



RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

outubro/2022

SUMÁRIO

| | |
|------------------------------------------------------------------|-------|
| ANÁLISE DO CENÁRIO ECONÔMICO | PG 03 |
| ECONOMIA BRASILEIRA | PG 04 |
| ECONOMIA MUNDIAL | PG 05 |
| CARTEIRA DE INVESTIMENTOS | PG 06 |
| COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS | PG 07 |
| FUNDO BB RENDA FIXA CURTO PRAZO DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO | PG 11 |
| FUNDO BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL | PG 13 |
| TÍTULOS PÚBLICOS E PRIVADO/XP INVESTIMENTOS | PG 15 |
| PLANO DE AÇÃO | PG 16 |
| COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM OUTUBRO..... | PG 18 |
| ANÁLISE DE DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS | PG 19 |
| POUPANÇA PÚBLICA | PG 22 |
| ENQUADRAMENTO..... | PG 23 |



K
J
M
M
M
M

ANÁLISE DO CENÁRIO ECONÔMICO



Pg 03



m dñz m77 & h

Inflação acelera em cinco das sete capitais componentes do IPC-S

O IPC-S da quarta quadrissemana de outubro de 2022 sobe 0,69% e acumula alta de 5,05% nos últimos 12 meses. Cinco das sete capitais pesquisadas registraram acréscimo em suas taxas de variação.

A tabela a seguir, apresenta as variações percentuais dos municípios das sete capitais componentes do índice, nesta e nas apurações anteriores.

| Municípios | Variação percentual ao mês até | | | | |
|----------------|--------------------------------|------------|------------|------------|------------|
| | 30.09.2022 | 07.10.2022 | 15.10.2022 | 22.10.2022 | 31.10.2022 |
| IPC-S | 0,02 | 0,26 | 0,42 | 0,62 | 0,69 |
| SALVADOR | 0,33 | 0,42 | 0,41 | 0,52 | 0,53 |
| BRASÍLIA | 0,20 | 0,44 | 0,69 | 0,90 | 1,04 |
| BELO HORIZONTE | -0,02 | 0,24 | 0,36 | 0,43 | 0,37 |
| RECIFE | 0,37 | 0,74 | 1,10 | 1,37 | 1,67 |
| RIO DE JANEIRO | 0,19 | 0,34 | 0,40 | 0,57 | 0,62 |
| PORTO ALEGRE | -0,29 | 0,16 | 0,32 | 0,51 | 0,71 |
| SÃO PAULO | -0,08 | 0,11 | 0,30 | 0,55 | 0,55 |

Fonte: FGV IBRE

Confiança Empresarial cai 3,3 pontos em outubro para menor nível desde maio deste ano

O Índice de Confiança Empresarial (ICE) do FGV IBRE cai 3,3 pontos em outubro, para 98,2 pontos, o menor nível desde maio deste ano (97,4 pts.). Em médias móveis trimestrais, o indicador interrompe a sequência de altas iniciada em abril de 2022 e recua ligeiramente, em 0,1 ponto.

"O ICE recua em outubro com piora das expectativas nos quatro setores pesquisados, sinal de que o setor produtivo espera uma desaceleração do nível de atividade nos próximos meses. Há certa resiliência no setor da construção, que continua registrando aumento da carteira de contratos e um bom nível de atividade corrente. No extremo oposto, a desaceleração continua se aprofundando na Indústria, com queda do nível de utilização da capacidade pelo terceiro mês seguido e piora da percepção sobre a procura interna e externa por produtos industriais. No Setor de Serviços, o bom momento do segmento de serviços prestados às famílias vem segurando uma queda mais acentuada da confiança", avalia Aloisio Campelo Jr., Superintendente de Estatísticas do FGV IBRE.

A queda da confiança empresarial de outubro foi motivada pela piora das percepções sobre a situação presente e das expectativas para os próximos meses. O Índice de Situação Atual Empresarial (ISA-E) e o Índice de Expectativas (IE-E) recuaram 2,7 e 4,2 pontos, respectivamente, para 99,3 e 95,9 pontos. O resultado interrompe a sequência de sete altas do ISA-E e de dois meses seguidos do IE-E, levando os indicadores para baixo do nível de neutralidade.

O Índice de Confiança Empresarial (ICE) consolida os índices de confiança dos quatro setores cobertos pelas Sondagens Empresariais produzidas pela FGV IBRE: Indústria, Serviços, Comércio e Construção.

Em outubro, a confiança cedeu em todos os setores que integram o ICE, com quedas mais expressivas na Indústria, Comércio e Serviços. Os resultados foram motivados pela piora das avaliações nos dois horizontes de tempo da pesquisa, exceto na Construção, em que o indicador de situação atual registrou alta de 0,9 pt.. Apenas a confiança da Construção se manteve acima do nível neutro dos 100 pontos

Fonte:FGV IBRE

Fed aumenta juros novamente e taxa chega ao nível mais alto desde 2008

O Federal Reserve (Fed), o banco central dos Estados Unidos, anunciou nesta quarta-feira (2/11) o quarto aumento consecutivo de 0,75 ponto percentual na taxa de juros. Dessa forma, a taxa fica no intervalo de 3,75% a 4%, o nível mais alto desde janeiro de 2008. Os aumentos consecutivos têm o objetivo de conter a inflação, que em setembro ficou em 8,2% no indicador interanual, bem acima da meta de 2% do Fed.

