

Relatório de acompanhamento mensal da execução da Política de Investimentos

Agosto – 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	Ago.2024	R\$	mês	ano	12 m	CDI	M.A.
				245.304.270,71	1,26%	5,89%	8,83%	0,87%	0,38%
								7,10%	6,15%
RENDA FIXA		100,00%	83,59%	205.018.879,12					
art. 7º, I, b (FI 100% TTN)		100%	100%	80.136.778,47					
1	BB Previdenciário FI RF TP IPCA I (15.08.22)		1,41%	3.462.326,65	0,85%	6,95%	11,04%	-	-
2	BNB Soberano FI RF		0,25%	618.336,16	0,88%	7,08%	11,13%	-	-
3	BNB IMA-B FI RF		0,93%	2.285.071,54	0,55%	1,54%	5,54%	-	-
4	Caixa Automático Poliss FIC RF CP		0,06%	159.023,30	0,60%	4,88%	7,73%	-	-
5	Caixa Brasil IMAB 5 TP RF FI LP		0,15%	375.471,06	0,58%	4,74%	7,91%	-	-
6	Caixa Brasil IMA-B TP RF FI LP		0,61%	1.502.006,60	0,50%	1,33%	5,08%	-	-
7	Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica RF		29,25%	71.734.543,16	0,68%	4,05%	7,52%	-	-
art. 7º, III, a (FI (geral) (ATIVO))		60%	60%	122.884.995,48					
8	BB Previdenciário RF Perfil FIC		14,57%	35.730.931,90	0,89%	7,21%	11,36%	-	-
9	BB Alocação Ativa Retorno Total FIC RF Previdenciário		1,04%	2.560.394,23	0,95%	5,91%	9,98%	-	-
10	Caixa Brasil Disponibilidades RF FI		2,25%	5.511.240,45	0,78%	6,68%	10,11%	-	-
11	Caixa Brasil Ref. DI FI LP		17,20%	42.179.795,49	0,88%	7,33%	11,61%	-	-
12	Caixa Brasil Renda Fixa Ativa FIC		7,34%	18.000.157,85	0,78%	5,50%	8,67%	-	-
13	Caixa Brasil Título Público FI RF LP		7,71%	18.902.475,56	0,86%	6,88%	10,90%	-	-
art. 7º, V, a (FIDC Fechado)		5%	5,00%	1.997.105,17					
14	BBIF Master FIDC LP		0,32%	777.394,54	-0,44%	-3,67%	-5,53%	-	-
15	LME IPCA FIDC Multissetorial Senior		0,50%	1.219.710,63	-4,45%	-7,23%	-8,99%	-	-
RV + ESTRUTURADOS + IMOBILIÁRIO		30,00%	13,21%	32.399.283,98					
art. 8º, I (FIA)		30%	30,00%	16.373.081,72					
16	BNB Seleção FIA		1,14%	2.807.554,35	7,49%	1,90%	16,66%	-	-
17	Caixa Brasil IBX 50 FIA		0,90%	2.196.580,33	5,90%	1,79%	16,83%	-	-
18	Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS		0,53%	1.311.769,28	5,73%	5,17%	19,13%	-	-
19	Caixa FIC Ações Expert Vinci Valor RPPS (SMALL)		0,30%	739.446,24	6,10%	-0,20%	14,19%	-	-
20	Caixa FIC FIA Brasil Ações Livre Quantico		1,99%	4.884.312,62	9,54%	2,74%	17,40%	-	-
21	Caixa FIC FIA Multigestor		1,81%	4.433.418,90	4,51%	-2,80%	7,56%	-	-
art. 10, I (Multimercado)		5,64%	10,00%	11.981.268,34					
22	Caixa Alocação Macro FIC Multimercado LP	15%	2,02%	4.957.190,93	1,33%	4,64%	10,29%	-	-
23	Caixa Brasil Estratégia Livre FIC Multimercado LP		0,76%	1.858.282,80	1,35%	1,86%	7,87%	-	-
24	Caixa Bolsa Americana FI Multimercado LP		1,67%	4.085.691,62	2,48%	24,25%	30,89%	-	-
25	Caixa FIM RV 30 LP		0,29%	722.389,20	2,42%	2,09%	9,14%	-	-
26	FIC FI Capital Protegido Bolsa de Valores V Multimercado		0,15%	357.713,79	-1,53%	-5,45%	4,73%	-	-
art. 10, II (FIP)		5,00%	0,76%	1.858.440,54					
27	Ático Florestal FIC FIP		0,76%	1.858.440,54	-0,05%	-0,37%	-0,58%	-	-
art. 11 (Imobiliário)		5%	5,00%	2.186.493,38					
28	HAZ FII (Ático Renda FII)		0,89%	2.186.493,38	0,14%	-3,30%	-5,95%	-	-
EXTERIOR		10,00%	3,20%	7.848.422,88					
art. 9º, II		10,00%	2,12%	5.203.001,29					
29	CEF FIC FIM Multigestor Global EQ IE	10%	0,16%	401.045,69	2,92%	29,07%	34,08%	-	-
30	BB Global Select Equity Invest. Ext. FIM (J.P.Morgan)		0,99%	2.421.389,31	2,98%	35,37%	46,13%	-	-
31	BB Nordea Invest. Ext. FIM		0,97%	2.380.566,29	3,62%	24,95%	28,47%	-	-
art. 9º, III		10,00%	1,08%	2.645.421,59					
32	BB Ações Bolsas Europeias ETF FIC Ações BDR Nível I		0,27%	651.269,87	3,41%	11,66%	18,71%	-	-
33	BB Ações Bolsas Globais Ativo ETF FIC Ações BDR Nível I		0,29%	699.610,54	2,28%	15,12%	19,75%	-	-
34	Caixa FIA Institucional BDR Nível I		0,53%	1.294.541,18	0,57%	41,02%	46,38%	-	-
Total da carteira		100,00%		245.266.585,98					
Saldo em c/c				37.684,73					
Total Geral da carteira		100,00%		245.304.270,71					
Renda Fixa		83,59%		205.018.879,12					
RV + Estruturados + Imobiliário		13,21%		32.399.283,98					
Exterior		3,20%		7.848.422,88					

