

r

Relatório de acompanhamento mensal da execução da Política de Investimentos

Janeiro – 2024

ÍNDICE

1. Relatório mensal de Investimentos

- a. Planilha analítica mensal
- b. Indicadores de desempenho (B3, ANBIMA e IBGE)
- c. Resumo geral das alocações em R\$
- d. Resumo geral das alocações em %
- e. Alocação dos recursos por Gestor/Custodiante
- f. Extrato mensal do desempenho
- g. Rentabilidade Geral e Meta Atuarial

1.1. 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	Jan.2024	R\$	mês	ano	12 m	CDI	M.A.
					235.940.138,41	0,51%	0,51%	13,07%	0,97%	0,82%
									0,97%	0,82%
RENDA FIXA			100,00%	84,25%	198.767.490,39					
art. 7º, I, b (FI 100% TTN)			100%	100%	37,10%	87.525.326,14				
1	BB Previdenciário FI RF TP IPCA I	(15.08.22)			1,39%	3.268.078,12	0,95%	0,95%	12,65%	-
2	BB Previdenciário FI RF TP IPCA III	(15.08.24)			0,12%	293.640,65	1,10%	1,10%	10,83%	-
3	BNB Soberano FI RF				0,25%	582.992,84	0,96%	0,96%	12,75%	-
4	BNB IMA-B FI RF				0,95%	2.239.047,05	-0,51%	-0,51%	15,08%	-
5	Caixa Brasil IMAB 5 TP RF FI LP				1,81%	4.264.678,72	0,66%	0,66%	11,18%	-
6	Caixa Brasil IMA-B TP RF FI LP				3,17%	7.479.866,62	-0,47%	-0,47%	15,36%	-
7	Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica RF				29,42%	69.397.022,14	0,66%	0,66%	13,16%	-
art. 7º, III, a (FI (geral) (ATIVO))			60%	60%	46,26%	109.129.081,94				
8	BB Previdenciário RF Perfil FIC				7,61%	18.422.489,47	0,97%	0,97%	12,80%	-
9	BB Alocação Ativa Retorno Total FIC RF Previdenciário				1,03%	2.438.139,79	0,85%	0,85%	15,22%	-
10	Caixa Brasil Disponibilidades RF FI				3,71%	8.750.563,59	0,88%	0,88%	11,49%	-
11	Caixa Brasil Ref. DI FI LP				18,84%	44.451.151,38	1,00%	1,00%	13,22%	-
12	Caixa Brasil Renda Fixa Ativa FIC				7,30%	17.212.266,09	0,88%	0,88%	12,69%	-
13	Caixa Brasil Título Público FI RF LP				7,57%	17.854.471,62	0,95%	0,95%	12,79%	-
art. 7º, V, a (FIDC Fechado)			5%	5,00%	0,90%	2.113.082,31				
14	BBIF Master FIDC LP				0,34%	803.996,30	-0,37%	-0,37%	-4,49%	-
15	LME IPCA FIDC Multissetorial Senior				0,55%	1.309.086,01	-0,64%	-0,64%	-4,41%	-
RV + ESTRUTURADOS + IMOBILIÁRIO			30,00%	13,07%	30.844.434,76					
art. 8º, I (FIA)			30%	30,00%	6,62%	15.608.854,97				
16	BNB Seleção FIA				1,12%	2.634.707,15	-4,37%	-4,37%	11,10%	-
17	Caixa Brasil IBX 50 FIA				0,88%	2.067.975,80	-4,17%	-4,17%	7,84%	-
18	Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS				0,51%	1.208.938,08	-3,07%	-3,07%	-	-
19	Caixa FIC Ações Expert Vinci Valor RPPS (SMALL)				0,30%	710.284,62	-4,13%	-4,13%	-	-
20	Caixa FIC FIA Brasil Ações Livre Quantico				1,96%	4.624.145,94	-2,73%	-2,73%	20,43%	-
21	Caixa FIC FIA Multigestor				1,85%	4.362.803,18	-4,15%	-4,15%	8,47%	-
art. 8º, II (FIA ETF)			30%							
art. 10, I (Multimercado)			5,49%	10,00%	4,70%	11.089.016,60				
22	Caixa Alocação Macro FIC Multimercado LP				2,02%	4.761.779,84	0,51%	0,51%	12,87%	-
23	Caixa Brasil Estratégia Livre FIC Multimercado LP				0,78%	1.828.339,23	0,22%	0,22%	11,75%	-
24	Caixa Bolsa Americana FI Multimercado LP				1,45%	3.426.563,74	1,69%	1,69%	27,16%	-
25	Caixa FIM RV 30 LP				0,30%	702.832,33	-0,68%	-0,68%	11,80%	-
26	FIC FI Capital Protegido Bolsa de Valores V Multimercado				0,16%	369.501,46	-2,34%	-2,34%	20,61%	-
art. 10, II (FIP)			5,00%	0,79%	1.864.579,61					
27	Ático Florestal FIC FIP				0,79%	1.864.579,61	-0,05%	-0,05%	-0,59%	-
art. 11 (Imobiliário)			5%	5,00%	0,97%	2.281.983,58				
28	HAZ FII (Ático Renda FII)				0,97%	2.281.983,58	0,14%	0,14%	3,09%	-
EXTERIOR			10,00%	2,67%	6.302.765,28					
art. 9º, II			10,00%	1,76%	4.150.264,07					
29	CEF FIC FIM Multigestor Global EQ IE				0,14%	319.984,81	3,07%	3,07%	11,51%	-
29	BB Global Select Equity Invest. Ext. FIM (J.P.Morgan)				0,79%	1.863.642,56	4,18%	4,18%	17,84%	-
30	BB Nordea Invest. Ext. FIM				0,83%	1.966.636,70	3,22%	3,22%	6,00%	-
art. 9º, III			10,00%	0,91%	2.152.501,21					
31	BB Ações Bolsas Europeias ETF FIC Ações BDR Nível I				0,25%	580.485,85	-0,48%	-0,48%	11,65%	-
32	BB Ações Bolsas Globais Ativo ETF FIC Ações BDR Nível I				0,26%	612.150,64	0,73%	0,73%	12,64%	-
33	Caixa FIA Institucional BDR Nível I				0,41%	959.864,72	4,56%	4,56%	-	-
Total da carteira			100,00%		235.914.690,43					
Saldo em c/c					25.447,98					
Total Geral da carteira			100,00%		235.940.138,41					
Renda Fixa			84,25%		198.767.490,39					
RV + Estruturados + Imobiliário			13,07%		30.844.434,76					
Exterior			2,67%		6.302.765,28					

2.2. Relatório mensal de Investimentos

Indicadores de desempenho (B3, ANBIMA e IBGE):

Indicadores		2024	jan
US\$ (comercial venda)		2,32%	2,32%
Indicadores de desempenho B3	Ibovespa	-4,79%	-4,79%
	Ibovespa (US\$)	-6,95%	-6,95%
	IGC-NM	-6,71%	-6,71%
	IDIV	-3,51%	-3,51%
	ICON	-8,33%	-8,33%
	SMLL	-6,55%	-6,55%
Indicadores de desempenho Global	MSCI World (US\$)	1,14%	1,14%
	MSCI ACWI (US\$)	0,53%	0,53%
	MSCI EM (US\$)	-4,68%	-4,68%
	Dow Jones (US\$)	1,22%	1,22%
	S&P 500 (US\$)	1,59%	1,59%
Índices ANBIMA	CDI	0,97%	0,97%
	IMA Geral	0,47%	0,47%
	IMA-B	-0,45%	-0,45%
	IMA-B 5	0,68%	0,68%
	IMA-B 5+	-1,47%	-1,47%
	IDkA (IPCA 2a)	0,81%	0,81%
	IDkA (IPCA 5a)	-0,23%	-0,23%
	IRF-M	0,67%	0,67%
	IRF-M 1	0,83%	0,83%
	IRF-M 1+	0,60%	0,60%
	IDkA Pré 1A	0,81%	0,81%
	IDkA Pré 2A	0,76%	0,76%
	IDkA Pré 5A	0,01%	0,01%
Índices IBGE	IPCA	0,42%	0,42%
Meta Atuarial (IPCA + 4,85% aa)		0,82%	0,82%
IGEPREV		0,51%	0,51%

