



COMPOSIÇÃO MENSAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO E ATIVO (JANEIRO 2022)

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO COM ESTRUTURAS E LIMITES

A carteira de investimentos do Fundo Municipal de Previdência do Servidor (FUMPRES) é composta por fundos de investimentos credenciados pela Diretoria Geral de Previdência, órgão responsável pela gestão do RPPS dos servidores públicos municipais dos poderes executivo e legislativo de Salvador, suas fundações e autarquias.

De acordo com a Política de Investimentos 2020, elaborada pelo Comitê de Investimentos, as aplicações do FUMPRES deverão ter predominância em investimentos de **renda fixa** obedecendo aos seguintes critérios:

SEGMENTO	COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DO FUNDO DE INVESTIMENTO	RESOLUÇÃO CMN 3.922/2010	% DO CAPITAL ALOCADO	% ALOCAÇÃO POR PL DO FUNDO	% ALOCAÇÃO POR FUNDO
RENDA FIXA	TÍTULOS DE EMISSÃO DO TESOUREO NACIONAL	ART. 7º, I, "A"	ATÉ 100%	NÃO SE APLICA	-
RENDA FIXA	100% TÍTULOS DE EMISSÃO DO TESOUREO NACIONAL, COM POLÍTICA DE INVESTIMENTO COMPROMISSADA EM BUSCAR O RETORNO DO IMA OU IDKA, EXCETO AQUELES ATRELADOS À TAXA DE JUROS DE UM DIA	ART. 7º, I, "B"	ATÉ 100%	ATÉ 15%	-
RENDA FIXA	OPERAÇÕES COMPROMISSADAS, LASTREADAS EXCLUSIVAMENTE PELOS TÍTULOS DE EMISSÃO DO TESOUREO NACIONAL	ART. 7º, II	ATÉ 5%	NÃO SE APLICA	-
RENDA FIXA	COTAS DE FI CLASSIFICADOS COMO RENDA FIXA OU COMO REFERENCIADOS EM INDICADORES DE DESEMPENHO DE RENDA FIXA, COM POLÍTICA DE INVESTIMENTO COMPROMISSADA EM BUSCAR O RETORNO DO IMA OU IDKA, EXCETO AQUELES ATRELADOS À TAXA DE JUROS DE UM DIA	ART. 7º, III	ATÉ 60%	ATÉ 15%	ATÉ 20%
RENDA FIXA	COTAS DE FI CLASSIFICADOS COMO RENDA FIXA OU COMO REFERENCIADOS EM INDICADORES DE DESEMPENHO DE RENDA FIXA, CONSTITUÍDOS SOB A FORMA DE CONDOMÍNIO ABERTO	ART. 7º, IV	ATÉ 40%	ATÉ 15%	ATÉ 20%
RENDA FIXA	COTAS DE FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS, CONSTITUÍDOS SOB A FORMA DE CONDOMÍNIO ABERTO (CDB E POUPANÇA)	ART. 7º, VI	ATÉ 15%	NÃO SE APLICA	-
RENDA FIXA	DEPÓSITOS DE POUPANÇA EM INSTITUIÇÃO FINANCEIRA CONSIDERADA DE BAIXO RISCO DE CRÉDITO (LETRAS IMOBILIÁRIAS GARANTIDAS)	ART. 7º, V	ATÉ 20%	NÃO SE APLICA	-
RENDA VARIÁVEL	FUNDOS DE AÇÕES EM GERAL	ART. 8º, II a	ATÉ 20%	ATÉ 5%	
	FUNDOS MULTIMERCADO	ART. 8º, III	ATÉ 10%	ATÉ 5%	
EXTERIOR	FUNDOS BDR NÍVEL I	ART. 9º, III	ATÉ 10%	NÃO SE APLICA	

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR ATIVO COM CLASSIFICAÇÃO DE RISCO

A tabela abaixo relaciona os fundos credenciados do FUMPRES com a sua classificação de risco, taxa de administração, rentabilidade, o índice de comparação (benchmark), e o percentual da rentabilidade do fundo em relação ao seu benchmark em 2022 (até **JANEIRO**).

Observamos que a carteira é composta por:

- Um fundo classificado como de **risco muito baixo** (com rentabilidade de **3,07%** em 2022);
- Dois de **risco baixo** (com rentabilidade de **2,58% e 3,79%** em 2022);
- Um de **risco alto** (com rentabilidades **-1,71%** em 2022)

FUNDO CREDENCIADO	CLASSIFICAÇÃO DE RISCO	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	RENTABILIDADE EM 2022	BENCHMARK	% BENCHMARK EM 2022
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO	MUITO BAIXO	0,50% A.A.	3,07%	CDI	85,27%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC	BAIXO	1,00% A.A.	2,58%	CDI	71,66%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FIC	BAIXO	0,20% A.A.	3,79%	CDI	105,27%
WEATERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	ALTO	0,20% A.A.	-1,71%	IMA-B	114,76%