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 - 08/2024:

Enquadramento Resolução 4963/2021			4.963/21	PAI	Total	CEF	BB	BBIF	LME	BNB	Ático
RF	art. 7º, I, b	FI NTN-B 5			375.471,06	375.471,06					
		FI IMA-B			3.787.078,14	1.502.006,60				2.285.071,54	
		Gestão Ativa			71.734.543,16	71.734.543,16	-				
		FI - TPF			4.239.686,11	159.023,30	3.462.326,65			618.336,16	
		100%	100%	80.136.778,47	73.771.044,12	3.462.326,65	-	-	2.903.407,70	-	
	art. 7º, III, a	Gestão Ativa			20.560.552,08	18.000.157,85	2.560.394,23				
FI DI				102.324.443,40	66.593.511,50	35.730.931,90					
	art. 7º, V, a		60%	60%	122.884.995,48	84.593.669,35	38.291.326,13	-	-	-	
FIDC (cota senior)		5%	5%	1.997.105,17			777.394,54	1.219.710,63			
TOTAL RF			100%	100%	205.018.879,12	158.364.713,47	41.753.652,78	777.394,54	1.219.710,63	2.903.407,70	-
RV	art. 8º, I	FIA	30%	30%	16.373.081,72	13.565.527,37				2.807.554,35	
	art. 10, I	Multimercado	10%	10%	11.981.268,34	11.981.268,34					
	art. 10, II	FIP	5%	5%	1.858.440,54						1.858.440,54
	art. 11	FII	5%	5%	2.186.493,38						2.186.493,38
TOTAL RV+Estr.+FII			30%	30%	32.399.283,98	25.546.795,71				2.807.554,35	4.044.933,92
IE	art. 9º, II	"Invest. no Exterior"			5.203.001,29	401.045,69	4.801.955,60				
	art. 9º, III	Ações BDR Nível I	10%	10%	2.645.421,59	1.294.541,18	1.350.880,41				
TOTAL IE			10%	10%	7.848.422,88	1.695.586,87	6.152.836,01				
TOTAL GERAL			100%	100%	245.266.585,98	185.607.096,05	47.906.488,79	777.394,54	1.219.710,63	5.710.962,05	4.044.933,92