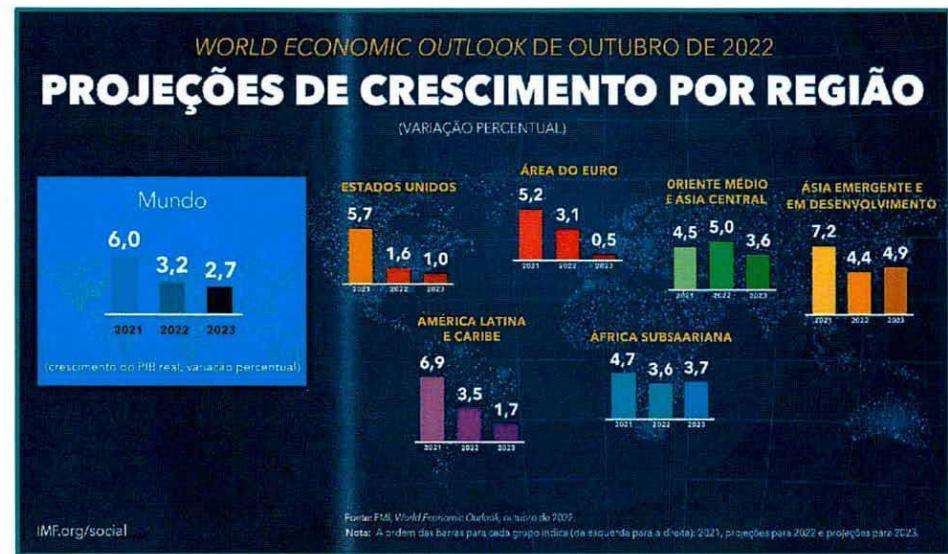
O banco central americano sinalizou que cogita uma mudança de política para os próximos anúncios, com economistas projetando altas dos juros menos acentuadas, para impactar menos a atividade econômica. "Aumentos contínuos na faixa da meta [de juros] serão apropriados para atingir uma postura de política monetária suficientemente restritiva para retornar a inflação a 2%", apontou o Fed em comunicado. "Ao determinar o ritmo de aumentos futuros na faixa da meta, o comitê levará em conta o aperto cumulativo da política monetária, os atrasos com que a política monetária afeta a atividade econômica e a inflação e os desenvolvimentos econômicos e financeiros", acrescentou.

Fonte: Fundo Monetário Internacional

Pg 05

Perspectivas e políticas mundiais

A desaceleração da atividade econômica mundial é mais ampla e acentuada do que se esperava, com uma inflação em níveis que já não se observava em décadas. As perspectivas econômicas dependem de uma calibração bem-sucedida das políticas monetária e fiscal, do curso da guerra na Ucrânia e das perspectivas de crescimento na China. Os riscos permanecem invulgarmente grandes: a postura da política monetária poderá não ser a ideal para reduzir a inflação; as trajetórias políticas divergentes nas maiores economias poderão exacerbar a valorização do dólar americano; o aperto do financiamento mundial poderá levar a uma situação de superendividamento dos mercados emergentes; e um agravamento da crise do setor imobiliário na China poderá minar o crescimento. As autoridades devem se concentrar em restaurar a estabilidade dos preços e aliviar as pressões sobre o custo de vida. A cooperação multilateral continua sendo necessária para acelerar a transição para a energia verde e evitar a fragmentação.



m m foy m m m m m

carteira de investimentos



Pg 06

fm *mr*



mr *AP*

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

ESTRUTURAS E LIMITES

A carteira de investimentos do Fundo Municipal de Previdência do Servidor (FUMPRES) é composta por três fundos de investimentos, sendo que existem 48 fundos 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 2022, elaborada pelo Comitê de Investimentos em dezembro de 2021, as aplicações do FUMPRES deverão ser efetuadas em investimentos de renda fixa, fundos de ações, Multimercado e BDRs, obedecendo aos seguintes critérios:

| SEGMENTO | COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DO FUNDO DE INVESTIMENTO | RESOLUÇÃO CMN 4.963/2021 | % DO CAPITAL ALOCADO | % ALOCAÇÃO POR PL DO FUNDO | % ALOCAÇÃO POR FUNDO |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------|
| RENDA FIXA | TÍTULOS DE EMISSÃO DO TESOURO NACIONAL, | ART. 7º, I, "A" | ATÉ 100% | NÃO SE APLICA | - |
| RENDA FIXA | 100% TÍTULOS DE EMISSÃO DO TESOURO 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 DEFINIDOS NA ALINHA "a" DO INCISO I | 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 | ART. 7º, VI | ATÉ 15% | NÃO SE APLICA | - |
| RENDA FIXA | DEPÓSITOS DE POUPANÇA EM INSTITUIÇÃO FINANCEIRA CONSIDERADA DE BAIXO RISCO DE CRÉDITO (LETTRAS IMOBILIÁRIAS GARANTIDAS) | ART. 7º, V | ATÉ 20% | NÃO SE APLICA | - |
| RENDA VARIÁVEL EXTERIOR | FUNDOS DE AÇÕES EM GERAL FUNDOS MULTIMERCADO FUNDOS BDR NÍVEL I | ART. 8º, II, a ART. 8º, III ART. 9º, III | ATÉ 20% ATÉ 10% ATÉ 10% | ATÉ 5% ATÉ 5% ATÉ 5% | - |

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

A tabela abaixo relaciona os fundos credenciados do FUMPRES com aplicações no mês de outubro de 2022, com a sua classificação de risco, taxa de administração, rentabilidade em 2022, rentabilidade nos últimos 12 meses, o índice de comparação (benchmark), e o percentual da rentabilidade do fundo em relação ao seu benchmark em 2022 e nos últimos 12 meses.

Observamos que a carteira é composta por um *fundo classificado como de risco baixo (com rentabilidades de 10,21% em 2022)* e *dois de risco muito baixo (com rentabilidade de 7,57% e 9,28% em 2022)*.

| FUNDO CREDENCIADO | CLASSIFICAÇÃO DE RISCO | TAXA DE ADMNISTRAÇÃO | RENTABILIDADE EM 2022 | RENTABILIDADE 12 MESES | BENCHMARK | % BENCHMARK EM 2022 | %BENCHMARK 12 MESES |
|---------------------------------------------------------------------|------------------------|----------------------|-----------------------|------------------------|-----------|---------------------|---------------------|
| BRADESCO FIC FIREND FIXA CURTO PRAZO PODER | MUITO BAIXO | 1,5% A.A. | 7,57% | 8,85% | CDI | 82,05% | 76,89% |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO | MUITO BAIXO | 0,50% A.A. | 9,28% | 10,64% | CDI | 92,70% | 92,44% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FIC | BAIXO | 0,20% A.A. | 10,21% | 11,80% | CDI | 101,99% | 102,52% |

Handwritten signatures and initials are present at the bottom right of the page, appearing to be signatures of the individuals involved in the document's preparation or approval.

