



Previdência do Servidor, Construindo Um Novo Tempo.

Relatório de acompanhamento mensal da execução da Política de Investimentos

Julho – 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	Jul.2024	R\$	mês	ano	12 m	CDI	M.A.
						242.212.239,42	1,07%	4,57%	7,77%	0,91%	0,78%
										6,18%	5,75%
RENTA FIXA				100,00%	84,01%	203.459.290,25					
art. 7º, I, b (FI 100% TTN)				100%	100%	32,99%					
1	BB Previdenciário FI RF TP IPCA I	(15.08.22)			1,42%	3.433.215,62	0,89%	6,05%	11,28%	-	-
2	BB Previdenciário FI RF TP IPCA III	(15.08.24)			0,12%	301.060,19	0,96%	6,72%	11,20%	-	-
3	BNB Soberano FI RF				0,25%	612.931,84	0,91%	6,15%	11,42%	-	-
4	BNB IMA-B FI RF				0,94%	2.272.614,37	1,99%	0,98%	4,58%	-	-
6	Caixa Automático Polis FIC RF CP				0,07%	158.070,42	0,63%	4,26%	7,96%		
7	Caixa Brasil IMAB 5 TP RF FI LP				0,15%	373.303,55	0,89%	4,13%	7,93%	-	-
9	Caixa Brasil IMA-B TP RF FI LP				0,62%	1.494.541,66	2,07%	0,82%	4,17%	-	-
9	Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica RF				29,42%	71.252.344,20	0,96%	3,35%	7,47%	-	-
art. 7º, III, a (FI geral) (ATIVO))				60%	60%	50,17%					
10	BB Previdenciário RF Perfil FIC	</									

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 - 07/2024:

Enquadramento Resolução 4963/2021			4.963/21	PAI	Total	CEF	BB	BBIF	LME	BNB	Ático
RF	art. 7º, I, b	FI NTN-B 5			373.303,55	373.303,55					
		FI IMA-B			3.767.156,03	1.494.541,66				2.272.614,37	
		Gestão Ativa			71.252.344,20	71.252.344,20	-				
		FI - TPF			4.505.278,07	158.070,42	3.734.275,81			612.931,84	
	art. 7º, III, a		100%	100%	79.898.081,85	73.278.259,83	3.734.275,81	-	-	2.885.546,21	-
		Gestão Ativa			20.397.485,12	17.861.105,81	2.536.379,31				
		FI DI			101.106.344,79	65.992.092,12	35.114.252,67				
RV	art. 7º, V, a	FIDC (cota senior)	60%	60%	121.503.829,91	83.853.197,93	37.650.631,98	-	-	-	
			5%	5%	2.057.378,49			780.830,19	1.276.548,30		
	TOTAL RF		100%	100%	203.459.290,25	157.131.457,76	41.384.907,79	780.830,19	1.276.548,30	2.885.546,21	-
	art. 8º, I	FIA	30%	30%	15.267.707,90	12.712.566,74				2.555.141,16	
		Multimercado	10%	10%	11.780.945,84	11.780.945,84					
		FIP	5%	5%	1.859.335,22						1.859.335,22
		FII	5%	5%	2.183.406,41						2.183.406,41
IE	TOTAL RV+Estr.+FII		30%	30%	31.091.395,37	24.493.512,58				2.555.141,16	4.042.741,63
	art. 9º, II	"Invest. no Exterior"			5.033.723,43	389.316,07	4.644.407,36				
		Ações BDR Nivel I	10%	10%	2.601.069,52	1.287.262,06	1.313.807,46				
	TOTAL IE		10%	10%	7.634.792,95	1.676.578,13	5.958.214,82				
	TOTAL GERAL		100%	100%	242.185.478,57	183.301.548,47	47.343.122,61	780.830,19	1.276.548,30	5.440.687,37	4.042.741,63

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 - 07/2024:

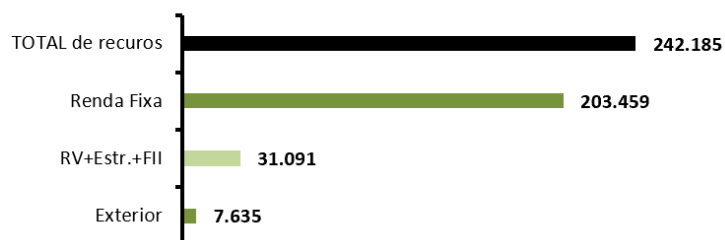
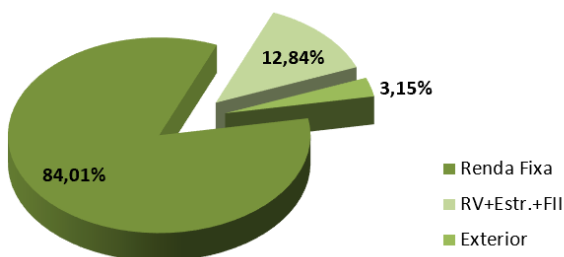
Enquadramento Resolução 4963/2021			4.963/21	PAI	Total	CEF	BB	BBIF	LME	BNB	Ático
RF	art. 7º, I, b	FI NTN-B 5			0,15%	0,15%					
		FI IMA-B			1,56%	0,62%				0,94%	
		Gestão Ativa			29,42%	29,42%					
		FI - TPF			1,86%	0,07%	1,54%			0,25%	
			100%	100%	32,99%	30,26%	1,54%			1,19%	
	art. 7º, III, a	Gestão Ativa			8,42%	7,37%	1,05%				
		FI DI			41,75%	27,25%	14,50%				
	art. 7º, V, a	FIDC (cota senior)	60%	60%	50,17%	34,62%	15,55%				
			5%	5%	0,85%			0,32%	0,53%		
TOTAL RF			100%	100%	84,01%	64,88%	17,09%	0,32%	0,53%	1,19%	
RV	art. 8º, I	FIA	30%	30%	6,30%	5,25%				1,06%	
	art. 10, I	Multimercado	10%	10%	4,86%	4,86%					
	art. 10, II	FIP	5%	5%	0,77%						0,77%
	art. 11	FII	5%	5%	0,90%						0,90%
TOTAL RV+Estr.+FII			30%	30%	12,84%	10,11%				1,06%	1,67%
IE	art. 9º, II	"Invest. no Exterior"	10%	10%	2,08%	0,16%	1,92%				
	art. 9º, III	Ações BDR Nivel I			1,07%	0,53%	0,54%				
TOTAL IE			10%	10%	3,15%	0,69%	2,46%				
TOTAL GERAL			100%	100%	100,00%	75,69%	19,55%	0,32%	0,53%	2,25%	1,67%

