



Previdência do Servidor, Construindo Um Novo Tempo.

Relatório de acompanhamento mensal da execução da Política de Investimentos

Maio – 2024

ÍNDICE

1. Relatório mensal de Investimentos

- a. Planilha analítica mensal
- b. Resumo geral das alocações em R\$
- c. Resumo geral das alocações em %
- d. Alocação dos recursos por Gestor/Custodiante
- e. Extrato mensal do desempenho
- f. Rentabilidade Geral – ano

1.a - Relatório mensal de Investimentos

Planilha analítica mensal:

Inicialmente apresentamos a planilha analítica com a rentabilidade mensal de todos os investimentos do IGEPREV, constando: saldo dos investimentos e saldo total, incluindo valores em conta-corrente; a rentabilidade da carteira no mês corrente, no ano e nos últimos 12 meses (quando existe histórico); número de cotistas de cada fundo investido, bem como o PL de cada FI, seus *benchmark*; aderência da Política de Investimentos à atual Resolução com enquadramento, limites e distribuição de alocações; comparação de desempenho da carteira e de cada fundo ao DI e meta atuarial.

Resolução 4.963/2021		PAI	Mai.2024	R\$	mês	ano	12 m	CDI	M.A.
				240.546.869,38	0,71%	2,69%	9,86%	0,83%	0,86%
								4,40%	4,31%
RENDA FIXA		100,00%	84,42%	202.948.404,07					
<i>art. 7º, I, b (FI 100% TTN)</i>		100%	100%	35,70%					
1	BB Previdenciário FI RF TP IPCA I (15.08.22)		1,40%	3.377.047,51	0,82%	4,32%	11,79%	-	-
2	BB Previdenciário FI RF TP IPCA III (15.08.24)		0,12%	294.790,15	0,88%	4,50%	11,06%	-	-
3	BNB Soberano FI RF		0,25%	602.653,79	0,82%	4,37%	11,90%	-	-
4	BNB IMA-B FI RF		0,93%	2.247.633,99	1,29%	-0,13%	6,68%	-	-
5	Caixa Brasil IMAB 5 TP RF FI LP		1,81%	4.356.340,79	1,03%	2,83%	8,70%	-	-
6	Caixa Brasil IMA-B TP RF FI LP		1,87%	4.496.158,92	1,30%	-0,23%	6,35%	-	-
7	Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica RF		29,31%	70.451.893,38	0,70%	2,19%	9,47%	-	-
<i>art. 7º, III, a (FI (geral) (ATIVO))</i>		60%	60%	47,86%					
8	BB Previdenciário RF Perfil FIC		11,25%	27.034.497,62	0,83%	4,42%	12,04%	-	-
9	BB Alocação Ativa Retorno Total FIC RF Previdenciário		1,04%	2.500.801,03	0,72%	3,44%	11,34%	-	-
10	Caixa Brasil Disponibilidades RF FI		1,45%	3.484.266,60	0,75%	3,96%	10,90%	-	-
11	Caixa Brasil Ref. DI FI LP		19,13%	45.993.610,76	0,84%	4,51%	12,52%	-	-
12	Caixa Brasil Renda Fixa Ativa FIC		7,32%	17.603.632,53	0,66%	3,18%	9,82%	-	-
13	Caixa Brasil Título Público FI RF LP		7,67%	18.427.673,22	0,79%	4,19%	11,73%	-	-
<i>art. 7º, V, a (FIDC Fechado)</i>		5%	5,00%	0,86%					
14	BBIF Master FIDC LP		0,33%	790.244,85	-0,41%	-2,08%	-4,84%	-	-
15	LME IPCA FIDC Multissetorial Senior		0,54%	1.287.158,93	-0,40%	-2,31%	-4,96%	-	-
RV + ESTRUTURADOS + IMOBILIÁRIO		30,00%	12,68%	30.473.999,50					
<i>art. 8º, I (FIA)</i>		30%	30,00%	6,18%					
16	BNB Seleção FIA		1,04%	2.511.238,03	-1,39%	-8,86%	9,93%	-	-
17	Caixa Brasil IBX 50 FIA		0,82%	1.967.481,04	-3,52%	-8,82%	10,23%	-	-
18	Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS		0,49%	1.183.944,80	-1,49%	-5,08%	15,29%	-	-
19	Caixa FIC Ações Expert Vinci Valor RPPS (SMALL)		0,28%	666.422,66	-3,81%	-10,05%	9,47%	-	-
20	Caixa FIC FIA Brasil Ações Livre Quantico		1,84%	4.432.676,55	-2,32%	-6,76%	15,12%	-	-
21	Caixa FIC FIA Multigestor		1,70%	4.083.825,50	-2,74%	-10,28%	5,91%	-	-
<i>art. 11 (Imobiliário)</i>		5%	5,00%	0,95%					
28	HAZ FII (Atico Renda FII)		0,95%	2.283.744,89	0,05%	0,32%	3,04%	-	-
EXTERIOR		10,00%	2,90%	6.968.001,07					
<i>art. 9º, II</i>		10,00%	1,89%	4.532.352,94					
29	CEF FIC FIM Multigestor Global EQ IE	10%	0,15%	351.001,96	2,93%	13,06%	20,87%	-	-
30	BB Global Select Equity Invest. Ext. FIM (J.P.Morgan)		0,88%	2.126.961,11	4,31%	18,91%	30,43%	-	-
31	BB Nordea Invest. Ext. FIM		0,85%	2.054.389,87	1,36%	7,83%	11,37%	-	-
<i>art. 9º, III</i>		10,00%	1,01%	2.435.648,13					
32	BB Ações Bolsas Europeias ETF FIC Ações BDR Nivel I	10%	0,27%	637.042,55	6,24%	9,22%	21,07%	-	-
33	BB Ações Bolsas Globais Ativo ETF FIC Ações BDR Nivel I		0,28%	662.503,29	4,48%	9,02%	21,18%	-	-
34	Caixa FIA Institucional BDR Nivel I		0,47%	1.136.102,29	6,78%	23,76%	35,92%	-	-
Total da carteira		100,00%		240.390.404,64					
Saldo em c/c				156.464,74					
Total Geral da carteira		100,00%		240.546.869,38					
Renda Fixa		84,42%		202.948.404,07					
RV + Estruturados + Imobiliário		12,68%		30.473.999,50					
Exterior		2,90%		6.968.001,07					