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

Pg 09

A tabela abaixo relaciona os Títulos Públicos e Privados com aplicação do FUMPRES referente a Receita Geral no mês de outubro/2022 com seus respectivos resultados. Dentre os Títulos relacionados o que obteve o melhor desempenho no mês em apreço foi a LTN que é um pré fixado, com um percentual de 1,02%.

| RESULTADO DAS APLICAÇÕES DO FUMPRES EM TÍTULOS PÚBLICOS E PRIVADOS RECEITA GERAL NO MÊS DE OUTUBRO/2022 | | | | | | | | | | |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|------------------------------|-----------------|-----------------------|---------------------|------------------------|------------------|------------------------|----------------------|----------------------------------------------------------------------------|
| DATA DA APLICAÇÃO | VENCIMENTO/RESGATE | TIPO DE TÍTULO | TAXA CONTRATADA | SALDO EM 31/09/2022 | APLICAÇÃO OUTUBRO | SALDO ATUAL 31/10/2022 | RESGASTE OUTUBRO | RENDIMENTO MÊS OUTUBRO | % RENDIMENTO OUTUBRO | % DO PL DO FUMPRES - RECEITA GERAL APlicado EM TÍTULOS PÚBLICOS E PRIVADOS |
| 18/08/2021 | 01/01/2023 | NTN-F 2023 | 8,45% | 9.964.069,94 | ----- | 10.028.425,77 | ----- | 64.355,83 | 0,65% | |
| 19/03/2021 | 01/01/2025 | NTN-F 2025 | 7,53% | 189.893,49 | ----- | 190.990,79 | ----- | 1.097,30 | 0,58% | |
| 20/04/2021 | 01/01/2025 | NTN-F 2025 | 7,92% | 192.763,75 | ----- | 193.933,35 | ----- | 1.169,60 | 0,61% | |
| 19/05/2021 | 01/01/2025 | NTN-F 2025 | 8,25% | 192.632,33 | ----- | 193.848,10 | ----- | 1.215,77 | 0,63% | |
| 17/06/2021 | 01/01/2025 | NTN-F 2025 | 7,97% | 193.646,72 | ----- | 194.828,84 | ----- | 1.182,12 | 0,61% | |
| 22/07/2021 | 01/01/2025 | NTN-F 2025 | 8,04% | 202.955,70 | ----- | 204.205,15 | ----- | 1.249,45 | 0,62% | |
| 01/07/2021 | 01/01/2025 | NTN-F 2025 | 8,08% | 35.039,33 | ----- | 35.256,08 | ----- | 216,75 | 0,62% | |
| 22/09/2021 | 01/01/2025 | NTN-F 2025 | 9,98% | 210.119,38 | ----- | 211.711,76 | ----- | 1.592,38 | 0,76% | |
| 01/10/2021 | 01/01/2023 | NTN-F 2023 | 9,17% | 29.911.546,73 | ----- | 30.120.553,13 | ----- | 209.006,40 | 0,70% | |
| 13/10/2021 | 01/01/2023 | NTN-F 2023 | 9,00% | 164.232,73 | ----- | 165.359,85 | ----- | 1.127,12 | 0,69% | |
| 20/10/2021 | 01/01/2025 | NTN-F 2025 | 10,40% | 210.540,07 | ----- | 212.199,82 | ----- | 1.659,75 | 0,79% | |
| 26/10/2021 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 4,84%+IPCA | 15.841.188,76 | ----- | 15.916.156,49 | ----- | 74.967,73 | 0,47% | |
| 04/11/2021 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 5,52%+IPCA | 5.280.451,74 | ----- | 5.308.160,63 | ----- | 27.708,89 | 0,52% | |
| 17/11/2021 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 5,05%+IPCA | 613.555,07 | ----- | 616.556,37 | ----- | 3.001,30 | 0,49% | |
| 23/11/2021 | 15/08/2024 | NTN-B 2024 | 5,26%+IPCA | 225.799,77 | ----- | 226.940,15 | ----- | 1.140,38 | 0,51% | |
| 22/12/2021 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 5,85%+IPCA | 26.604.178,29 | ----- | 26.750.416,83 | ----- | 146.238,54 | 0,55% | |
| 21/01/2021 | 10/01/2025 | LETRA FINANCEIRA DO BRADESCO | 6,00%+IPCA | 5.378.119,86 | ----- | 5.385.950,22 | ----- | 7.830,36 | 0,15% | |
| 17/05/2022 | 16/05/2024 | LETRA FINANCEIRA DO BANCO XP | 6,2%+IPCA | 2.146.813,55 | ----- | 2.159.014,72 | ----- | 12.201,17 | 0,57% | |
| 28/10/2022 | 09/05/2023 | LETRA FINANCEIRA DO BRADESCO | 14,00% | ----- | 9.956.330,07 | 9.961.508,25 | ----- | 5.178,18 | 0,05% | |
| 04/01/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 5,59%+IPCA | 2.082.182,16 | ----- | 2.093.219,53 | ----- | 11.037,37 | 0,53% | |
| 16/02/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 6,26%+IPCA | 690.116,52 | ----- | 694.122,68 | ----- | 4.006,16 | 0,58% | |
| 02/02/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 6,48%+IPCA | 3.152.100,79 | ----- | 3.170.921,66 | ----- | 18.820,87 | 0,60% | |
| 12/04/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 5,79%+IPCA | 2.019.151,24 | ----- | 2.030.158,29 | ----- | 11.007,05 | 0,55% | |
| 12/04/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 6,00%+IPCA | 1.511.571,57 | ----- | 1.520.051,80 | ----- | 8.480,23 | 0,56% | |
| 31/03/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 5,42%+IPCA | 11.183.174,94 | ----- | 11.241.013,27 | ----- | 57.838,33 | 0,52% | |
| 25/02/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 6,36%+IPCA | 4.158.556,49 | ----- | 4.183.010,07 | ----- | 24.453,58 | 0,59% | |
| 29/07/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 7,95%+IPCA | 10.043.424,42 | ----- | 10.114.381,00 | ----- | 70.956,58 | 0,71% | |
| 18/08/2022 | 01/01/2023 | LTN-2023 | 13,70% | 655.614,50 | ----- | 662.329,33 | ----- | 6.714,83 | 1,02% | |
| 16/08/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 7,88%+IPCA | 18.078.712,53 | ----- | 18.205.520,16 | ----- | 126.807,63 | 0,70% | |
| 16/08/2022 | 01/01/2023 | LTN-2023 | 13,67% | 30.492.108,53 | ----- | 30.803.872,05 | ----- | 311.763,52 | 1,02% | |
| 25/08/2022 | 01/10/2022 | LTN-2022 | 13,68% | 10.127.845,65 | ----- | ----- | 10.133.000,00 | 5.154,35 | 0,05% | |
| TOTAIS | | | | 191.752.106,55 | 9.956.330,07 | 192.794.616,19 | | 1.219.179,54 | 0,43% | 70,86% |