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 - 08/2024:

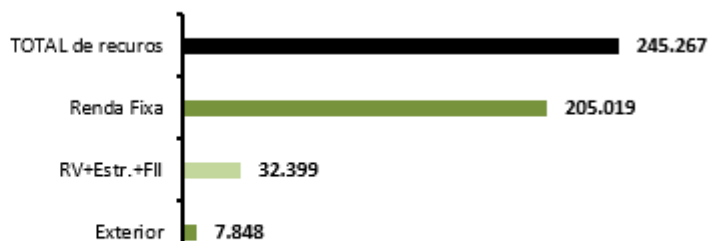
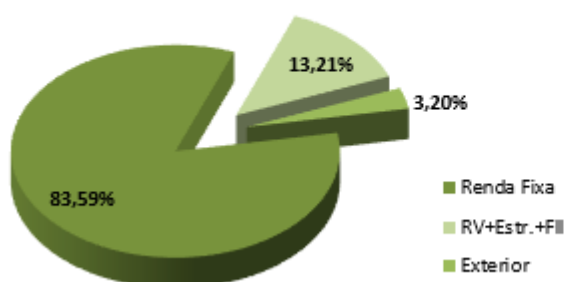
Enquadramento Resolução 4963/2021			4.963/21	PAI	Total	CEF	BB	BBIF	LME	BNB	Ático
RF	art. 7º, I, b	FI NTN-B 5			0,15%	0,15%					
		FI IMA-B			1,54%	0,61%				0,93%	
		Gestão Ativa			29,25%	29,25%					
		FI - TPF			1,73%	0,06%	1,41%			0,25%	
		100%	100%	32,67%	30,08%	1,41%			1,18%		
	art. 7º, III, a	Gestão Ativa			8,38%	7,34%	1,04%				
FI DI				41,72%	27,15%	14,57%					
	art. 7º, V, a		60%	60%	50,10%	34,49%	15,61%				
FIDC (cota senior)		5%	5%	0,81%			0,32%	0,50%			
TOTAL RF			100%	100%	83,59%	64,57%	17,02%	0,32%	0,50%	1,18%	
RV	art. 8º, I	FIA	30%	30%	6,68%	5,53%					1,14%
	art. 10, I	Multimercado	10%	10%	4,88%	4,88%					
	art. 10, II	FIP	5%	5%	0,76%						0,76%
	art. 11	FII	5%	5%	0,89%						0,89%
TOTAL RV+Estr.+FII			30%	30%	13,21%	10,42%				1,14%	1,65%
IE	art. 9º, II	"Invest. no Exterior"			2,12%	0,16%	1,96%				
	art. 9º, III	Ações BDR Nível I	10%	10%	1,08%	0,53%	0,55%				
TOTAL IE			10%	10%	3,20%	0,69%	2,51%				
TOTAL GERAL			100%	100%	100,00%	75,68%	19,53%	0,32%	0,50%	2,33%	1,65%

1-d - Relatório mensal de Investimentos

Alocação dos recursos por Gestor/Custodiante:

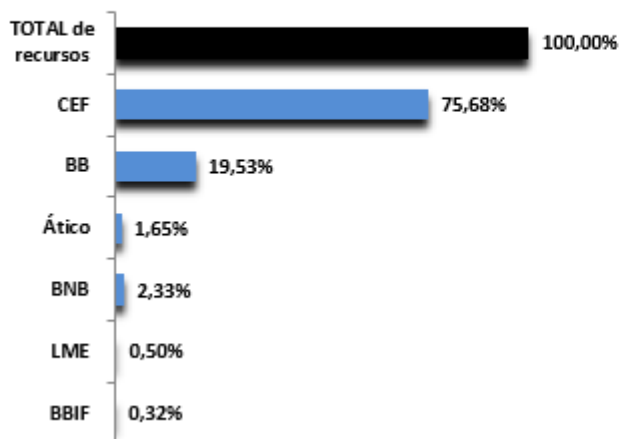
De forma simples e objetiva os gráficos abaixo permitem perceber com rapidez em quais Instituições Financeiras os recursos do IGEPREV estão alocados.

**Investimentos por categoria
alocação efetiva - 08/2024**

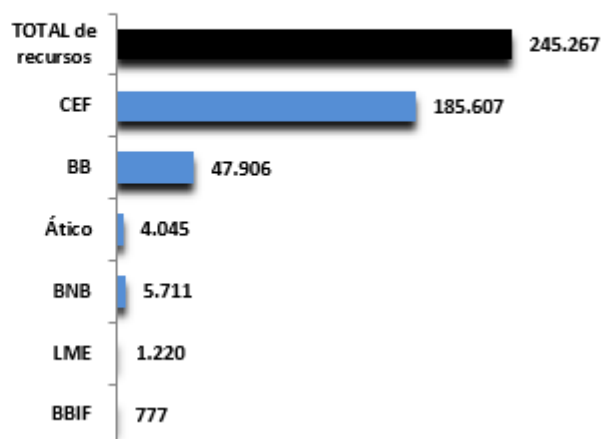


**Investimentos por categoria
R\$ (milhões)
08/2024**

**Alocação de recursos
por Gestor
08/2024 (%)**



**Alocação de recursos
por Gestor
08/2024 (R\$ milhões)**



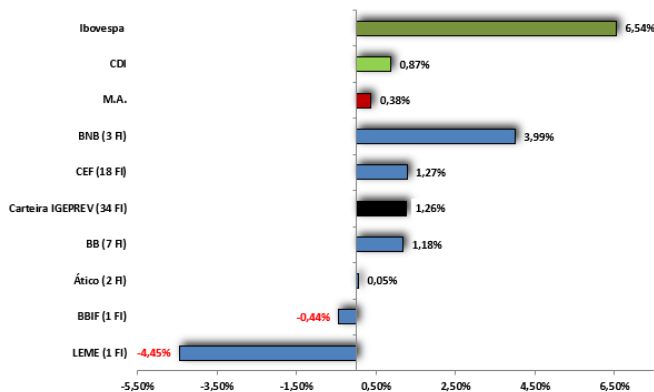
1.e - Relatório mensal de Investimentos

Extrato mensal do desempenho:

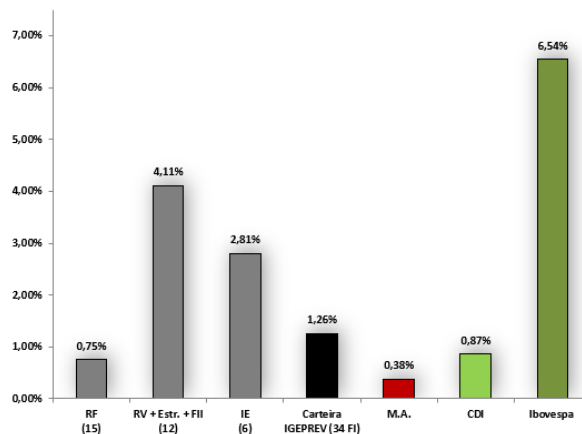
Os gráficos abaixo identificam o desempenho do IGEPREV por classe de ativos e por Instituição Financeira no mês em análise, em comparação com a meta atuarial e ao CDI.

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

Rentabilidade por Gestores - 08/2024



Rentabilidade por segmento - 08/2024



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

