62	-0,13	1,11	1,38	0,75	0,98	-0,56	-0,50	-0,11	0,22	7,82	16,43	4,64	0,25	-0,70	2,08	4,70	23,70	32,99	48,57
● BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfl	0,96	0,49	0,46	-2,10	0,91	1,07	0,95	1,77	-0,89	-0,75	-0,07	0,33	9,90	13,07	2,12	0,40	-1,10	2,36	2,04	17,56	28,50	44,75
● Itau Instit Alocacao Dinamica RF FL...	0,34	0,34	0,26	0,53	0,14	0,54	0,44	0,55	-0,12	-0,23	0,08	0,01	8,22	11,91	2,56	0,26	-0,21	1,24	3,22	17,30	25,75	42,79

Tabela de Riscos (até 05/11/2020)

Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Mín 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos
● IPCA Ibge	-	-	-	-	-0,69	1,15	-0,38	-	-
● Caixa FIC Brasil Gestao Estrategic...	5,96	0,28	2,81	9,75	-4,27	1,38	-0,56	8	4
● BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfl	6,25	-0,15	2,95	10,23	-5,49	1,77	-2,10	8	4
● Itau Instit Alocacao Dinamica RF FL...	1,66	0,03	0,79	2,72	-1,57	0,55	-0,23	10	2

Retorno acumulado em 2020



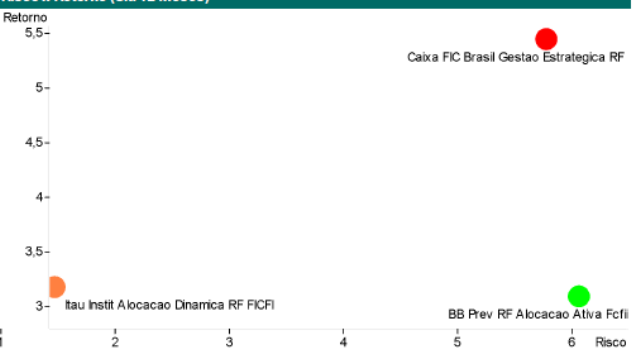
Risco x Retorno em 2020

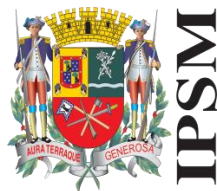


Retorno acumulado (Últ. 12 meses)



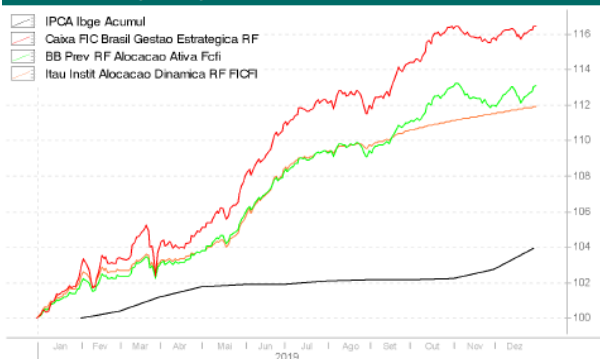
Risco x Retorno (Últ. 12 meses)



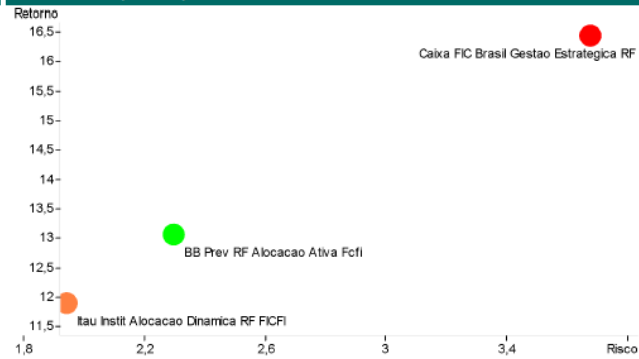


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

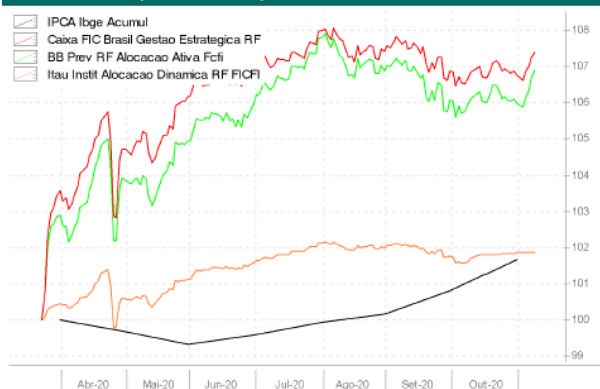
Retorno Acumulado (em 2019)



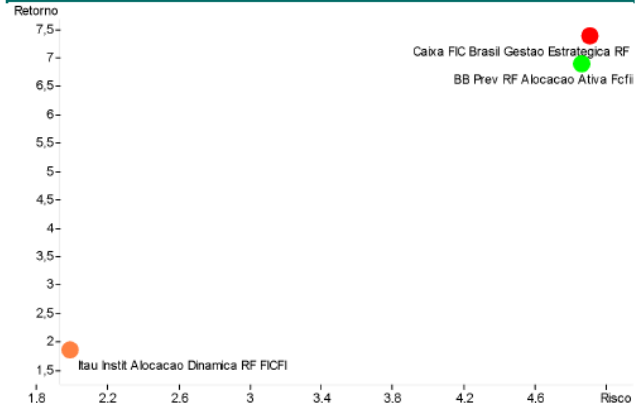
Risco x Retorno (em 2019)



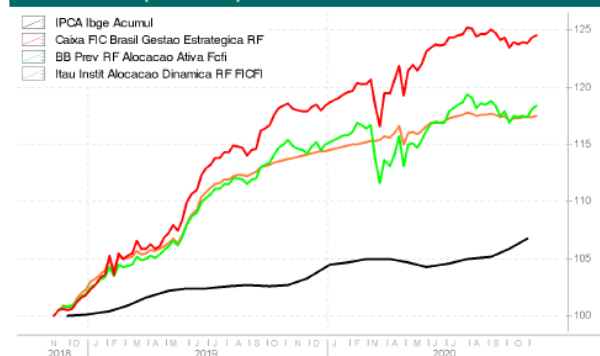
Retorno acumulado (desde 23/03/2020)



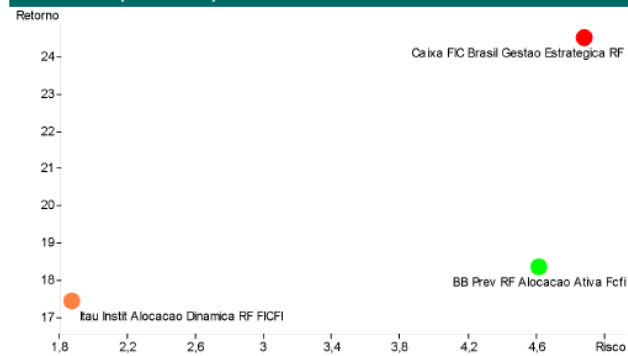
Risco x Retorno (desde 23/03/2020)



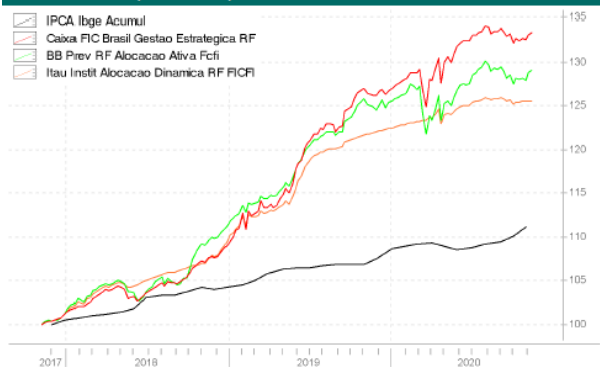
Retorno acumulado (Últ. 24 meses)



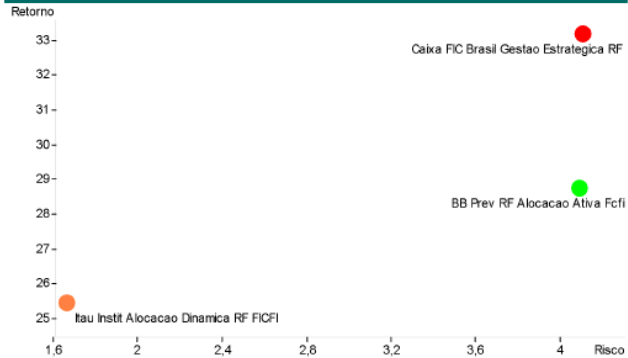
Risco x Retorno (Últ. 24 meses)

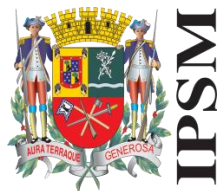


Retorno acumulado (Últ. 36 meses)



Risco x Retorno 36 meses





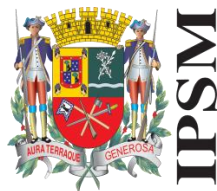
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Perfil da Carteira - Maiores Investimentos						
Nome	Data Últ. Cart. Aberta	% 1º Maior Invest.	Nome 1º Maior Investimento	% 2º Maior Invest.	Nome 2º Maior Investimento	
● IPCA Ibge	-	-	-	-	-	-
● Caixa FIC Brasil Gestao Estrat...	31/07/2020	16,71	NTN-F 950199 2025-01-01 - Operações compromissadas	8,80	NTN-F 950199 2023-01-01 - Títulos públicos	
● BB Prev RF Alocacao Ativa Fofi	31/10/2020	21,54	NTN-B 760199 2045-05-15 - Operações compromissadas	6,92	NTN-F 950199 2021-01-01 - Títulos públicos	
● Itau Instit Alocacao Dinamica...	30/09/2020	34,58	NTN-F 950199 2021-01-01 - Operações compromissadas	20,95	NTN-F 950199 2029-01-01 - Operações compromissadas	

Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)													
Nome	% Ações a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debên.	% Depósitos	% Oper. Comprom.	% Tit. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
● IPCA Ibgc	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-
● Caixa FIC Brasil Gestao Estra...	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	16,72	83,29	31/07/2020	0,00	100,01	0,00
● BB Prev RF Alocacao Ativa Fofi	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	21,54	78,50	31/10/2020	0,00	100,04	0,00
● Itau Instit Alocacao Dinamica...	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	55,66	44,40	30/09/2020	0,00	100,06	0,00

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

Fonte: Economatica

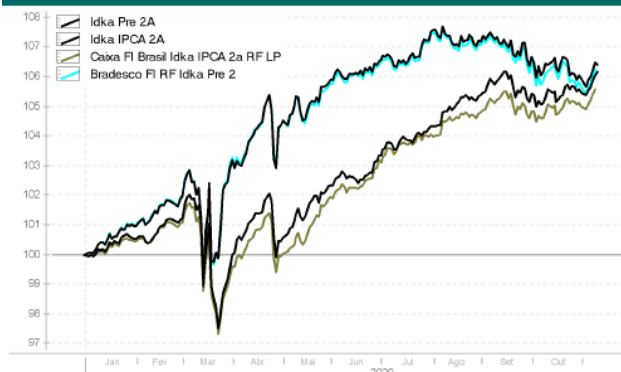


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

IDKA 2A

Dados Gerais																						
Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Nº Cotistas	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark												
● Idka Pre	-	-	-	30/12/2005	-	-	-	-	-	-												
● Idka IPCA	-	-	-	30/12/2005	-	-	-	-	-	-												
● Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	Caixa	Renda Fixa Indexados	8.608.759	16/08/2012	0,20	988	1.000	D+000	Não se Aplica	IDKA IPCA 2A												
● Bradesco FI RF Idka Pre 2	Bram Bradesco Asset Manag...	Renda Fixa Indexados	886.028	17/06/2016	-	125	10.000	D+000	Não se Aplica	IDKA PRÉ 2A												
Retornos (%) (até 05/11/2020)																						
	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	nov 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m	24m	36m	48m
● Idka Pre	0,60	0,95	1,03	1,18	1,28	1,30	0,70	0,89	-0,36	-0,47	-0,71	0,08	11,63	11,89	6,00	-0,32	-1,19	1,25	6,32	21,56	35,20	58,25
● Idka IPCA	1,20	0,54	0,69	-1,21	0,57	1,75	0,99	0,94	1,03	0,02	0,04	0,21	9,75	11,82	5,67	0,47	1,26	4,75	6,92	19,78	31,52	49,79
● Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	1,10	0,46	0,60	-1,45	0,43	1,91	1,18	0,83	0,79	0,04	0,15	0,21	9,30	11,19	5,22	0,52	1,12	5,00	6,36	18,37	29,35	45,98
● Bradesco FI RF Idka Pre 2	0,54	0,95	1,07	1,21	1,20	1,21	0,70	0,90	-0,39	-0,55	-0,74	0,09	11,29	11,60	5,75	-0,24	-1,33	1,05	5,96	20,94	34,04	56,13
Tabela de Riscos (até 05/11/2020)																						
Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Mín 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos													
● Idka Pre	5,72	0,57	2,70	9,35	-3,80	1,30	-0,71	9	3													
● Idka IPCA	4,43	0,85	2,09	7,23	-4,40	1,75	-1,21	11	1													
● Caixa FI Brasil Idka IPCA 2a RF LP	4,12	0,78	1,94	6,73	-4,32	1,91	-1,45	11	1													
● Bradesco FI RF Idka Pre 2	5,71	0,51	2,69	9,32	-3,84	1,21	-0,74	9	3													

Retorno acumulado em 2020



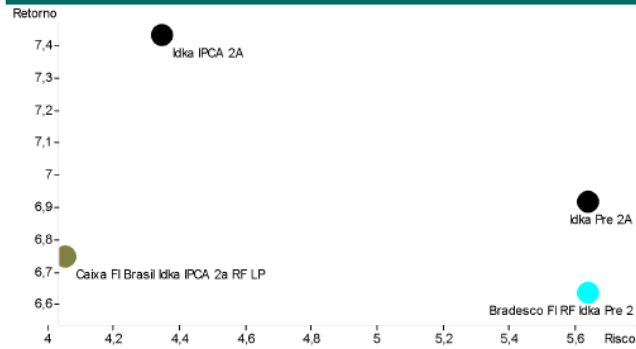
Risco x Retorno em 2020



Retorno acumulado (Últ. 12 meses)

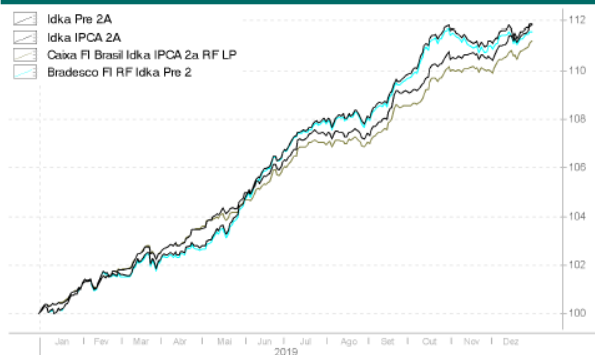


Risco x Retorno (Últ. 12 meses)

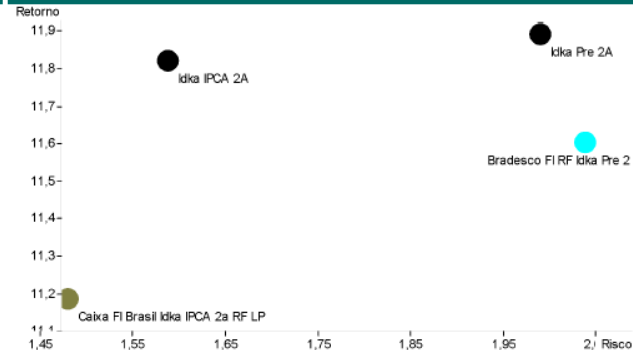


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Retorno Acumulado (em 2019)



Risco x Retorno (em 2019)



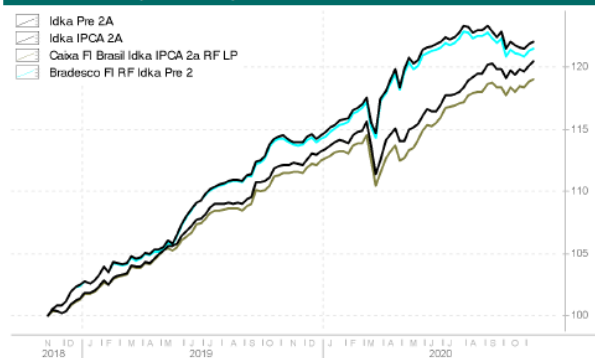
Retorno acumulado (desde 23/03/2020)



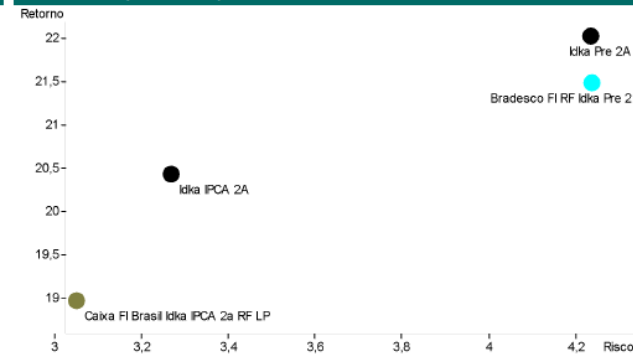
Risco x Retorno (desde 23/03/2020)

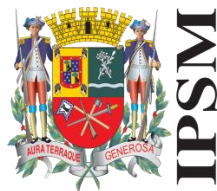


Retorno acumulado (Últ. 24 meses)

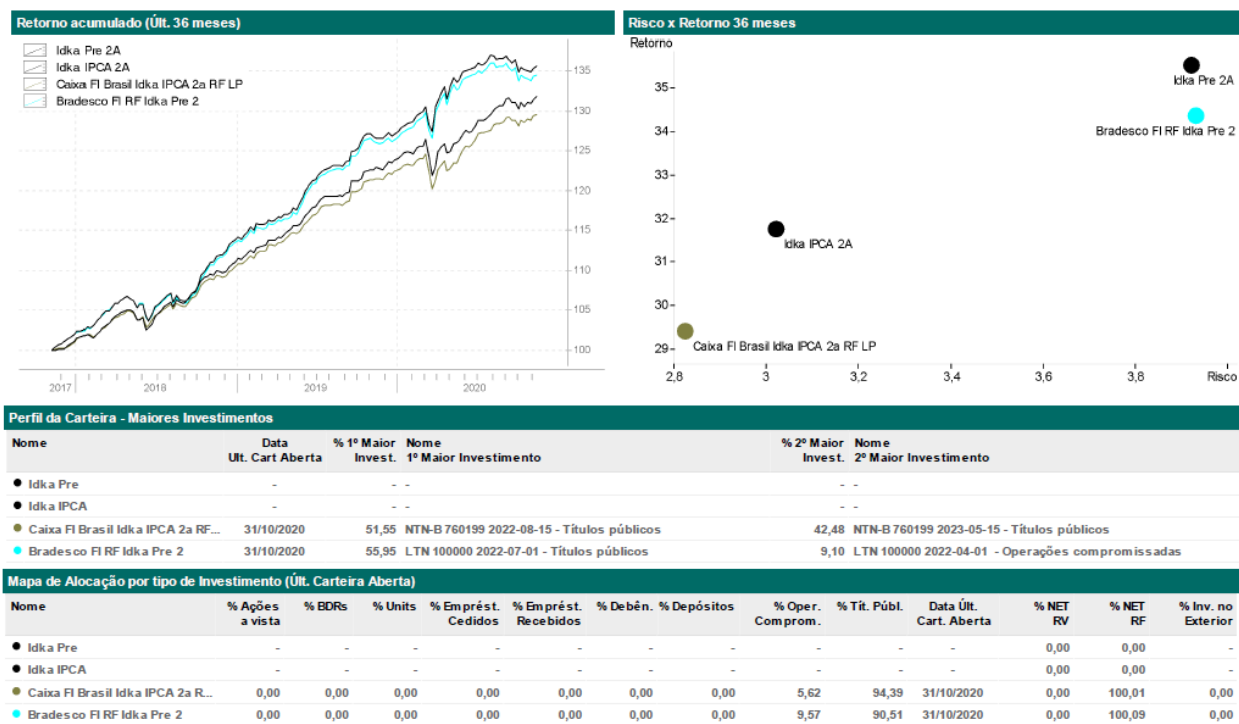


Risco x Retorno (Últ. 24 meses)



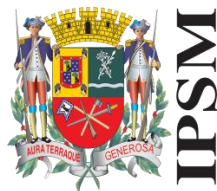


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos



As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

Fonte: Economatica



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

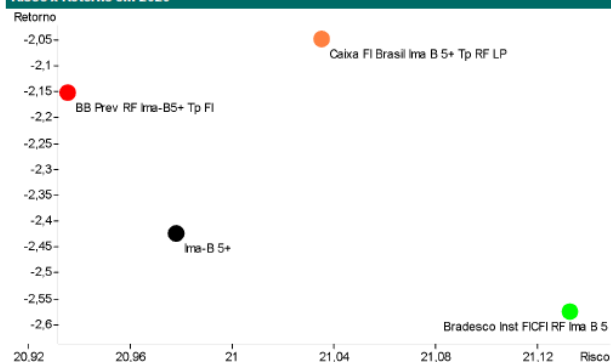
IMA-B 5+

Dados Gerais																						
Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Nº Cotistas	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto res gate	Invest no exterior	Benchmark												
● Ima-B	-	-	-	16/09/2003	-	-	-	-	-	-												
● BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI	BB Dtv S.A	Renda Fixa Indexados	2.059.269	28/04/2011	0,20	310	10.000	D+002	Não se Aplica	IMA-B 5+												
● Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	Bram Bradesco Asset Manag...	Renda Fixa Duração Alt...	273.693	30/06/2011	0,20	47	50.000	D+001	Não se Aplica	IMA-B 5+												
● Caixa FI Brasil Ima B 5+ Tp RF LP	Caixa	Renda Fixa Indexados	2.032.766	18/04/2012	0,20	331	1.000	D+000	Não se Aplica	IMA-B 5+												
Retornos (%) (até 05/11/2020)																						
	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	nov 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m	24m	36m	48m
● Ima-B	2,60	0,03	0,32	-10,93	2,01	1,02	2,84	7,32	-3,62	-2,60	0,22	1,20	15,41	30,37	-3,20	1,66	-3,93	6,23	-5,08	30,28	46,77	66,62
● BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI	2,72	0,05	0,30	-10,89	1,92	1,00	2,80	7,28	-3,69	-2,65	0,20	1,13	15,14	30,05	-3,55	1,58	-4,12	5,92	-5,35	29,53	45,44	64,30
● Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	2,60	-0,03	0,29	-11,33	1,97	1,01	2,75	7,33	-3,73	-2,59	0,21	1,19	15,04	29,91	-3,98	1,65	-4,04	5,98	-5,88	28,74	44,54	63,57
● Caixa FI Brasil Ima B 5+ Tp RF LP	2,56	-0,04	0,29	-10,91	1,95	1,00	2,83	7,29	-3,64	-2,64	0,22	1,20	14,98	29,73	-3,47	1,67	-4,00	6,09	-5,49	29,14	45,02	64,24
Tabela de Riscos (até 05/11/2020)																						
Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Min 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos													
● Ima-B	19,77	-0,32	9,32	32,29	-18,71	7,32	-10,93	9	3													
● BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI	19,68	-0,33	9,28	32,15	-18,57	7,28	-10,89	9	3													
● Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	19,90	-0,36	9,37	32,46	-19,06	7,33	-11,33	8	4													
● Caixa FI Brasil Ima B 5+ Tp RF LP	19,79	-0,34	9,33	32,32	-18,69	7,29	-10,91	8	4													

Retorno acumulado em 2020



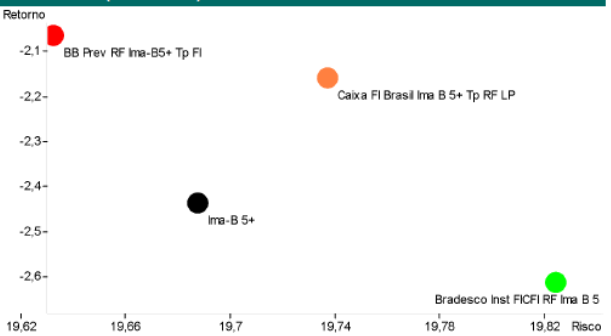
Risco x Retorno em 2020



Retorno acumulado (Últ. 12 meses)



Risco x Retorno (Últ. 12 meses)

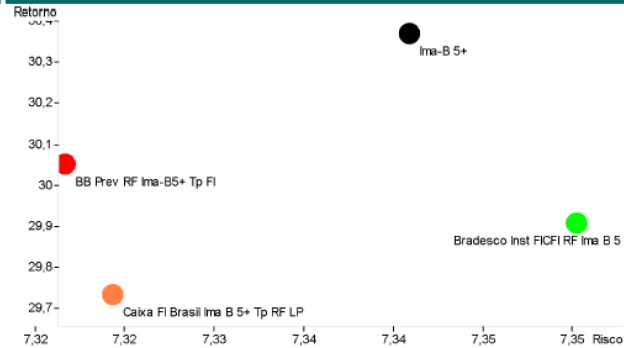


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Retorno Acumulado (em 2019)



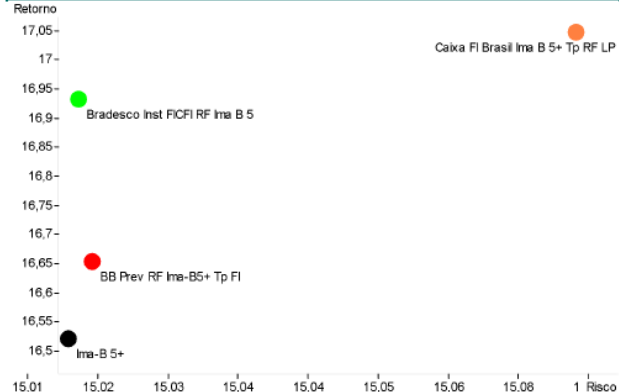
Risco x Retorno (em 2019)



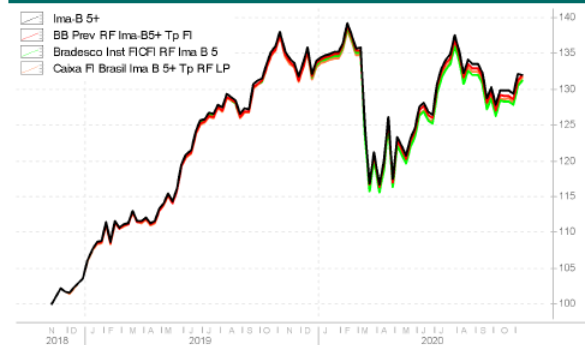
Retorno acumulado (desde 23/03/2020)



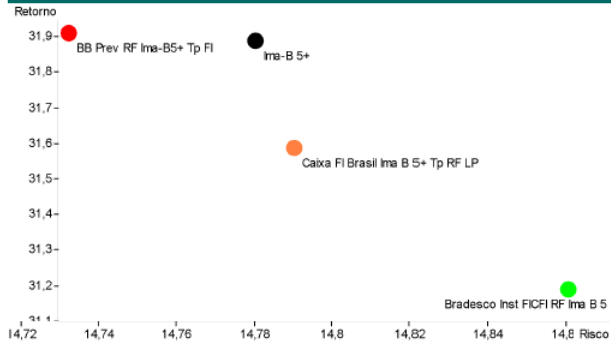
Risco x Retorno (desde 23/03/2020)