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

Pg 10

A tabela abaixo relaciona os Títulos Públicos com aplicação do FUMPRES referente aos recursos da Poupança Pública Previdenciária no mês de outubro/2022 com seus respectivos resultados. Dentre os Títulos relacionados o que obteve o melhor desempenho no mês em apreço foi a NTN-F 2031 que é um Título pré fixado, com um percentual de 0,83%.

| RESULTADO DAS APLICAÇÕES DO FUMPRES EM TÍTULOS PÚBLICOS RECEITA POUPANÇA PREVIDENCIÁRIA NO MÊS DE OUTUBRO/2022 | | | | | | | | | | |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|----------------|-----------------|----------------------|-------------------|------------------------|------------------|------------------------|----------------------|----------------------------------------------------------|
| DATA DA APLICAÇÃO | VENCIMENTO/RESGATE | TIPO DE TÍTULO | TAXA CONTRATADA | SALDO EM 30/09/2022 | APLICAÇÃO OUTUBRO | SALDO ATUAL 31/10/2022 | RESGASTE OUTUBRO | RENDIMENTO MÊS outubro | % RENDIMENTO outubro | % DO PL DA POUPANÇA PÚBLICA APLICADO EM TÍTULOS PÚBLICOS |
| 05/05/2022 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,67%+IPCA | 798.711,75 | ----- | 802.993,14 | ----- | 4.281,39 | 0,54% | |
| 04/08/2021 | 01/01/2031 | NTN-F 2031 | 9,54% | 838.720,37 | ----- | 844.807,74 | ----- | 6.087,37 | 0,73% | |
| 17/05/2022 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,56%+IPCA | 298.110,86 | ----- | 299.684,12 | ----- | 1.573,26 | 0,53% | |
| 05/03/2021 | 01/01/2031 | NTN-F 2031 | 8,45% | 6.978.213,11 | ----- | 7.023.283,91 | ----- | 45.070,80 | 0,65% | |
| 31/03/2021 | 01/01/2031 | NTN-F 2031 | 9,16% | 925.329,54 | ----- | 931.788,49 | ----- | 6.458,95 | 0,70% | |
| 04/05/2021 | 01/01/2031 | NTN-F 2031 | 9,12% | 825.208,88 | ----- | 830.944,80 | ----- | 5.735,92 | 0,70% | |
| 19/05/2021 | 01/01/2031 | NTN-F 2031 | 9,35% | 80.677,86 | ----- | 81.252,22 | ----- | 574,36 | 0,71% | |
| 07/06/2021 | 01/01/2031 | NTN-F 2031 | 8,89% | 819.004,80 | ----- | 824.559,51 | ----- | 5.554,71 | 0,68% | |
| 01/07/2021 | 01/01/2031 | NTN-F 2031 | 9,09% | 433.706,60 | ----- | 436.711,71 | ----- | 3.005,11 | 0,69% | |
| 06/07/2021 | 01/01/2031 | NTN-F 2031 | 9,25% | 844.115,26 | ----- | 850.062,92 | ----- | 5.947,66 | 0,70% | |
| 09/09/2021 | 01/01/2031 | NTN-F 2031 | 10,85% | 839.933,88 | ----- | 846.828,66 | ----- | 6.894,78 | 0,82% | |
| 05/10/2021 | 01/01/2031 | NTN-F 2031 | 11,00% | 789.695,60 | ----- | 796.263,44 | ----- | 6.567,84 | 0,83% | |
| 05/10/2021 | 01/01/2031 | NTN-F 2031 | 11,00% | 44.846,91 | ----- | 45.219,90 | ----- | 372,99 | 0,83% | |
| 05/03/2021 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 3,66%+IPCA | 3.927.504,54 | ----- | 3.942.545,71 | ----- | 15.041,17 | 0,38% | |
| 27/10/2021 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,40%+IPCA | 863.815,10 | ----- | 868.458,43 | ----- | 4.643,33 | 0,54% | |
| 17/11/2021 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,12%+IPCA | 117.689,75 | ----- | 118.271,73 | ----- | 581,98 | 0,49% | |
| 02/12/2021 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,13%+IPCA | 906.259,18 | ----- | 910.743,82 | ----- | 4.484,64 | 0,49% | |
| 23/12/2021 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,12%+IPCA | 1.992.008,07 | ----- | 2.001.858,56 | ----- | 9.850,49 | 0,49% | |
| 11/04/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 5,70%+IPCA | 421.037,50 | ----- | 423.304,21 | ----- | 2.266,71 | 0,54% | |
| 11/04/2022 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,37%+IPCA | 418.156,41 | ----- | 420.303,43 | ----- | 2.147,02 | 0,51% | |
| 04/01/2022 | 01/01/2031 | NTN-F 2031 | 10,90% | 622.228,70 | ----- | 627.358,86 | ----- | 5.130,16 | 0,82% | |
| 02/02/2022 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,52% + IPCA | 893.149,52 | ----- | 897.836,64 | ----- | 4.687,12 | 0,52% | |
| 03/03/2022 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,69% + IPCA | 863.976,72 | ----- | 868.431,60 | ----- | 4.454,88 | 0,52% | |
| 03/06/2022 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,72%+IPCA | 824.354,54 | ----- | 828.805,16 | ----- | 4.450,62 | 0,54% | |
| 28/06/2022 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,75%+IPCA | 917.315,65 | ----- | 922.288,08 | ----- | 4.972,43 | 0,54% | |
| 03/08/2022 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 6,17%+IPCA | 941.557,38 | ----- | 946.960,10 | ----- | 5.402,72 | 0,57% | |
| TOTAIS | | | | 28.225.328,48 | ----- | 28.391.566,89 | ----- | 166.238,40 | 0,62% | 91,52% |