2.3. 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 - 01/2024:

Enquadramento Resolução 4963/2021			4.963/21	PAI	Total	CEF	BB	BBIF	LME	BNB	Ático
RF	art. 7º, I, b	FI NTN-B 5			4.264.678,72	4.264.678,72					
		FI IMA-B			9.718.913,67	7.479.866,62				2.239.047,05	
		Gestão Ativa			69.397.022,14	69.397.022,14					
		FI - TPF			4.144.711,61		3.561.718,77			582.992,84	
	art. 7º, III, a		100%	100%	87.525.326,14	81.141.567,48	3.561.718,77	-	-	2.822.039,89	-
		Gestão Ativa			19.650.405,88	17.212.266,09	2.438.139,79				
		FI DI			89.478.676,06	71.056.186,59	18.422.489,47				
	art. 7º, V, a	FIDC (cota senior)	60%	60%	109.129.081,94	88.268.452,68	20.860.629,26	-	-	-	
			5%	5%	2.113.082,31			803.996,30	1.309.086,01		
TOTAL RF			100%	100%	198.767.490,39	169.410.020,16	24.422.348,03	803.996,30	1.309.086,01	2.822.039,89	-
RV	art. 8º, I	FIA	30%	30%	15.608.854,97	12.974.147,82				2.634.707,15	
	art. 10, I	Multimercado	10%	10%	11.089.016,60	11.089.016,60					
	art. 10, II	FIP	5%	5%	1.864.579,61						1.864.579,61
	art. 11	FII	5%	5%	2.281.983,58						2.281.983,58
TOTAL RV+Estr.+FII			30%	30%	30.844.434,76	24.063.164,42				2.634.707,15	4.146.563,19
IE	art. 9º, II	"Invest. no Exterior"	10%	10%	4.150.264,07	319.984,81	3.830.279,26				
	art. 9º, III	Ações BDR Nível I			2.152.501,21	959.864,72	1.192.636,49				
TOTAL IE			10%	10%	6.302.765,28	1.279.849,53	5.022.915,75				
TOTAL GERAL			100%	100%	235.914.690,43	194.753.034,11	29.445.263,78	803.996,30	1.309.086,01	5.456.747,04	4.146.563,19

2.4. 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 - 01/2024:

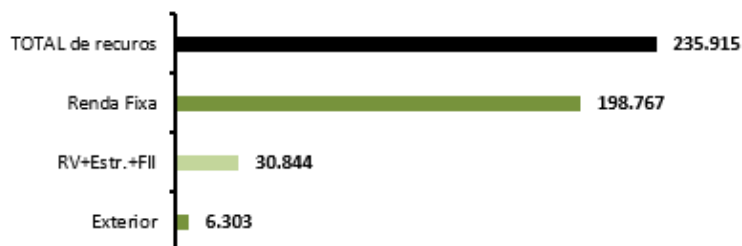
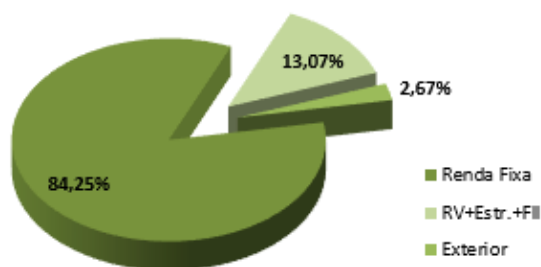
Enquadramento Resolução 4963/2021			4.963/21	PAI	Total	CEF	BB	BBIF	LME	BNB	Ático
RF	art. 7º, I, b	FI NTN-B 5			1,81%	1,81%					
		FI IMA-B			4,12%	3,17%				0,95%	
		Gestão Ativa			29,42%	29,42%					
		FI - TPF			1,76%		1,51%			0,25%	
			100%	100%	37,10%	34,39%	1,51%			1,20%	
	art. 7º, III, a	Gestão Ativa			8,33%	7,30%	1,03%				
		FI DI			37,93%	30,12%	7,81%				
			60%	60%	46,26%	37,42%	8,84%				
	art. 7º, V, a	FIDC (cota senior)	5%	5%	0,90%			0,34%	0,55%		
TOTAL RF			100%	100%	84,25%	71,81%	10,35%	0,34%	0,55%	1,20%	
RV	art. 8º, I	FIA	30%	30%	6,62%	5,50%				1,12%	
	art. 10, I	Multimercado	10%	10%	4,70%	4,70%					
	art. 10, II	FIP	5%	5%	0,79%						0,79%
	art. 11	FII	5%	5%	0,97%						0,97%
TOTAL RV+Estr.+FII			30%	30%	13,07%	10,20%				1,12%	1,76%
IE	art. 9º, II	"Invest. no Exterior"			1,76%	0,14%	1,62%				
	art. 9º, III	Ações BDR Nível I	10%	10%	0,91%	0,41%	0,51%				
TOTAL IE			10%	10%	2,67%	0,54%	2,13%				
TOTAL GERAL			100%	100%	100,00%	82,55%	12,48%	0,34%	0,55%	2,31%	1,76%

2.5. Relatório mensal de Investimentos

Alocação dos recursos por Gestor/Custodiante:

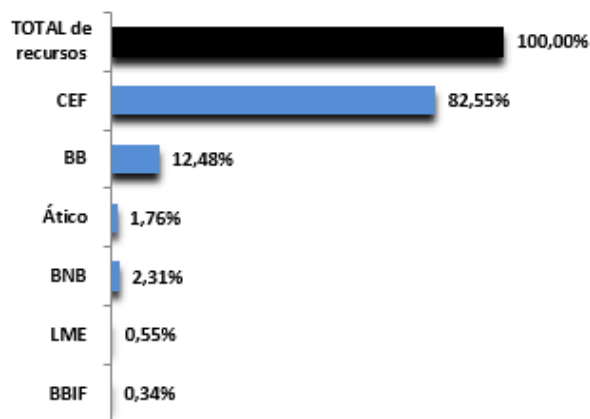
De forma simples e objetiva os gráficos abaixo permitem perceber com rapidez em quais Instituições Financeiras os recursos do IGEPREV estão alocados.