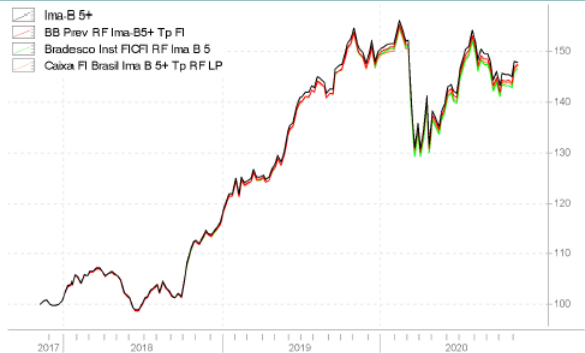
Retorno acumulado (Últ. 24 meses)



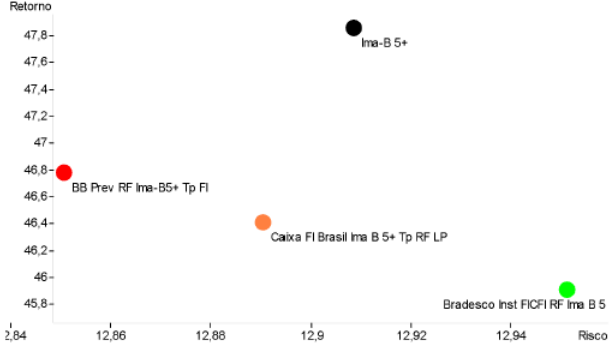
Risco x Retorno (Últ. 24 meses)

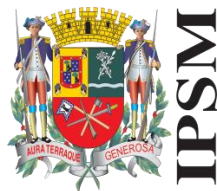


Retorno acumulado (Últ. 36 meses)



Risco x Retorno 36 meses





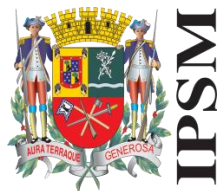
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Perfil da Carteira - Maiores Investimentos					
Nome	Data Últ. Cart. Aberta	% 1º Maior Invest.	Nome 1º Maior Investimento	% 2º Maior Invest.	Nome 2º Maior Investimento
● Ima-B	-	-	-	-	-
● BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI	31/10/2020	28,47	NTN-B 760199 2050-08-15 - Títulos públicos	16,53	NTN-B 760199 2045-05-15 - Títulos públicos
● Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	31/10/2020	24,02	NTN-B 760199 2050-08-15 - Títulos públicos	22,03	NTN-B 760199 2045-05-15 - Títulos públicos
● Caixa FI Brasil Ima B 5+ Tp RF LP	31/10/2020	28,41	NTN-B 760199 2050-08-15 - Títulos públicos	16,58	NTN-B 760199 2045-05-15 - Títulos públicos

Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)													
Nome	% Ações a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debên.	% Depósitos	% Oper. Comprom.	% Tít. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
● Ima-B	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-
● BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	8,65	91,38	31/10/2020	0,00	100,02	0,00
● Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1,22	98,80	31/10/2020	0,00	100,02	0,00
● Caixa FI Brasil Ima B 5+ Tp RF...	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	5,16	94,85	31/10/2020	0,00	100,02	0,00

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo, ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

Fonte: Economatica



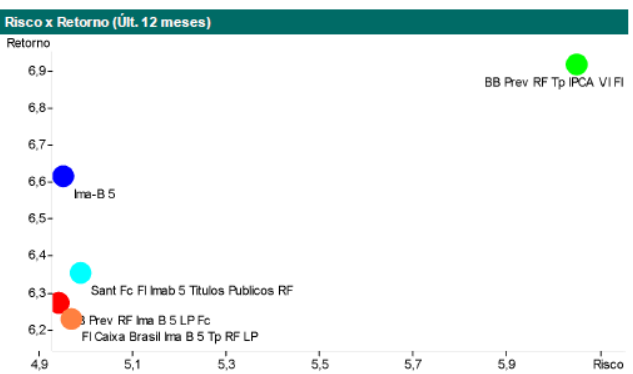
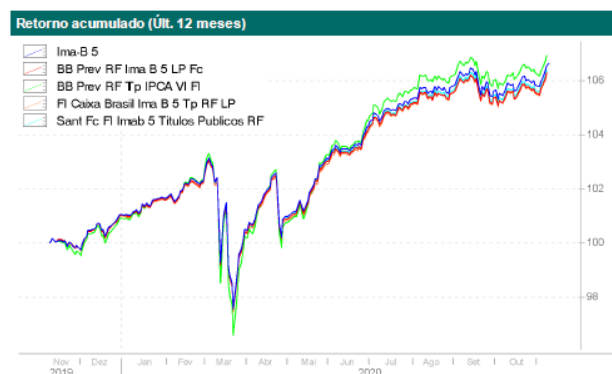
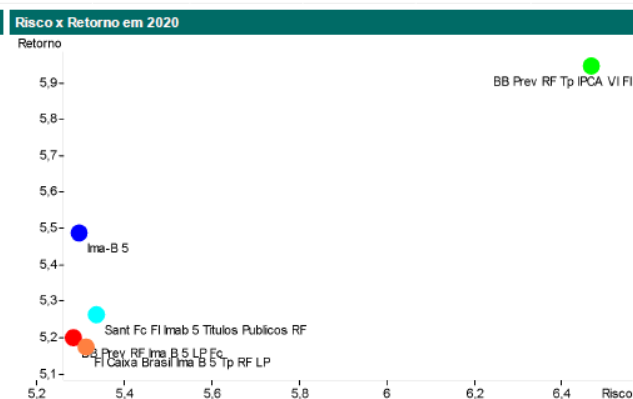
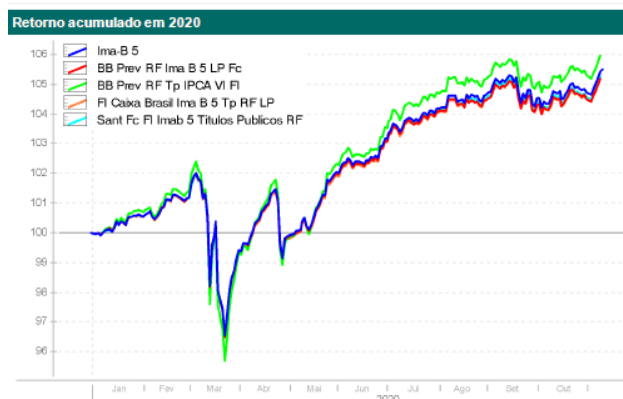
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

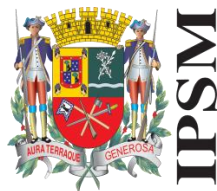
IMA-B 5

Dados Gerais										
Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Nº Cotistas	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark
Ima-B	-	-	-	16/09/2003	-	-	-	-	-	-
BB Prev RF Ima B 5 LP Fc	BB Dtvn S.A	Renda Fixa Indexados	4.379.459	30/09/2013	0,20	656	1.000	D+001	Não se Aplica IMA-B 5	
BB Prev RF Tp IPCA VI FI	BB Dtvn S.A	Renda Fixa Duração Liv...	285.625	20/03/2014	0,20	31	300.000	D+000	Não se Aplica IMA-B 5	
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	Caixa	Renda Fixa Indexados	12.058.272	09/07/2010	0,20	954	1.000	D+000	Não se Aplica IMA-B 5	
Sant Fc FI Imab 5 Titulos Publicos...	Santander Brasil Gestao de R...	Renda Fixa Indexados	1.124.548	06/09/2011	0,20	160	50.000	D+001	Não se Aplica IMA-B 5	

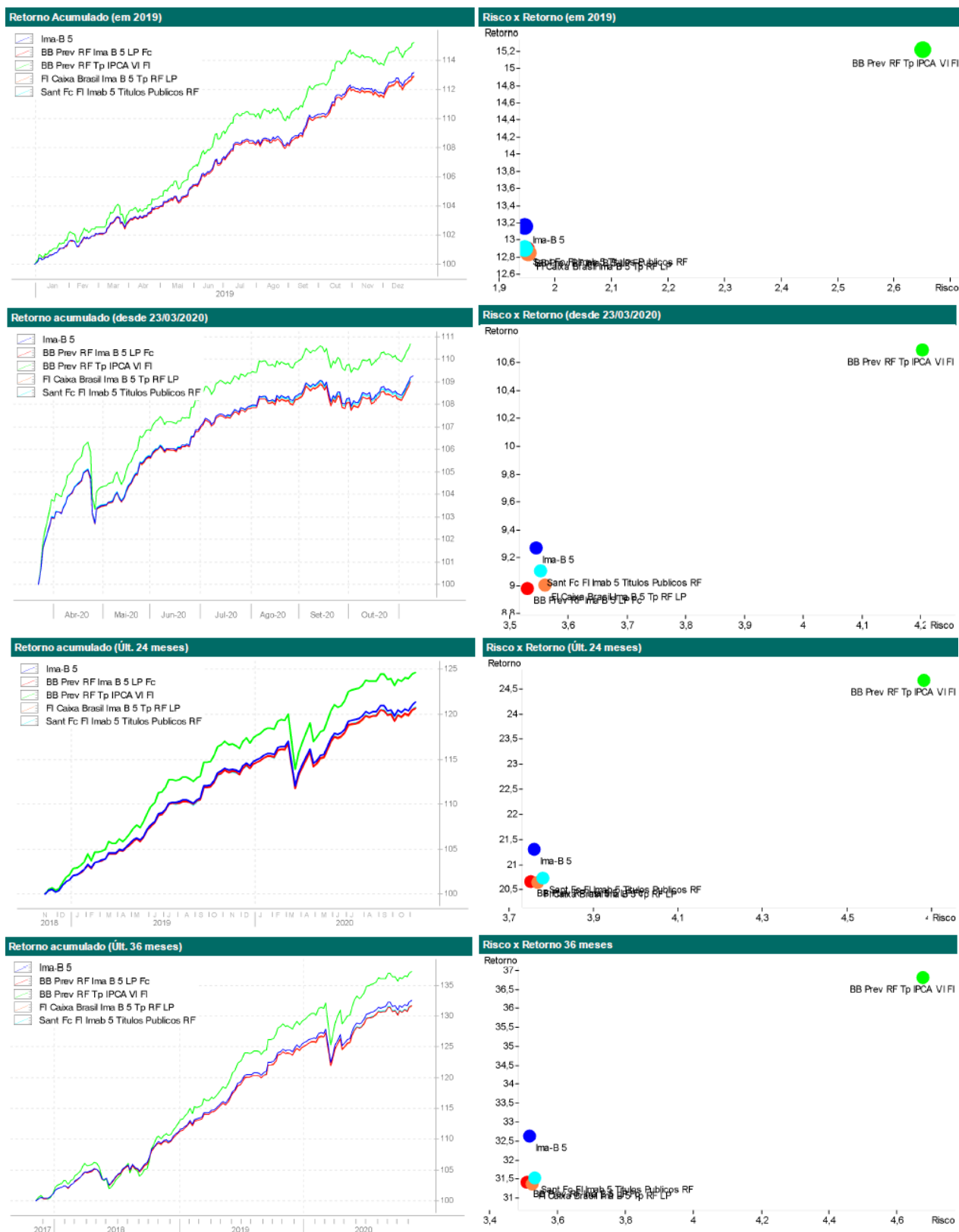
Retornos (%) (até 05/11/2020)										
	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020
Ima-B	1,24	0,56	0,64	-1,75	0,49	2,12	1,12	0,99	0,43	-0,12
BB Prev RF Ima B 5 LP Fc	1,19	0,56	0,65	-1,79	0,49	2,11	1,08	0,97	0,37	-0,15
BB Prev RF Tp IPCA VI FI	1,28	0,69	0,72	-2,06	0,54	2,45	1,20	1,12	0,46	-0,14
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	1,21	0,54	0,63	-1,80	0,47	2,11	1,10	0,97	0,39	-0,16
Sant Fc FI Imab 5 Titulos Publicos...	1,22	0,54	0,62	-1,75	0,49	2,13	1,08	0,97	0,40	-0,14

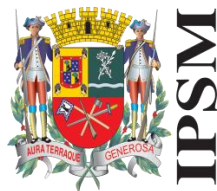
Tabela de Riscos (até 05/11/2020)									
Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Min 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos
Ima-B	5,02	0,58	2,36	8,19	-5,38	2,12	-1,75	10	2
BB Prev RF Ima B 5 LP Fc	5,00	0,53	2,35	8,15	-5,39	2,11	-1,79	10	2
BB Prev RF Tp IPCA VI FI	6,12	0,54	2,88	9,97	-6,52	2,45	-2,06	10	2
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	5,03	0,52	2,37	8,20	-5,40	2,11	-1,80	10	2
Sant Fc FI Imab 5 Titulos Publicos RF	5,05	0,54	2,38	8,23	-5,40	2,13	-1,75	10	2





Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos





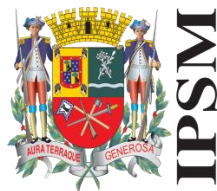
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Perfil da Carteira - Maiores Investimentos												
Nome	Data Últ. Cart. Aberta	% 1º Maior Invest.	Nome 1º Maior Investimento	% 2º Maior Invest.	Nome 2º Maior Investimento							
Ima-B	-	-	-	-	-							
BB Prev RF Ima B 5 LP Fc	31/10/2020	28,37	NTN-B 760199 2022-08-15 - Títulos públicos	17,36	NTN-B 760199 2024-08-15 - Títulos públicos							
BB Prev RF Tp IPCA VI FI	31/10/2020	66,22	NTN-B 760199 2022-08-15 - Títulos públicos	33,62	NTN-B 760199 2024-08-15 - Títulos públicos							
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	31/10/2020	31,15	NTN-B 760199 2022-08-15 - Títulos públicos	19,85	NTN-B 760199 2023-05-15 - Títulos públicos							
Sant Fc FI Imab 5 Títulos Publi...	31/10/2020	31,17	NTN-B 760199 2022-08-15 - Títulos públicos	20,97	NTN-B 760199 2024-08-15 - Títulos públicos							

Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)													
Nome	% Ações a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debên.	% Depósitos	% Oper. Comprom.	% Tít. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
Ima-B	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-
BB Prev RF Ima B 5 LP Fc	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	11,41	88,61	31/10/2020	0,00	100,02	0,00
BB Prev RF Tp IPCA VI FI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,15	99,84	31/10/2020	0,00	100,00	0,00
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1,98	98,03	31/10/2020	0,00	100,00	0,00
Sant Fc FI Imab 5 Títulos Publi...	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,16	99,93	31/10/2020	0,00	100,09	0,00

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Ecomatoma é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

Fonte: Ecomatoma



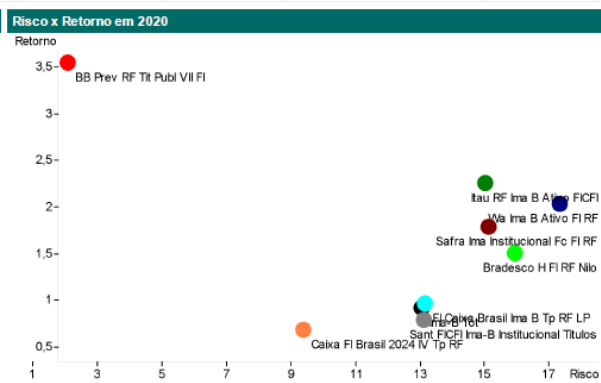
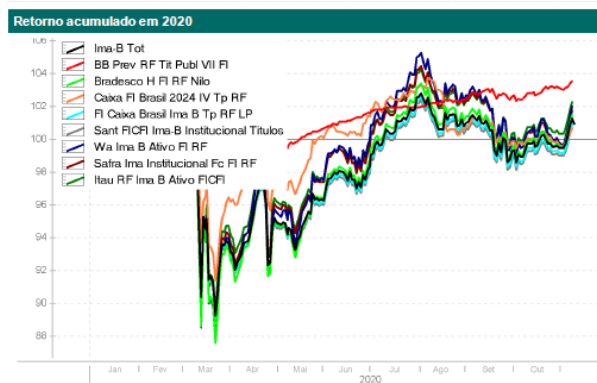
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

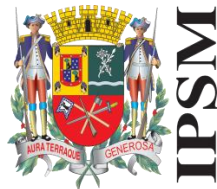
IMA-B

Dados Gerais											
Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Nº Cotistas	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark	
● Ima-B	-	-	-	16/09/2003	-	-	-	-	-	-	
● BB Prev RF Tit Publ VII FI	BB Dtvn S.A.	Renda Fixa Duração Liv...	533.421	16/03/2015	0,20	165	300.000	D+000	Não se Aplica	IMA-B	
● Bradesco H FI RF Nilo	Bram Bradesco Asset Manag...	Renda Fixa Duração Bai...	848.409	28/12/2012	0,30	26	300.000	D+004	Não se Aplica	IMA-B	
● Caixa FI Brasil 2024 IV Tp RF	Caixa	Renda Fixa Duração Liv...	1.409.108	09/03/2015	0,20	74	300.000	D+000	Não se Aplica	IMA-B	
● FI Caixa Brasil Ima B Tp RF LP	Caixa	Renda Fixa Indexados	6.129.684	08/03/2010	0,20	901	1.000	D+000	Não se Aplica	IMA-B	
● Sant FICFI Ima-B Institucional Titul...	Santander Brasil Gestao de R...	Renda Fixa Indexados	1.236.399	29/12/2011	0,20	195	50.000	D+001	Não se Aplica	IMA-B	
● Wa Ima B Ativo FI RF	Western Asset	Renda Fixa Duração Liv...	486.941	24/09/2010	0,50	53	5.000	D+001	Não se Aplica	IMA-B	
● Safra Ima Institucional Fc FI RF	Banco J Safra SA	Renda Fixa Duração Liv...	1.684.169	31/10/2018	0,20	48	1.000.000	D+004	Não se Aplica	IMA-B	
● Itau RF Ima B Ativo FICFI	Itau Unibanco SA	Renda Fixa Duração Alt...	480.047	17/10/2002	0,50	105	100.000	D+001	Não se Aplica	IMA-B	

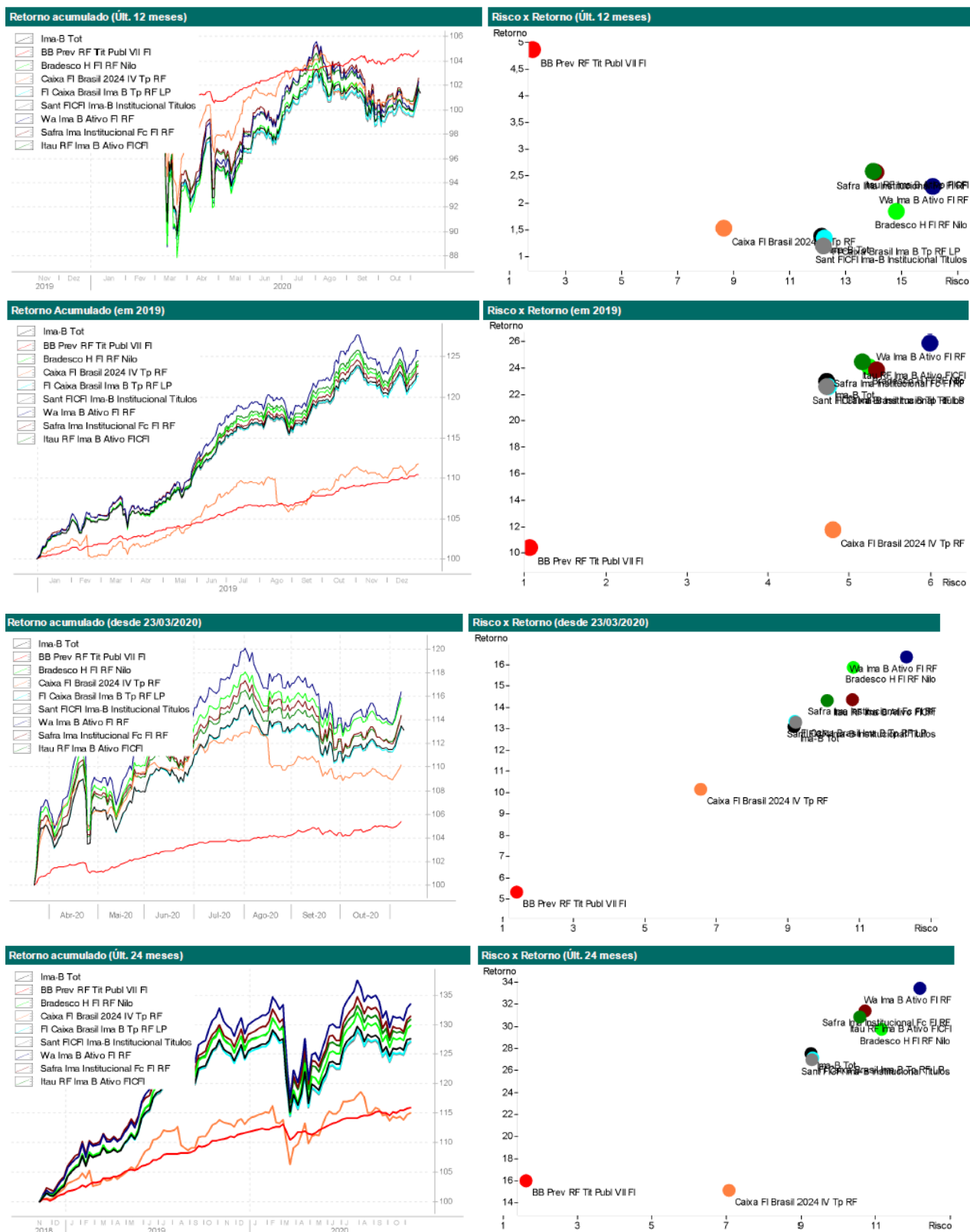
Retornos (%) (até 05/11/2020)											
	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020
● Ima-B	2,01	0,26	0,45	-6,97	1,31	1,52	2,05	4,39	-1,80	-1,51	0,21
● BB Prev RF Tit Publ VII FI	0,92	0,20	0,41	-1,34	0,14	1,25	0,99	0,32	0,47	0,19	0,49
● Bradesco H FI RF Nilo	2,05	0,37	0,55	-7,55	1,65	1,75	2,28	4,62	-2,05	-1,61	0,06
● Caixa FI Brasil 2024 IV Tp RF	1,49	0,80	-1,67	-2,69	0,70	3,16	1,24	1,77	-2,51	-0,77	-0,18
● FI Caixa Brasil Ima B Tp RF LP	1,99	0,25	0,44	-7,10	1,30	1,50	2,03	4,38	-1,83	-1,53	0,19
● Sant FICFI Ima-B Institucional Titul...	1,98	0,24	0,43	-7,17	1,26	1,49	2,00	4,36	-1,82	-1,54	0,19
● Wa Ima B Ativo FI RF	2,16	0,55	0,81	-7,34	1,69	2,22	2,37	5,13	-2,62	-2,18	-0,28
● Safra Ima Institucional Fc FI RF	2,24	0,35	0,65	-6,70	1,77	1,60	2,11	4,81	-2,03	-2,09	-0,26
● Itau RF Ima B Ativo FICFI	2,05	0,21	0,70	-6,12	1,53	1,59	1,99	4,43	-1,92	-1,67	-0,00

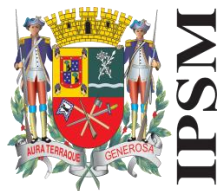
Tabela de Riscos (até 05/11/2020)											
Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Mín 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos		
● Ima-B	12,76	-0,22	6,01	20,82	-12,68	4,39	-6,97	9	3		
● BB Prev RF Tit Publ VII FI	2,40	0,60	1,13	3,93	-2,66	1,25	-1,34	11	1		
● Bradesco H FI RF Nilo	15,44	-0,16	7,27	25,18	-14,56	4,62	-7,55	9	3		
● Caixa FI Brasil 2024 IV Tp RF	9,27	-0,22	4,35	15,08	-10,13	3,16	-2,69	7	5		
● FI Caixa Brasil Ima B Tp RF LP	12,82	-0,25	6,04	20,92	-12,80	4,38	-7,10	9	3		
● Sant FICFI Ima-B Institucional Titul...	12,80	-0,25	6,03	20,88	-12,93	4,36	-7,17	9	3		
● Wa Ima B Ativo FI RF	16,76	-0,13	7,88	27,30	-14,91	5,13	-7,34	8	4		
● Safra Ima Institucional Fc FI RF	14,67	-0,13	6,91	23,93	-13,28	4,81	-6,70	8	4		
● Itau RF Ima B Ativo FICFI	14,57	-0,13	6,87	23,79	-12,79	4,43	-6,12	8	4		



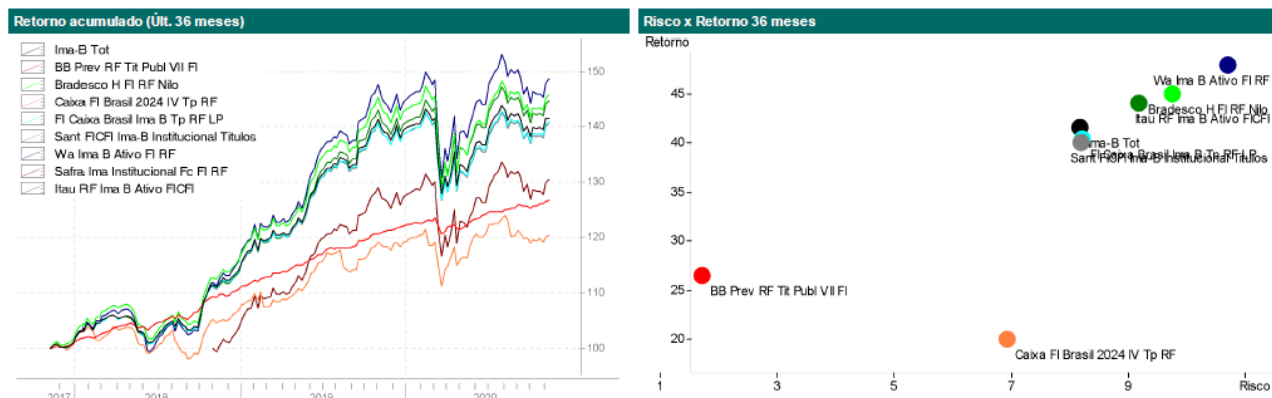


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos





Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos



Perfil da Carteira - Maiores Investimentos

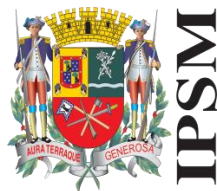
Nome	Data Últ. Cart. Aberta	% 1º Maior Invest.	Nome 1º Maior Investimento	% 2º Maior Invest.	Nome 2º Maior Investimento
● Ima-B	-	-	-	-	-
● BB Prev RF Tit Publ VII FI	31/10/2020	99,48	NTN-B 760199 2022-08-15 - Títulos públicos	0,52	NTN-B 760199 2045-05-15 - Operações compromissadas
● Bradesco H FI RF Nilo	31/10/2020	17,70	NTN-B 760199 2050-08-15 - Títulos públicos	13,18	NTN-B 760199 2045-05-15 - Títulos públicos
● Caixa FI Brasil 2024 IV Tp RF	31/10/2020	99,81	NTN-B 760199 2024-08-15 - Títulos públicos	0,19	LTN 100000 2021-10-01 - Operações compromissadas
● FI Caixa Brasil Ima B Tp RF LP	31/10/2020	15,68	NTN-B 760199 2050-08-15 - Títulos públicos	13,98	NTN-B 760199 2022-08-15 - Títulos públicos
● Sant FICFI Ima-B Institucional Titulos	30/09/2020	15,63	NTN-B 760199 2050-08-15 - Títulos públicos	13,98	NTN-B 760199 2022-08-15 - Títulos públicos
● Wa Ima B Ativo FI RF	31/10/2020	17,65	NTN-B 760199 2050-08-15 - Títulos públicos	10,17	NTN-B 760199 2022-08-15 - Títulos públicos
● Safra Ima Institucional Fc FI RF	31/07/2020	36,08	NTN-B 760199 2050-08-15 - Títulos públicos	15,02	NTN-B 760199 2024-08-15 - Títulos públicos
● Itau RF Ima B Ativo FICFI	30/09/2020	15,58	NTN-B 760199 2050-08-15 - Títulos públicos	9,53	Índice IDI - Opç venda - posiç titulares

Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)

Nome	% Ações a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debên.	% Depósitos	% Oper. Comprom.	% Tít. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
● Ima-B	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-
● BB Prev RF Tit Publ VII FI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,52	99,48	31/10/2020	0,00	100,00	0,00
● Bradesco H FI RF Nilo	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1,97	3,88	3,26	91,35	31/10/2020	0,00	100,46	0,00
● Caixa FI Brasil 2024 IV Tp RF	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,19	99,81	31/10/2020	0,00	100,00	0,00
● FI Caixa Brasil Ima B Tp RF LP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	5,52	94,49	31/10/2020	0,00	100,01	0,00
● Sant FICFI Ima-B Institucional...	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,13	99,91	30/09/2020	0,00	100,04	0,00
● Wa Ima B Ativo FI RF	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,44	99,70	31/10/2020	0,00	100,14	0,00
● Safra Ima Institucional Fc FI RF	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	13,32	86,75	31/10/2020	0,00	100,07	0,00
● Itau RF Ima B Ativo FICFI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	6,21	8,30	0,24	85,01	31/10/2020	0,00	99,77	0,00

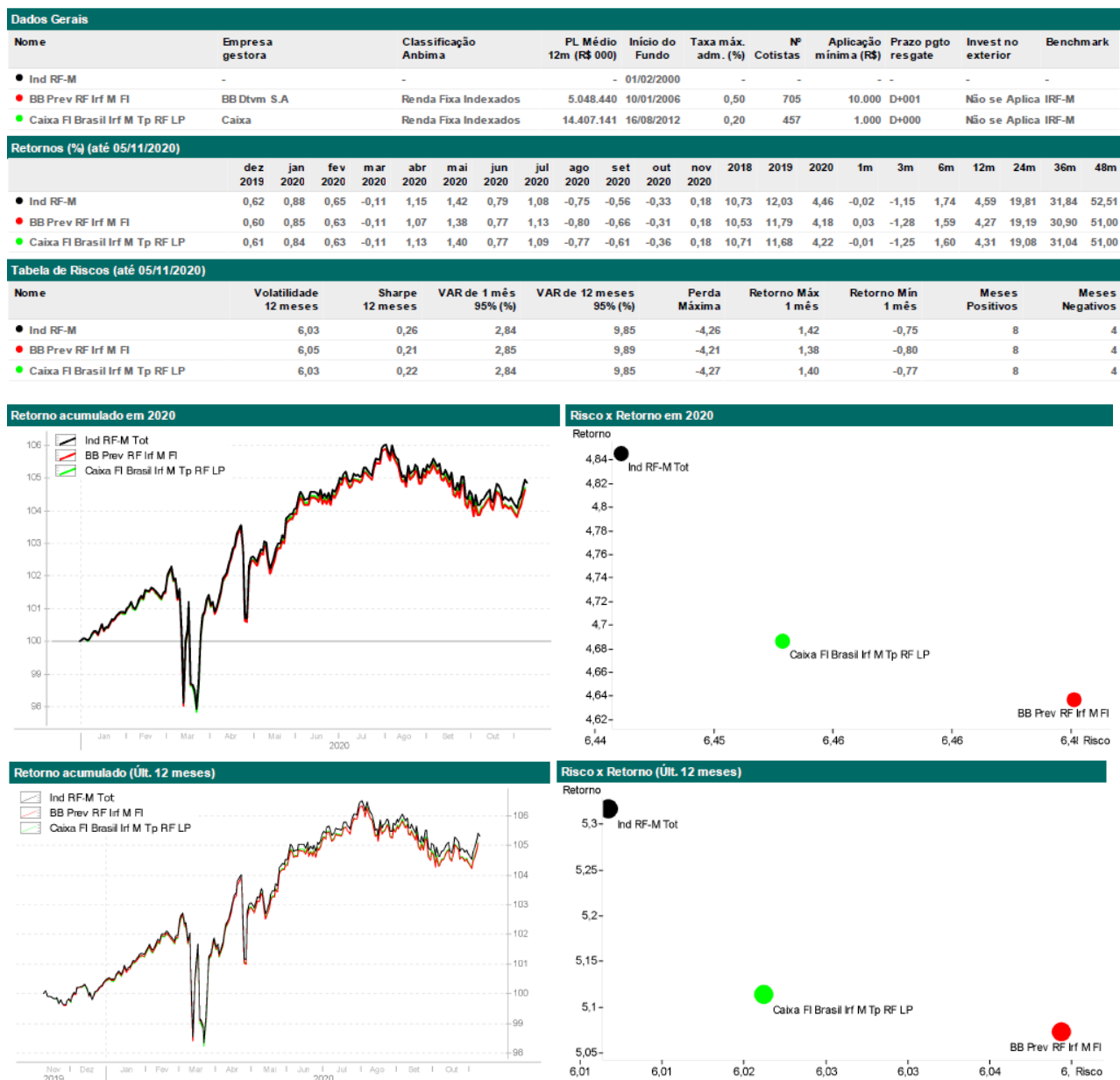
As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

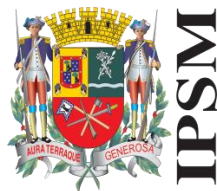
Fonte: Economatica



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

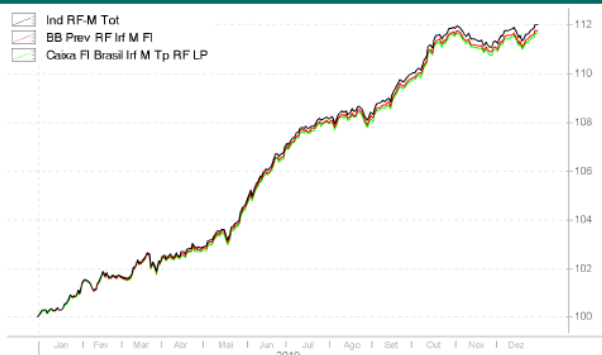
IRF-M



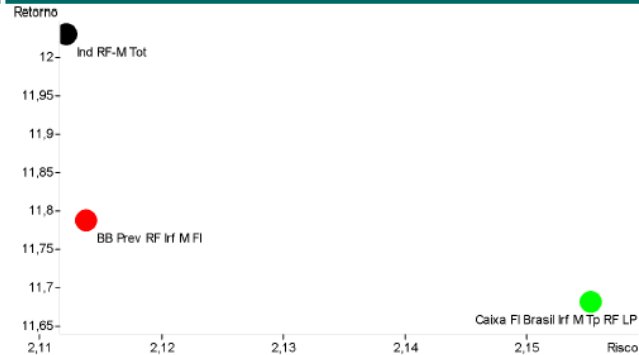


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Retorno Acumulado (em 2019)



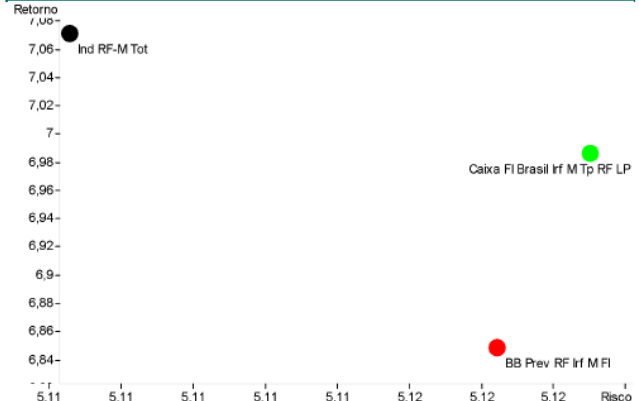
Risco x Retorno (em 2019)



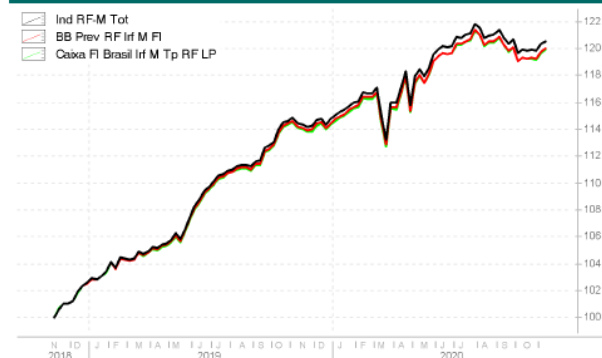
Retorno acumulado (desde 23/03/2020)



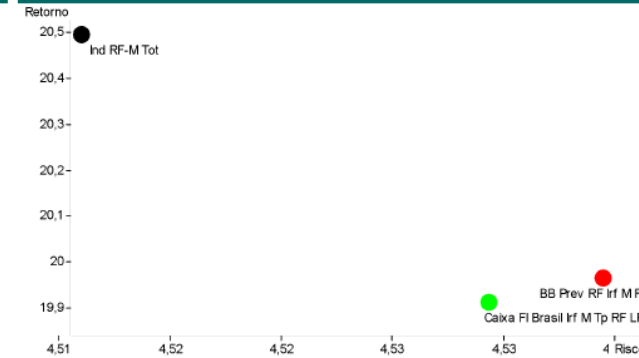
Risco x Retorno (desde 23/03/2020)



Retorno acumulado (Últ. 24 meses)



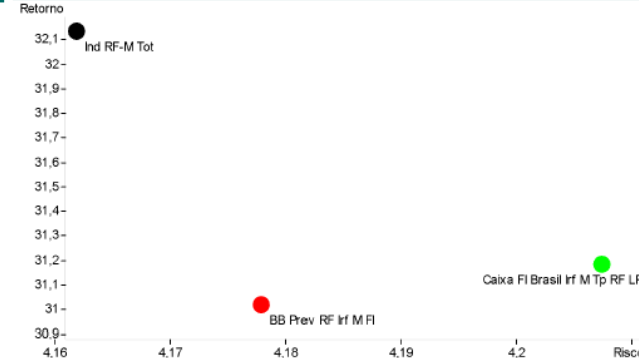
Risco x Retorno (Últ. 24 meses)

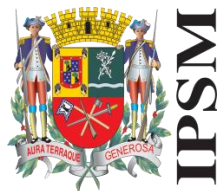


Retorno acumulado (Últ. 36 meses)



Risco x Retorno 36 meses





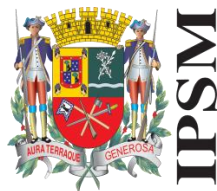
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Perfil da Carteira - Maiores Investimentos					
Nome	Data Últ. Cart. Aberta	% 1º Maior Invest.	Nome 1º Maior Investimento	% 2º Maior Invest.	Nome 2º Maior Investimento
● Ind RF-M	-	-	-	-	-
● BB Prev RF Irf M FI	31/10/2020	18,13	NTN-B 760199 2045-05-15 - Operações compromissadas	11,46	NTN-F 950199 2023-01-01 - Títulos públicos
● Caixa FI Brasil Irf M Tp RF LP	31/10/2020	21,41	LTN 100000 2021-04-01 - Operações compromissadas	10,21	NTN-F 950199 2023-01-01 - Títulos públicos

Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)													
Nome	% Ações a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debên.	% Depósitos	% Oper. Com prom.	% Tít. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
● Ind RF-M	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-
● BB Prev RF Irf M FI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	18,13	81,90	31/10/2020	0,00	100,03	0,00
● Caixa FI Brasil Irf M Tp RF LP	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	21,41	78,62	31/10/2020	0,00	100,03	0,00

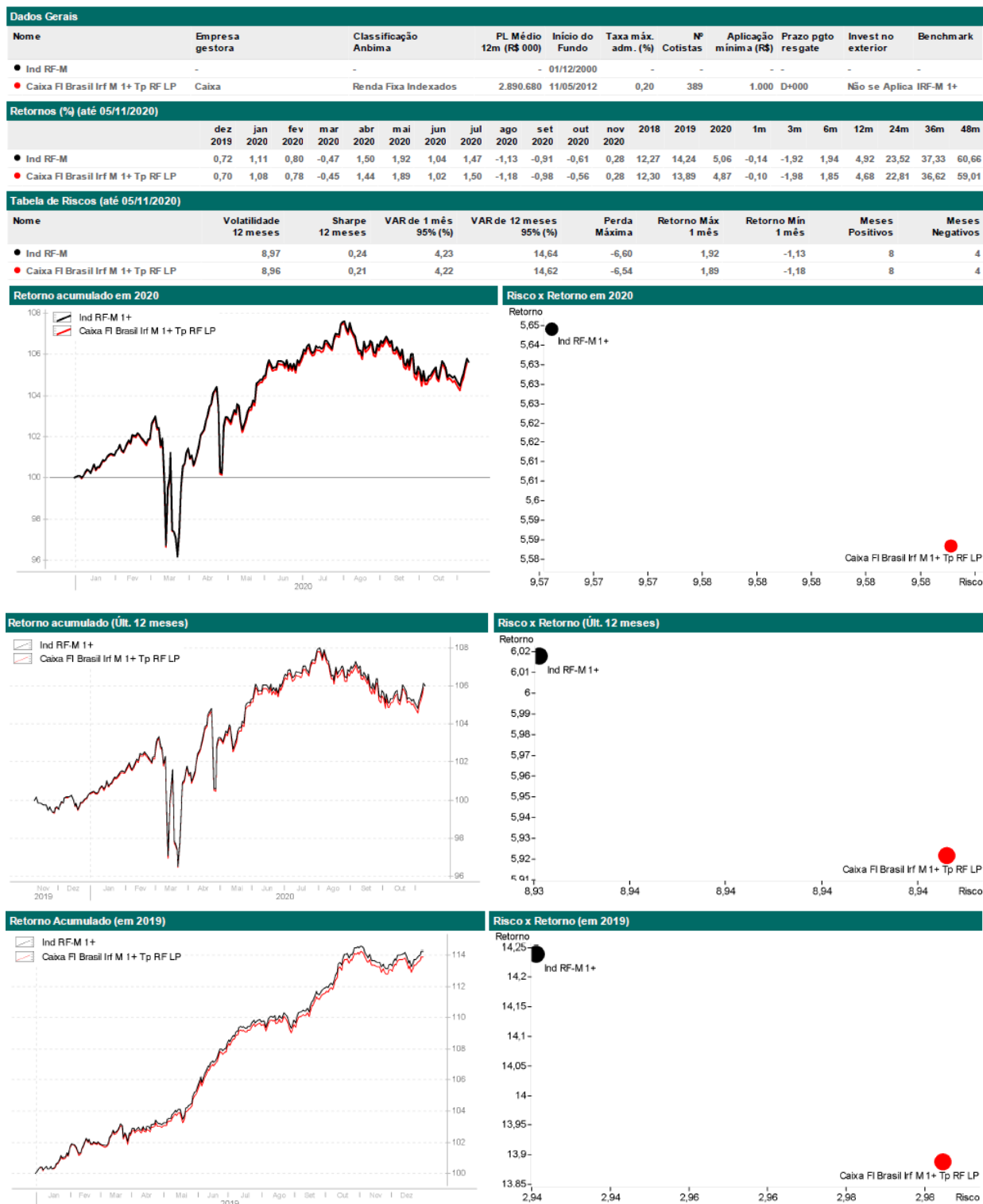
As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

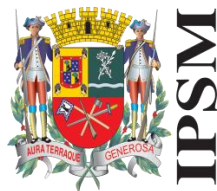
Fonte: Economatica



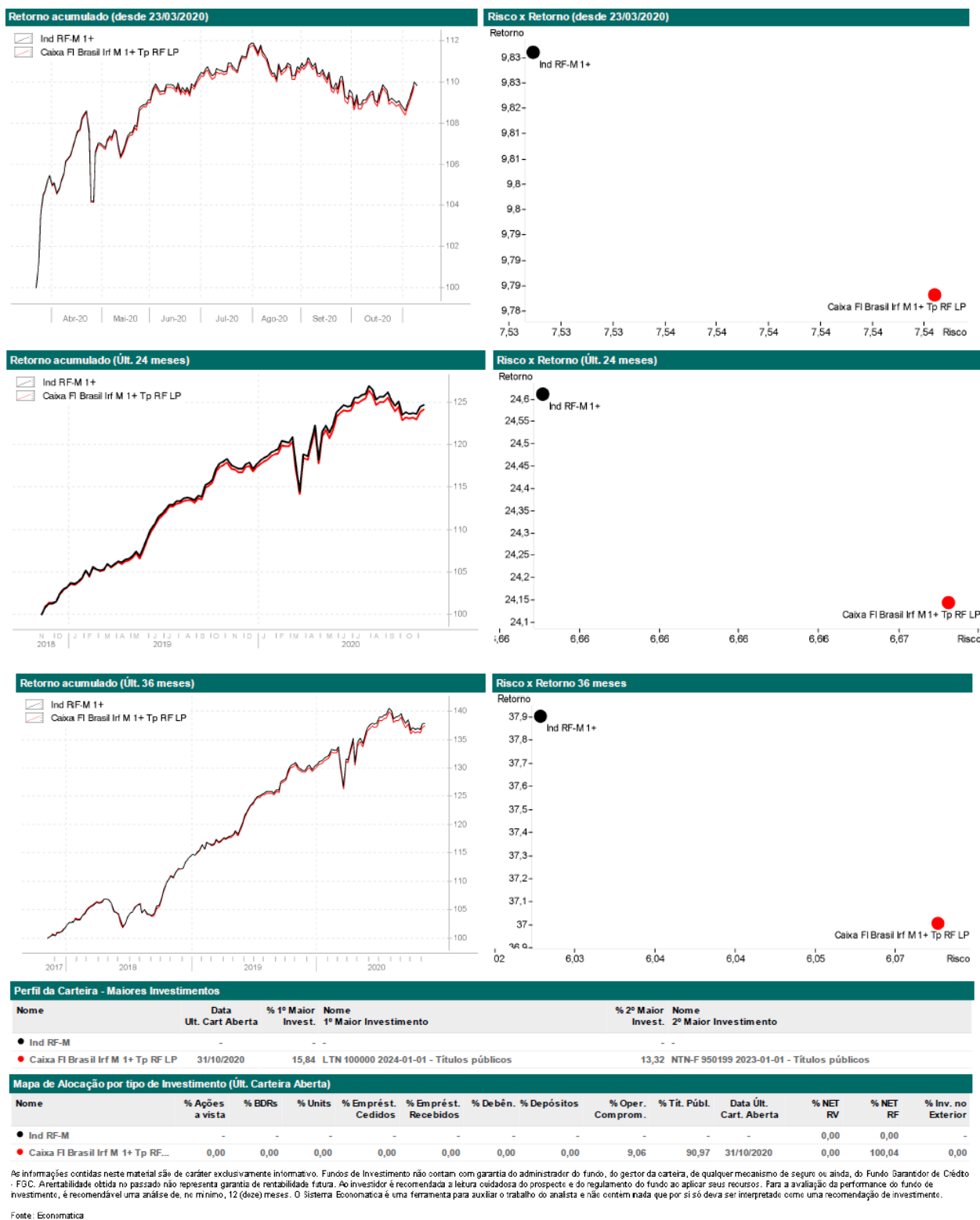
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

IRF-M 1+





Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

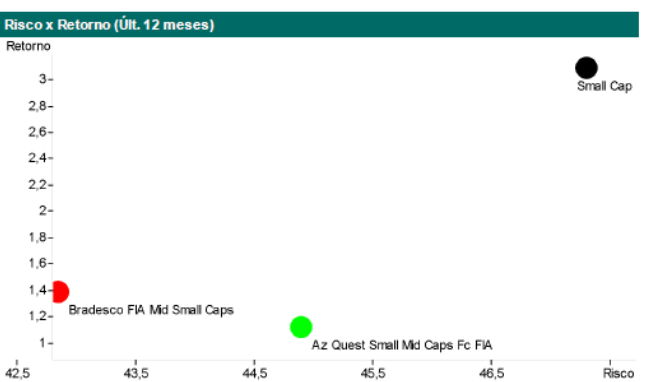
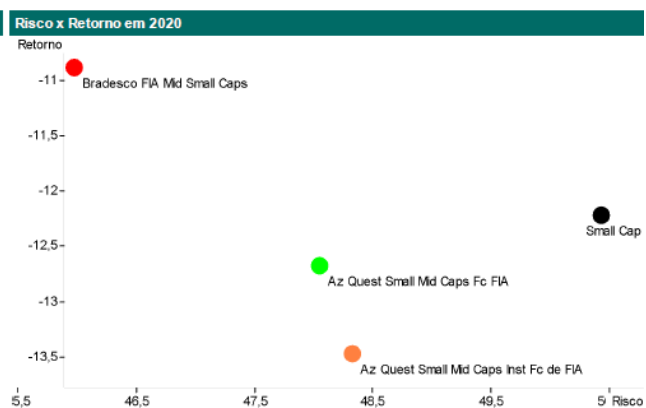
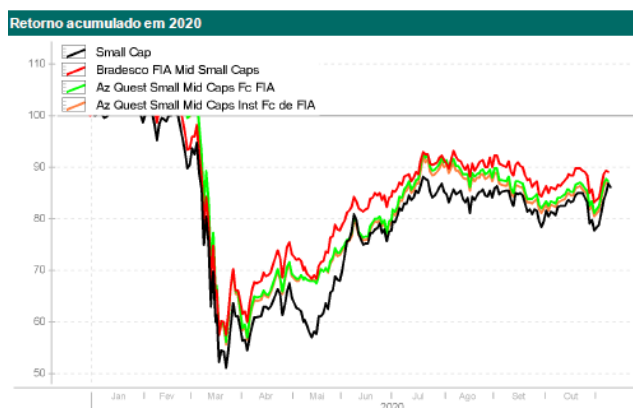


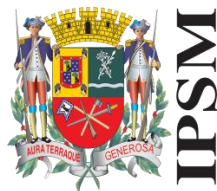
Small Caps

Dados Gerais										
Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Nº Cotistas	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark
● Small Cap	-	-	-	30/04/2008	-	-	-	-	-	-
● Bradesco FIA Mid Small Caps	Bram Bradesco Asset Manag...	Ações Small Caps	1.992.573	30/09/2004	1,50	1.917	20.000	D+003	Não se Aplica	IBRX
● Az Quest Small Mid Caps Fc FIA	Az Quest Investimentos	Ações Livre	1.238.545	30/12/2009	2,50	6.094	10.000	D+029	Não se Aplica	IBRX
● Az Quest Small Mid Caps Inst Fc d...	Az Quest Investimentos	Ações Livre	-	02/12/2019	2,00	35	-	D+029	Não se Aplica	OUTROS

Retornos (%) (até 05/11/2020)										
	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020
● Small Cap	12,65	0,45	-8,27	-35,07	10,19	5,07	14,43	9,50	-1,23	-5,44
● Bradesco FIA Mid Small Caps	10,43	1,61	-7,91	-31,64	14,55	6,18	8,50	8,23	-1,58	-5,04
● Az Quest Small Mid Caps Fc FIA	10,83	6,67	-6,19	-37,75	11,39	5,79	8,63	14,10	-3,21	-5,97
● Az Quest Small Mid Caps Inst Fc d...	-	6,25	-6,01	-38,07	11,36	5,83	8,54	13,85	-3,13	-5,95

Tabela de Riscos (até 05/11/2020)									
Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Mín 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos
● Small Cap	48,82	0,19	22,47	77,84	-51,69	14,43	-35,07	7	5
● Bradesco FIA Mid Small Caps	44,02	0,16	20,35	70,49	-46,11	14,55	-31,64	7	5
● Az Quest Small Mid Caps Fc FIA	46,24	0,18	21,30	73,78	-49,66	14,10	-37,75	7	5
● Az Quest Small Mid Caps Inst Fc d...	48,08	0,06	22,13	76,66	-49,86	13,85	-38,07	-	-



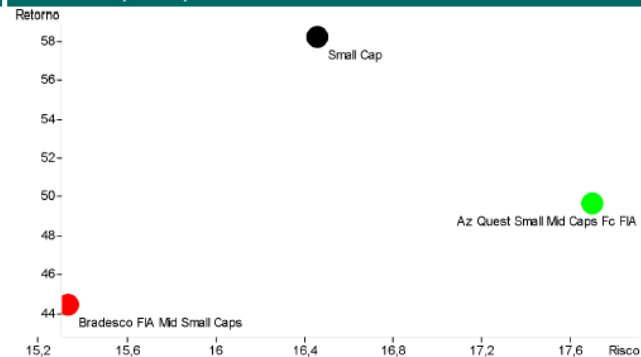


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Retorno Acumulado (em 2019)



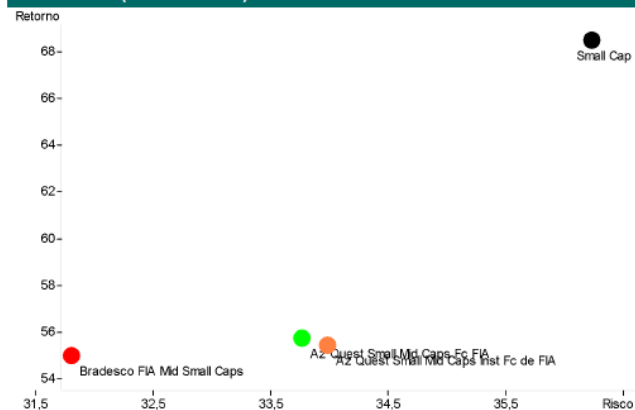
Risco x Retorno (em 2019)



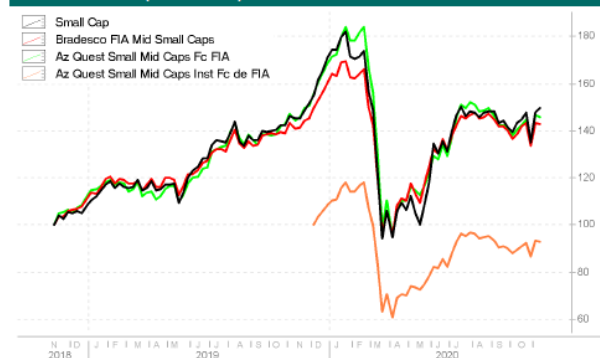
Retorno acumulado (desde 23/03/2020)