FUNDO BB RENDA FIXA C.P. DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO

Pg 11

SOBRE O FUNDO

O BB Renda Fixa Curto Prazo Diferenciado Setor Público é indicado para os Governos Estaduais e Municipais, suas Autarquias e Fundações que desejam liquidez e rentabilidade diárias. O fundo aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que apresentem carteira composta, exclusivamente, por títulos públicos federais pré-fixados ou pós-fixados, desde que indexados e/ou sintetizados para CDI/SELIC. A carteira é gerida e administrada pela BB Gestão de Recursos – Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (BBDTVM).

O fundo, que funciona desde **21 de fevereiro de 2005**, tem grau de risco classificado como **muito baixo** e categoria ANBIMA Renda Fixa Duração Baixa Soberano, com taxa de administração de 0,50% ao ano e liquidez imediata (D+0).

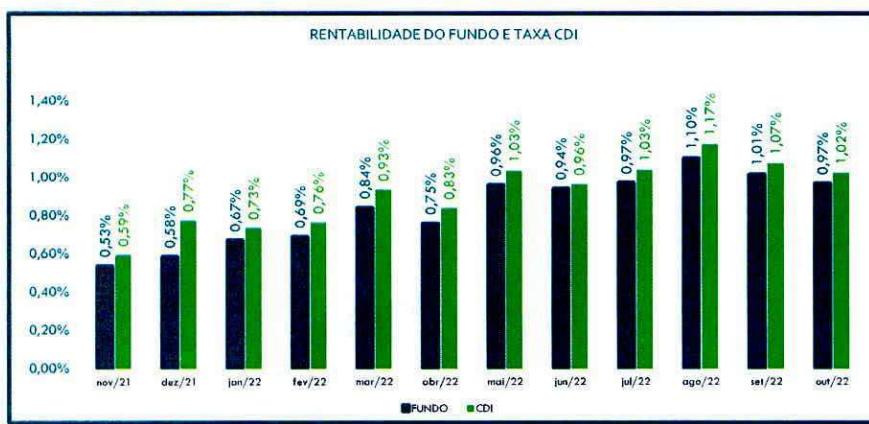
RESULTADO HISTÓRICO

O BB Renda Fixa Curto Prazo Diferenciado Setor Público possui rentabilidade de 0,97% em outubro de 2022 (95,09% do CDI acumulado no mesmo período).

A taxa de rentabilidade anual do fundo mostra que um pico foi atingido em 2016 (13,38%), seguido de queda em 2017 (9,40%) e 2018 (5,89%).

O patrimônio líquido do fundo em outubro de 2022 foi de R\$ 28.256.194.855,33

A rentabilidade mensal quando comparada com o CDI, ficou em 95,09%, como indica o gráfico "Rentabilidade do Fundo e Taxa CDI" a seguir.



Em outubro de 2022 a posição da carteira estava composta por 80,74% de operação compromissada over e 19,26% de LFT (letras financeiras do tesouro).

O gráfico "Rendimento Mensal do Fundo" mostra o resultado de rendimento do fundo nos últimos 12 meses, com um ganho de aproximadamente R\$ 28.234 no mês corrente e aproximadamente R\$ 464.413 de saldo acumulado nos últimos 12 meses.



DESEMPENHO EM OUTUBRO

O fundo BB Renda Fixa Curto Prazo Diferenciado Setor Público começou outubro com um saldo de aproximadamente R\$ 17.313 mi. Ao longo do mês foram aplicados aproximadamente R\$ 40.072 milhões e (R\$ 34.746) milhões de resgates. O saldo final, registrado no mês de outubro de 2022, foi de R\$ 22.667.212,20 milhões – com um rendimento acumulado de R\$ 28.234,78 no mês.

Em outubro o montante do capital médio investido (por dia) no mês girou em torno de R\$ 3.263 milhões. O rendimento médio por dia chegou a R\$ 1.486,04. A média da taxa de retorno do investimento (TRI), calculada com o rendimento total em razão do capital médio investido, fechou outubro em 0,066451%.

mr

mt77

2

SP

**FUNDO BB RENDA FIXA C.P.
DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO**

Pg 12

A planilha a seguir detalha a movimentação financeira do fundo BB Renda Fixa Curto Prazo Diferenciado Setor Público durante o mês de outubro de 2022, e foi elaborada com base nos extratos bancários emitidos dia-a-dia.

A movimentação líquida entre aplicações e resgates foi de 5.325.408,94 milhões. Ocorreram movimentações de aplicações e resgates durante o período. As aplicações financeiras totalizaram aproximadamente R\$ 40,072 milhões, sendo a maior ocorrida no dia 31 de outubro no valor de R\$ 20.000.000,00.

O saldo total de resgates foi de aproximadamente (R\$34.476) milhões, sendo a maior movimentação ocorrida no dia 1 de outubro valor de (R\$ 15) milhões.