**Investimentos por categoria
alocação efetiva - 01/2024**

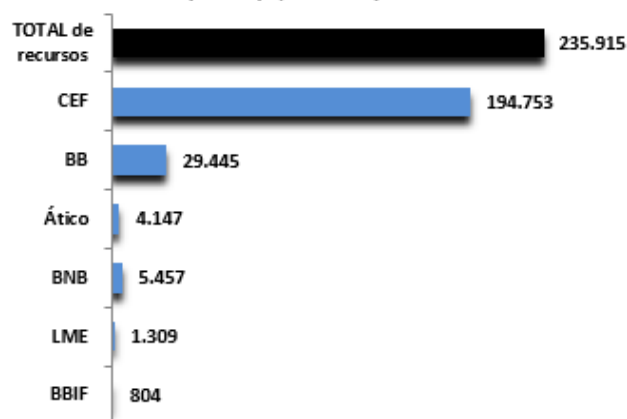


**Investimentos por categoria
R\$ (milhões)
01/2024**

**Alocação de recursos
por Gestor
01/2024 (%)**



**Alocação de recursos
por Gestor
01/2024 (R\$ milhões)**



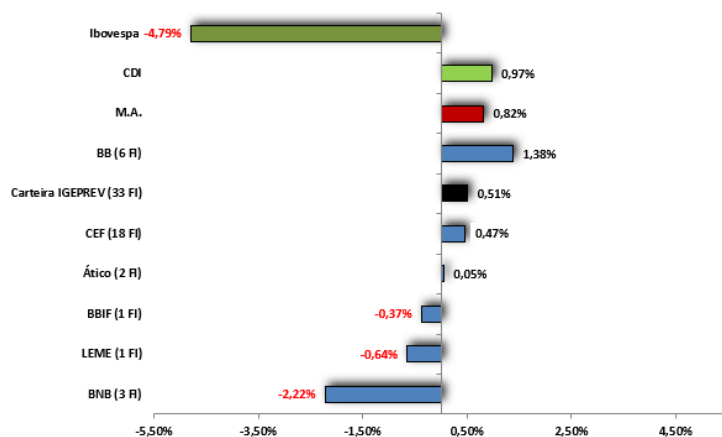
2.6. Relatório mensal de Investimentos

Extrato mensal do desempenho:

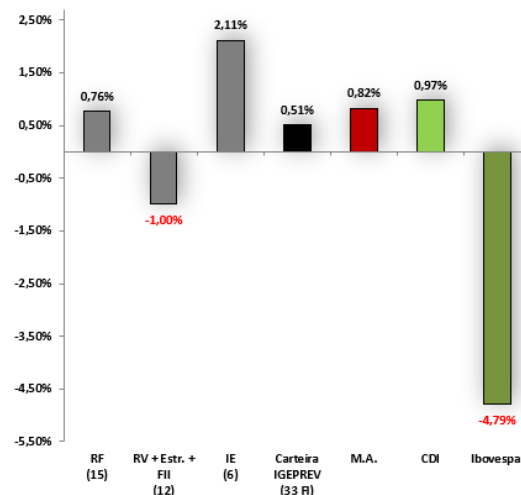
Os gráficos abaixo identificam o desempenho do IGEPREV por classe de ativos e por Instituição Financeira no mês em análise, em comparação com a meta atuarial e ao CDI.

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

Rentabilidade por Gestores - 01/2024



Rentabilidade por segmento - 01/2024

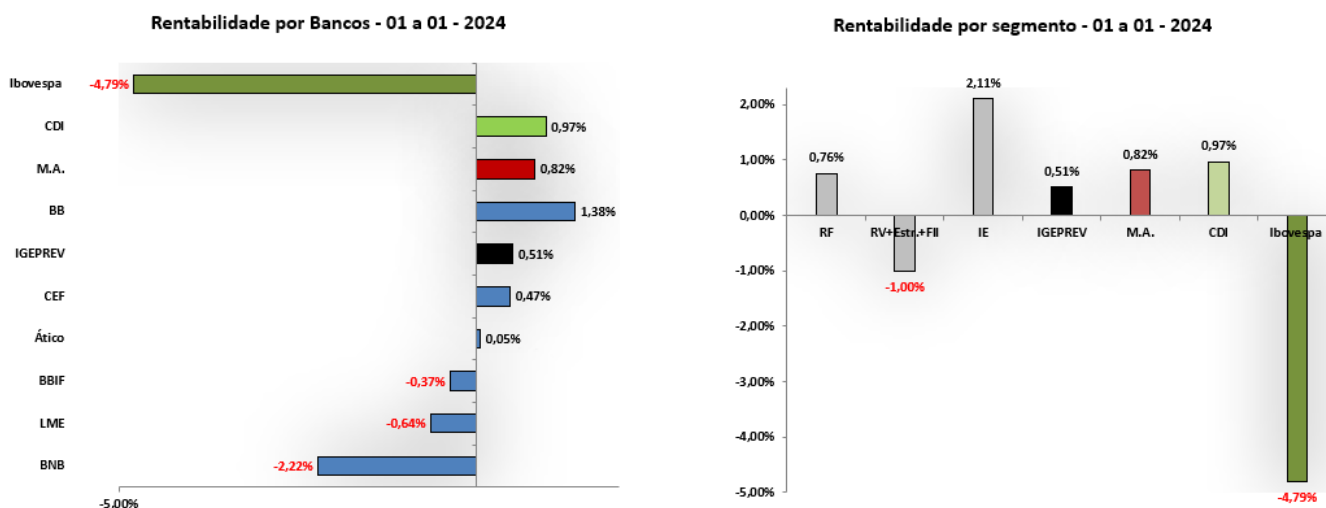


2.7. Relatório mensal de Investimentos

Rentabilidade Geral e Meta Atuarial:

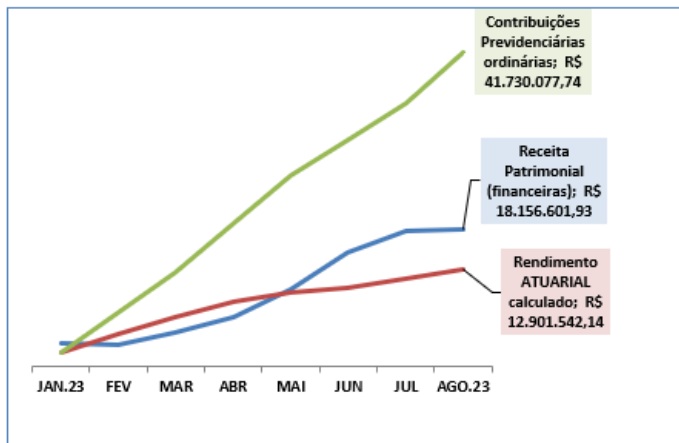
O gráfico nº 01 indica de forma integral e por Instituição Financeira no exercício, a rentabilidade da carteira do IGEPREV e os desempenhos da meta atuarial e do CDI.

Gráfico nº 01



3.1. Relatório de Compatibilidade do P com A (ALM) Comparativo Receita Financeira x Receita Atuarial Estimada:

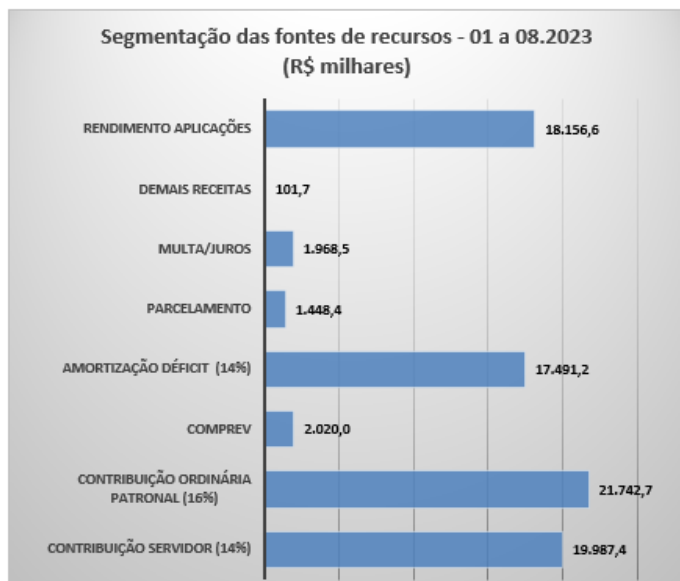
2023 - Evolução das Receitas



Quadro-resumo: Análise do Desempenho

	R\$ (milhares)
PL em 31/12/22	200.413,5
PL em 31/08/23	215.179,5
Evolução do PL (c/ despesas pagas)	14.766,0
Contribuições Previdenciárias do Ente	42.650,9
Contribuição Previdenciária do Servidor	19.987,4
COMPREV	2.020,0
Demais receitas	101,7
Rendimento de Aplicação Financeira	18.156,6
Rendimento Atuarial programado	12.901,5
Excedente sobre a meta atuarial	5.255,1

