



Previdência do Servidor, Construindo Um Novo Tempo.

Relatório de acompanhamento mensal da execução da Política de Investimentos

Junho – 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	Jun.2024	R\$	mês	ano	12 m	CDI	M.A.
						237.179.787,87	0,75%	3,46%	8,02%	0,79%	0,61%
										5,22%	4,94%
RENTA FIXA				100,00%	83,92%	199.020.193,64					
art. 7º, I, b (FI 100% TTN)				100%	100%	33,29%	78.943.220,49				
1	BB Previdenciário FI RF TP IPCA I	(15.08.22)			1,43%	3.403.074,95	0,77%	5,12%	11,47%	-	-
2	BB Previdenciário FI RF TP IPCA III	(15.08.24)			0,13%	298.197,64	1,16%	5,70%	11,31%	-	-
3	BNB Soberano FI RF				0,26%	607.426,56	0,79%	5,19%	11,58%	-	-
4	BNB IMA-B FI RF				0,94%	2.228.347,62	-0,86%	-0,98%	3,37%	-	-
5	Caixa Brasil IMAB 5 TP RF FI LP				0,16%	370.000,06	0,37%	3,21%	8,00%	-	-
6	Caixa Brasil IMA-B TP RF FI LP				0,62%	1.464.192,71	-1,00%	-1,22%	2,87%	-	-
7	Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica RF				29,76%	70.571.980,95	0,17%	2,36%	7,40%	-	-
art. 7º, III, a (FI (geral) (ATIVO))				60%	60%	49,76%	118.011.571,02				
8	BB Previdenciário RF Perfil FIC				13,62%	32.313.546,15	0,79%	5,24%	11,71%	-	-
9	BB Alocação Ativa Retorno Total FIC RF Previdenciário				1,06%	2.510.377,64	0,38%	3,84%	9,78%	-	-
10	Caixa Brasil Disponibilidades RF FI				0,84%	2.003.216,96	0,71%	4,70%	10,59%	-	-
11	Caixa Brasil Ref. DI FI LP				19,55%	46.370.106,46	0,82%	5,36%	12,19%	-	-
12	Caixa Brasil Renda Fixa Ativa FIC				7,47%	17.709.062,58	0,60%	3,80%	8,65%	-	-
13	Caixa Brasil Título Público FI RF LP				7,21%	17.105.261,23	0,78%	5,00%	11,34%	-	-
art. 7º, V, a (FIDC Fechado)				5%	5,00%	0,87%	2.065.402,13				
14	BBIF Master FIDC LP				0,33%	784.245,70	-0,76%	-2,82%	-5,27%	-	-
15	LME IPCA FIDC Multissetorial Senior				0,54%	1.281.156,43	-0,47%	-2,76%	-5,06%	-	-
RV + ESTRUTURADOS + IMOBILIÁRIO				30,00%	12,93%	30.656.802,41					
art. 8º, I (FIA)				30%	30,00%	6,32%	14.986.602,01				
16	BNB Seleção FIA				1,08%	2.555.141,16	1,75%	-7,26%	4,52%	-	-
17	Caixa Brasil IBX 50 FIA				0,84%	1.998.472,33	1,58%	-7,39%	3,54%	-	-
18	Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS				0,51%	1.204.976,57	1,78%	-3,39%	8,58%	-	-
19	Caixa FIC Ações Expert Vinci Valor RPPS (SMALL)				0,28%	675.577,82	1,37%	-8,82%	2,40%	-	-
20	Caixa FIC FIA Brasil Ações Livre Quantico				1,87%	4.427.816,71	-0,11%	-6,86%	4,76%	-	-
21	Caixa FIC FIA Multigestor				1,74%	4.124.617,42	1,00%	-9,38%	-1,76%	-	-
art. 10, I (Multimercado)				5,68%	10,00%	4,90%	11.620.354,65				
22	Caixa Alocação Macro FIC Multimercado LP				2,04%	4.827.543,30	0,00%	1,90%	8,57%	-	-
23	Caixa Brasil Estratégia Livre FIC Multimercado LP				0,76%	1.808.204,51	-0,74%	-0,89%	6,09%	-	-
24	Caixa Bolsa Americana FI Multimercado LP				1,66%	3.932.454,83	3,90%	16,70%	29,37%	-	-
25	Caixa FIM RV 30 LP				0,29%	694.103,12	-0,27%	-1,91%	5,94%	-	-
26	FIC FI Capital Protegido Bolsa de Valores V Multimercado				0,15%	358.048,89	1,24%	-5,37%	6,95%	-	-
art. 10, II (FIP)				5,00%	0,78%	1.860.297,85					
27	Ático Florestal FIC FIP				0,78%	1.860.297,85	-0,04%	-0,28%	-0,55%	-	-
art. 11 (Imobiliário)				5%	5,00%	0,92%	2.189.547,90				
28	HAZ FII (Ático Renda FII)				0,92%	2.189.547,90	-4,12%	-3,54%	-1,10%	-	-
EXTERIOR				10,00%	3,16%	7.487.169,75					
art. 9º, II				10,00%	2,07%	4.914.085,54					
29	CEF FIC FIM Multigestor Global EQ IE				0,16%	380.973,97	8,54%	22,71%	32,18%	-	-
30	BB Global Select Equity Invest. Ext. FIM (J.P.Morgan)				0,99%	2.351.699,39	10,57%	31,47%	46,24%	-	-
31	BB Nordea Invest. Ext. FIM				0,92%	2.181.412,18	6,18%	14,49%	20,68%	-	-
art. 9º, III				10%	1,08%	2.573.084,21					
32	BB Ações Bolsas Europeias ETF FIC Ações BDR Nivel I				0,26%	615.347,77	-3,41%	5,50%	13,05%	-	-
33	BB Ações Bolsas Globais Ativo ETF FIC Ações BDR Nivel I				0,29%	676.980,54	2,19%	11,40%	18,06%	-	-
34	Caixa FIA Institucional BDR Nivel I				0,54%	1.280.755,90	12,73%	39,52%	52,18%	-	-
Total da carteira				100,00%		237.164.165,80					
Saldo em c/c						15.622,07					
Total Geral da carteira				100,00%		237.179.787,87					
Renda Fixa				83,92%		199.020.193,64					
RV + Estruturados + Imobiliário				12,93%		30.656.802,41					
Exterior				3,16%		7.487.169,75					