O mês de outubro iniciou com o saldo de aproximadamente R\$17.313 milhões e finalizou com o saldo aproximado de R\$ 22.667 milhões. O saldo de rendimento acumulado foi de R\$28.234,78.

| DATA | SALDO INICIAL | APLICAÇÃO | RESGATE | CAPITAL INVESTIDO | RENDIMENTO DIÁRIO | SALDO FINAL | VALOR DA COTA | RENTABILIDADE DIÁRIA | RENDIMENTO ACUMULADO | TRI |
|-------------|----------------------|------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|--------------------|----------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------|
| 31/10/2022 | 2.671.772,20 | 20.000.000,00 | -4.560,00 | 22.667.212,20 | 0,00 | 22.667.212,20 | 5,073162652 | 0,000000% | R\$ 28.234,78 | 0,000000% |
| 28/10/2022 | 1.521.649,56 | 1.149.605,32 | -1.622,02 | 2.669.632,86 | 2.139,34 | 2.671.772,20 | 5,073162652 | 0,096600% | R\$ 28.234,78 | 0,080136% |
| 26/10/2022 | 2.530.390,21 | 0,00 | -1.009.479,03 | 1.520.911,18 | 738,38 | 1.521.649,56 | 5,068266711 | 0,048548% | R\$ 26.095,44 | 0,048549% |
| 25/10/2022 | 494.892,68 | 5.020.581,89 | -2.986.301,60 | 2.529.172,97 | 1.217,24 | 2.530.390,21 | 5,065807361 | 0,048128% | R\$ 25.357,06 | 0,048128% |
| 24/10/2022 | 794.655,01 | 0,00 | -300.000,00 | 494.655,01 | 237,67 | 494.892,68 | 5,063370457 | 0,048047% | R\$ 24.139,82 | 0,048048% |
| 21/10/2022 | 798.106,92 | 0,00 | -3.835,63 | 794.271,29 | 383,72 | 794.655,01 | 5,060938840 | 0,048312% | R\$ 23.902,15 | 0,048311% |
| 20/10/2022 | 2.815.337,90 | 0,00 | -2.017.614,66 | 797.723,24 | 383,68 | 798.106,92 | 5,058494962 | 0,048096% | R\$ 23.518,43 | 0,048097% |
| 19/10/2022 | 815.424,71 | 2.124.754,71 | -126.202,11 | 2.813.977,31 | 1.360,59 | 2.815.337,90 | 5,056063179 | 0,048351% | R\$ 23.134,75 | 0,048351% |
| 18/10/2022 | 615.030,51 | 200.000,00 | 0,00 | 815.030,51 | 394,20 | 815.424,71 | 5,053619710 | 0,048368% | R\$ 21.774,16 | 0,048366% |
| 17/10/2022 | 615.190,58 | 0,00 | -455,76 | 614.734,82 | 295,69 | 615.030,51 | 5,051176550 | 0,048099% | R\$ 21.379,96 | 0,048100% |
| 14/10/2022 | 614.893,71 | 0,00 | 0,00 | 614.893,71 | 296,87 | 615.190,58 | 5,048748169 | 0,048280% | R\$ 21.084,27 | 0,048280% |
| 13/10/2022 | 614.598,97 | 0,00 | 0,00 | 614.598,97 | 294,74 | 614.893,71 | 5,046311820 | 0,047958% | R\$ 20.787,40 | 0,047956% |
| 11/10/2022 | 1.614.302,90 | 0,00 | -1.000.000,00 | 614.302,90 | 296,07 | 614.598,97 | 5,043892891 | 0,048195% | R\$ 20.492,66 | 0,048196% |
| 10/10/2022 | 1.603.095,47 | 730.429,83 | -720.000,00 | 1.613.525,30 | 777,60 | 1.614.302,90 | 5,041463157 | 0,048193% | R\$ 20.196,59 | 0,048193% |
| 07/10/2022 | 924.538,02 | 713.241,75 | -35.461,82 | 1.602.317,95 | 777,52 | 1.603.095,47 | 5,039034677 | 0,048524% | R\$ 19.418,99 | 0,048525% |
| 06/10/2022 | 5.541.712,74 | 0,00 | -4.617.623,20 | 924.089,54 | 448,48 | 924.538,02 | 5,036590730 | 0,048533% | R\$ 18.641,47 | 0,048532% |
| 05/10/2022 | 12.462.732,05 | 0,00 | -6.923.688,23 | 5.539.043,82 | 2.668,92 | 5.541.712,74 | 5,034147494 | 0,048184% | R\$ 18.192,99 | 0,048184% |
| 04/10/2022 | 2.323.043,21 | 10.133.654,32 | 0,00 | 12.456.697,53 | 6.034,52 | 12.462.732,05 | 5,031723023 | 0,048444% | R\$ 15.524,07 | 0,048444% |
| 03/10/2022 | 17.313.568,48 | 0,00 | -15.000.014,82 | 2.313.553,66 | 9.489,55 | 2.323.043,21 | 5,029286634 | 0,096390% | R\$ 9.489,55 | 0,410172% |

FUNDO BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL

Pg 13

SOBRE O FUNDO

O BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI Longo Prazo Perfil FIC é destinado a receber recursos dos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPSs), e tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas através da diversificação dos ativos financeiros que compõem a sua carteira mediante aplicação de seus recursos em cotas de fundos de investimento, tendo como parâmetro o CDI.