Segmentação das fontes de recursos - 01 a 08.2023 (R\$ milhares)

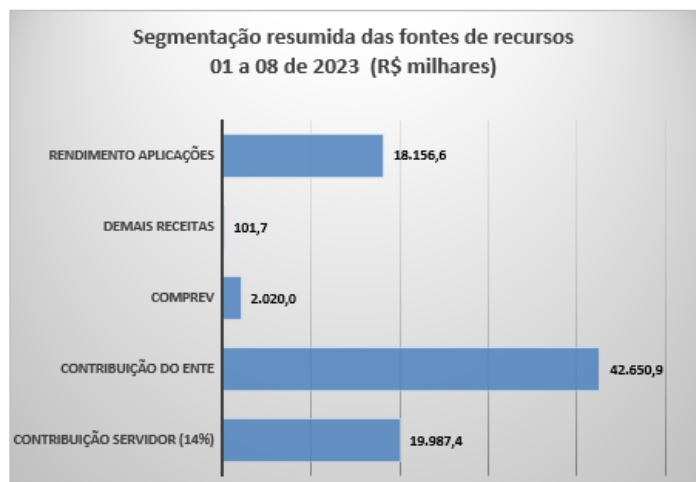


Fontes de recursos (jan/ago - 2023)

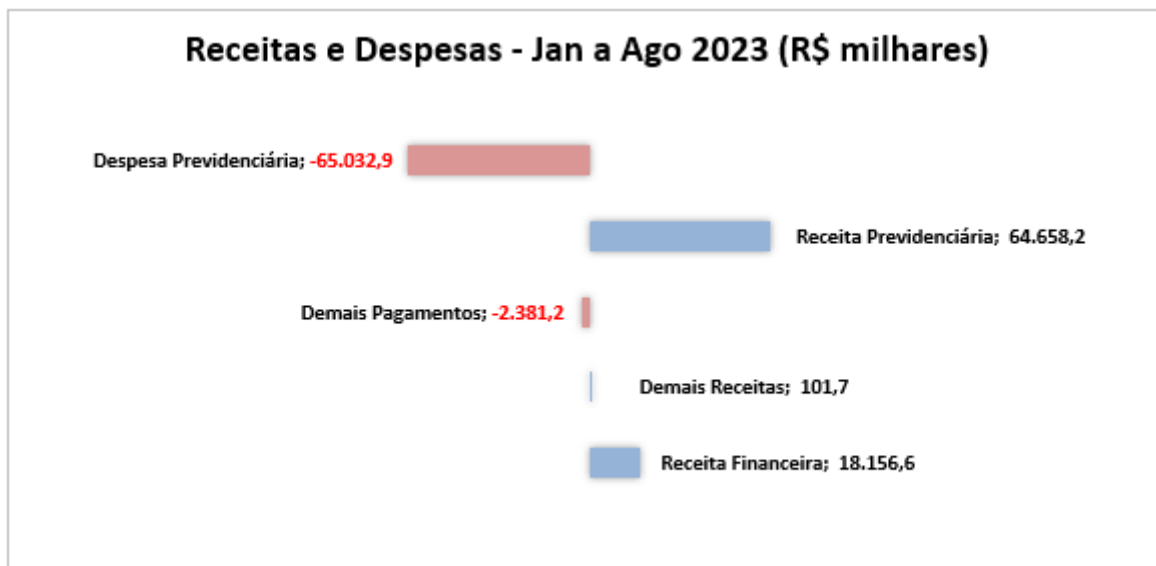
Fontes de recursos (jan/ago - 2023)	R\$ (milhares)
Pagamentos	68.609,0
Contribuição servidor (14%)	19.987,4
Contribuição ordinária patronal (16%)	21.742,7
COMPREV	2.020,0
Amortização Déficit (14%)	17.491,2
Parcelamento	1.448,4
Multa/Juros	1.968,5
Demais Receitas	101,7
Rendimento aplicações	18.156,6
Evolução do PL	14.766,0
Meta atuarial (4,81% cf 18,09% patronal)	12.901,5