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 - 06/2024:

Enquadramento Resolução 4963/2021			4.963/21	PAI	Total	CEF	BB	BBIF	LME	BNB	Ático
RF	art. 7º, I, b	FI NTN-B 5			370.000,06	370.000,06					
		FI IMA-B			3.692.540,33	1.464.192,71				2.228.347,62	
		Gestão Ativa			70.571.980,95	70.571.980,95	-				
		FI - TPF			4.308.699,15		3.701.272,59			607.426,56	
		100%	100%	78.943.220,49	72.406.173,72	3.701.272,59	-	-	2.835.774,18	-	
	art. 7º, III, a	Gestão Ativa			20.219.440,22	17.709.062,58	2.510.377,64				
FI DI				97.792.130,80	65.478.584,65	32.313.546,15					
		60%	60%	118.011.571,02	83.187.647,23	34.823.923,79	-	-	-		
art. 7º, V, a	FIDC (cota senior)	5%	5%	2.065.402,13			784.245,70	1.281.156,43			
TOTAL RF			100%	100%	199.020.193,64	155.593.820,95	38.525.196,38	784.245,70	1.281.156,43	2.835.774,18	-
RV	art. 8º, I	FIA	30%	30%	14.986.602,01	12.431.460,85				2.555.141,16	
	art. 10, I	Multimercado	10%	10%	11.620.354,65	11.620.354,65					
	art. 10, II	FIP	5%	5%	1.860.297,85						1.860.297,85
	art. 11	FII	5%	5%	2.189.547,90						2.189.547,90
TOTAL RV+Estr.+FII			30%	30%	30.656.802,41	24.051.815,50				2.555.141,16	4.049.845,75
IE	art. 9º, II	"Invest. no Exterior"			4.914.085,54	380.973,97	4.533.111,57				
	art. 9º, III	Ações BDR Nivel I	10%	10%	2.573.084,21	1.280.755,90	1.292.328,31				
TOTAL IE			10%	10%	7.487.169,75	1.661.729,87	5.825.439,88				
TOTAL GERAL			100%	100%	237.164.165,80	181.307.366,32	44.350.636,26	784.245,70	1.281.156,43	5.390.915,34	4.049.845,75

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 - 06/2024:

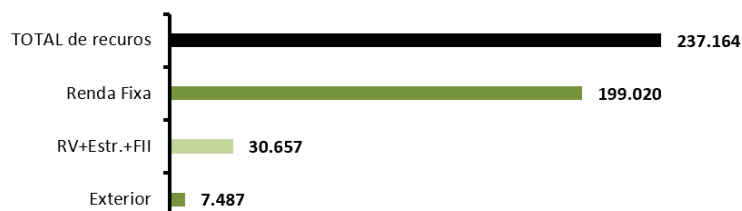
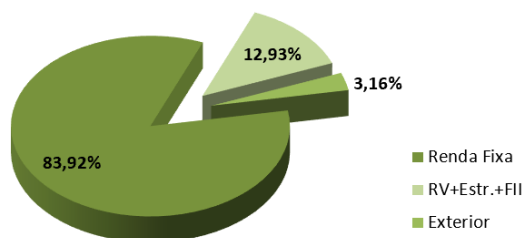
Enquadramento Resolução 4963/2021			4.963/21	PAI	Total	CEF	BB	BBIF	LME	BNB	Ático
RF	art. 7º, I, b	FI NTN-B 5			0,16%	0,16%					
		FI IMA-B			1,56%	0,62%				0,94%	
		Gestão Ativa			29,76%	29,76%					
		FI - TPF			1,82%		1,56%			0,26%	
		100%	100%	33,29%	30,53%	1,56%			1,20%		
	art. 7º, III, a	Gestão Ativa			8,53%	7,47%	1,06%				
FI DI				41,23%	27,61%	13,62%					
	art. 7º, V, a		60%	60%	49,76%	35,08%	14,68%				
		FIDC (cota senior)	5%	5%	0,87%			0,33%	0,54%		
TOTAL RF			100%	100%	83,92%	65,61%	16,24%	0,33%	0,54%	1,20%	
RV	art. 8º, I	FIA	30%	30%	6,32%	5,24%				1,08%	
	art. 10, I	Multimercado	10%	10%	4,90%	4,90%					
	art. 10, II	FIP	5%	5%	0,78%						0,78%
	art. 11	FII	5%	5%	0,92%						0,92%
TOTAL RV+Estr.+FII			30%	30%	12,93%	10,14%				1,08%	1,71%
IE	art. 9º, II	"Invest. no Exterior"			2,07%	0,16%	1,91%				
	art. 9º, III	Ações BDR Nivel I	10%	10%	1,08%	0,54%	0,54%				
TOTAL IE			10%	10%	3,16%	0,70%	2,46%				
TOTAL GERAL			100%	100%	100,00%	76,45%	18,70%	0,33%	0,54%	2,27%	1,71%