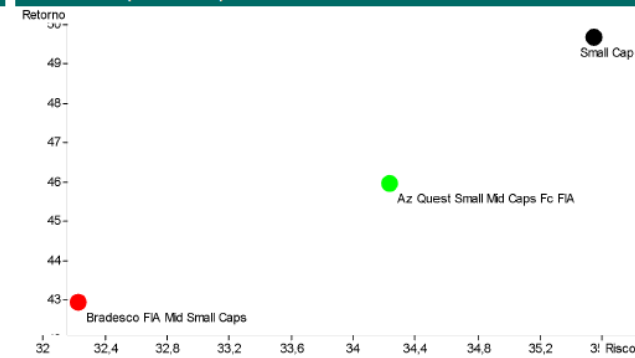
Risco x Retorno (desde 23/03/2020)



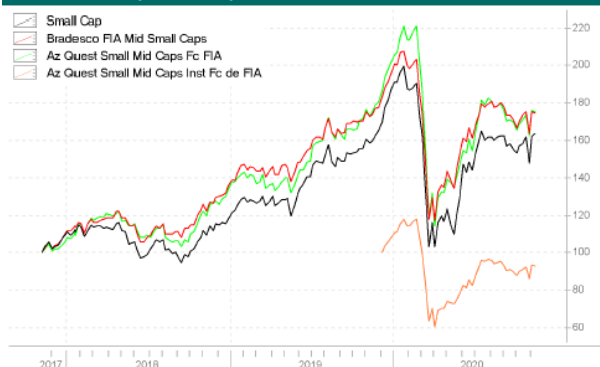
Retorno acumulado (Últ. 24 meses)



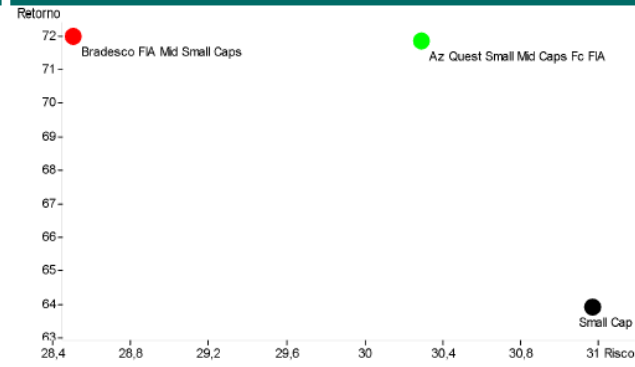
Risco x Retorno (Últ. 24 meses)

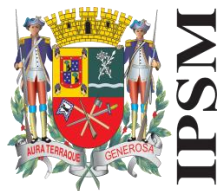


Retorno acumulado (Últ. 36 meses)



Risco x Retorno 36 meses





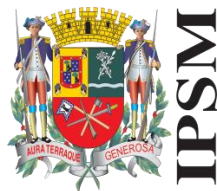
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Perfil da Carteira - Maiores Investimentos													
Nome	Data Últ. Cart. Aberta	% 1º Maior Invest.	Nome 1º Maior Investimento	% 2º Maior Invest.	Nome 2º Maior Investimento								
● Small Cap	-	-	-	-	-								
● Bradesco FIA Mid Small Caps	31/10/2020	6,68	Alpargatas PN - Ações	5,89	Grupo Natura ON - Ações								
● Az Quest Small Mid Caps Fo FIA	31/10/2020	100,12	Az Quest Small Caps Mid Mast FIA	0,08	NTN-F 950199 2023-01-01 - Operações compromissadas								
● Az Quest Small Mid Caps Inst...	31/07/2020	12,02	Viavarejo ON - Ações	10,50	Outras aplicações - Outras aplicações								

Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)													
Nome	% Ações a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debên.	% Depósitos	% Oper. Comprom.	% Tít. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
● Small Cap	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-
● Bradesco FIA Mid Small Caps	88,42	0,00	10,16	0,00	0,00	0,00	0,00	1,38	0,00	31/10/2020	98,58	1,38	0,00
● Az Quest Small Mid Caps Fo...	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,09	0,00	31/10/2020	0,00	0,09	0,00
● Az Quest Small Mid Caps Ins...	86,06	0,00	1,55	0,00	0,00	0,00	0,00	5,31	0,00	31/07/2020	87,61	5,31	0,00

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

Fonte: Economatica



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER

Dados Gerais

Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Nº Cotistas	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark
• Kinea Pe IV Feeder Inst I FIP Me	Kinea Private Equity	Fundos de Participações	195.484	30/05/2018	2,00	-	0	-	Não se Aplica	Não se Aplica

Retornos (% (até 09/11/2020))

	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	nov 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m	24m	36m	48m
• Kinea Pe IV Feeder Inst I FIP Me	5,20	-0,43	22,34	-5,52	-0,04	-0,06	8,37	-2,60	-18,22	-2,03	-2,03	-	-	37,00	-	-	-	-	-	-	-	-

Tabela de Riscos (até 09/11/2020)

Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Mín 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos
• Kinea Pe IV Feeder Inst I FIP Me	-	-	-	-	-23,55	22,34	-18,22	-	-

Retorno acumulado desde a primeira informação

Risco x Retorno (Últ. 12 meses)

Perfil da Carteira - Maiores Investimentos

Nome	Data Ult. Cart Aberta	% 1º Maior Invest.	Nome 1º Maior Investimento	% 2º Maior Invest.	Nome 2º Maior Investimento
• Kinea Pe IV Feeder Inst I FIP Me	31/08/2020	101,35	Kinea Pe IV Master FIP Me - Classe D - Cotas de fundos	0,60	LFT 210100 2021-03-01 - Títulos públicos

Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)

Nome	% Ações a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debên.	% Depósitos	% Oper. Comprom.	% Tit. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
• Kinea Pe IV Feeder Inst I FIP...	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,30	1,96	31/08/2020	0,00	2,26	0,00

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

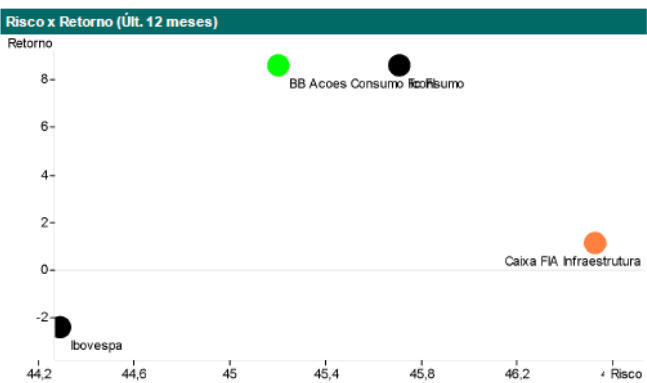
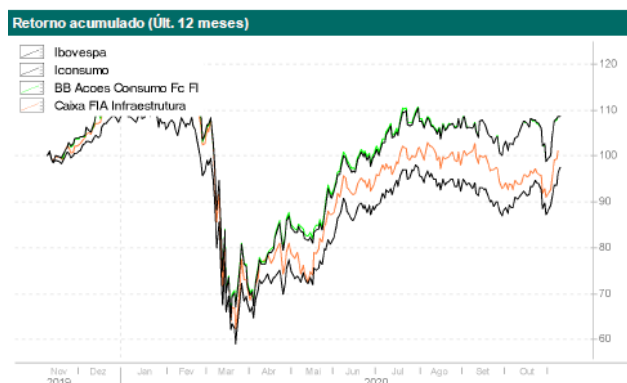
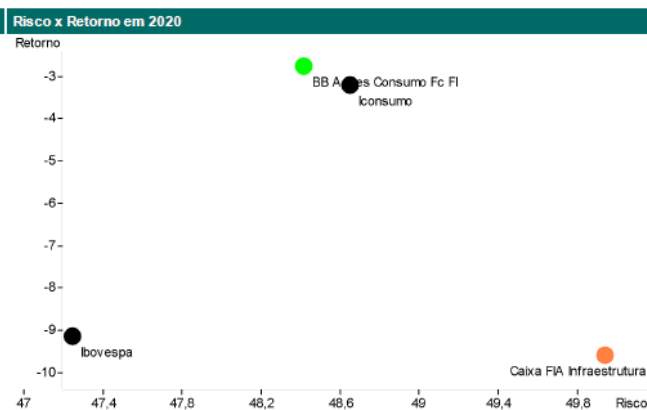
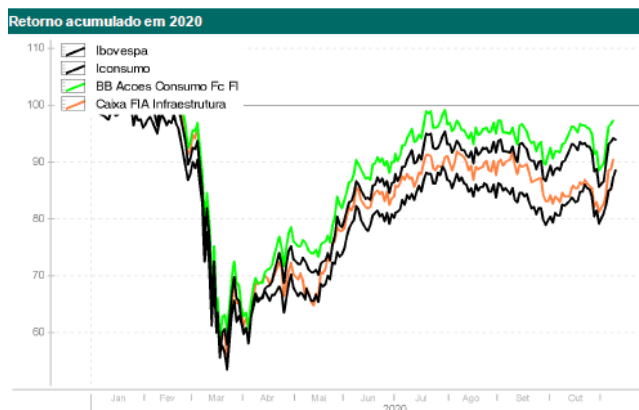
Segundo as notas explicativas da administradora às demonstrações financeiras em 29 de fevereiro de 2020 do Kinea Private Equity IV Feeder Institucional I Fundo de Investimento em Participações Multiestratégia, a variação da cota não necessariamente representa verificação efetiva da rentabilidade do Fundo. A rentabilidade do Fundo, segundo o mesmo documento, será objeto de aferição objetiva por ocasião da realização financeira dos investimentos e do encerramento e liquidação do Fundo.

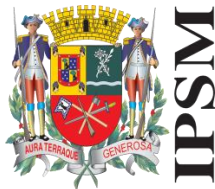
Ações Setoriais

Dados Gerais										
Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Nº Cotistas	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark
● Ibovespa	-	-	-	29/12/1967	-	-	-	-	-	-
● Iconsumo	-	-	-	29/12/2006	-	-	-	-	-	-
● BB Acoes Consumo Fc FI	BB Dvm S.A	Ações Setoriais	356.824	03/10/2007	2,00	13.647	0 D+003	-	Não se Aplica	ICON - CON...
● Caixa FIA Infraestrutura	Caixa	Ações Setoriais	491.754	19/04/2010	2,00	9.182	1.000 D+003	-	Não se Aplica	Não se Aplica

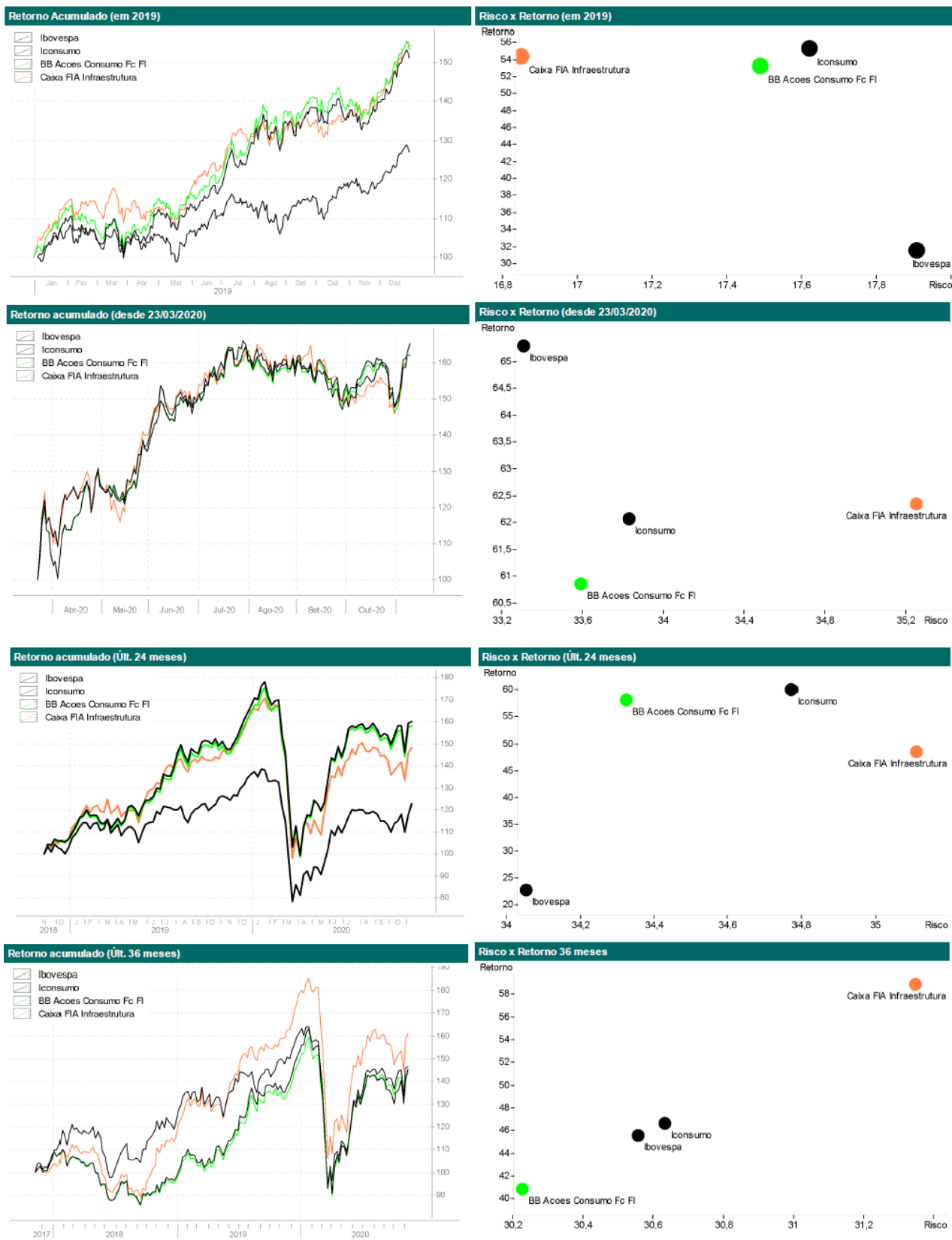
Retornos (%) (até 05/11/2020)										
	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020
● Ibovespa	6,85	-1,63	-8,43	-29,90	10,25	8,57	8,76	8,27	-3,44	-4,80
● Iconsumo	8,03	3,66	-10,00	-31,51	17,67	7,65	10,08	7,62	-1,48	-3,96
● BB Acoes Consumo Fc FI	7,68	3,73	-9,87	-30,87	17,71	7,75	9,92	7,39	-1,73	-4,08
● Caixa FIA Infraestrutura	9,36	1,12	-9,16	-30,78	10,49	11,03	7,50	8,53	-3,66	-5,18

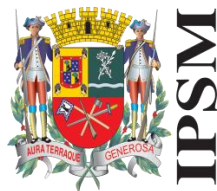
Tabela de Riscos (até 05/11/2020)									
Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Min 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos
● Ibovespa	45,12	-0,02	20,99	72,71	-46,82	11,83	-29,90	6	6
● Iconsumo	46,94	0,32	21,70	75,16	-47,19	17,67	-31,51	7	5
● BB Acoes Consumo Fc FI	46,29	0,32	21,41	74,18	-46,65	17,71	-30,87	7	5
● Caixa FIA Infraestrutura	47,55	0,18	22,03	76,33	-46,98	11,24	-30,78	7	5





Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos





Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Perfil da Carteira - Maiores Investimentos												
Nome	Data Últ. Cart. Aberta	% 1º Maior Invest.	Nome 1º Maior Investimento	% 2º Maior Invest.	Nome 2º Maior Investimento							
● Ibovespa	-	-	-	-	-							
● Iconsumo	-	-	-	-	-							
● BB Acoes Consumo Fc FI	31/10/2020	11,67	Magaz Luiza ON - Ações	9,32	Ambev S/A ON - Ações							
● Caixa FIA Infraestrutura	31/07/2020	9,40	Petrobras PN - Ações	8,92	Localiza ON - Ações							

Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)													
Nome	% Ações a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debên.	% Depósitos	% Oper. Comprom.	% Tít. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
● Ibovespa	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-
● Iconsumo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-
● BB Acoes Consumo Fc FI	98,43	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,05	0,00	31/10/2020	98,43	4,05	0,00
● Caixa FIA Infraestrutura	89,52	0,00	8,92	0,00	0,00	0,00	0,00	0,96	0,41	31/07/2020	98,45	1,36	0,00

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

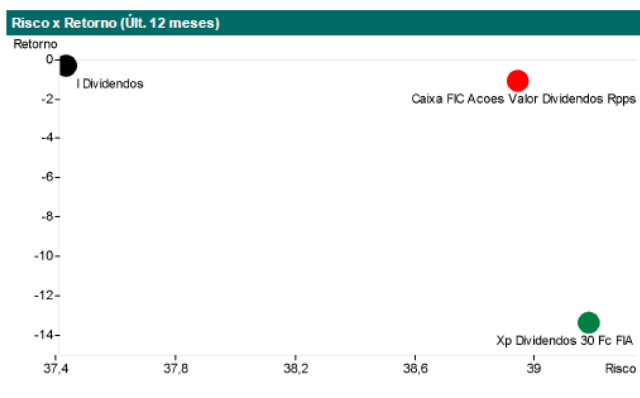
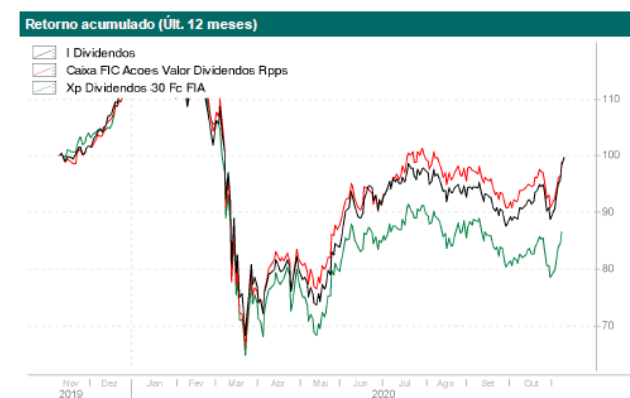
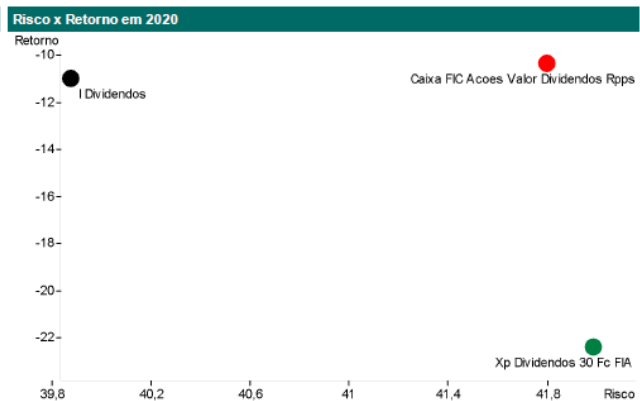
Fonte: Economatica

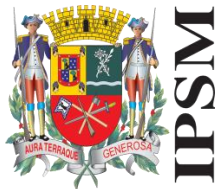
Dividendos

Dados Gerais											
Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Nº Cotistas	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark	
● I Dividendos	-	-	-	29/12/2005	-	-	-	-	-	-	
● Caixa FIC Acoes Valor Dividendos...	Vinci Equities Gestora de Rec...	Ações Dividendos	813.990	24/08/2012	1,72	158	100.000	D+032	Não se Aplica	Não se Aplica	
● Xp Dividendos 30 Fc FIA	Xp Asset Management	Ações Dividendos	119.593	26/04/2017	3,00	1.907	-	D+032	Não se Aplica	Não se Aplica	

Retornos (%) (até 05/11/2020)																							
	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	nov 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m	24m	36m	48m	
● I Dividendos	9,99	-1,58	-6,18	-25,53	3,76	5,00	8,95	6,53	-4,83	-4,63	0,65	6,80	15,95	45,16	-15,16	6,38	-0,47	20,81	-4,95	28,31	42,11	81,27	
● Caixa FIC Acoes Valor Dividendos...	8,52	1,53	-6,37	-27,40	7,24	7,50	4,58	8,32	-3,82	-4,93	0,05	5,56	10,75	42,07	-12,95	3,92	-2,42	18,45	-4,70	31,20	41,42	58,94	
● Xp Dividendos 30 Fc FIA	7,32	1,43	-6,81	-29,67	4,53	2,74	6,24	6,16	-4,73	-5,25	-3,09	6,61	16,52	52,16	-24,91	2,20	-4,91	11,58	-16,60	22,88	38,62		

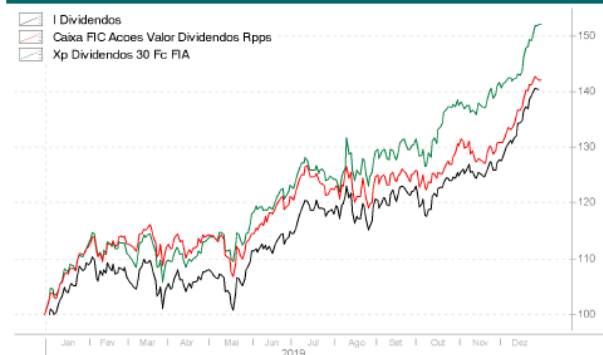
Tabela de Riscos (até 05/11/2020)									
Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Min 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos
● I Dividendos	37,93	-0,03	17,71	61,36	-40,93	12,07	-25,53	7	5
● Caixa FIC Acoes Valor Dividendos...	39,53	-0,01	18,42	63,80	-42,98	8,74	-27,40	8	4
● Xp Dividendos 30 Fc FIA	39,61	-0,33	18,51	64,13	-44,67	10,18	-29,67	7	5



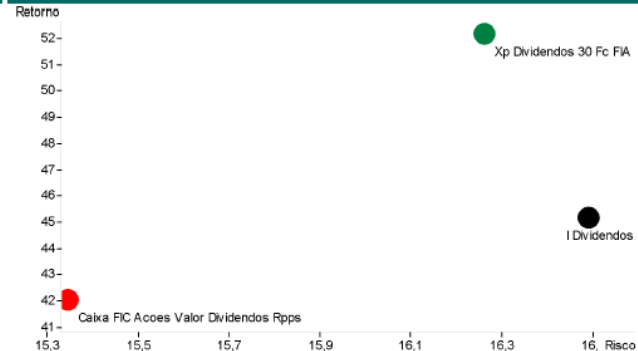


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

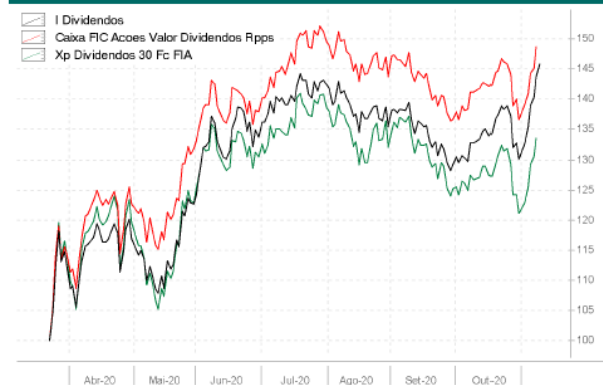
Retorno Acumulado (em 2019)



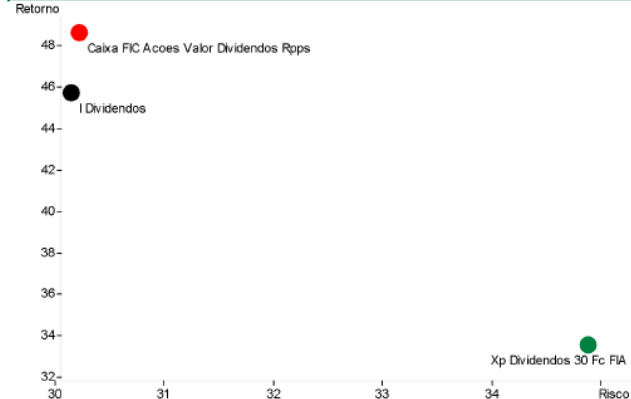
Risco x Retorno (em 2019)



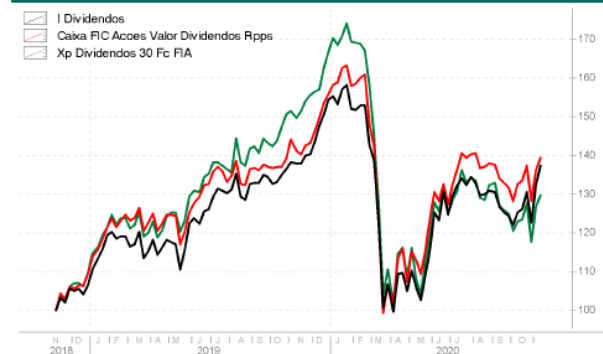
Retorno acumulado (desde 23/03/2020)



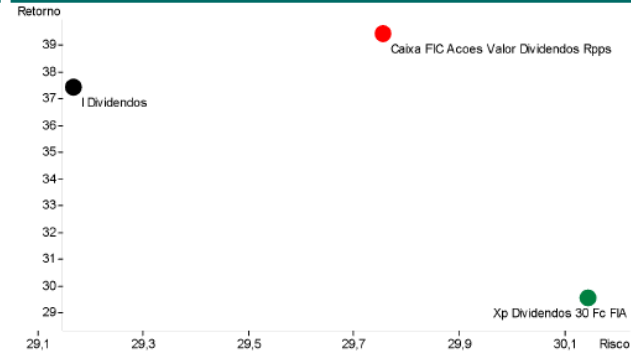
Risco x Retorno (desde 23/03/2020)



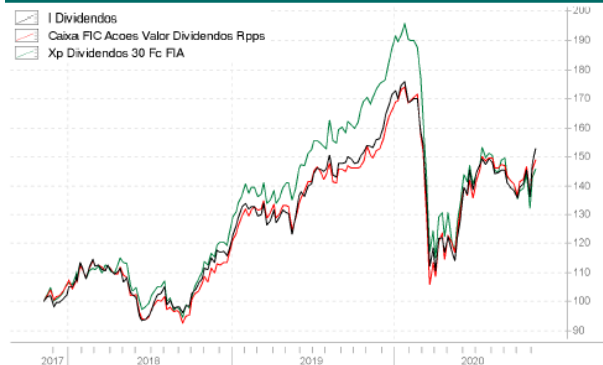
Retorno acumulado (Últ. 24 meses)



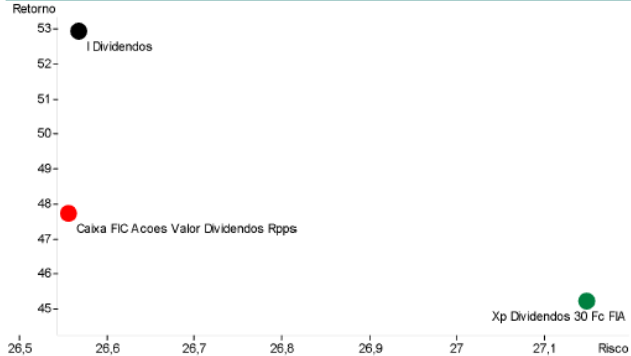
Risco x Retorno (Últ. 24 meses)

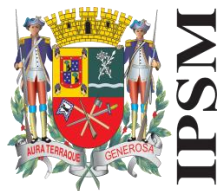


Retorno acumulado (Últ. 36 meses)