22% dos recursos recebidos

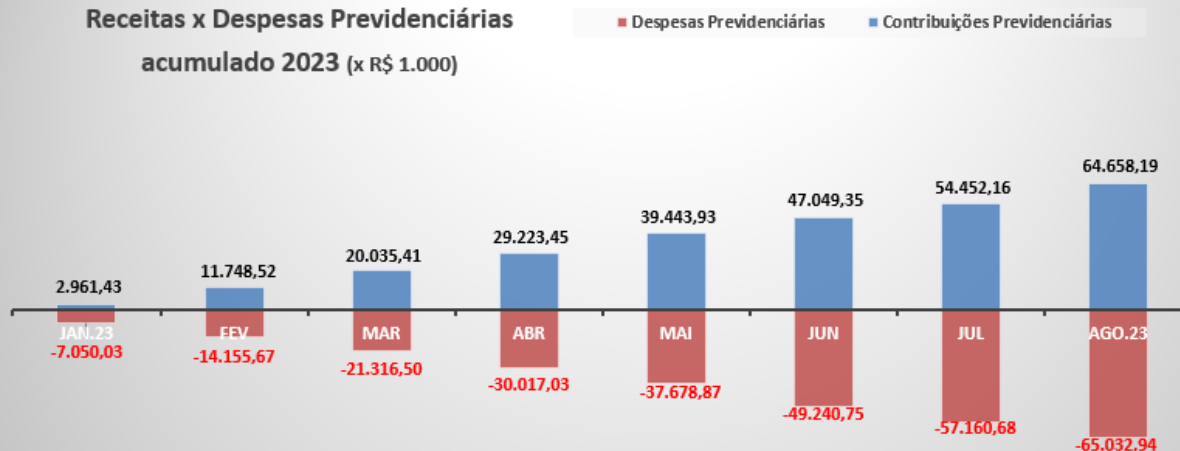
17% dos recursos recebidos



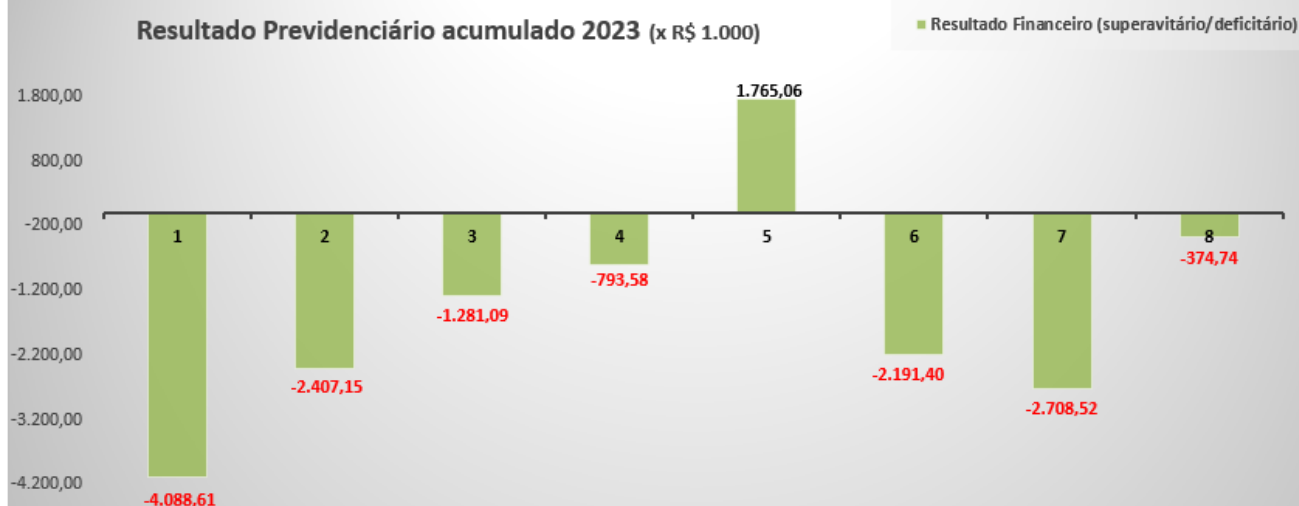
Fontes de recursos (jan/ago - 2023)	R\$ (milhares)
Pagamentos	68.609,0
Contribuição servidor (14%)	19.987,4
Contribuição do Ente	42.650,9
COMPREV	2.020,0
Demais Receitas	101,7
Rendimento aplicações	18.156,6
78% dos recursos recebidos	
64.759,9	
Evolução anual do PL	14.765,96
Meta atuarial	12.901,5



Receitas x Despesas Previdenciárias acumulado 2023 (x R\$ 1.000)



Resultado Previdenciário acumulado 2023 (x R\$ 1.000)

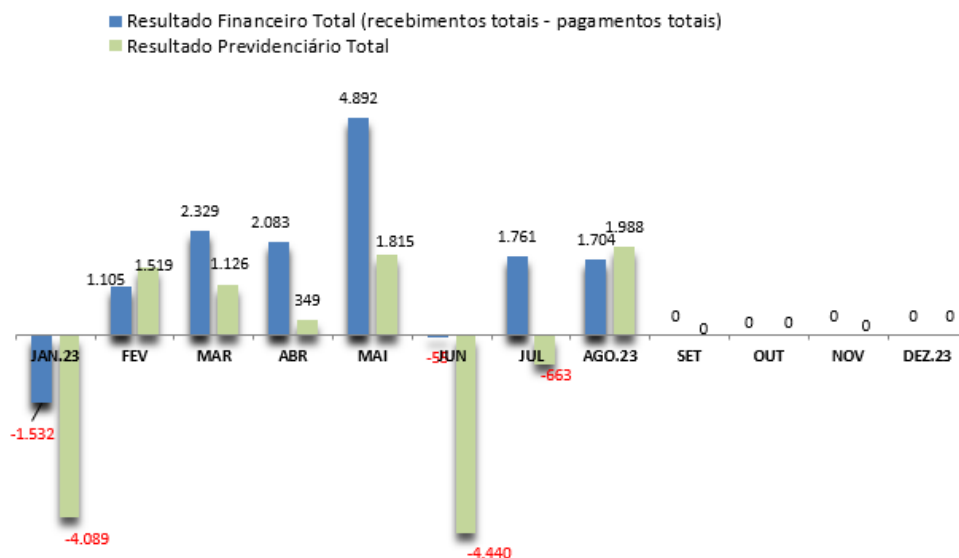


Foi analisado os resultados mensais financeiros e previdenciários. O resultado financeiro agrega as receitas da contribuição previdenciária do servidor e do ente, mais as receitas com a amortização do déficit os parcelamentos de débitos previdenciários, multa e juros sobre contribuições, demais receitas e as receitas das aplicações financeiras, descontado os pagamentos integrais do RPPS efetuados no mês.

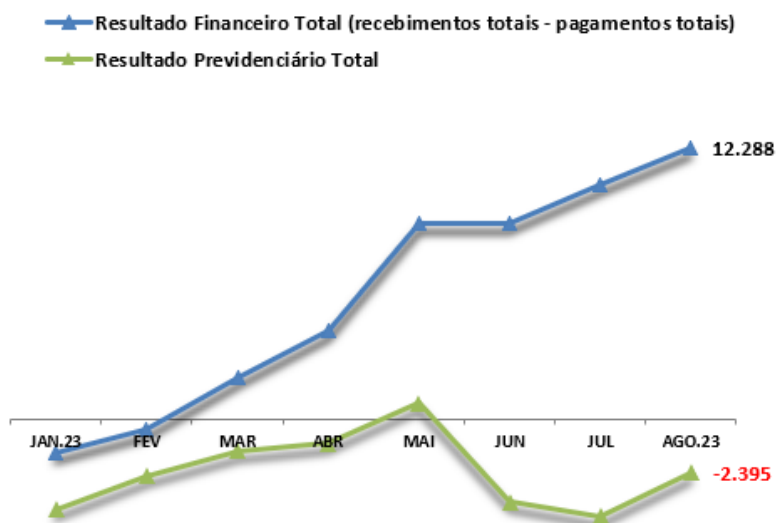
O resultado previdenciário considera apenas as receitas da contribuição previdenciária do servidor e do ente, mais as receitas com a amortização do déficit os parcelamentos de débitos previdenciários, multa e juros sobre contribuições, descontado os pagamentos dos benefícios previdenciários efetuados no mês.

Previdência do Servidor, Construindo Um Novo Tempo.

2023 - Resultado líquido mensal (R\$ milhares)

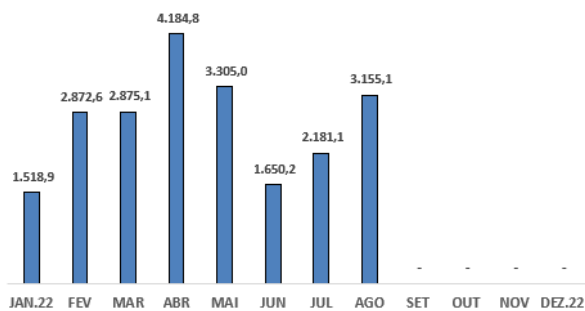


2023 - Resultado acumulado mensal (R\$ milhares)

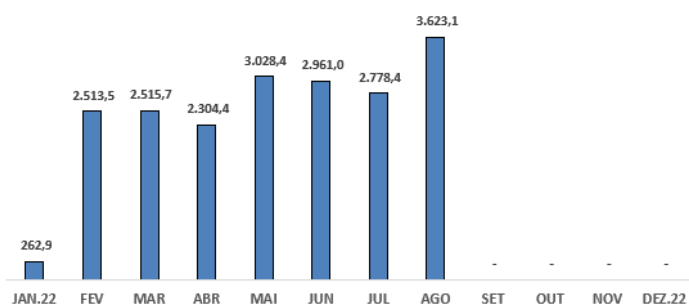


Previdência do Servidor, Construindo Um Novo Tempo.