1-b - Relatório mensal de Investimentos

Resumo geral das alocações em R\$:

O Quadro-resumo em reais detalha as alocações do IGEPREV por enquadramento à Resolução, por classe e categoria de ativos, percentual aprovado na Política de Investimentos e permitido pela legislação, e valores identificados por Instituição Financeira no formato integral, por renda fixa, renda variável + estruturados + fundos imobiliários e investimentos no exterior.

Quadro-resumo de alocações, em R\$ por enquadramento e Instituição Financeira - 05/2024:

Enquadramento Resolução 4963/2021			4.963/21	PAI	Total	CEF	BB	BBIF	LME	BNB	Ático
RF	art. 7º, I, b	FI NTN-B 5			4.356.340,79	4.356.340,79					
		FI IMA-B			6.743.792,91	4.496.158,92				2.247.633,99	
		Gestão Ativa			70.451.893,38	70.451.893,38		-			
		FI - TPF			4.274.491,45		3.671.837,66			602.653,79	
		100%	100%	85.826.518,53	79.304.393,09	3.671.837,66	-	-	2.850.287,78	-	
	art. 7º, III, a	Gestão Ativa			20.104.433,56	17.603.632,53	2.500.801,03				
		FI DI			94.940.048,20	67.905.550,58	27.034.497,62				
			60%	60%	115.044.481,76	85.509.183,11	29.535.298,65	-	-	-	
	art. 7º, V, a	FIDC (cota senior)	5%	5%	2.077.403,78			790.244,85	1.287.158,93		
TOTAL RF			100%	100%	202.948.404,07	164.813.576,20	33.207.136,31	790.244,85	1.287.158,93	2.850.287,78	-
RV	art. 8º, I	FIA	30%	30%	14.845.588,58	12.334.350,55				2.511.238,03	
	art. 10, I	Multimercado	10%	10%	11.483.545,59	11.483.545,59					
	art. 10, II	FIP	5%	5%	1.861.120,44						1.861.120,44
	art. 11	FII	5%	5%	2.283.744,89						2.283.744,89
TOTAL RV+Estr.+FII			30%	30%	30.473.999,50	23.817.896,14				2.511.238,03	4.144.865,33
IE	art. 9º, II	"Invest. no Exterior"			4.532.352,94	351.001,96	4.181.350,98				
	art. 9º, III	Ações BDR Nivel I	10%	10%	2.435.648,13	1.136.102,29	1.299.545,84				
TOTAL IE			10%	10%	6.968.001,07	1.487.104,25	5.480.896,82				
TOTAL GERAL			100%	100%	240.390.404,64	190.118.576,59	38.688.033,13	790.244,85	1.287.158,93	5.361.525,81	4.144.865,33