Risco x Retorno 36 meses





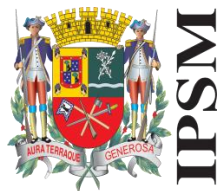
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Perfil da Carteira - Maiores Investimentos					
Nome	Data Últ. Cart. Aberta	% 1º Maior Invest.	Nome 1º Maior Investimento	% 2º Maior Invest.	Nome 2º Maior Investimento
● I Dividendos	-	-	-	-	-
● Caixa FIC Acoes Valor Dividen...	31/07/2020	11,16	Vale ON - Ações	10,78	Cemig PN - Ações
● Xp Dividendos 30 Fc FIA	31/07/2020	11,05	Brasil ON - Ações	10,50	Eletrobras ON - Ações

Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)													
Nome	% Ações a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debên.	% Depósitos	% Oper. Comprom.	% Tít. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
● I Dividendos	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-
● Caixa FIC Acoes Valor Divide...	83,78	0,00	2,79	8,74	0,00	0,00	0,00	4,93	0,00	31/10/2020	95,31	4,93	0,00
● Xp Dividendos 30 Fc FIA	87,63	0,00	5,79	0,00	0,00	0,00	0,00	5,08	0,00	31/07/2020	93,42	5,08	0,00

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

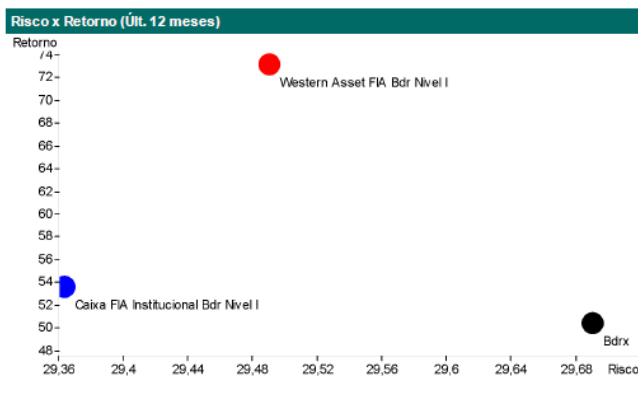
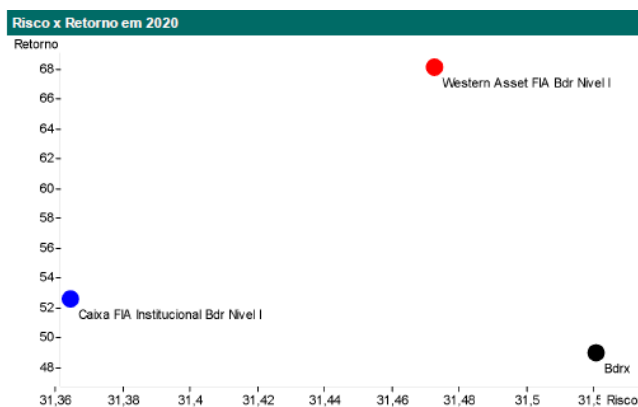
Fonte: Economatica

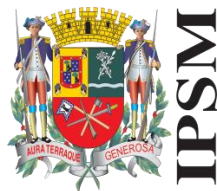


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

BDR

Dados Gerais																						
Nome	Empresa gestora			Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Nº Cotistas	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark										
Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	Caixa			Ações Livre	1.208.503	25/06/2013	0,70	178	10.000	D+003	Não se Aplica	Não se Aplica										
Western Asset FIA Bdr Nivel I	Western Asset			Ações Livre	1.098.629	06/05/2014	1,50	93.925	1.000	D+004	Até 40 %	Não se Aplica										
Bdrx	-			-	-	05/10/2010	-	-	-	-	-	-										
Retornos (%) (até 05/11/2020)																						
	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	nov 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m	24m	36m	48m
Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	-1,76	6,52	-5,69	6,30	15,96	2,78	4,37	1,88	15,16	-1,99	-1,77	4,03	10,18	34,46	56,10	3,22	10,68	24,30	65,18	101,52	141,52	206,87
Western Asset FIA Bdr Nivel I	-1,58	7,39	-1,97	2,40	19,81	4,34	4,31	2,56	16,27	-1,39	-2,23	5,73	9,82	35,55	70,87	3,54	13,54	30,50	81,53	124,69	165,30	235,62
Bdrx	-1,52	6,47	-5,70	5,47	16,32	2,90	4,50	1,77	14,62	-1,97	-1,75	4,08	12,02	35,67	54,86	3,32	10,63	24,21	64,39	101,78	146,63	217,82
Tabela de Riscos (até 05/11/2020)																						
Nome	Volatilidade 12 meses			Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)		VAR de 12 meses 95% (%)		Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Min 1 mês	Meses Positivos		Meses Negativos								
Caixa FIA Institucional Bdr Nivel I	29,30			2,31	13,88		48,08		-19,77	15,96	-5,69	8		4								
Western Asset FIA Bdr Nivel I	29,38			2,87	13,93		48,27		-18,30	19,81	-2,23	8		4								
Bdrx	29,64			2,30	14,04		48,63		-20,61	16,32	-5,70	8										



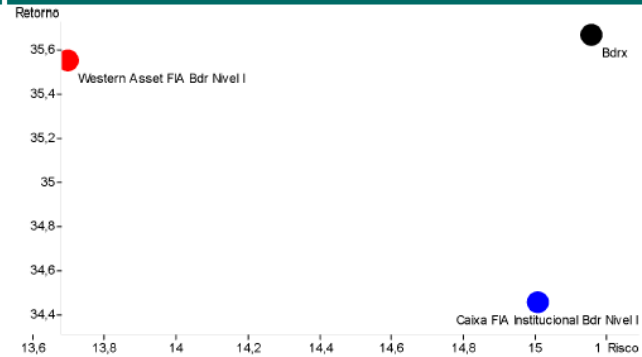


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

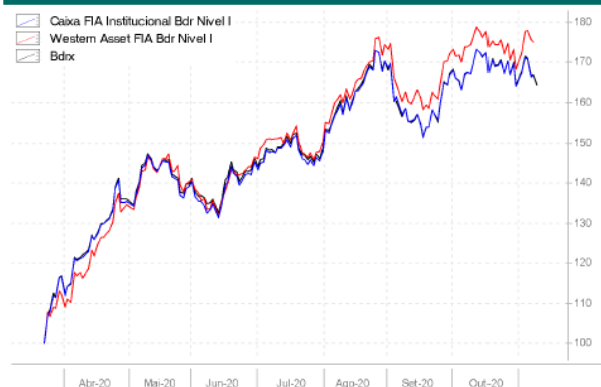
Retorno Acumulado (em 2019)



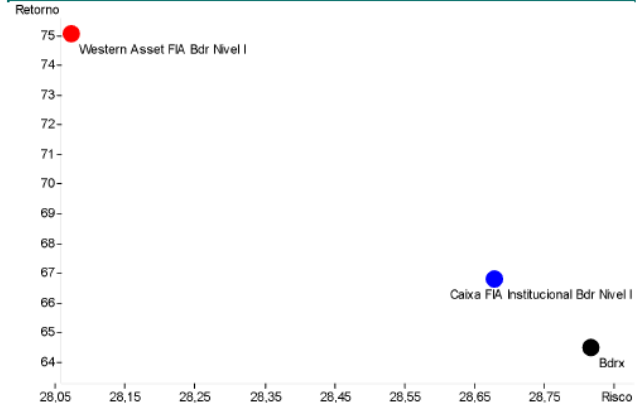
Risco x Retorno (em 2019)



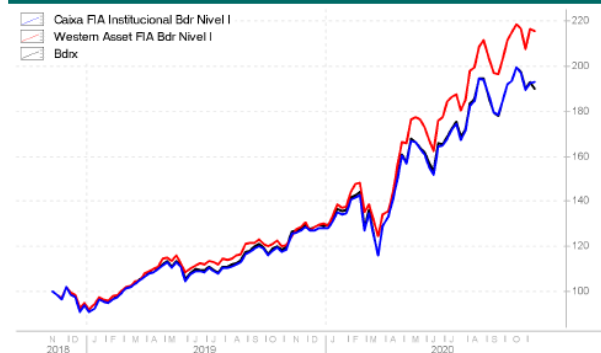
Retorno acumulado (desde 23/03/2020)



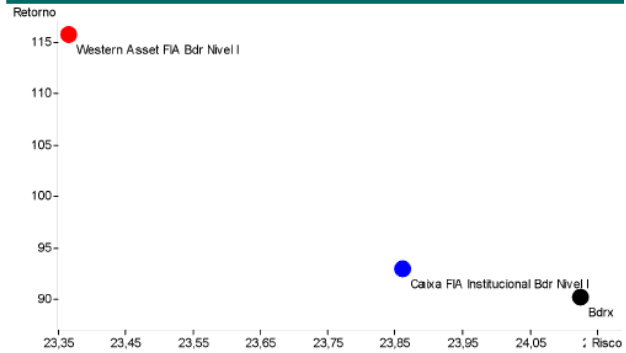
Risco x Retorno (desde 23/03/2020)



Retorno acumulado (Últ. 24 meses)



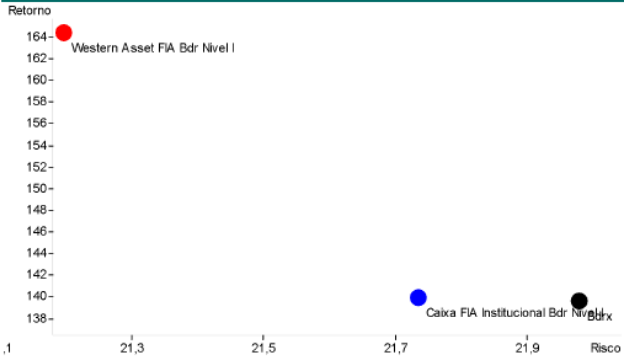
Risco x Retorno (Últ. 24 meses)

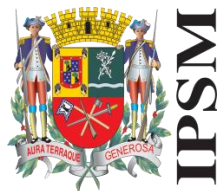


Retorno acumulado (Últ. 36 meses)



Risco x Retorno 36 meses





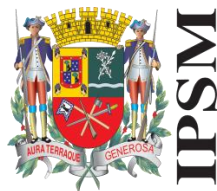
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Perfil da Carteira - Maiores Investimentos						
Nome	Data Últ. Cart. Aberta	% 1º Maior Invest.	Nome 1º Maior Investimento	% 2º Maior Invest.	Nome 2º Maior Investimento	
● Caixa FIA Institucional Bdr Niv...	31/10/2020	13,40	Apple Inc Com - Brazilian depos receipt BDR	11,00	Microsoft Corp Com - Brazilian depos receipt BDR	
● Western Asset FIA Bdr Nivel I	31/07/2020	10,20	Amazon Com Inc / Cod: Amzo34 / Tipo: Outros Instrumen...	5,69	Microsoft Corporation / Cod: Mstft34 / Tipo: Outros Instrumen...	
● Bdrx	-	-	-	-	-	

Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)													
Nome	% Ações a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debên.	% Depósitos	% Oper. Comprom.	% Tít. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
● Caixa FIA Institucional Bdr Niv...	0,00	98,46	0,00	0,31	0,00	0,00	0,00	1,07	0,63	31/10/2020	98,77	1,70	0,00
● Western Asset FIA Bdr Nivel I	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,15	4,18	31/07/2020	0,00	4,34	98,01
● Bdrx	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não cortam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

Fonte: Economatica



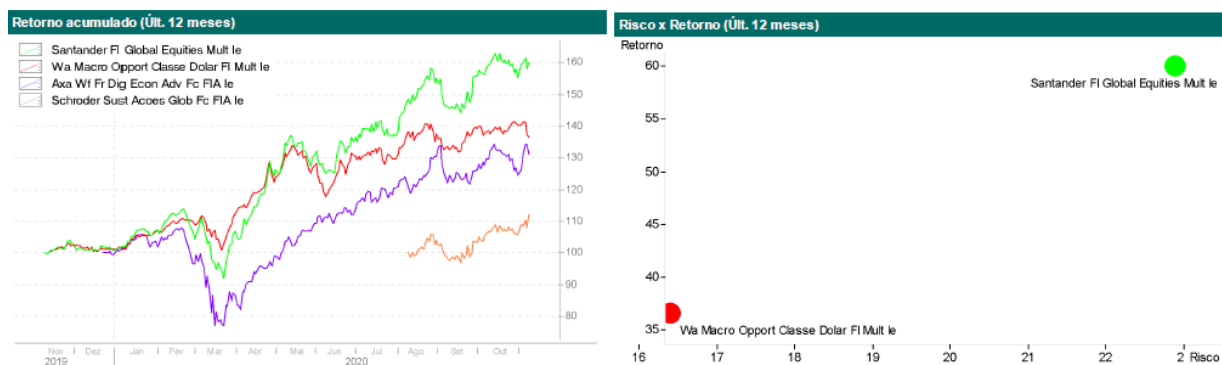
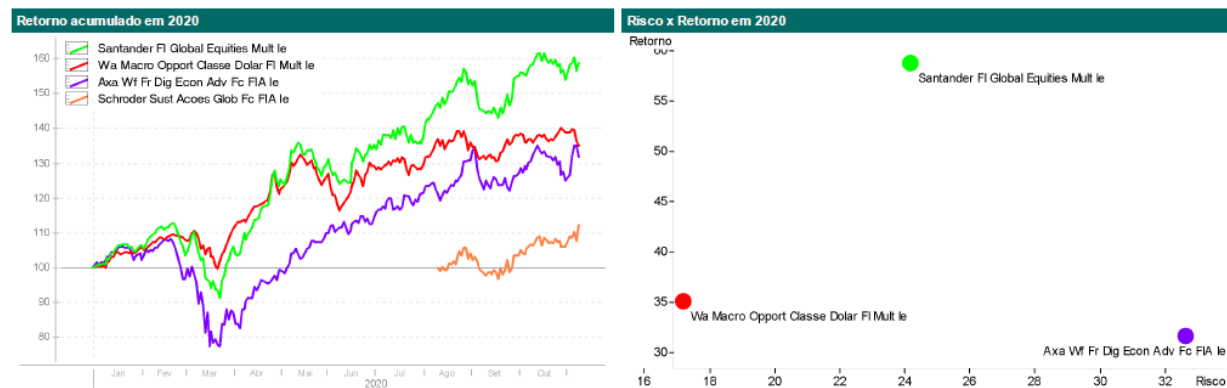
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

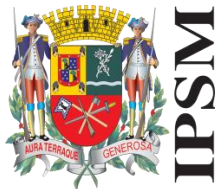
Globais

Dados Gerais											
Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Cotistas	Nº	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark
● Santander FI Global Equities Mult...	Santander Brasil Gestao de R...	Multimercados Invest....	461.413	06/09/2013	1,00	5.520		50.000	D+008	Até 100%	CDI
● Wa Macro Opport Classe Dolar F...	Western Asset	Multimercados Invest....	66.435	26/07/2016	1,00	1.640		1.000	D+005	> 67%	Não se Aplica
● Axa Wf Fr Dig Econ Adv Fc FIA Ie	Xp Vista Asset Management...	Ações Invest. no Exteri...	-	23/12/2019	0,80	4.454		5.000	D+006	> 67%	Não se Aplica
● Schroder Sust Acoes Glob Fc FL...	Schroder Brasil	Ações Invest. no Exteri...	-	10/08/2020	1,00	5		5.000	D+004	> 67%	OUTROS

Retornos (%) (até 05/11/2020)																							
	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	nov 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m	24m	36m	48m	
Santander FI Global Equities Mult Ie	-2,19	6,46	-2,83	2,60	18,04	3,48	4,43	1,69	11,85	0,54	-0,61	4,23	4,53	25,92	60,37	3,23	11,70	27,19	68,24	94,32	117,34	170,86	
Wa Macro Opport Classe Dolar FI...	-1,33	5,86	1,89	3,24	9,98	3,00	2,38	0,34	4,95	1,43	0,67	0,52	10,61	20,09	39,58	2,75	5,14	11,89	45,27	80,03	87,21	110,82	
Axa Wf Fr Dig Econ Adv Fc FIA Ie	-	2,26	-5,23	-10,15	14,11	10,56	4,16	6,27	7,63	-3,02	-1,58	8,05	-	-	34,94	4,40	8,83	34,94	-	-	-	-	
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	-	-	-	-	-	-	-	-	-0,62	2,46	4,06	-	-	-	6,21	-	-	-	-	-	-	-	

Tabela de Riscos (até 05/11/2020)											
Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Mín 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos		
● Santander FI Global Equities Mult Ie	22,98	2,96	10,90	37,76	-19,06	18,04	-2,83	9	3		
● Wa Macro Opport Classe Dolar FI...	16,61	2,60	7,86	27,23	-12,02	9,98	-2,70	10	2		
● Axa Wf Fr Dig Econ Adv Fc FIA Ie	-	-	-	-	-28,40	14,11	-10,15	-	-		
● Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	-	-	-	-	-8,49	5,96	-0,62	-	-		



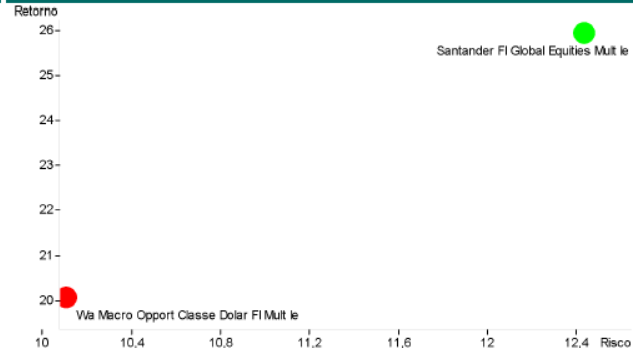


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

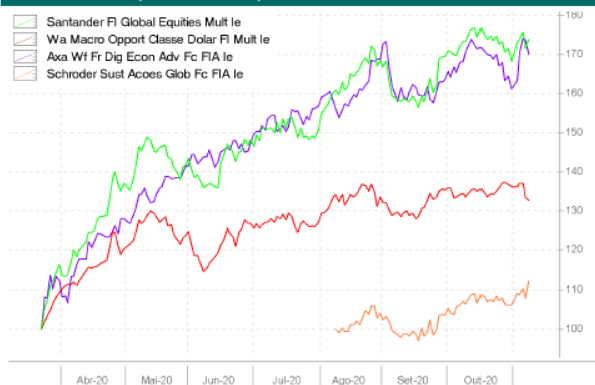
Retorno Acumulado (em 2019)



Risco x Retorno (em 2019)



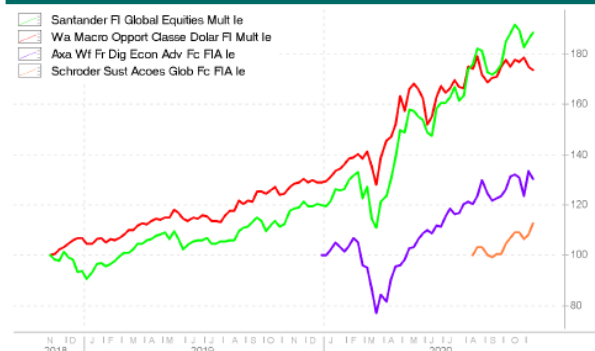
Retorno acumulado (desde 23/03/2020)



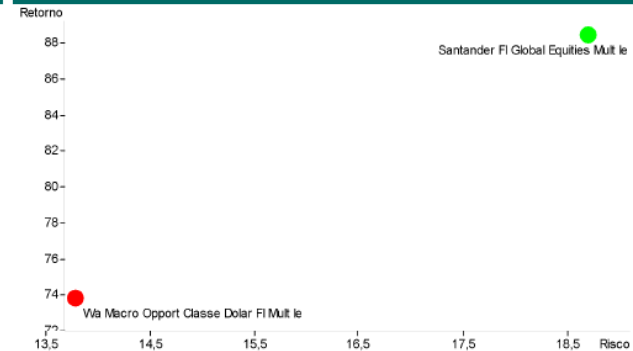
Risco x Retorno (desde 23/03/2020)



Retorno acumulado (Últ. 24 meses)



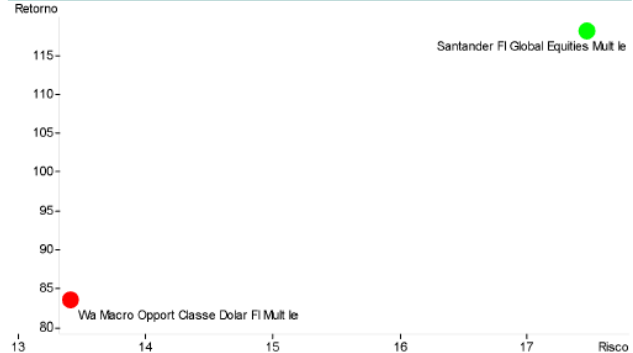
Risco x Retorno (Últ. 24 meses)

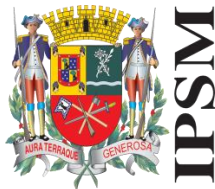


Retorno acumulado (Últ. 36 meses)



Risco x Retorno 36 meses





Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Perfil da Carteira - Maiores Investimentos									
Nome	Data Últ. Cart. Aberta	% 1º Maior Invest.	Nome 1º Maior Investimento	% 2º Maior Invest.	Nome 2º Maior Investimento				
Santander FI Global Equities...	30/09/2020	9,57	Tfbl0021 / Cod: Tfbl0021 / Tipo: Fundos Offshore / Brasil - L...	9,19	Tfbl0006 / Cod: Tfbl0006 / Tipo: Fundos Offshore / Brasil - Inv...				
Wa Macro Opport Classe Dola...	31/10/2020	96,85	Lm Wa Macro Opp / Cod: 9000057 / Tipo: Outros / Irlanda -...	8,31	Valores a receber - Valores a receber				
Axa Wf Fr Dig Econ Adv Fc FIA le	31/07/2020	94,06	Axa Wf Fr Dig Econ / Cod: 9000060 / Tipo: Outros / Luxem...	2,06	LFT 210100 2022-03-01 - Títulos públicos				
Schroder Sust Acoes Glob Fc...	31/10/2020	99,51	Schroder Glob Sust G / Cod: Sgdwdca / Tipo: Outros / Bra...	0,39	NTN-F 950199 2021-01-01 - Operações com promissadas				

Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)													
Nome	% Ações a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debên.	% Depósitos	% Oper. Comprom.	% Tit. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
Santander FI Global Equities...	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	4,83	6,48	30/09/2020	0,00	11,31	102,10
Wa Macro Opport Classe Dol...	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,64	31/10/2020	0,00	0,64	96,85
Axa Wf Fr Dig Econ Adv Fc FL...	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1,66	7,30	31/07/2020	0,00	8,96	94,06
Schroder Sust Acoes Glob F...	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,58	0,00	31/10/2020	0,00	0,58	99,51

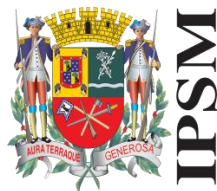
As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ajuda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

Fonte: Economatica

MSCI

MSCI WORLD			
Retorno Out/20	Retorno 3 meses	Retorno 6 meses	Retorno 12 meses
-3,140%	-0,481%	11,695%	2,659%
Desvio Padrão Out/20	Desvio Padrão 3 meses	Desvio Padrão 6 meses	Desvio Padrão 12 meses
1,063%	0,9887%	1,1075%	1,7761%
Volatilidade Out/20	Volatilidade 3 Meses	Volatilidade 6 Meses	Volatilidade 12 Meses
4,87%	7,85%	12,43%	28,19%

Santander FI Global Equities			
Retorno Out/20	Retorno 3 meses	Retorno 6 meses	Retorno 12 meses
-0,611%	11,765%	22,815%	61,963%
Desvio Padrão Out/20	Desvio Padrão 3 meses	Desvio Padrão 6 meses	Desvio Padrão 12 meses
1,0514%	1,3559%	1,4194%	1,4495%
Volatilidade Out/20	Volatilidade 3 Meses	Volatilidade 6 Meses	Volatilidade 12 Meses
4,82%	10,76%	15,93%	23,01%



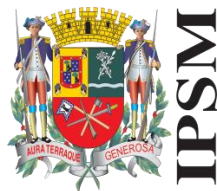
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