Repasse alíquota Patronal - 2023 (R\$ milhares)



Repasse Servidor - 2023 (R\$ milhares)



4.1. Relatório semestral de Diligências

Verificação dos Ativos que compõem o PL dos FI's e TVM, excluídos TPF:

- Caixa Bolsa Americana FIM LP (CNPJ: 30.036.235/0001-02):

Composição da Carteira

	Nome do Ativo		Valor do Ativo (R\$)		Participação do Ativo
	NTN-B - Venc.: 15/05/2023		857.381,14		17,3722 %
	NTN-B - Venc.: 15/08/2022		804.744,47		16,3057 %
	NTN-B - Venc.: 15/08/2024		510.402,13		10,3417 %
	NTN-B - Venc.: 15/05/2025		437.067,06		8,8558 %
	NTN-B - Venc.: 15/05/2021		350.886,60		7,1096 %
	LFT - Venc.: 01/03/2026		269.009,35		5,4506 %
	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2024		224.153,28		4,5418 %
	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2023		222.368,92		4,5056 %
	VALE ON N1 - VALE3		104.149,67		2,1103 %
	LFT - Venc.: 01/09/2025		97.419,13		1,9739 %
	LFT - Venc.: 01/09/2026		85.142,66		1,7252 %
	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2021		70.490,16		1,4283 %
	ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4		36.212,92		0,7337 %
	LFT - Venc.: 01/03/2024		33.969,35		0,6883 %
	Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2022		33.441,67		0,6776 %
	AMBEV S/A ON - ABEV3		33.068,06		0,6700 %
	MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3		32.918,12		0,6670 %
	PETROBRAS PN - PETR4		31.775,95		0,6438 %
	B3 ON NM - B3SA3		30.399,53		0,6160 %
	BRABESCO PN N1 - BBDC4		28.340,12		0,5742 %
	PETROBRAS ON - PETR3		23.697,62		0,4802 %
	INTERMEDICA ON NM - GNDI3		22.186,10		0,4495 %
	GRUPO NATURAON NM - NTCO3		21.383,47		0,4333 %
	LFT - Venc.: 01/03/2023		21.268,68		0,4309 %
	JBS ON NM - JBSS3		20.336,31		0,4121 %
	LOCALIZA ON NM - RENT3		19.379,91		0,3927 %
	LOJAS RENNER ON NM - LREN3		16.580,78		0,3360 %
	WEG ON NM - WEGE3		15.167,56		0,3073 %
	LFT - Venc.: 01/09/2024		14.045,75		0,2846 %
	VIAVAREJO ON N2 - VVAR3		13.484,53		0,2732 %
	BRASIL ON NM - BBAS3		13.467,88		0,2729 %
	RAIADROGASIL ON NM - RADL3		13.044,75		0,2643 %
	SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3		12.807,74		0,2595 %
	ITAUSA PN N1 - ITSA4		11.945,15		0,2420 %
	LOJAS AMERIC PN - LAME4		10.572,47		0,2142 %
	CYRELA REALT ON NM - CYRE3		9.984,80		0,2023 %
	LFT - Venc.: 01/03/2025		9.811,81		0,1988 %
	PETRORIO ON NM - PRIO3		9.147,21		0,1853 %
	ENEVA ON NM - ENEV3		8.908,13		0,1805 %
	GERDAU PN N1 - GGBR4		8.871,52		0,1798 %
	AZUL PN N2 - AZUL4		8.808,02		0,1785 %
	BRF SA ON NM - BRFS3		8.798,29		0,1783 %
	BTGP BANCO UNT - BPAC11		8.214,48		0,1664 %
	B2W DIGITAL ON NM - BTOW3		8.172,01		0,1656 %
	COGNA ON NM - COGN3		8.058,65		0,1633 %
	LOCAMERICA ON NM - LCAM3		7.409,46		0,1501 %
	MARFRIG ON NM - MRFG3		7.361,64		0,1492 %
	RUMO S.A. ON NM - RAIL3		7.292,15		0,1478 %
	QUALICORP ON NM - QUAL3		7.174,41		0,1454 %
	BANCO INTER UNT N2 - BIDI11		7.096,58		0,1438 %
	IRB BRASIL RE ON NM - IRBR3		6.969,66		0,1412 %

• **Caixa Brasil Estratégia Livre FIC FIM LP (CNPJ: 34.660.276/0001-18):**

CAIXA MASTER ESTRATÉGIA LIVRE FI MULTIMERCADO LP

CNPJ: 34.660.200/0001-92

Composição da Carteira

 Ativo	 Valor do Ativo (R\$)	 Participação do Ativo
LFT - Venc.: 01/03/2026	258.227,97	29,6652 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	255.607,46	29,3642 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2021	131.657,27	15,1248 %
LFT - Venc.: 01/03/2024	54.991,09	6,3174 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	32.613,90	3,7467 %
LFT - Venc.: 01/09/2026	31.576,42	3,6275 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	25.282,91	2,9045 %
LFT - Venc.: 01/09/2023	21.387,07	2,4569 %
Cotas de ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SMAL11	17.512,47	2,0118 %
LFT - Venc.: 01/03/2021	10.740,80	1,2339 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2021	9.231,10	1,0605 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	8.662,36	0,9951 %
Opções - Posições titulares - IBOVL98	4.777,50	0,5488 %
MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	3.927,84	0,4512 %
VIAVAREJO ON N2 - VVAR3	3.372,50	0,3874 %
CENTAURO ON NM - CINTO3	2.470,08	0,2838 %
LOJAS AMERIC PN - LAME4	2.109,56	0,2423 %
DIFERENCIAL DE SWAP A RECEBER - DI1 X PRE	1.670,16	0,1919 %
Opções - Posições titulares - IBOVL102	1.656,57	0,1903 %
B2W DIGITAL ON NM - BTOW3	1.654,40	0,1901 %
Opções - Posições titulares - IBOVA106	614,67	0,0706 %
Opções - Posições titulares - IBOVL310	611,10	0,0702 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF29	247,52	0,0284 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DOLFUTF21	81,73	0,0094 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF22	48,31	0,0055 %
Opções - Posições titulares - IBOVX89	43,20	0,0050 %
Mercado Futuro - Posições compradas - SEKFUTG21	34,00	0,0039 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF24	26,18	0,0030 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - T10FUTH21	7,00	0,0008 %
Outros Valores a receber	5,53	0,0006 %
Outras Disponibilidades	0,93	0,0001 %
Opções - Posições titulares - DOLOPDZND8	0,00	0,0000 %
Opções - Posições lançadas - DOLOPDZND3	0,00	0,0000 %
Opções - Posições lançadas - IBOVL140	0,00	0,0000 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN21	-12,27	-0,0014 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - NOKFUTG21	-21,00	-0,0024 %
Outros Valores a pagar	-31,06	-0,0036 %
Opções - Posições lançadas - IBOVL113	-243,18	-0,0279 %
Opções - Posições lançadas - IBOVL11	-341,46	-0,0392 %
Opções - Posições lançadas - IBOVL5	-571,27	-0,0656 %
Opções - Posições lançadas - IBOVL108	-648,48	-0,0745 %
Opções - Posições lançadas - IBOVA110	-704,13	-0,0809 %
DIFERENCIAL DE SWAP A PAGAR - DI1 X PRE	-1.074,67	-0,1235 %

6.2. Relatório semestral de Diligências

Situação patrimonial, fiscal, comercial das empresas investidas em FIP:

- Dados conferidos nos relatórios de Dual Diligence:
 - o <https://www.caixa.gov.br/site/paginas/downloads.aspx>