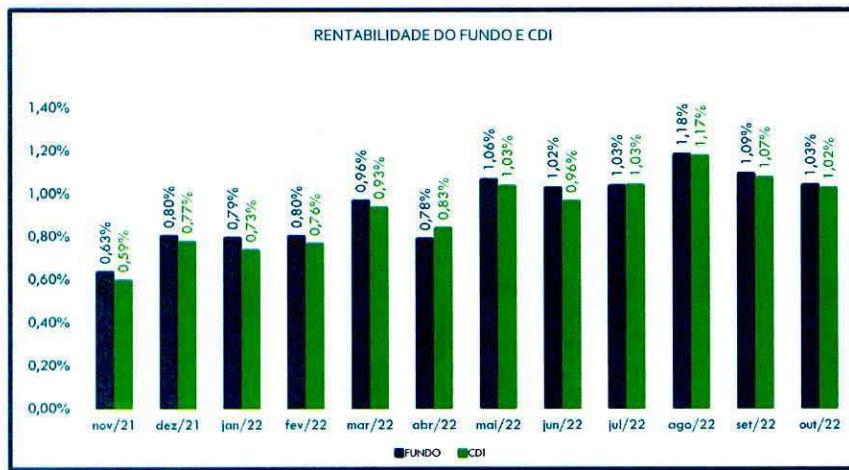
O fundo, que funciona desde **28 de fevereiro de 2011**, tem grau de risco classificado como **baixo** e categoria ANBIMA **Renda Fixa Duração Baixo Grau de Investimento**, com taxa de administração de 0,20% ao ano e liquidez D+0. Destacamos que, por aplicar seus recursos em fundo de investimento que possui taxa de administração de até 0,10% a.a., o custo total de administração pode chegar a 0,30% ao ano.

RESULTADO HISTÓRICO

O BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI Longo Prazo Perfil FIC possui rentabilidade de 1,03% em outubro de 2022, ante um desempenho de 1,02% CDI. A taxa de rentabilidade anual do fundo mostra que o pico foi atingido em 2015 (15,38%), seguido de quedas sucessivas até fechar 2018 em 9,22%.

O patrimônio líquido do fundo em outubro de 2022 foi de R\$ 12.427.649.222,70 e concentra seus investimentos em espécies de ativos.

A rentabilidade mensal foi de 102% do CDI no período, como indica o gráfico "Rentabilidade do Fundo e CDI" a seguir.



Em outubro de 2022 a posição da carteira estava composta por 58,55% títulos públicos federais, 15,41% de Letra Financeira não ligada, 13,14% de operações compromissadas over, 8,67% de debêntures, 3,64% Letra Financeira subordinada BB pós, 0,59% outros.

O gráfico **"Rendimento Mensal do Fundo"** mostra o resultado de rendimento no mês de outubro no valor de R\$ 766.395,91 e nos últimos 12 meses, com um ganho acumulado de R\$ 4.121.338,60



DESEMPENHO EM OUTUBRO

O fundo BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI Longo Prazo Perfil FIC começou outubro com um saldo superior a R\$ 54.187 milhões. O saldo final registrado em outubro de 2022, foi de aproximadamente R\$ 56.638 milhões – com um rendimento de R\$ 766.395,91 no mês.

O capital médio investido (por dia) no mês girou em torno de R\$ 74.027 milhões. O rendimento médio por dia chegou a R\$ 40.336,63. A média da taxa de retorno do investimento (TRI), calculada como o rendimento total em razão do capital médio investido, fechou em 0,055524% .

cpm77

✓

✓

FUNDO BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL

Pg 14

A planilha a seguir detalha a movimentação financeira do fundo BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI Longo Prazo Perfil FIC durante o mês de outubro de 2022, e foi elaborada com base nos extratos bancários emitidos dia-a-dia.

Houveram movimentações de resgate no valor de R\$ (94.400) milhões. O mês de outubro finalizou com o rendimento acumulado de R\$ 766.395,91. A média do capital investido no período foi de aproximadamente R\$ 74.027 milhões, enquanto que a média do rendimento diário foi R\$ 40.336,63. O fundo iniciou o período com o saldo de aproximadamente R\$ 54.187 milhões e finalizou o período com o saldo aproximado de R\$ 56.638 milhões. A média da TRI do mês de outubro ficou em 0,055524%.

| DATA | SALDO INICIAL | APLICAÇÃO | RESGATE | CAPITAL INVESTIDO | RENDIMENTO DIÁRIO | SALDO FINAL | VALOR DA COTA | RENTABILIDADE DIÁRIA | RENDIMENTO ACUMULADO | TRI |
|------------|---------------|---------------|----------------|-------------------|-------------------|---------------|---------------|----------------------|----------------------|-----------|
| 31/10/2022 | 76.598.631,66 | 0,00 | -20.000.000,00 | 56.598.631,66 | 39.369,00 | 56.638.000,66 | 2,654095207 | 0,051396% | 766.395,91 | 0,069558% |
| 28/10/2022 | 86.514.797,65 | 259,91 | -10.000.000,00 | 76.515.057,56 | 83.574,10 | 76.598.631,66 | 2,652731796 | 0,102468% | 727.026,91 | 0,109226% |
| 26/10/2022 | 80.407.161,57 | 6.066.572,64 | 0,00 | 86.473.734,21 | 41.063,44 | 86.514.797,65 | 2,650016365 | 0,051069% | 643.452,81 | 0,047487% |
| 25/10/2022 | 46.383.755,33 | 34.000.000,00 | 0,00 | 80.383.755,33 | 23.406,24 | 80.407.161,57 | 2,648663709 | 0,050462% | 602.389,37 | 0,029118% |
| 24/10/2022 | 77.440.825,26 | 0,00 | -31.100.000,00 | 46.340.825,26 | 42.930,07 | 46.383.755,33 | 2,647327811 | 0,051560% | 578.983,13 | 0,092640% |
| 21/10/2022 | 77.403.997,09 | 0,00 | 0,00 | 77.403.997,09 | 36.828,17 | 77.440.825,26 | 2,645963551 | 0,051455% | 536.053,06 | 0,047579% |
| 20/10/2022 | 75.364.579,12 | 2.000.000,00 | 0,00 | 77.364.579,12 | 39.417,97 | 77.403.997,09 | 2,644602772 | 0,052303% | 499.224,89 | 0,050951% |
| 19/10/2022 | 77.324.091,63 | 0,00 | -2.000.000,00 | 75.324.091,63 | 40.487,49 | 75.364.579,12 | 2,643220288 | 0,052361% | 459.806,92 | 0,053751% |
| 18/10/2022 | 77.484.371,22 | 31.100.000,00 | -31.300.000,00 | 77.284.371,22 | 39.720,41 | 77.324.091,63 | 2,641837001 | 0,051262% | 419.319,43 | 0,051395% |
| 17/10/2022 | 77.442.794,70 | 0,00 | 0,00 | 77.442.794,70 | 41.576,52 | 77.484.371,22 | 2,640483424 | 0,053687% | 379.599,02 | 0,053687% |
| 14/10/2022 | 77.402.382,35 | 0,00 | 0,00 | 77.402.382,35 | 40.412,35 | 77.442.794,70 | 2,639066595 | 0,052211% | 338.022,50 | 0,052211% |
| 13/10/2022 | 77.362.562,17 | 0,00 | 0,00 | 77.362.562,17 | 39.820,18 | 77.402.382,35 | 2,637689438 | 0,051472% | 297.610,15 | 0,051472% |
| 11/10/2022 | 76.323.048,14 | 1.000.000,00 | 0,00 | 77.323.048,14 | 39.514,03 | 77.362.562,17 | 2,636332461 | 0,051772% | 257.789,97 | 0,051103% |
| 10/10/2022 | 76.282.948,75 | 0,00 | 0,00 | 76.282.948,75 | 40.099,39 | 76.323.048,14 | 2,634968283 | 0,052374% | 218.275,94 | 0,052567% |
| 07/10/2022 | 76.243.023,26 | 0,00 | 0,00 | 76.243.023,26 | 39.925,49 | 76.282.948,75 | 2,633588960 | 0,052558% | 178.176,55 | 0,052366% |
| 06/10/2022 | 76.203.860,43 | 0,00 | 0,00 | 76.203.860,43 | 39.162,83 | 76.243.023,26 | 2,632205513 | 0,051392% | 138.251,06 | 0,051392% |
| 05/10/2022 | 69.251.183,80 | 6.916.916,89 | 0,00 | 76.168.100,69 | 35.759,74 | 76.203.860,43 | 2,630853460 | 0,051638% | 99.088,23 | 0,046948% |
| 04/10/2022 | 69.215.552,02 | 0,00 | 0,00 | 69.215.552,02 | 35.631,78 | 69.251.183,80 | 2,629495648 | 0,051479% | 63.328,49 | 0,051479% |
| 03/10/2022 | 54.187.855,31 | 15.000.000,00 | 0,00 | 69.187.855,31 | 27.696,71 | 69.215.552,02 | 2,628142695 | 0,051112% | 27.696,71 | 0,040031% |