IBOVESPA

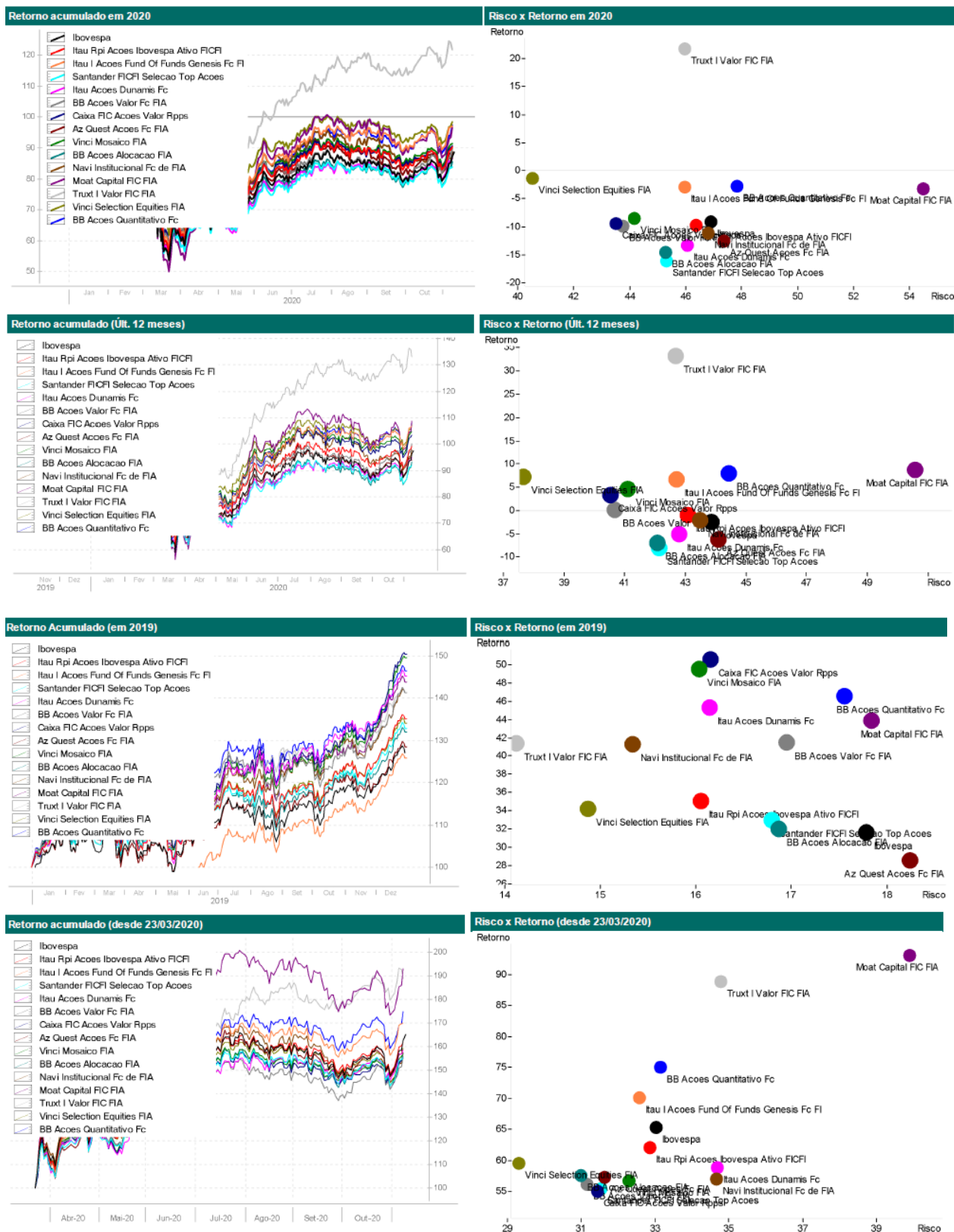
Dados Gerais											
Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Nº Cotistas	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark	
● Ibovespa	-	-	-	29/12/1967	-	-	-	-	-	-	
● Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FI...	Itau Dtvn	Ações Índice Ativo	790.176	25/04/2008	2,50	56	50.000	D+002	Não se Aplica	IBOVESPA F...	
● Itau I Acoes Fund Of Funds Gen...	Itau Dtvn	Ações Livre	249.387	11/06/2019	1,90	15	100	D+024	Até 20 %	IBOVESPA F...	
● Santander RCFI Selecao Top Ac...	Santander Brasil Gestao de R...	Ações Valor/Crescime...	586.532	03/04/1998	2,50	3.228	1.000	D+003	Não se Aplica	IBOVESPA F...	
● Itau Acoes Dunamis Fc	Itau Unibanco SA	Ações Livre	3.478.751	12/09/2016	2,00	45.117	100	D+002	Até 20 %	IBOVESPA F...	
● BB Acoes Valor Fc FIA	BB Dtvn S.A	Ações Valor/Crescime...	810.201	30/01/2018	2,00	1.693	0	D+032	Não se Aplica	IBOVESPA	
● Caixa FIC Acoes Valor Rpps	Vinci Equities Gestora de Rec...	Ações Livre	498.144	13/12/2011	1,72	115	100.000	D+023	Não se Aplica	Não se Aplica	
● Az Quest Acoes Fc FIA	Az Quest Investimentos	Ações Livre	821.212	01/06/2005	2,50	11.706	10.000	D+003	Não se Aplica	IBOVESPA	
● Vinci Mosaico FIA	Vinci Equities Gestora de Rec...	Ações Livre	1.438.617	12/07/2010	1,97	1.477	10.000	D+003	Não se Aplica	IBOVESPA F...	
● BB Acoes Alocacao FIA	BB Dtvn S.A	Ações Livre	389.022	30/08/2013	1,00	670	0	D+003	Não se Aplica	Não se Aplica	
● Navi Institucional Fc de FIA	Navi Capital	Ações Livre	1.023.063	30/09/2011	1,50	3.331	10.000	D+032	Não se Aplica	IBOVESPA	
● Moat Capital FIC FIA	Moat Capital Gestao de Recur...	Ações Livre	2.436.477	04/08/2014	2,00	3.219	50.000	D+002	Não se Aplica	IBOVESPA F...	
● Truxt I Valor FIC FIA	Truxt Investimentos	Ações Livre	422.643	02/06/2017	-	857	-	D+003	Até 40 %	IPCA	
● Vinci Selection Equities FIA	Vinci Gestao de Patrimonio LT...	Ações Livre	420.427	01/11/2012	4,00	160	500	D+062	Até 20 %	IBOVESPA	
● BB Acoes Quantitativo Fc	BB Dtvn S.A	Ações Livre	200.691	24/03/2006	2,00	9.729	0	D+003	Não se Aplica	Não se Aplica	

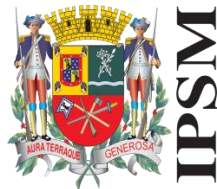
Retornos (%) (até 05/11/2020)																							
	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	nov 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m	24m	36m	48m	
● Ibovespa	6,85	-1,63	-8,43	-29,90	10,25	8,57	8,76	8,27	-3,44	-4,80	-0,69	7,24	15,03	31,58	-12,88	4,85	-1,99	26,78	-7,33	12,45	36,31	63,56	
● Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo RCFI	8,27	0,68	-7,78	-31,34	11,57	7,94	8,62	8,46	-3,01	-4,26	-1,33	7,35	16,10	35,04	-11,05	4,64	-1,72	26,99	-3,05	21,38	43,70	70,40	
● Itau I Acoes Fund Of Funds Genes...	8,27	1,14	-6,82	-31,12	12,62	9,31	9,74	9,52	-2,26	-4,28	-0,57	7,88	-	-	-3,62	5,92	0,55	33,44	5,55	-	-	-	
● Santander RCFI Selecao Top Acoes	7,81	-0,66	-9,20	-33,48	11,00	6,02	9,31	8,91	-1,81	-4,27	-1,95	7,48	14,95	32,92	-16,73	4,42	-1,37	27,56	-9,21	11,27	33,43	68,63	
● Itau Acoes Dunamis Fc	8,13	-0,19	-9,79	-32,44	11,03	5,36	9,28	7,54	-0,20	-4,96	0,50	7,48	22,48	45,27	-14,33	6,65	2,57	28,83	-6,46	26,08	55,27	92,01	
● BB Acoes Valor Fc FIA	8,81	-1,44	-8,96	-27,05	8,39	7,48	7,44	6,38	-3,55	-4,77	2,22	6,26	-	41,43	-13,05	6,75	0,74	24,25	-4,02	25,02	-	-	
● Caixa FIC Acoes Valor Rpps	12,22	1,95	-6,80	-31,10	9,76	7,03	9,33	8,86	-4,82	-2,90	-1,78	7,53	15,62	50,52	-10,65	4,08	-1,37	25,16	1,89	46,44	64,41	82,50	
● Az Quest Acoes Fc FIA	7,53	3,82	-8,29	-35,44	11,36	9,33	9,88	8,86	-1,98	-6,19	-0,62	7,52	26,12	28,60	-12,04	6,00	-1,93	29,74	-6,56	12,19	45,27	70,65	
● Vinci Mosaico FIA	12,34	1,74	-5,42	-31,73	10,08	7,08	9,35	9,03	-4,83	-2,81	-1,81	7,61	14,80	49,55	-9,77	4,14	-1,24	25,57	3,19	46,69	59,44	118,41	
● BB Acoes Alocacao FIA	8,20	-1,38	-8,48	-31,67	9,48	7,13	9,07	7,46	-3,28	-4,38	-0,86	6,98	16,19	31,96	-16,85	4,26	-1,76	25,54	-10,23	6,96	29,71	48,61	
● Navi Institucional Fc de FIA	9,04	-2,30	-6,28	-27,86	12,22	7,16	8,30	8,78	-2,88	-7,12	-2,89	5,53	34,07	41,32	-13,49	1,10	-7,42	19,11	-5,86	24,77	65,26	102,69	
● Moat Capital FIC FIA	8,82	-0,67	-8,75	-36,50	21,52	12,34	12,72	12,57	-3,68	-7,68	-1,91	6,75	30,15	43,85	-7,15	2,95	-5,77	33,86	4,14	31,68	86,42	155,76	
● Truxt I Valor FIC FIA	7,07	5,63	-7,70	-25,83	13,46	11,33	15,05	10,00	2,91	-3,68	1,02	7,60	17,49	41,37	24,54	8,42	5,92	53,81	36,43	78,27	115,21	-	
● Vinci Selection Equities FIA	7,70	0,39	-5,96	-25,42	10,98	7,60	8,34	8,97	-2,52	-4,58	-1,14	6,00	19,35	34,19	-3,24	3,60	-2,18	25,48	4,78	30,57	59,52	91,81	
● BB Acoes Quantitativo Fc	9,64	2,47	-8,46	-32,23	13,81	9,31	9,24	9,81	-1,31	-4,94	-0,66	6,25	8,45	46,57	-6,08	4,08	-1,05	31,46	3,06	38,35	53,06	80,34	

Tabela de Riscos (até 05/11/2020)										
Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Mín 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos	
● Ibovespa	45,12	-0,02	20,99	72,71	-46,82	11,83	-29,90	6	6	
● Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo RCFI	44,40	0,08	20,62	71,43	-46,95	11,57	-31,34	7	5	
● Itau I Acoes Fund Of Funds Genes...	44,04	0,29	20,44	70,80	-46,11	12,62	-31,12	7	5	
● Santander RCFI Selecao Top Acoes	43,52	-0,08	20,17	69,85	-48,30	11,00	-33,48	6	6	
● Itau Acoes Dunamis Fc	44,00	-0,01	20,47	70,92	-47,39	11,03	-32,44	7	5	
● BB Acoes Valor Fc FIA	41,59	0,03	19,42	67,27	-44,79	10,08	-27,05	7	5	
● Caixa FIC Acoes Valor Rpps	41,88	0,19	19,42	67,28	-45,07	12,22	-31,10	7	5	
● Az Quest Acoes Fc FIA	45,59	0,01	21,08	73,03	-48,93	11,36	-35,44	7	5	
● Vinci Mosaico FIA	42,53	0,22	19,69	68,22	-45,32	12,34	-31,73	7	5	
● BB Acoes Alocacao FIA	43,39	-0,11	20,12	69,68	-47,74	9,94	-31,67	6	6	
● Navi Institucional Fc de FIA	44,49	0,01	20,77	71,96	-45,08	12,22	-27,86	6	6	
● Moat Capital FIC FIA	51,88	0,30	24,11	83,51	-52,41	21,52	-36,50	6	6	
● Truxt I Valor FIC FIA	43,78	1,06	20,39	70,65	-40,47	15,05	-25,83	9	3	
● Vinci Selection Equities FIA	38,71	0,25	18,05	62,54	-41,19	10,98	-25,42	7	5	
● BB Acoes Quantitativo Fc	45,79	0,24	21,21	73,48	-48,63	13,81	-32,23	7	5	

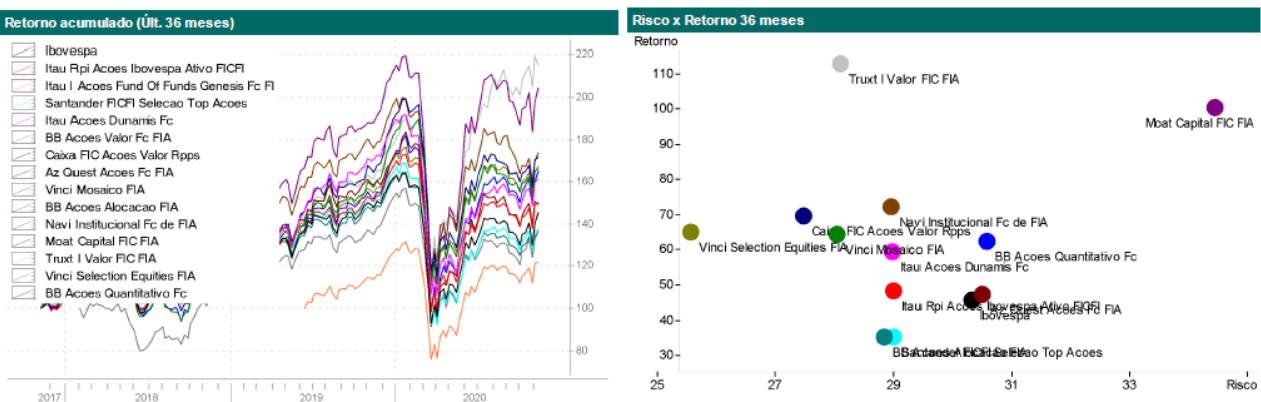
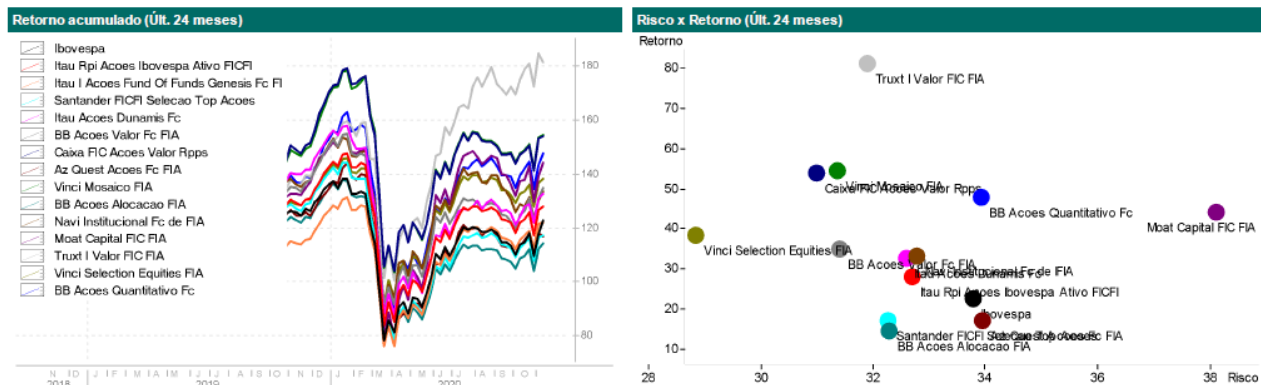


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos





Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

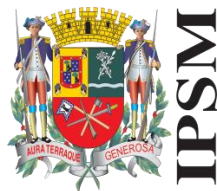


Perfil da Carteira - Maiores Investimentos

Nome	Data Últ. Cart. Aberta	% 1º Maior Invest.	Nome 1º Maior Investimento	% 2º Maior Invest.	Nome 2º Maior Investimento
● Ibovespa	-	-	-	-	-
● Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo...	30/06/2020	8,29	Vale ON - Ações	6,34	It Now Ibov - Emprést-ações e TVM cedid
● Itau I Acoes Fund Of Funds Ge...	30/06/2020	6,09	Vale ON - Ações	5,53	Magaz Luiza ON - Ações
● Santander FICFI Selecao Top...	31/07/2020	8,59	Vale ON - Ações	8,20	Bradesco PN - Ações
● Itau Acoes Dunamis Fc	30/06/2020	11,14	Energisa UNT N2 - Cert ou rec de dep de val mob	6,92	Magaz Luiza ON - Ações
● BB Acoes Valor Fc FIA	31/07/2020	28,51	Outras aplicações - Outras aplicações	24,56	LFT 210100 2022-09-01 - Operações comprometidas
● Caixa FIC Acoes Valor Rpps	31/07/2020	11,96	Vale ON - Ações	9,84	Locamerica ON - Ações
● Az Quest Acoes Fc FIA	31/10/2020	100,02	Az Quest Master FIA	0,28	Valores a receber - Valores a receber
● Vinci Mosaico FIA	31/07/2020	12,06	Vale ON - Ações	8,82	Locamerica ON - Ações
● BB Acoes Alcacao FIA	31/10/2020	17,19	NTN-B 760199 2045-05-15 - Operações comprometidas	10,99	Vale ON - Ações
● Navi Institucional Fc de FIA	31/10/2020	100,01	Navi Institucional Master FIA	0,14	NTN-F 950199 2021-01-01 - Operações comprometidas
● Moat Capital FIC FIA	31/07/2020	11,43	Viavarejo ON - Ações	10,12	ItauUnibanco PN - Ações
● Truxt I Valor FIC FIA	31/07/2020	39,48	Citico / Cod: 82 / Tipo: Fundos Offshore / Estados Unidos d...	9,79	Magaz Luiza ON - Ações
● Vinci Selection Equities FIA	31/07/2020	6,29	LFT 210100 2023-03-01 - Títulos públicos	4,61	Ishares Ibovespa Fundo de Índice
● BB Acoes Quantitativo Fc	31/10/2020	28,61	NTN-B 760199 2045-05-15 - Operações comprometidas	9,30	BB Etf Ibovespa Fundo de Índice - Cotas de fundos

Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)

Nome	% Ações a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debén.	% Depósitos	% Oper. Comprom.	% Tít. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
● Ibovespa	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-
● Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativ...	79,50	0,00	2,99	6,78	0,00	0,00	0,00	2,52	2,19	31/10/2020	89,27	4,71	0,00
● Itau I Acoes Fund Of Funds G...	85,25	0,00	2,09	4,29	0,00	0,00	0,00	3,77	1,67	31/10/2020	91,63	5,44	0,00
● Santander FICFI Selecao Top...	92,77	0,00	4,07	0,00	0,00	0,00	0,00	3,49	0,00	30/09/2020	96,84	3,49	0,00
● Itau Acoes Dunamis Fc	79,97	0,00	11,14	0,04	0,00	0,00	0,00	0,00	0,22	30/09/2020	91,14	0,22	6,56
● BB Acoes Valor Fc FIA	44,20	0,00	1,89	0,00	0,00	0,00	0,00	24,56	0,00	31/10/2020	46,09	24,56	0,00
● Caixa FIC Acoes Valor Rpps	77,83	0,00	6,52	14,30	0,00	0,00	0,00	1,01	0,00	31/10/2020	98,65	1,01	0,00
● Az Quest Acoes Fc FIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,16	0,00	31/10/2020	0,00	0,16	0,00
● Vinci Mosaico FIA	77,90	0,00	1,36	14,81	0,00	0,00	0,00	0,04	0,00	31/07/2020	94,08	0,04	0,00
● BB Acoes Alcacao FIA	65,82	0,01	2,56	0,00	0,00	0,00	0,00	17,19	0,01	31/10/2020	68,39	17,20	0,00
● Navi Institucional Fc de FIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,15	0,00	31/10/2020	0,00	0,15	0,00
● Moat Capital FIC FIA	94,64	0,00	4,00	0,05	0,00	0,00	0,00	0,77	0,00	31/07/2020	98,68	0,77	0,00
● Truxt I Valor FIC FIA	55,83	0,00	0,00	9,67	-7,19	0,00	0,00	5,51	0,00	31/07/2020	58,30	5,51	39,48
● Vinci Selection Equities FIA	70,54	0,00	1,39	4,33	0,00	0,00	0,00	4,54	14,15	31/07/2020	76,26	18,69	0,00
● BB Acoes Quantitativo Fc	50,17	0,00	5,72	0,00	0,00	0,00	0,00	28,61	0,00	31/10/2020	55,89	28,61	0,00

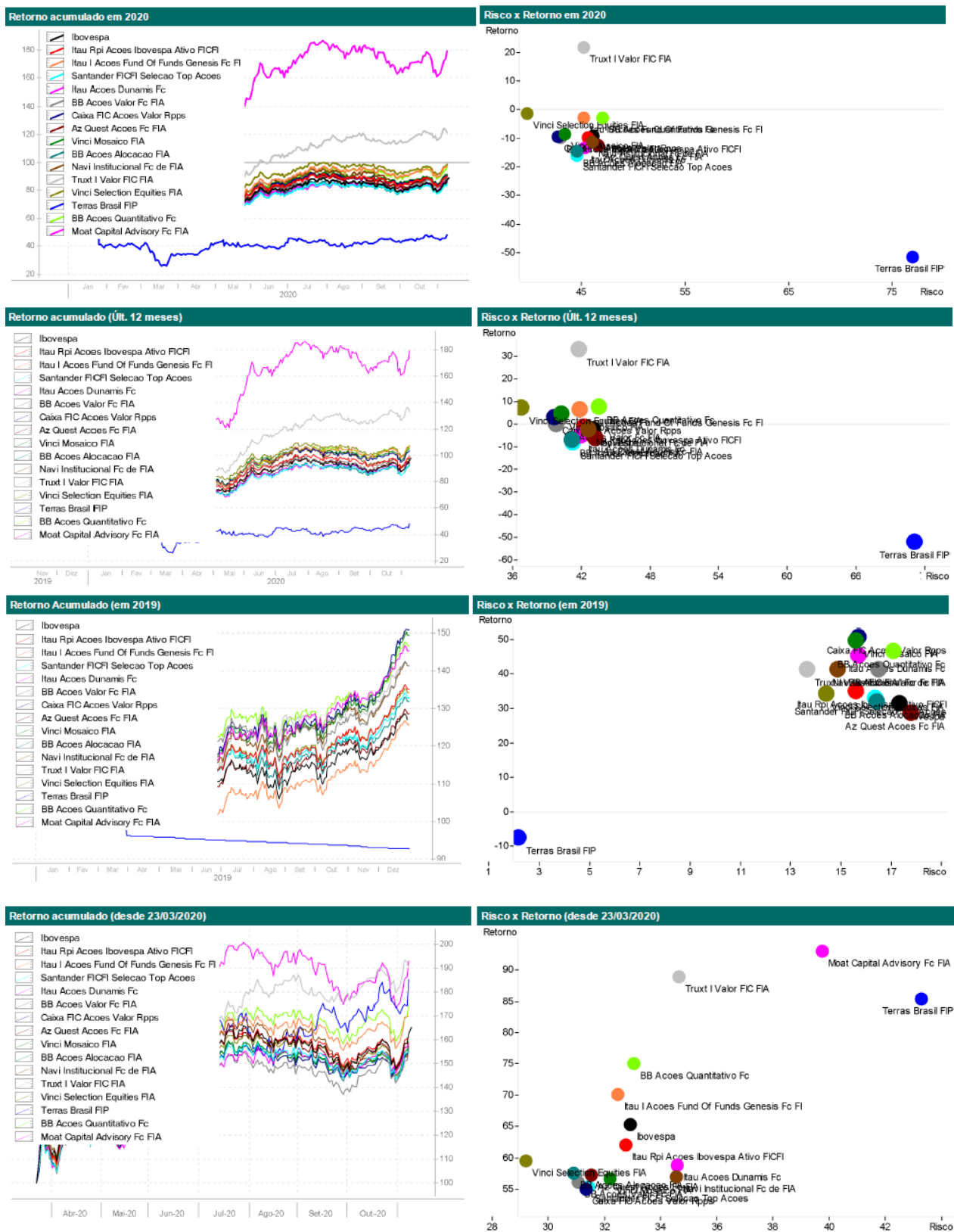


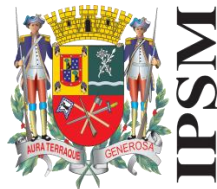
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Ibovespa – Com FIP Terras Brasil