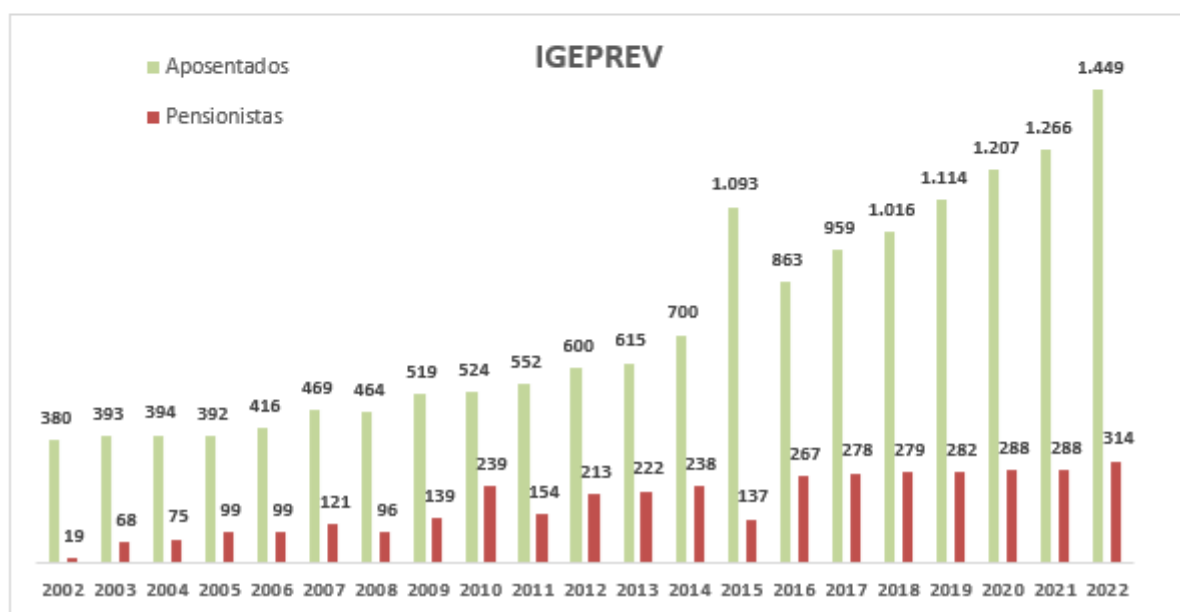
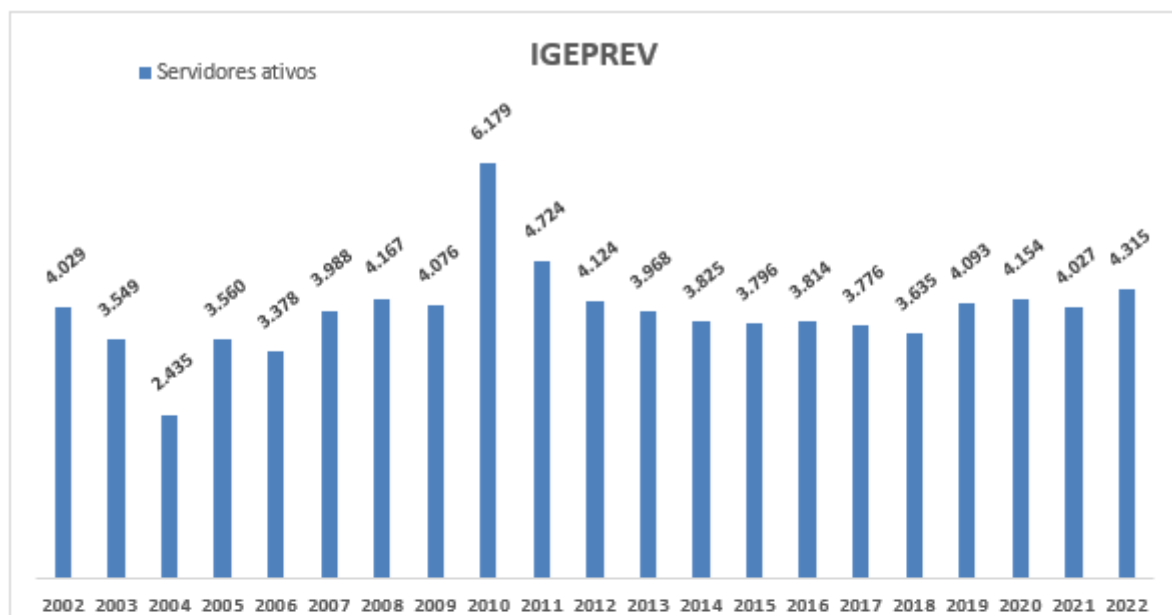
7.3. Relatório semestral de Diligências

Rating da RF: (FI, Ativos diretos, FIDC, Crédito Privado e Debêntures de Infra.):

