Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU
Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba
Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000
Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - MAIO/2020

Banco do Brasil

	Saldo Anterior	Aplicação	Resgate	Juros	Rendimento	Saldo Final	Enquadramento	Volatilidade	VaR	Rentabilidade					% Instituição	% Carteira
										Mês	Ano	12m	24m	36m		
BB Previdenciario RF Alocação Ativa	60.836.662,23	0,00	0,00	0,00	652.256,66	61.488.918,89	Art. 7º , I, B	3,66%	0,43%	1,07%	0,79%	7,59%	22,37%	33,47%	73,51%	15,44%
BB Previdenciário RF TP XI 2020	6.429.204,65	0,00	0,00	0,00	134.415,09	6.563.619,74	Art. 7º , I, B	2,24%	0,34%	2,09%	2,16%	9,62%	26,68%	39,12%	7,85%	1,65%
BB Previdenciário RF IMA-B 5+	15.441.493,74	0,00	0,00	0,00	154.044,95	15.595.538,69	Art. 7º , I, B	12,18%	1,31%	1,00%	-7,95%	4,09%	37,43%	46,99%	18,64%	3,92%
	82.707.360,62				940.716,70	83.648.077,32										

Banco Bradesco

	Saldo Anterior	Aplicação	Resgate	Juros	Rendimento	Saldo Final	Enquadramento	Volatilidade	VaR	Rentabilidade					% Instituição	% Carteira
										Mês	Ano	12m	24m	36m		
Bradesco FIC FI Alocação Dinâmica	16.617.910,83	0,00	-3.531,39	0,00	186.600,73	16.800.980,17	Art. 7º , IV	3,92%	0,46%	1,12%	0,82%	7,44%	21,37%		100,00%	4,22%
	16.617.910,83				186.600,73	16.800.980,17										

Banco itaú Unibanco

	Saldo Anterior	Aplicação	Resgate	Juros	Rendimento	Saldo Final	Enquadramento	Volatilidade	VaR	Rentabilidade					% Instituição	% Carteira
										Mês	Ano	12m	24m	36m		
Itaú Renda Fixa Alocação	63.318.239,52	0,00	0,00	0,00	342.217,15	63.660.456,67	Art. 7º , IV	1,47%	0,18%	0,54%	1,82%	7,84%	19,42%	32,39%	100,00%	15,99%
	63.318.239,52				342.217,15	63.660.456,67										

Caixa Econômica Federal

	Saldo Anterior	Aplicação	Resgate	Juros	Rendimento	Saldo Final	Enquadramento	Volatilidade	VaR	Rentabilidade					% Instituição	% Carteira
										Mês	Ano	12m	24m	36m		
Caixa FI Brasil IMA-B TP RF	56.882.416,28	0,00	0,00	0,00	853.591,19	57.736.007,47	Art. 7º , I, B	7,69%	0,87%	1,50%	-3,82%	6,23%	31,21%	42,33%	40,25%	14,50%
Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica	68.535.576,30	0,00	0,00	0,00	944.917,63	69.480.496,93	Art. 7º , I, B	3,61%	0,44%	1,38%	3,85%	11,99%	27,82%	38,17%	48,44%	17,45%
Caixa FI Brasil IMA-B 5+	11.972.371,63	0,00	0,00	0,00	119.731,60	12.092.103,23	Art. 7º , I, B	12,21%	1,31%	1,00%	-8,04%	3,72%	36,70%	46,24%	8,43%	3,04%
Caixa FIC Brasil RF Ativa	0,00	2.020.000,00	0,00	0,00	23.760,90	2.043.760,90	Art. 7º , IV	4,02%	0,49%	1,44%	1,35%				1,42%	0,51%
Caixa Small Caps Ativo	936.824,60	85.000,00	0,00	0,00	55.096,96	1.076.921,56	Art. 8º, II, A	38,32%	4,20%	4,76%	-30,42%	-2,38%	20,38%	42,95%	0,75%	0,27%
Caixa Infraestrutura	531.575,93	85.000,00	0,00	0,00	105.007,61	1.021.683,54	Art. 8º, II, A	4097,00%	4,77%	11,03%	-21,99%	2,40%	42,57%	56,89%	0,71%	0,26%
	138.858.764,74				2.102.105,89	143.450.973,63										

Santander

	Saldo Anterior	Aplicação	Resgate	Juros	Rendimento	Saldo Final	Enquadramento	Volatilidade	VaR	Rentabilidade					% Instituição	% Carteira
										Mês	Ano	12m	24m	36m		
Santander Ativo RF (350)	1.760.870,17	0,00	0,00	0,00	8.509,71	1.769.379,88	Art. 7º , I, B	0,96%	0,12%	0,48%	1,64%	8,93%	19,77%	26,00%	6,41%	15,44%
Santander Ativo RF (150)	28.439.689,85	69.000,00	-2.800.000,00	0,00	136.453,16	25.845.143,01	Art. 7º , I, B	0,96%	0,12%	0,48%	1,64%	8,93%	19,77%	26,00%	93,59%	1,65%
	30.200.560,02				144.962,87	27.614.522,89										

Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU
Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba
Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000
Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

Títulos Públicos	Saldo Anterior	Aplicação	Resgate	Juros	Rendimento	Saldo Final	Enquadramento	Volatilidade	VaR	Rentabilidade					% Instituição	% Carteira
										Mês	Ano	12m	24m	36m		
4.400 NTNC 01.04.2021 (IGPM)	19.425.930,23	0,00	0,00	0,00	295.789,90	19.721.720,13	Art. 7º , I, A	1,12%	0,19%	1,52%	3,09%	11,04%	26,65%	44,38%	31,31%	14,50%
11.150 NTNB 15.08.2024 (IPCA)	41.933.812,23	0,00	0,00	0,00	1.332.404,93	43.266.217,16	Art. 7º , I, A	5,39%	0,71%	3,18%	2,69%	12,45%	32,73%	45,07%	68,69%	17,45%
	61.359.742,46				1.628.194,83	62.987.937,29										

Saldo Anterior	393.062.578,19
Saldo Atual	398.162.947,97
Rentabilidade mês	5.344.798,17

Meta Atuarial x Patrimônio	Mês	3M	6M	12M	24M	36M
Meta Atuarial (INPC + 5,86%)	0,20%	1,11%	4,15%	8,09%	20,03%	29,38%
Carteira de Investimentos	1,35%	**-1,09%**	1,06%	8,01%	24,36%	35,18%
P.P. Indexador	1,15%	-2,20%	-3,09%	-0,08%	4,33%	5,80%
Volatilidade Anual		13,99%	10,08%	7,37%	5,73%	4,85%

Value-at-Risk (VaR)	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio
Renda Fixa	0,23%	0,33%	2,03%	1,26%	0,52%
Renda Variável	0,00%	0,00%	11,89%	5,75%	4,48%
Renda Fixa	927.334,38	1.335.519,41	7.927.122,96	4.956.369,78	2.059.534,58
Renda Variável	0,00	0,00	102.839,70	101.688,78	94.017,51