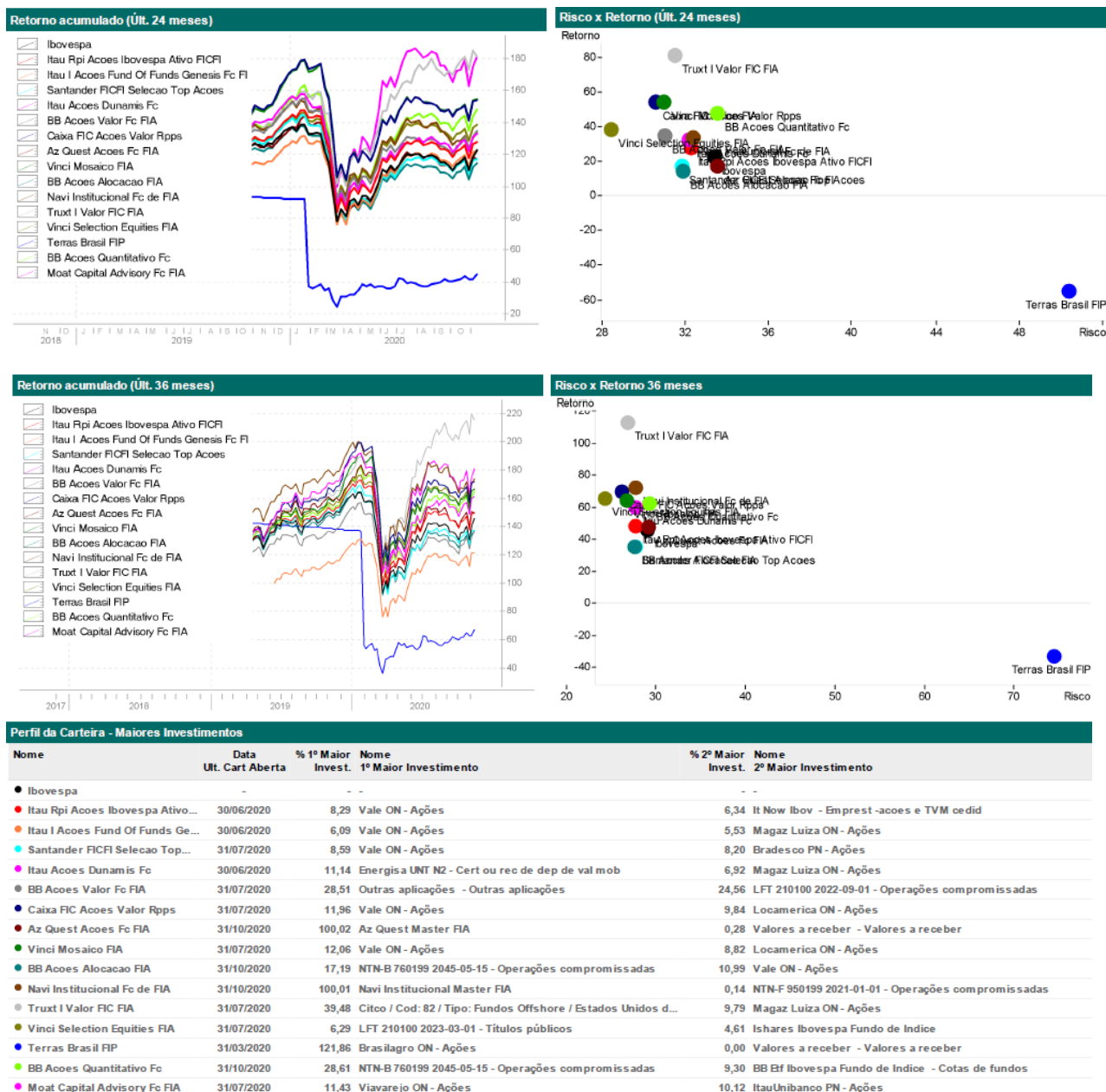
Dados Gerais																						
Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Cotistas	Nº	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark											
● Ibovespa	-	-	-	29/12/1967	-	-	-	-	-	-	-											
● Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FL...	Itau Dtvn	Ações Índice Ativo	790.176	25/04/2008	2,50	56	50.000	D+002	Não se Aplica	IBOVESPA F...												
● Itau I Acoes Fund Of Funds Gen...	Itau Dtvn	Ações Livre	249.387	11/06/2019	1,90	15	100	D+024	Até 20 %	IBOVESPA F...												
● Santander FICFI Selecao Top Ac...	Santander Brasil Gestao de R...	Ações Valor/Crescime...	586.532	03/04/1998	2,50	3.228	1.000	D+003	Não se Aplica	IBOVESPA F...												
● Itau Acoes Dunamis Fc	Itau Unibanco SA	Ações Livre	3.478.751	12/09/2016	2,00	45.117	100	D+002	Até 20 %	IBOVESPA F...												
● BB Acoes Valor Fc FIA	BB Dtvn S.A	Ações Valor/Crescime...	810.201	30/01/2018	2,00	1.693	0	D+032	Não se Aplica	IBOVESPA												
● Caixa FIC Acoes Valor Rpps	Vinci Equities Gestora de Rec...	Ações Livre	498.144	13/12/2011	1,72	115	100.000	D+023	Não se Aplica	Não se Aplica												
● Az Quest Acoes Fc FIA	Az Quest Investimentos	Ações Livre	821.212	01/06/2005	2,50	11.706	10.000	D+003	Não se Aplica	IBOVESPA												
● Vinci Mosaio FIA	Vinci Equities Gestora de Rec...	Ações Livre	1.438.617	12/07/2010	1,97	1.477	10.000	D+003	Não se Aplica	IBOVESPA F...												
● BB Acoes Alocacao FIA	BB Dtvn S.A	Ações Livre	389.022	30/08/2013	1,00	670	0	D+003	Não se Aplica	Não se Aplica												
● Navi Institucional Fc de FIA	Navi Capital	Ações Livre	1.023.063	30/09/2011	1,50	3.331	10.000	D+032	Não se Aplica	IBOVESPA												
● Truxt I Valor FIC FIA	Truxt Investimentos	Ações Livre	422.643	02/06/2017	-	857	-	D+003	Até 40 %	IPCA												
● Vinci Selection Equities FIA	Vinci Gestao de Patrimonio LT...	Ações Livre	420.427	01/11/2012	4,00	160	500	D+062	Até 20 %	IBOVESPA												
● Terras Brasil FIP	BRZ Investimentos Ltda	Fundos de Participações	7.121	30/05/2014	2,00	8	1.000.000	Não se aplica	Não se Aplica	Não se Aplica												
● BB Acoes Quantitativo Fc	BB Dtvn S.A	Ações Livre	200.691	24/03/2006	2,00	9.729	0	D+003	Não se Aplica	Não se Aplica												
● Moat Capital Advisory Fc FIA	Moat Capital Gestao de Recur...	Ações Livre	-	19/03/2020	2,00	15.489	20.000	D+017	Não se Aplica	IBOVESPA F...												
Retornos (%) (até 05/11/2020)																						
	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	nov 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m	24m	36m	48m
● Ibovespa	6,85	-1,63	-8,43	-29,90	10,25	8,57	8,76	8,27	-3,44	-4,80	-0,69	7,24	15,03	31,58	-12,88	4,85	-1,99	26,78	-7,33	12,45	36,31	63,56
● Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	8,27	0,68	-7,78	-31,34	11,57	7,94	8,62	8,46	-3,01	-4,26	-1,33	7,35	16,10	35,04	-11,05	4,64	-1,72	26,99	-3,05	21,38	43,70	70,40
● Itau I Acoes Fund Of Funds Genes...	8,27	1,14	-6,82	-31,12	12,62	9,31	9,74	9,52	-2,26	-4,28	-0,57	7,88	-	-	-3,62	5,92	0,55	33,44	5,55	-	-	-
● Santander FICFI Selecao Top Acoes	7,81	-0,66	-9,20	-33,48	11,00	6,02	9,31	8,91	-1,81	-4,27	-1,95	7,48	14,95	32,92	-16,73	4,42	-1,37	27,56	-9,21	11,27	33,43	68,63
● Itau Acoes Dunamis Fc	8,13	-0,19	-9,79	-32,44	11,03	5,36	9,28	7,54	-0,20	-4,96	0,50	7,48	22,48	45,27	-14,33	6,65	2,57	28,83	-6,46	26,08	55,27	92,01
● BB Acoes Valor Fc FIA	8,81	-1,44	-8,96	-27,05	8,39	7,48	7,44	6,38	-3,55	-4,77	2,22	6,26	-	41,43	-13,05	6,75	0,74	24,25	-4,02	25,02	-	-
● Caixa FIC Acoes Valor Rpps	12,22	1,95	-6,80	-31,10	9,76	7,03	9,33	8,86	-4,82	-2,90	-1,78	7,53	15,62	50,52	-10,65	4,08	-1,37	25,16	1,89	46,44	64,41	82,50
● Az Quest Acoes Fc FIA	7,53	3,82	-8,29	-35,44	11,36	9,33	9,88	8,86	-1,98	-6,19	-0,62	7,52	26,12	28,60	-12,04	6,00	-1,93	29,74	-6,56	12,19	45,27	70,65
● Vinci Mosaio FIA	12,34	1,74	-5,42	-31,73	10,08	7,08	9,35	9,03	-4,83	-2,81	-1,81	7,61	14,80	49,55	-9,77	4,14	-1,24	25,57	3,19	46,69	59,44	118,41
● BB Acoes Alocacao FIA	8,20	-1,38	-8,48	-31,67	9,48	7,13	9,07	7,46	-3,28	-4,38	-0,86	6,98	16,19	31,96	-16,85	4,26	-1,76	25,54	-10,23	6,96	29,71	48,61
● Navi Institucional Fc de FIA	9,04	-2,30	-6,28	-27,86	12,22	7,16	8,30	8,78	-2,88	-7,12	-2,89	5,53	34,07	41,32	-13,49	1,10	-7,42	19,11	-5,86	24,77	65,26	102,69
● Truxt I Valor FIC FIA	7,07	5,63	-7,70	-25,83	13,46	11,33	15,05	10,00	2,91	-3,68	1,02	7,60	17,49	41,37	24,54	8,42	5,92	53,81	36,43	78,27	115,21	-
● Vinci Selection Equities FIA	7,70	0,39	-5,96	-25,42	10,98	7,60	8,34	8,97	-2,52	-4,58	-1,14	6,00	19,35	34,19	-3,24	3,60	-2,18	25,48	4,78	30,57	59,52	91,81
● Terras Brasil FIP	-0,36	-59,39	-6,58	-8,38	21,19	-4,24	5,87	-0,17	-2,36	5,26	4,24	0,35	49,29	-7,24	-54,17	3,76	11,49	6,41	-54,59	-57,76	-37,06	-40,22
● BB Acoes Quantitativo Fc	9,64	2,47	-8,46	-32,23	13,81	9,31	9,24	9,81	-1,31	-4,94	-0,66	6,25	8,45	46,57	-6,08	4,08	-1,05	31,46	3,06	38,35	53,06	80,34
● Moat Capital Advisory Fc FIA	-	-	-	-	21,53	12,38	12,73	12,54	-3,67	-7,67	-1,91	6,74	-	-	-	2,93	-5,77	33,88	-	-	-	-
Tabela de Riscos (até 05/11/2020)																						
Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Mín 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos													
● Ibovespa	45,12	-0,02	20,99	72,71	-46,82	11,83	-29,90	6	6													
● Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	44,40	0,08	20,62	71,43	-46,95	11,57	-31,34	7	5													
● Itau I Acoes Fund Of Funds Genesi...	44,04	0,29	20,44	70,80	-46,11	12,62	-31,12	7	5													
● Santander FICFI Selecao Top Acoes	43,52	-0,08	20,17	69,85	-48,30	11,00	-33,48	6	6													
● Itau Acoes Dunamis Fc	44,00	-0,01	20,47	70,92	-47,39	11,03	-32,44	7	5													
● BB Acoes Valor Fc FIA	41,59	0,03	19,42	67,27	-44,79	10,08	-27,05	7	5													
● Caixa FIC Acoes Valor Rpps	41,88	0,19	19,42	67,28	-45,07	12,22	-31,10	7	5													
● Az Quest Acoes Fc FIA	45,59	0,01	21,08	73,03	-48,93	11,36	-35,44	7	5													
● Vinci Mosaio FIA	42,53	0,22	19,69	68,22	-45,32	12,34	-31,73	7	5													
● BB Acoes Alocacao FIA	43,39	-0,11	20,12	69,68	-47,74	9,94	-31,67	6	6													
● Navi Institucional Fc de FIA	44,49	0,01	20,77	71,96	-45,08	12,22	-27,86	6	6													
● Truxt I Valor FIC FIA	43,78	1,06	20,39	70,65	-40,47	15,05	-25,83	9	3													
● Vinci Selection Equities FIA	38,71	0,25	18,05	62,54	-41,19	10,98	-25,42	7	5													
● Terras Brasil FIP	97,14	-0,50	34,06	117,99	-74,04	21,19	-59,39	5	7													
● BB Acoes Quantitativo Fc	45,79	0,24	21,21	73,48	-48,63	13,81	-32,23	7	5													
● Moat Capital Advisory Fc FIA	-	-	-	-	-15,34	21,53	-7,67	-	-													

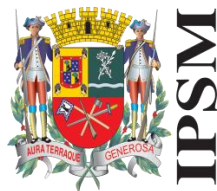
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos





Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos



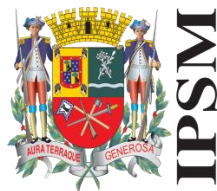


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)													
Nome	% Ações a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debên.	% Depósitos	% Oper. Comprom.	% Tit. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
● Ibovespa	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-
● Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativ...	79,50	0,00	2,99	6,78	0,00	0,00	0,00	2,52	2,19	31/10/2020	89,27	4,71	0,00
● Itau I Acoes Fund Of Funds G...	85,25	0,00	2,09	4,29	0,00	0,00	0,00	3,77	1,67	31/10/2020	91,63	5,44	0,00
● Santander FICFI Selecao Top...	92,77	0,00	4,07	0,00	0,00	0,00	0,00	3,49	0,00	30/09/2020	96,84	3,49	0,00
● Itau Acoes Dunamis Fc	79,97	0,00	11,14	0,04	0,00	0,00	0,00	0,00	0,22	30/09/2020	91,14	0,22	6,56
● BB Acoes Valor Fc FIA	44,20	0,00	1,89	0,00	0,00	0,00	0,00	24,56	0,00	31/10/2020	46,09	24,56	0,00
● Caixa FIC Acoes Valor Rpps	77,83	0,00	6,52	14,30	0,00	0,00	0,00	1,01	0,00	31/10/2020	98,65	1,01	0,00
● Az Quest Acoes Fc FIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,16	0,00	31/10/2020	0,00	0,16	0,00
● Vinci Mosaico FIA	77,90	0,00	1,36	14,81	0,00	0,00	0,00	0,04	0,00	31/07/2020	94,08	0,04	0,00
● BB Acoes Alocacao FIA	65,82	0,01	2,56	0,00	0,00	0,00	0,00	17,19	0,01	31/10/2020	68,39	17,20	0,00
● Navi Institucional Fc de FIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,15	0,00	31/10/2020	0,00	0,15	0,00
● Truxt I Valor FIC FIA	55,83	0,00	0,00	9,67	-7,19	0,00	0,00	5,51	0,00	31/07/2020	58,30	5,51	39,48
● Vinci Selection Equities FIA	70,54	0,00	1,39	4,33	0,00	0,00	0,00	4,54	14,15	31/07/2020	76,26	18,69	0,00
● Terras Brasil FIP	121,86	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	31/03/2020	121,86	0,00	0,00
● BB Acoes Quantitativo Fc	50,17	0,00	5,72	0,00	0,00	0,00	0,00	28,61	0,00	31/10/2020	55,89	28,61	0,00
● Moat Capital Advisory Fc FIA	94,66	0,00	4,00	0,05	0,00	0,00	0,00	0,77	0,00	31/07/2020	98,71	0,77	0,00

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não cortam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

Fonte: Economatica



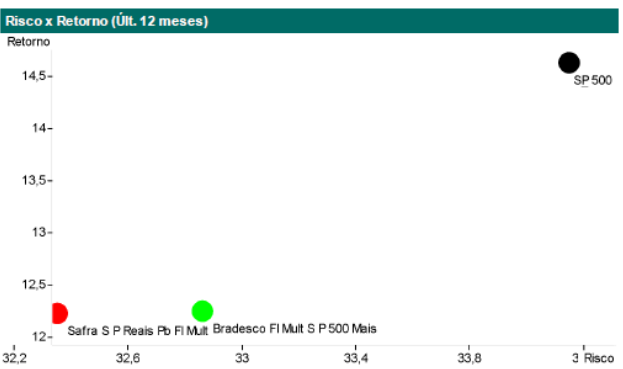
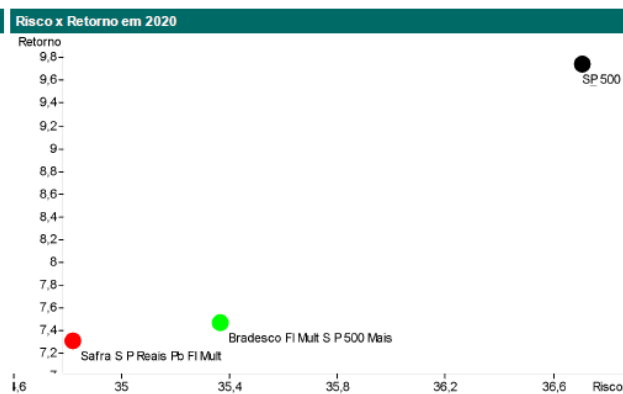
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

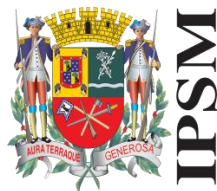
S&P 500

Dados Gerais											
Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Cotistas	Nº	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark
● S&P 500	-	-	-	30/12/1927	-	-	-	-	-	-	-
● Safra S P Reais Pb FI Mult	Banco J Safra SA	Multimercados Estrat...	461.609	13/07/2015	1,00	92	200.000	D+002	Até 20 %	CDI	
● Bradesco FI Mult S P 500 Mais	Bram Bradesco Asset Manag...	Multimercados Livre	121.069	29/11/2013	1,50	932	10.000	D+004	Não se Aplica	Não se Aplica	

Retornos (%) (até 05/11/2020)											
	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020
● S&P 500	2,86	-0,16	-8,41	-12,51	12,68	4,53	1,84	5,51	7,01	-3,92	-2,77
● Safra S P Reais Pb FI Mult	2,63	0,37	-7,44	-14,56	11,71	5,18	0,91	5,58	6,86	-4,80	-2,30
● Bradesco FI Mult S P 500 Mais	2,58	0,29	-7,51	-14,56	11,83	5,22	0,86	5,59	6,90	-4,71	-2,31

Tabela de Riscos (até 05/11/2020)											
Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Mín 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos		
● S&P 500	34,46	0,48	16,19	56,09	-33,92	12,68	-12,51	7	5		
● Safra S P Reais Pb FI Mult	32,55	0,43	15,31	53,03	-34,78	11,71	-14,56	8	4		
● Bradesco FI Mult S P 500 Mais	33,07	0,43	15,55	53,86	-34,88	11,83	-14,56	8	4		



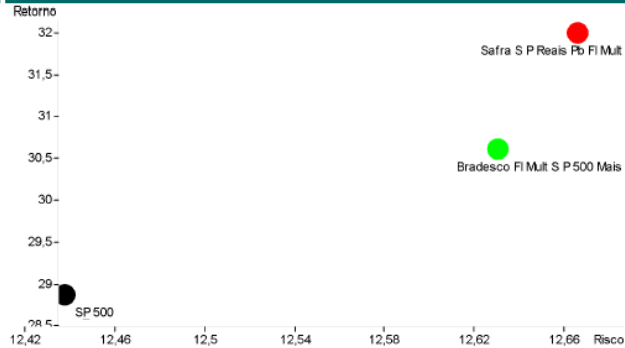


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Retorno Acumulado (em 2019)



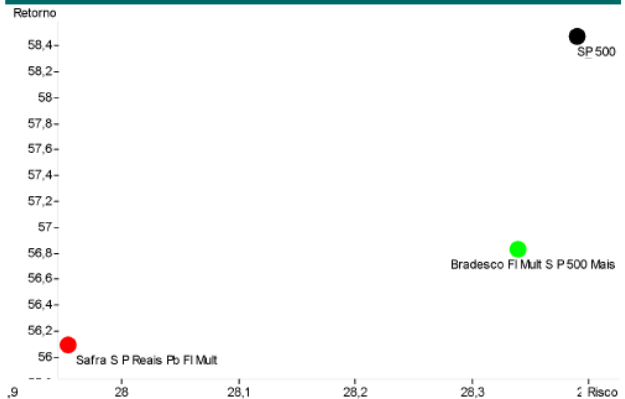
Risco x Retorno (em 2019)



Retorno acumulado (desde 23/03/2020)



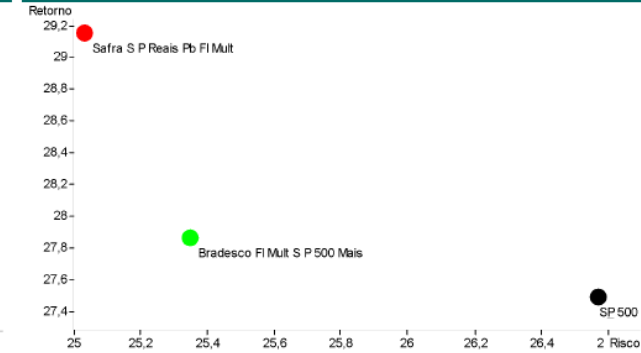
Risco x Retorno (desde 23/03/2020)



Retorno acumulado (Últ. 24 meses)



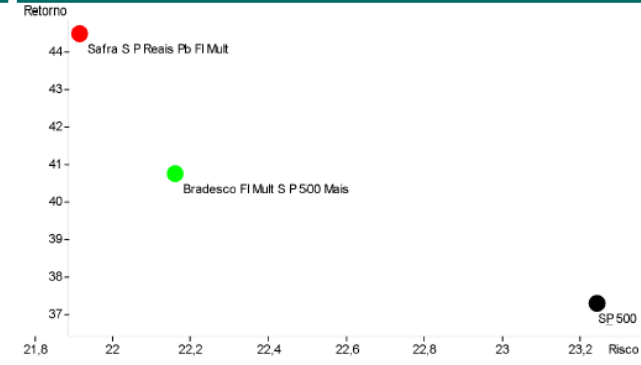
Risco x Retorno (Últ. 24 meses)

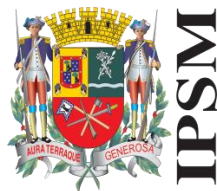


Retorno acumulado (Últ. 36 meses)



Risco x Retorno 36 meses





Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Perfil da Carteira - Maiores Investimentos											
Nome	Data Últ. Cart. Aberta	% 1º Maior Invest.	Nome 1º Maior Investimento	% 2º Maior Invest.	Nome 2º Maior Investimento						
● S&P 500	-	-	-	-	-						
● Safra S P Reais Pb FI Mult	31/07/2020	38,82	LFT 210100 2022-09-01 - Títulos públicos	24,42	LFT 210100 2023-03-01 - Títulos públicos						
● Bradesco FI Mult S P 500 Mais	31/10/2020	27,26	LFT 210100 2023-09-01 - Títulos públicos	25,69	LFT 210100 2021-03-01 - Títulos públicos						

Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)													
Nome	% Ações a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debên.	% Depósitos	% Oper. Comprom.	% Tít. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
● S&P 500	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-
● Safra S P Reais Pb FI Mult	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	100,28	31/07/2020	0,00	100,28	0,00
● Bradesco FI Mult S P 500 Mais	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	10,25	91,50	31/10/2020	0,00	101,75	0,00

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

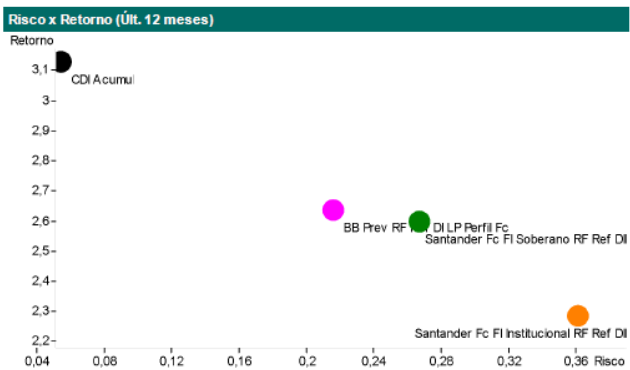
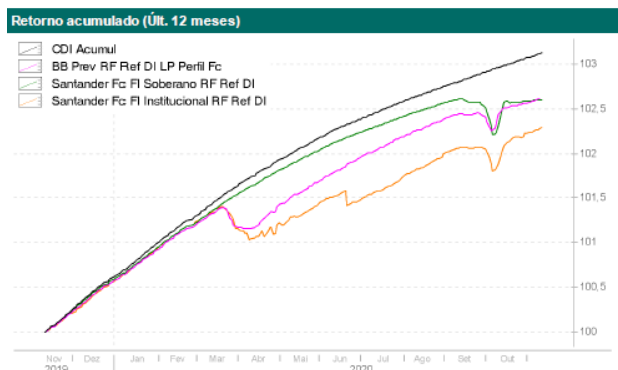
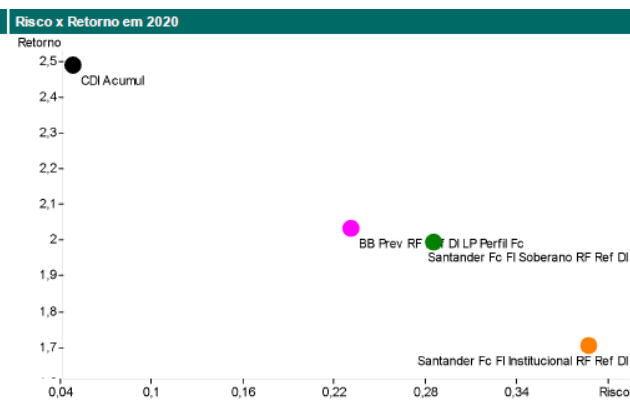
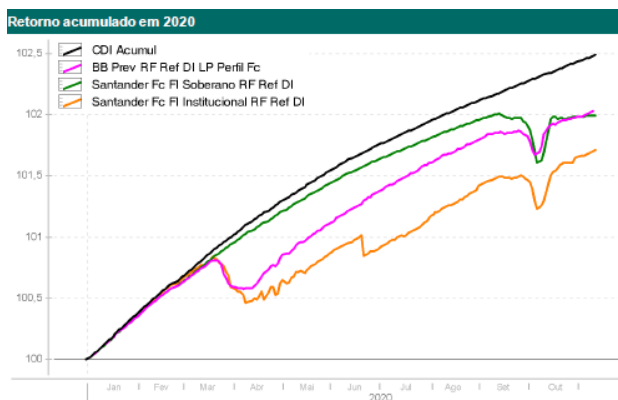
Fonte: Economatica



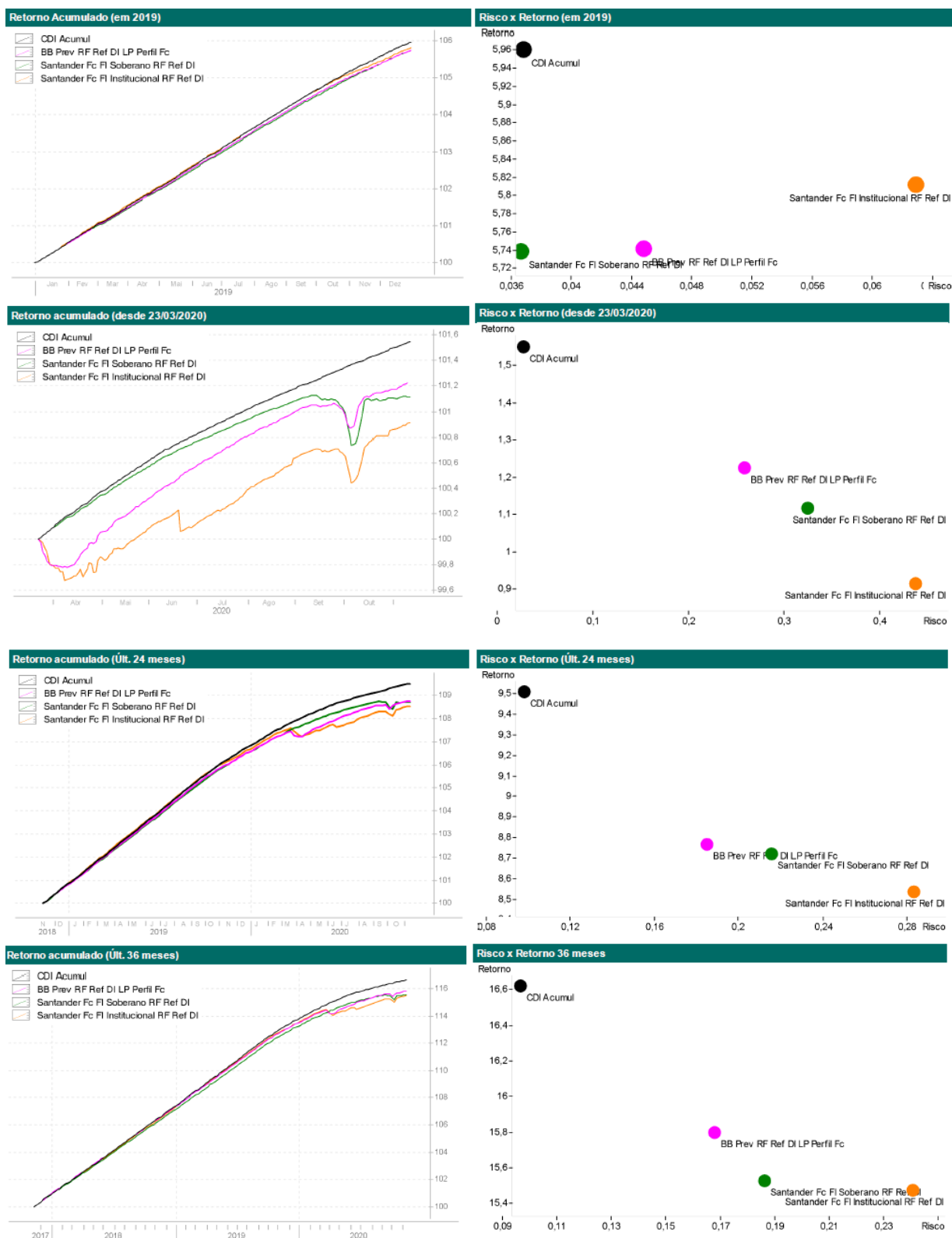
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

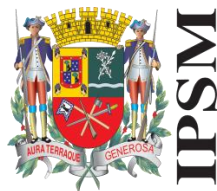
CDI

Dados Gerais																						
Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Nº Cotistas	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark												
● CDI	-	-	-	06/03/1986	-	-	-	-	-	-												
● BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	BB Dtm S.A	Renda Fixa Duração Bai...	2.598.672	28/04/2011	0,30	583	1.000	D+000	Não se Aplica	CDI												
● Santander Fc FI Soberano RF Ref...	Santander Brasil Gestao de R...	Renda Fixa Duração Bai...	4.458.111	24/11/2008	0,20	332	100	D+000	Não se Aplica	CDI												
● Santander Fc FI Institucional RF...	Santander Brasil Gestao de R...	Renda Fixa Duração Bai...	2.682.104	27/11/1997	0,20	499	500.000	D+000	Não se Aplica	CDI												
Retornos (%) (até 06/11/2020)																						
	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	nov 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m	24m	36m	48m
● CDI	0,37	0,38	0,29	0,34	0,28	0,24	0,21	0,19	0,16	0,16	0,16	0,03	6,42	5,96	2,47	0,16	0,47	1,11	3,16	9,57	16,73	29,57
● BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	0,35	0,35	0,27	-0,03	0,26	0,26	0,26	0,24	0,18	0,02	0,16	0,03	6,33	5,74	2,02	0,33	0,36	1,12	2,65	8,83	15,90	28,84
● Santander Fc FI Soberano RF Ref DI	0,36	0,36	0,27	0,32	0,26	0,22	0,20	0,17	0,14	-0,05	0,07	0,01	6,18	5,74	2,00	0,38	0,15	0,74	2,66	8,80	15,66	28,32
● Santander Fc FI Institucional RF Re...	0,37	0,37	0,28	-0,07	0,06	0,22	0,04	0,27	0,25	0,04	0,19	0,03	6,35	5,81	1,68	0,45	0,46	1,01	2,31	8,59	15,58	28,65
Tabela de Riscos (até 06/11/2020)																						
Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Mín 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos													
● CDI	0,07	-0,06	0,03	0,11	0,00	0,38	0,05	12	0													
● BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	0,23	-2,24	0,11	0,37	-0,23	0,35	-0,03	11	1													
● Santander Fc FI Soberano RF Ref DI	0,28	-1,86	0,13	0,46	-0,39	0,36	-0,05	11	1													
● Santander Fc FI Institucional RF Re...	0,37	-2,24	0,18	0,61	-0,37	0,37	-0,07	11	1													