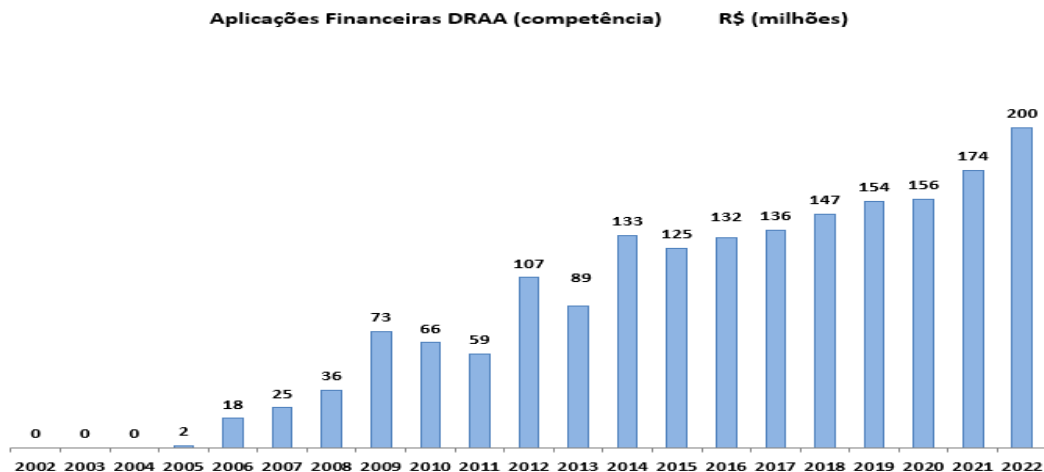
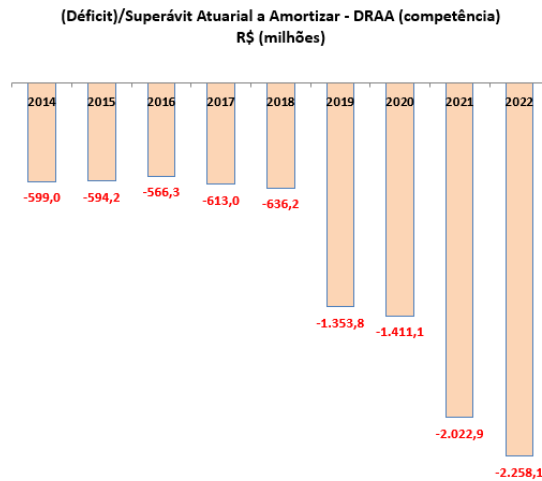
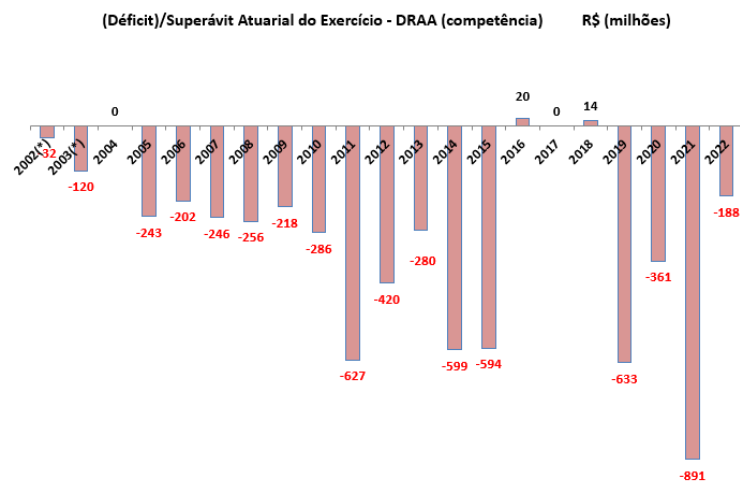
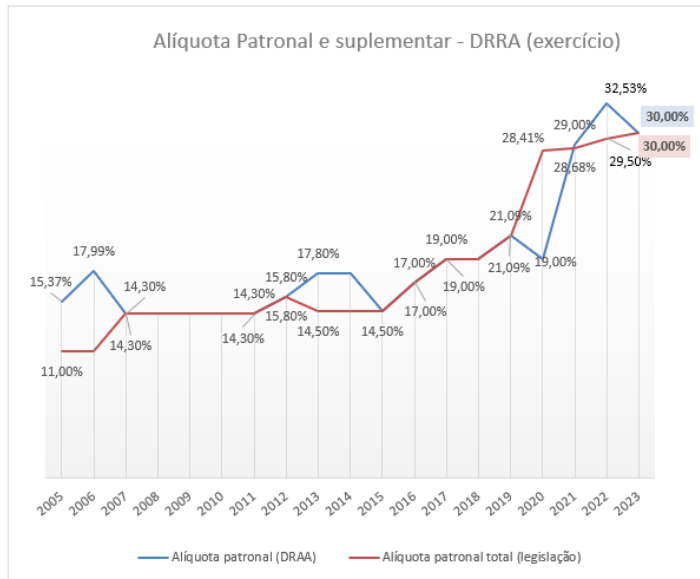
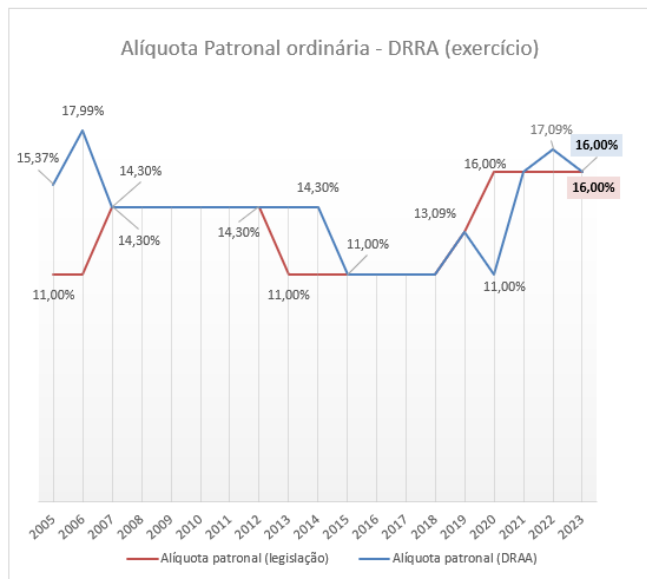
Nome	Risco Anbima
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	Renda Variável + Alavancagem
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	Renda Variável + Alavancagem
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Não informado
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	Não informado
BB NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	Não informado
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	Não informado
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Não informado
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Índice de Referência + Juros Mercado Doméstico + Crédito + Índice de Preços Mercado Doméstico + Alavancagem
BBIF MASTER FIDC LP 1	Não classificado
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	Não informado
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não classificado
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	Renda Variável + Alavancagem
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	Diversas Classes de Ativos + Alavancagem
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	Renda Variável + Alavancagem
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	Não informado
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	Não informado
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	Não informado
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Não informado
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	Não informado
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Não informado
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	Diversas Classes de Ativos
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	Renda Variável
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	Renda Variável + Alavancagem
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Não informado
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	Renda Variável + Alavancagem
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	Não informado
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	Renda Variável
HAZ FII - ATCR11	Não classificado
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não classificado

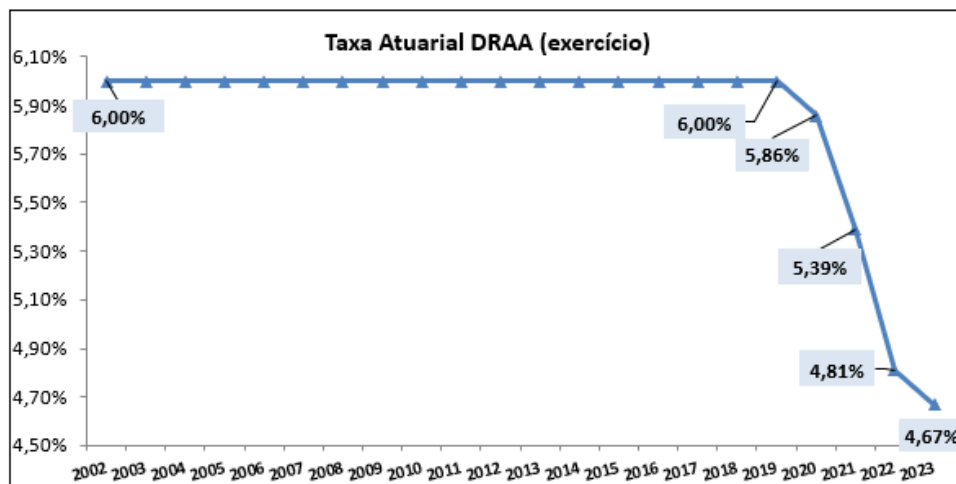
8.1. Relatório de Governança Corporativa

Evolução da situação atuarial:



Previdência do Servidor, Construindo Um Novo Tempo.





8.2. Relatório de Governança Corporativa

Gestão de investimentos:

Resolução 4.963/2021
Ático Florestal FIC FIP
BB Ações Bolsas Europeias ETF FIC Ações BDR Nível I
BB Ações Bolsas Globais Ativo ETF FIC Ações BDR Nível I
BB Alocação Ativa Retorno Total FIC RF Previdenciário
BB Global Select Equity Invest. Ext. FIM (J.P.Morgan)
BB Nordea Invest. Ext. FIM
BB Previdenciário FI RF TP IPCA I
BB Previdenciário FI RF TP IPCA III
BB Previdenciário RF Perfil FIC
BBIF Master FIDC LP
BNB Seleção FIA
Caixa Alocação Macro FIC Multimercado LP
Caixa Bolsa Americana FI Multimercado LP
Caixa Brasil Disponibilidades RF FI
Caixa Brasil Estratégia Livre FIC Multimercado LP
Caixa Brasil IBX 50 FIA
Caixa Brasil IDkA 2A TP RF FI
Caixa Brasil IMAB 5 TP RF FI LP
Caixa Brasil Ref. DI FI LP
Caixa Brasil Renda Fixa Ativa FIC
Caixa Brasil Título Público FI RF LP
Caixa FIA Institucional BDR Nível I
Caixa FIA SMALL CAPS Ativo
Caixa FIC Ações Expert Vinci Valor RPPS (SMALL)
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS
Caixa FIC FIA Brasil Ações Livre Quantico
Caixa FIC FIA Multigestor
Caixa FIM RV 30 LP
CEF FIC FIM Multigestor Global EQ IE
FIC FI Capital Protegido Bolsa de Valores V Multimercado
HAZ FII (Ático Renda FII)
LME IPCA FIDC Multissetorial Senior