1-d - Relatório mensal de Investimentos

Alocação dos recursos por Gestor/Custodiante:

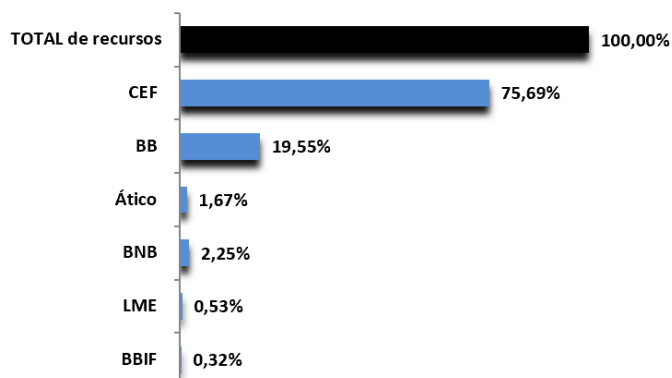
De forma simples e objetiva os gráficos abaixo permitem perceber com rapidez em quais Instituições Financeiras os recursos do IGEPREV estão alocados.

**Investimentos por categoria
alocação efetiva - 07/2024**

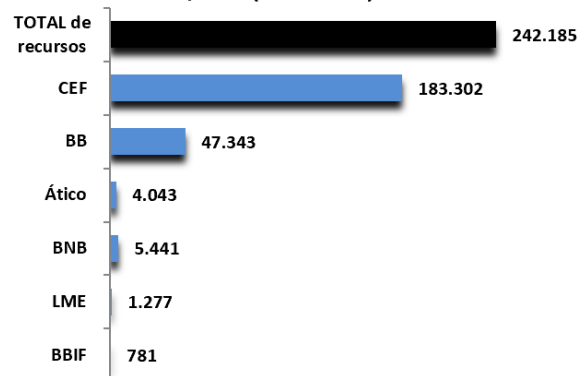


**Investimentos por categoria
R\$ (milhões)
07/2024**

**Alocação de recursos
por Gestor
07/2024 (%)**



**Alocação de recursos
por Gestor
07/2024 (R\$ milhões)**

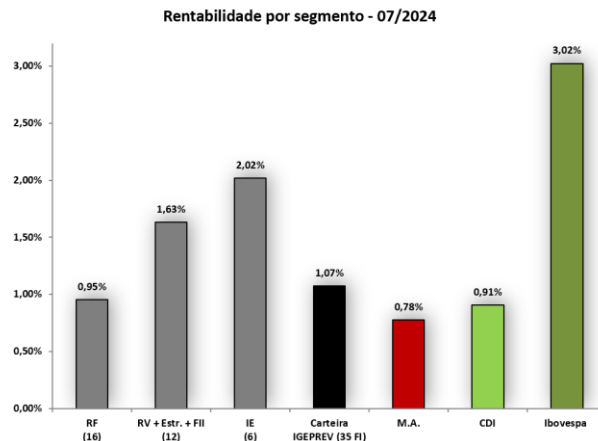
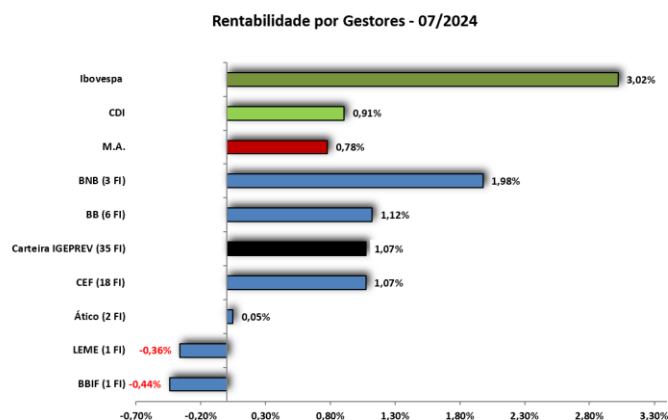


1.e - Relatório mensal de Investimentos

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