1-d - Relatório mensal de Investimentos

Alocação dos recursos por Gestor/Custodiante:

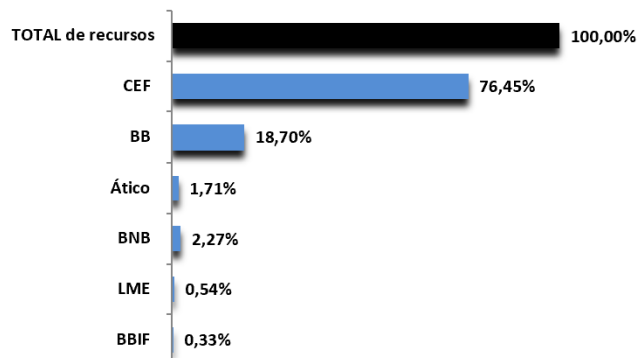
De forma simples e objetiva os gráficos abaixo permitem perceber com rapidez em quais Instituições Financeiras os recursos do IGEPREV estão alocados.

**Investimentos por categoria
alocação efetiva - 06/2024**

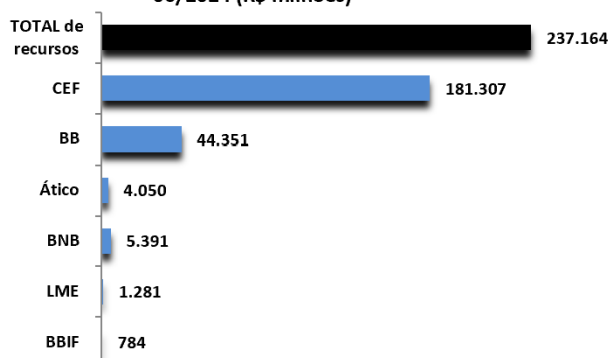


**Investimentos por categoria
R\$ (milhões)
06/2024**

**Alocação de recursos
por Gestor
06/2024 (%)**



**Alocação de recursos
por Gestor
06/2024 (R\$ milhões)**

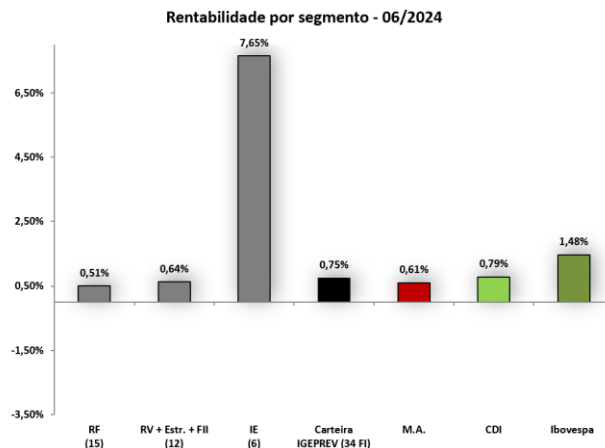
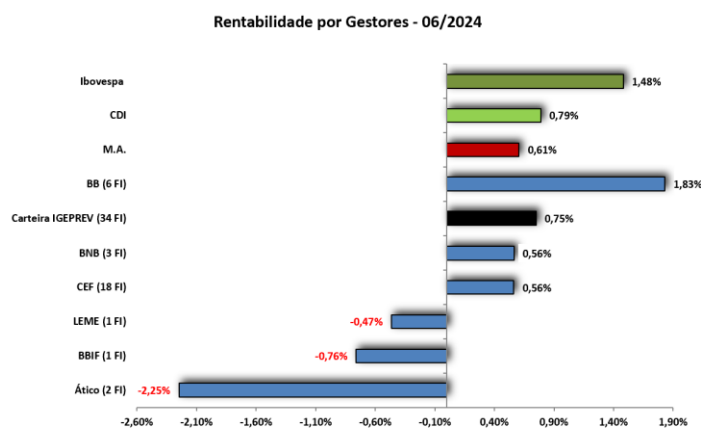


1.e - Relatório mensal de Investimentos

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