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos



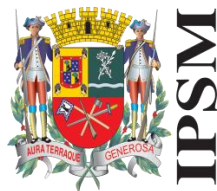


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Perfil da Carteira - Maiores Investimentos													
Nome	Data Últ. Cart. Aberta	% 1º Maior Invest.	Nome 1º Maior Investimento	% 2º Maior Invest.	Nome 2º Maior Investimento								
● CDI	-	-	-	-	-								
● BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	31/10/2020	15,51	NTN-B 760199 2055-05-15 - Operações compromissadas	14,45	Banco Bradesco S.A. - Dep a prazo e otr tit de inst fin								
● Santander Fc FI Soberano RF...	31/10/2020	24,79	LFT 210100 2026-03-01 - Operações compromissadas	15,50	LFT 210100 2022-09-01 - Títulos públicos								
● Santander Fc FI Institucional R...	31/10/2020	43,42	LFT 210100 2023-09-01 - Títulos públicos	16,02	NTN-F 950199 2025-01-01 - Operações compromissadas								
Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)													
Nome	% Ações a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debén.	% Depósitos	% Oper. Comprom.	% Tít. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
● CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-
● BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	10,09	27,63	15,52	46,38	31/10/2020	0,00	99,62	0,00
● Santander Fc FI Soberano RF...	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	36,26	63,75	31/10/2020	0,00	100,01	0,00
● Santander Fc FI Institucional...	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	8,89	27,03	16,02	45,68	31/10/2020	0,00	97,62	0,00

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

Fonte: Economatica



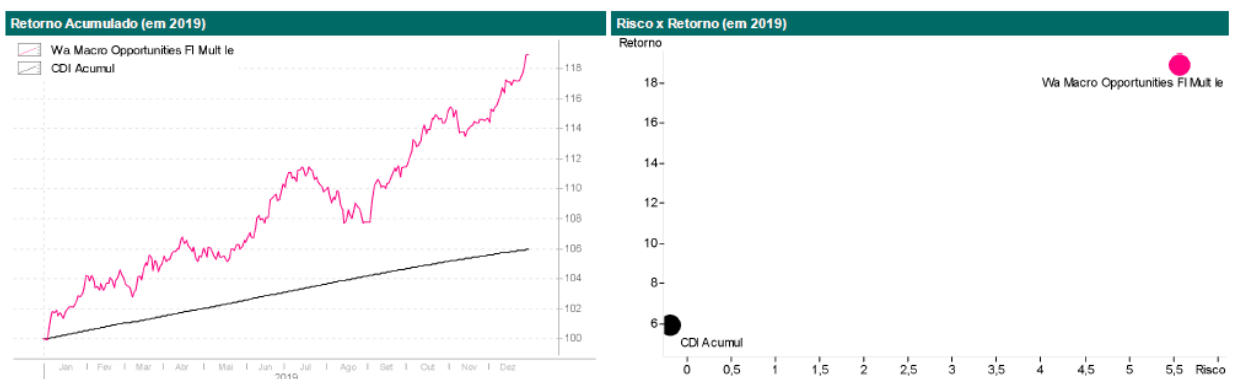
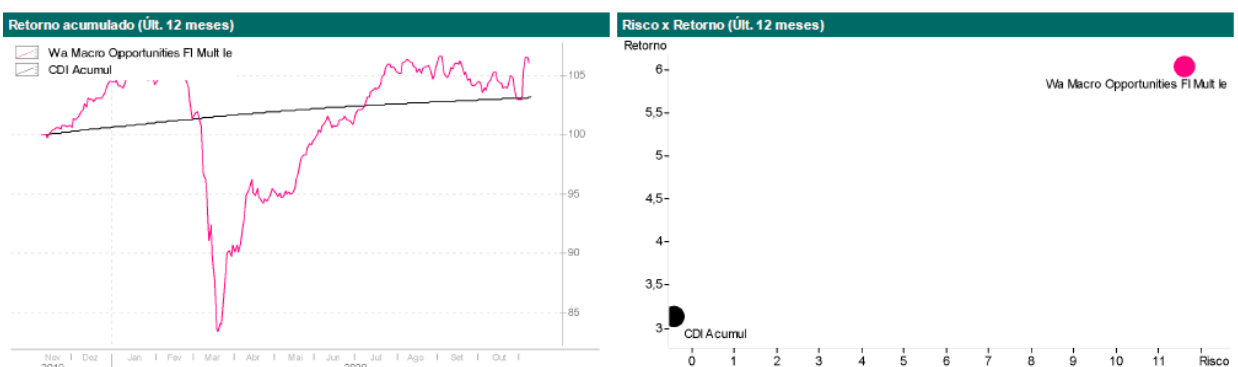
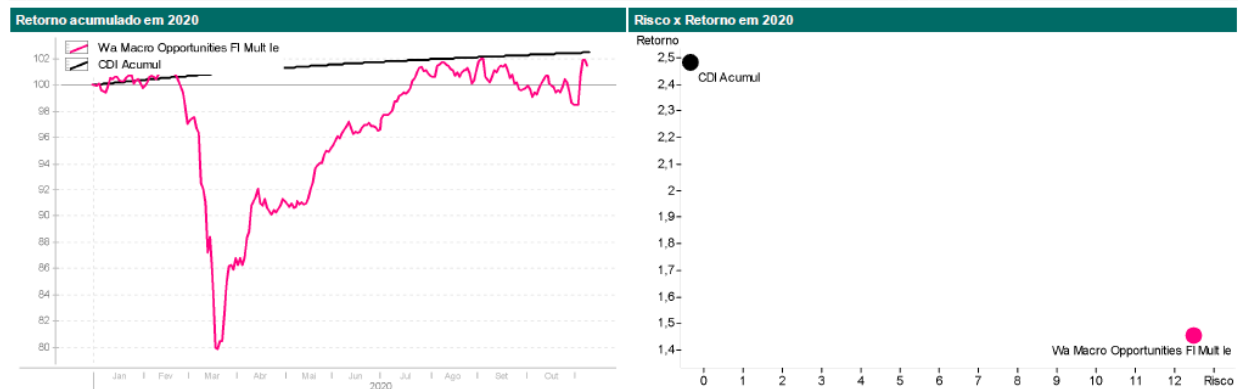
Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

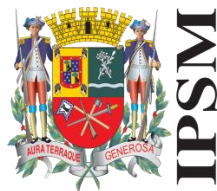
CDI – Outros

Dados Gerais										
Nome	Empresa gestora	Classificação Anbima	PL Médio 12m (R\$ 000)	Início do Fundo	Taxa máx. adm. (%)	Nº Cotistas	Aplicação mínima (R\$)	Prazo pgto resgate	Invest no exterior	Benchmark
● Wa Macro Opportunities FI Mult le	Western Asset	Multimercados Invest...	923.341	05/10/2015	0,10	62	100.000	D+005	> 67%	Não se Aplica
● CDI	-	-	-	06/03/1986	-	-	-	-	-	-

Retornos (%) (até 05/11/2020)																			
	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	nov 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m
● Wa Macro Opportunities FI Mult le	3,66	-0,24	-2,75	-10,55	5,04	4,42	1,52	4,26	0,41	-1,36	-1,27	3,43	-2,68	18,87	1,90	2,86	0,44	12,01	5,54
● CDI	0,37	0,38	0,29	0,34	0,28	0,24	0,21	0,19	0,16	0,16	0,16	0,02	6,42	5,96	2,46	0,16	0,47	1,12	3,18

Tabela de Riscos (até 05/11/2020)									
Nome	Volatilidade 12 meses	Sharpe 12 meses	VAR de 1 mês 95% (%)	VAR de 12 meses 95% (%)	Perda Máxima	Retorno Máx 1 mês	Retorno Min 1 mês	Meses Positivos	Meses Negativos
● Wa Macro Opportunities FI Mult le	12,18	0,25	5,72	19,81	-21,20	5,04	-10,55	7	5
● CDI	0,07	-0,04	0,03	0,11	0,00	0,38	0,04	12	0



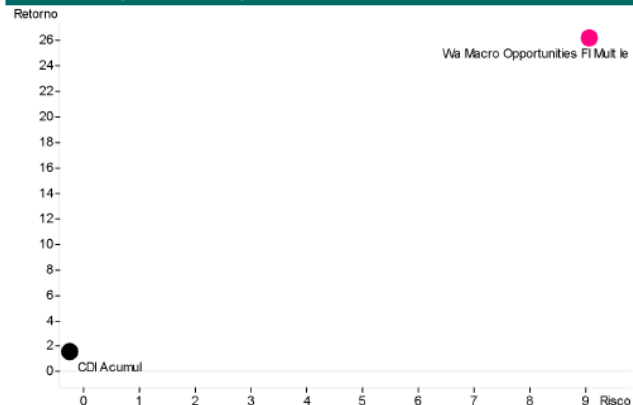


Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

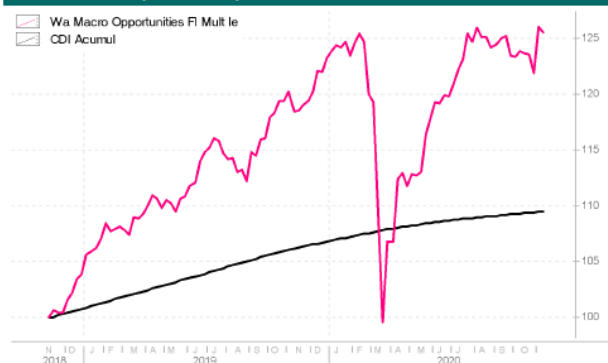
Retorno acumulado (desde 23/03/2020)



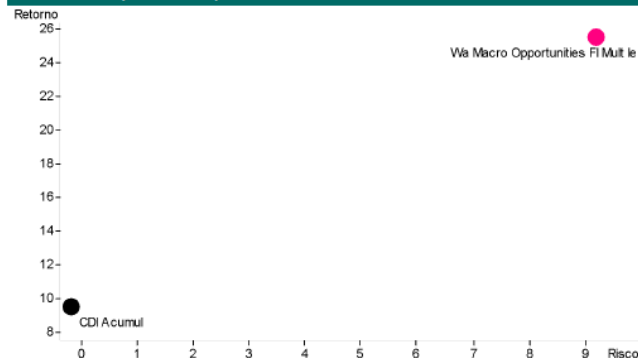
Risco x Retorno (desde 23/03/2020)



Retorno acumulado (Últ. 24 meses)



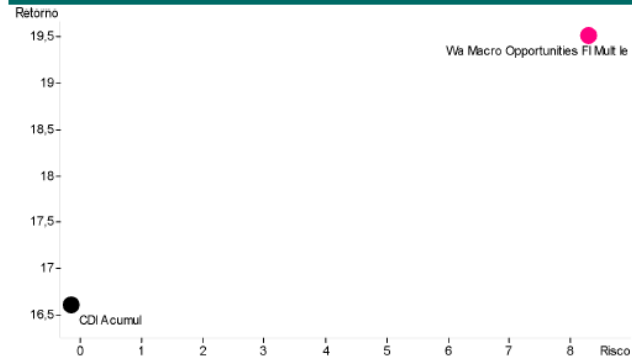
Risco x Retorno (Últ. 24 meses)



Retorno acumulado (Últ. 36 meses)



Risco x Retorno 36 meses



Perfil da Carteira - Maiores Investimentos

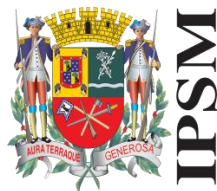
Nome	Data Últ. Cart. Aberta	% 1º Maior Invest.	Nome 1º Maior Investimento	% 2º Maior Invest.	Nome 2º Maior Investimento
● Wa Macro Opportunities FI Mu...	30/09/2020	96,68	Lm Wa Macro Opport / Cod: 9000055 / Tipo: Outros / Irland...	2,53	Valores a receber - Valores a receber
● CDI	-	-	-	-	-

Mapa de Alocação por tipo de Investimento (Últ. Carteira Aberta)

Nome	% Apões a vista	% BDRs	% Units	% Emprést. Cedidos	% Emprést. Recebidos	% Debên.	% Depósitos	% Oper. Comprom.	% Tít. Públ.	Data Últ. Cart. Aberta	% NET RV	% NET RF	% Inv. no Exterior
● Wa Macro Opportunities FI M...	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,10	3,44	30/09/2020	0,00	3,54	96,68
● CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-

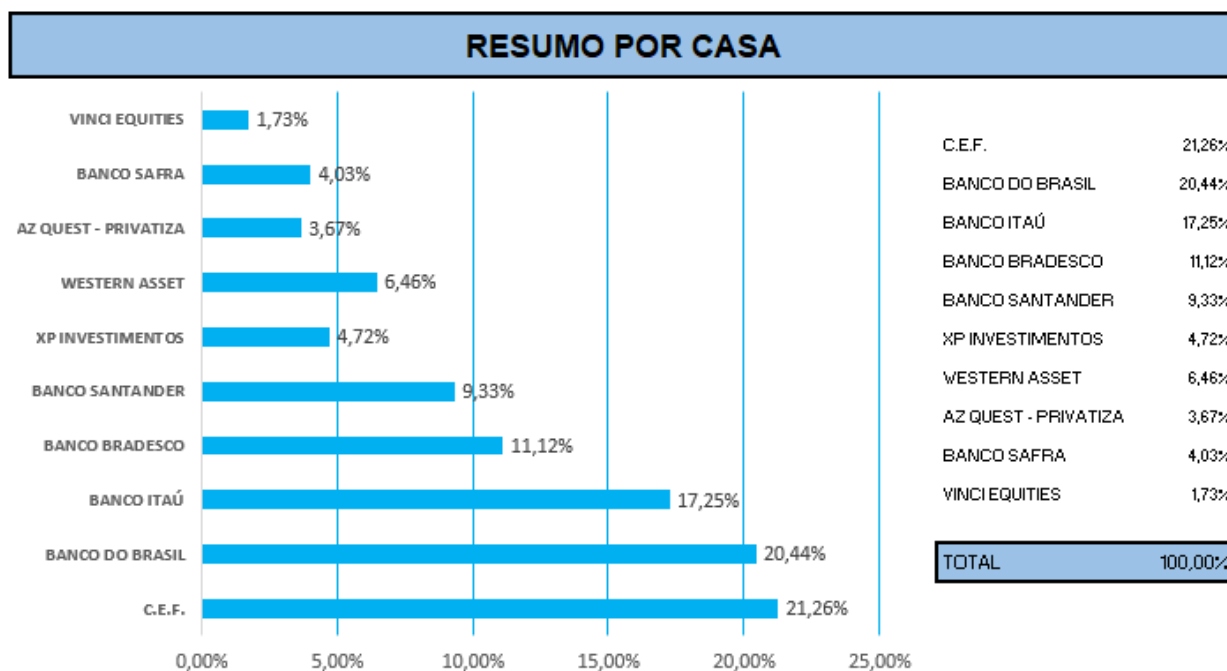
As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

Fonte: Economatica



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Distribuição por instituições





Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Lâmina de Indicadores

Índices de Renda Fixa (até 31/10/2020)

	nov 2019	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m	24m	36m	48m
CDI	0,38	0,37	0,38	0,29	0,34	0,28	0,24	0,21	0,19	0,16	0,16	0,16	6,42	5,96	2,44	0,16	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79	29,73
Selic	0,38	0,37	0,38	0,29	0,34	0,28	0,24	0,21	0,19	0,16	0,16	0,16	6,43	5,96	2,44	0,16	0,47	1,12	3,21	9,62	16,80	29,76
Poupança	0,50	0,50	0,50	0,50	0,50	0,50	0,50	0,50	0,50	0,50	0,50	0,50	6,17	6,17	5,11	0,50	1,51	3,04	6,17	12,72	19,67	28,39
Ima-B 5	-0,28	1,24	0,56	0,64	-1,75	0,49	2,12	1,12	0,99	0,43	-0,12	0,20	9,87	13,15	4,72	0,20	0,50	4,81	5,71	20,28	31,47	49,19
Ima-B	-2,45	2,01	0,26	0,45	-6,97	1,31	1,52	2,05	4,39	-1,80	-1,51	0,21	13,06	22,95	-0,51	0,21	-3,08	4,81	-1,00	25,47	38,38	58,57
Ima-B 5+	-4,07	2,60	0,03	0,32	-10,93	2,01	1,02	2,84	7,32	-3,62	-2,60	0,22	15,41	30,37	-4,35	0,22	-5,92	4,90	-5,85	28,98	43,02	64,85
Irfm 1	0,33	0,42	0,44	0,38	0,60	0,45	0,42	0,28	0,24	0,12	0,15	0,16	6,97	6,76	3,29	0,16	0,43	1,38	4,06	11,49	19,36	34,03
Irfm	-0,46	0,62	0,88	0,65	-0,11	1,15	1,42	0,79	1,08	-0,75	-0,56	-0,33	10,73	12,03	4,27	-0,33	-1,63	1,64	4,44	19,78	31,08	52,25
Irfm 1+	-0,83	0,72	1,11	0,80	-0,47	1,50	1,92	1,04	1,47	-1,13	-0,91	-0,61	12,27	14,24	4,76	-0,61	-2,63	1,75	4,63	23,41	36,20	60,11
Ima Geral	-0,71	0,90	0,56	0,45	-1,98	0,86	1,02	0,99	1,74	-0,60	-0,60	0,09	10,03	12,82	2,49	0,09	-1,11	2,64	2,67	17,87	28,36	46,25
Ima Geral ex-C	-0,70	0,91	0,50	0,44	-1,93	0,84	0,97	0,90	1,66	-0,68	-0,71	-0,00	9,80	12,63	1,96	-0,00	-1,39	2,13	2,16	17,10	27,20	45,17
Ima-C	-1,15	0,40	2,54	0,63	-3,52	1,39	2,63	3,74	4,26	2,11	2,95	2,81	18,38	19,41	21,09	2,81	8,08	19,98	20,18	45,58	72,54	87,98
Ihfa	-0,21	2,54	0,56	-1,57	-6,24	2,90	1,87	1,81	2,68	0,25	-1,90	-0,28	7,09	11,12	-0,25	-0,28	-1,93	4,45	2,07	10,99	19,93	36,15
Ida DI	-0,07	0,43	0,50	0,31	-4,87	0,49	0,78	1,02	1,47	0,85	0,53	0,31	7,39	5,59	1,24	0,31	1,70	5,05	1,61	8,16	16,16	31,31
Ida Geral	-0,65	0,94	0,69	0,39	-5,15	0,88	1,31	1,30	2,00	0,54	0,21	0,54	9,05	8,58	2,56	0,54	1,30	6,04	2,85	12,91	22,72	38,67
Ida IPCA	-1,58	1,72	0,99	0,51	-5,65	1,56	2,24	1,78	2,90	0,02	-0,31	0,91	11,75	12,96	4,80	0,91	0,62	7,74	4,91	20,39	33,40	50,52
Idka IPCA 2A	0,01	1,20	0,54	0,69	-1,21	0,57	1,75	0,99	0,94	1,03	0,02	0,04	9,75	11,82	5,45	0,04	1,09	4,85	6,73	19,60	31,26	49,77
Idka PRÉ 2A	-0,35	0,60	0,95	1,03	1,18	1,28	1,30	0,70	0,89	-0,36	-0,47	-0,71	11,63	11,89	5,91	-0,71	-1,53	1,34	6,18	21,62	34,82	58,26

Moedas (até 31/10/2020)

	nov 2019	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m	24m	36m	48m
Euro Real	4,30	-2,76	4,44	4,46	15,86	3,61	1,61	2,08	-0,03	6,30	1,13	1,68	11,83	2,06	48,42	1,68	9,30	13,33	50,53	59,58	76,30	93,16
Dolar Ptax V...	5,49	-4,58	5,92	5,37	15,56	4,39	-0,01	0,92	-4,98	5,15	3,10	2,32	17,13	4,02	43,20	2,32	10,93	6,35	44,15	55,25	76,14	81,44

Índices de Ações (até 31/10/2020)

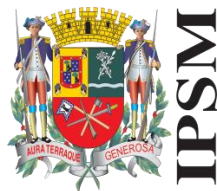
	nov 2019	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m	24m	36m	48m
Ibovespa	0,95	6,85	-1,63	-8,43	-29,90	10,25	8,57	8,76	8,27	-3,44	-4,80	-0,69	15,03	31,58	-18,76	-0,69	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44	44,71
Dividendos	2,35	9,99	-1,58	-6,18	-25,53	3,76	5,00	8,95	6,53	-4,83	-4,63	0,65	15,95	45,16	-20,56	0,65	-8,64	11,34	-10,58	24,50	30,96	62,38
Bdrs	9,03	-1,52	6,47	-5,70	5,47	16,32	2,90	4,50	1,77	14,62	-1,97	-1,75	12,02	35,67	48,79	-1,75	10,39	20,81	59,76	95,14	140,84	202,71
Small Cap	5,14	12,65	0,45	-8,27	-35,07	10,19	5,07	14,43	9,50	-1,23	-5,44	-2,28	8,13	58,20	-20,78	-2,28	-8,74	20,16	-6,17	34,08	41,52	84,32
MidLarge	0,68	6,79	-1,34	-8,16	-29,60	10,12	8,87	8,23	8,05	-3,78	-4,64	-0,28	16,49	31,16	-18,18	-0,28	-8,50	16,48	-12,03	8,38	28,25	45,33
Setor Consumo	2,99	8,03	3,66	-10,00	-31,51	17,67	7,65	10,08	7,62	-1,48	-3,96	-2,86	-9,57	55,25	-11,86	-2,86	-8,08	17,23	-1,94	42,20	27,52	48,74
S&P 500	3,40	2,86	-0,16	-8,41	-12,51	12,68	4,53	1,84	5,51	7,01	-3,92	-2,77	-6,24	28,88	1,21	-2,77	-0,04	12,28	7,65	20,59	26,98	53,80

Índices de Inflação (até 31/10/2020)

	nov 2019	dez 2019	jan 2020	fev 2020	mar 2020	abr 2020	mai 2020	jun 2020	jul 2020	ago 2020	set 2020	out 2020	2018	2019	2020	1m	3m	6m	12m	24m	36m	48m
IPCA	0,51	1,15	0,21	0,25	0,07	-0,31	-0,38	0,26	0,36	0,24	0,64	0,86	3,75	4,31	2,22	0,86	1,75	1,99	3,92	6,55	11,41	14,42

As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou ainda, do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para a avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. O Sistema Economatica é uma ferramenta para auxiliar o trabalho do analista e não contém nada que por si só deva ser interpretado como uma recomendação de investimento.

Fonte: Economatica



Instituto de Previdência do Servidor Municipal de São José dos Campos

Plano de Ação Mensal da Área de Investimentos

PLANO DE AÇÃO MENSAL - OUTUBRO 2020													
GESTÃO DE INVESTIMENTOS													
ATIVIDADES	JAN	FEB	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	RESPONSÁVEIS
Acompanhamento e análise da conjuntura econômica, cenários e perspectivas do mercado financeiro													Diretoria Financeira e Economista
Acompanhamento sistemático da situação patrimonial, fiscal, comercial e jurídica das instituições investidas													Comitê de Investimentos
Manutenção dos arquivos físico e digital de investimentos													Divisão de Contabilidade e Tesouraria/ Economista
Monitoramento dos riscos dos investimentos													Economista
Atualização sobre novas legislações que dispõem sobre aplicação de recursos dos RPPS													Todos
Monitoramento da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos													Economista
Captação de extratos e relatórios detalhados das instituições financeiras													Divisão de Contabilidade e Tesouraria
Comunicação com gestores, administradores, distribuidores e outros													Comitê de Investimentos
Análise de dados atualizados dos fluxos de caixa e dos investimentos, com visão de curto e longo prazo													Chefia da Divisão de Contabilidade e Tesouraria, Diretoria Financeira e
Análise da evolução da execução do orçamento do RPPS													Chefia de Contabilidade e Diretoria Financeira
Elaboração do relatório gerencial de Investimentos													Economista
Elaboração de informe diário de investimentos e disseminação entre os													Economista
Inserção dos resultados dos investimentos no Relatório de Aportes													Diretoria Financeira e Economista
Acompanhamento atuarial dos investimentos													Todos
Publicação no site: Rentabilidade e Meta													Economista
Edição e publicação no site: Distribuição dos Investimentos por Ativo/													Economista
Distribuição dos Investimentos por Instituição													Economista
Plotagem do relatório gerencial													Economista
AGCs/AECs/Consultivas													Diretoria Financeira, Chefia da Divisão de
Avaliação de conveniência e adequação das propostas de investimentos e respectivas análises técnicas													Comitê de Investimentos
Reunião ordinária do Comitê de Investimentos													Comitê de Investimentos e Setor de Investimentos
Publicação e arquivamento das atas das reuniões do Comitê de Investimentos													Chefia da Divisão de Contabilidade e Tesouraria
Elaboração e publicação das APRs e liquidação das operações													Chefia da Divisão de Contabilidade e Tesouraria
Elaboração de relatório mensal de Investimentos													Economista
Parecer do Comitê de Investimentos quanto ao relatório mensal de													Comitê de Investimentos
Aprovação do relatório mensal de investimentos pelo Conselho Fiscal													Conselho Fiscal
Publicação do relatório mensal aprovado													Economista
Elaboração de relatório mensal de diligências de verificação dos lastros relativos aos títulos ou a papéis incluídos em operações estruturadas adquiridas por meio de veículos de investimento													Economista
Elaboração da Política de Investimentos													Diretoria Financeira
Aprovação da Política de Investimentos pelo Conselho Administrativo													Conselho Administrativo
Envio mensal do DAIR à Secretaria da Previdência													Assistente de Gestão
Envio de demonstrativo da Política de Investimentos à Secretaria da Previdência: DPIN													Diretoria Financeira
Alteração da Política de Investimentos, aprovação pelo Conselho													Diretoria Financeira e Economista
Reenvio do DPIN, publicação													Diretoria Financeira e Economista
Credenciamento: envio de ofício às instituições financeiras													Diretoria Financeira
Credenciamento: recebimento de documentos das instituições													Economista
Análise dos documentos para credenciamento: preenchimento dos Termos de Análise e Atestados de Credenciamento, do Ministério da Previdência/													Economista e Diretora Financeira
Produção de pareceres													
Apreciação dos Termos e pareceres pelo Comitê													Comitê de Investimentos
Publicação de relação de entidades credenciadas													Comitê de Investimentos
Congressos e seminários: IPSM, ABIPEM, APEPREM, outros													Atividades de Capacitação