1.c - Relatório mensal de Investimentos

Resumo geral das alocações em %:

O Quadro-resumo em percentual detalha as alocações do IGEPREV por enquadramento à Resolução, por classe e categoria de ativos, percentual aprovado na Política de Investimentos e permitido pela legislação, e valores identificados por Instituição Financeira no formato integral, por renda fixa e por renda variável. Esta segregação é muito importante para observar o balanceamento da carteira do RPPS, identificando no caso do IGEPREV, uma elevada concentração em ativos vinculados ao CDI e TPF.

Quadro-resumo de alocações, em percentual por enquadramento e Instituição Financeira - 05/2024:

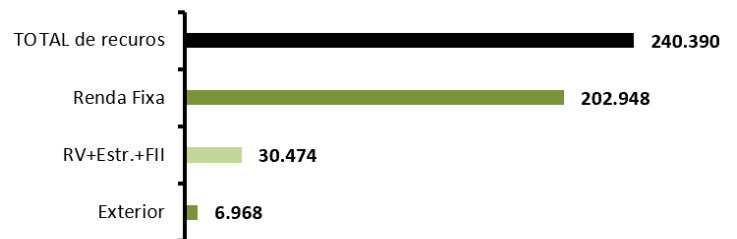
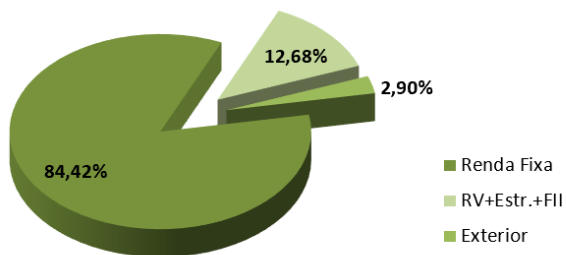
Enquadramento Resolução 4963/2021			4.963/21	PAI	Total	CEF	BB	BBIF	LME	BNB	Ático
RF	art. 7º, I, b	FI NTN-B 5			1,81%	1,81%					
		FI IMA-B			2,81%	1,87%				0,93%	
		Gestão Ativa			29,31%	29,31%					
		FI - TPF			1,78%		1,53%			0,25%	
			100%	100%	35,70%	32,99%	1,53%			1,19%	
	art. 7º, III, a	Gestão Ativa			8,36%	7,32%	1,04%				
		FI DI			39,49%	28,25%	11,25%				
	art. 7º, V, a	FIDC (cota senior)	60%	60%	47,86%	35,57%	12,29%				
TOTAL RF			100%	100%	84,42%	68,56%	13,81%	0,33%	0,54%	1,19%	
RV	art. 8º, I	FIA	30%	30%	6,18%	5,13%				1,04%	
	art. 10, I	Multimercado	10%	10%	4,78%	4,78%					
	art. 10, II	FIP	5%	5%	0,77%						0,77%
	art. 11	FII	5%	5%	0,95%						0,95%
TOTAL RV+Estr.+FII			30%	30%	12,68%	9,91%				1,04%	1,72%
IE	art. 9º, II	"Invest. no Exterior"			1,89%	0,15%	1,74%				
	art. 9º, III	Ações BDR Nivel I	10%	10%	1,01%	0,47%	0,54%				
TOTAL IE			10%	10%	2,90%	0,62%	2,28%				
TOTAL GERAL			100%	100%	100,00%	79,09%	16,09%	0,33%	0,54%	2,23%	1,72%

1-d - Relatório mensal de Investimentos

Alocação dos recursos por Gestor/Custodiante:

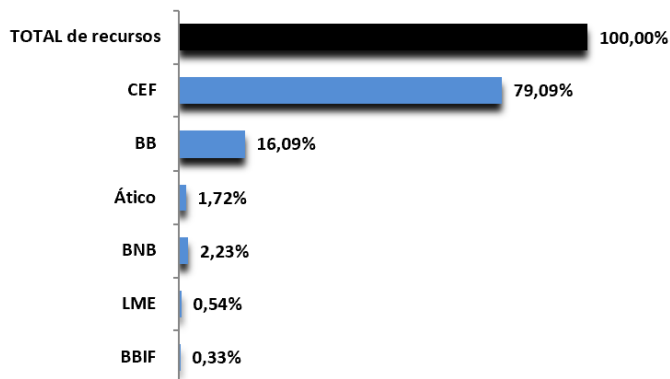
De forma simples e objetiva os gráficos abaixo permitem perceber com rapidez em quais Instituições Financeiras os recursos do IGEPREV estão alocados.

**Investimentos por categoria
alocação efetiva - 05/2024**

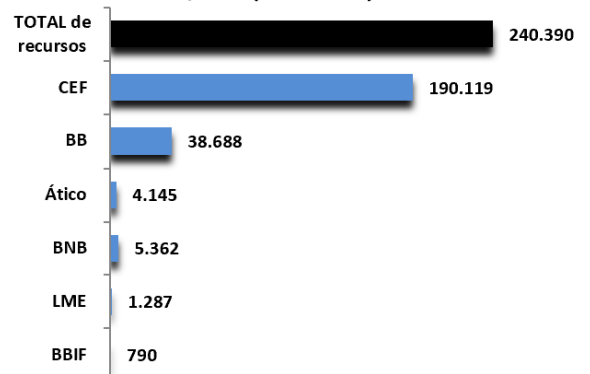


**Investimentos por categoria
R\$ (milhões)
05/2024**

**Alocação de recursos
por Gestor
05/2024 (%)**



**Alocação de recursos
por Gestor
05/2024 (R\$ milhões)**

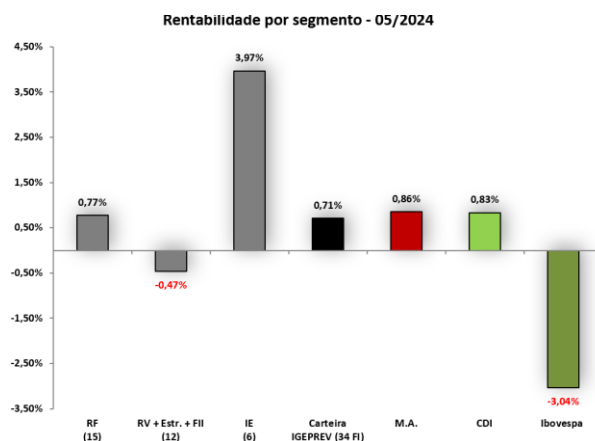
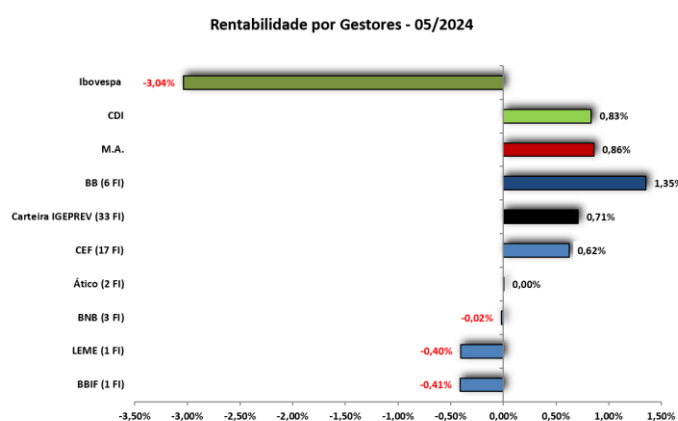


1.e - Relatório mensal de Investimentos

Extrato mensal do desempenho:

Os gráficos abaixo identificam o desempenho do IGEPREV por classe de ativos e por Instituição Financeira no mês em análise, em comparação com a meta atuarial e ao CDI.

Está identificado também a quantidade de fundos de investimentos em cada observação.



1.f - Relatório mensal de Investimentos

Rentabilidade Geral – ano

O gráfico nº 01 indica de forma integral e por Instituição Financeira no exercício, a rentabilidade da carteira do IGEPREV e os desempenhos da meta atuarial e do CDI.

Gráfico nº 01