J
J
J
J

pmj
AS

NTN-B

Sigla para Nota do Tesouro Nacional tipo B, a NTN-B é um tipo de Título Público do Tesouro Direto. Trata-se de uma opção de renda fixa, com retorno pós-fixado e atrelado à taxa de juros semestrais. Além do resgate ao final do contrato, tem retorno semestral.

Em relação à segurança, trata-se de um investimento de renda fixa, e o risco do não pagamento pelo governo é baixo. Portanto, é ideal para aliar retorno e proteção. O Tesouro Direto, no geral, tem rentabilidade prefixada ou pós-fixada. No caso da NTN-B, a possibilidade de ganhos depende apenas da movimentação do IPCA. Com a inflação mais alta, os ganhos também são maiores.

NTN-F

É um título do Tesouro Direto com prazo e rentabilidade prefixada. Ou seja, é sabido exatamente quanto tempo levará para sacar o dinheiro e quanto receberá ao final do investimento.

Por ser um título público, ele é segurado pelo Tesouro Nacional. O NTN-F é um investimento de liquidez diária. Isso significa que pode ser vendido a qualquer momento, mesmo antes da data de vencimento.

LTN

Sigla para Letra do Tesouro Nacional. Como se trata de um investimento pré-fixado. Isso significa dizer que seu retorno é conhecido de maneira antecipada, já no momento da contratação. Sua liquidez é diária, porém caso liquide antes do vencimento será pelo valor de mercado e não pela taxa contratada.

| TÍTULO | RENDIMENTO |
|-----------------------------------------|-------------------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS – NTN-F23 -F25 - F31 | R\$ 381.273,12 |
| TÍTULOS PÚBLICOS – NTN-B22, 23, 24 e 35 | R\$ 655.302,40 |
| TÍTULOS PÚBLICOS LTN/23 | R\$ 323.632,70 |
| TÍTULO PRIVADO (LF BRADESCO/ XP) | R\$ 25.209,71 |
| TOTAL | R\$ 1.385.417,94 |

an *fr* *pm77* *r* *kp*

PLANO DE AÇÃO



JM
m

MMX
X

PLANO DE AÇÃO MENSAL

Pg 17

Plano de Ação Mensal

O Plano de ação mensal de investimentos consiste no planejamento de atividades visando um atingimento da Meta Atuarial, definida na política de Investimentos do Fundo Municipal de Previdência do Servidor – FUMPRES.

A Meta Atuarial do FUMPRES definida na política de Investimentos para o exercício 2022 é de 4,81% + IPCA.

Para o mês de novembro /2022, foram definidas as seguintes ações:

| OBJETIVO | AÇÃO | PRAZO |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| Rentabilidade mensal da carteira de investimentos, buscando o melhor desempenho possível, objetivando o atingimento da Meta Atuarial anual, 4,81% + IPCA. | Assessorar na definição, execução e deliberação da Política de Investimentos quando da realização da Política de Investimentos; | anual |
| | Acompanhar mensalmente a Política de Investimentos através do Relatório Mensal da Carteira de Investimentos o qual é sempre apresentado nas reuniões do Comitê de Investimentos; | mensal |
| | Avaliação dos gestores dos ativos em que os recursos estão aplicados e na tomada de decisões a eles relacionadas; | mensal |
| | Acompanhar a gestão dos ativos financeiros dos Fundos e debater a performance alcançada pelos seus investimentos de acordo com objetivos estabelecidos pela Política de Investimentos, através da análise do Relatório Mensal da Carteira de Investimentos; | mensal |
| | Assessorar os trabalhos de avaliação e seleção de gestores externos de investimentos (Credenciamentos); | mensal |
| | Avaliar os resultados dos investimentos e sugerir mudanças, sempre que necessário, para assegurar conformidade às diretrizes de investimentos e para determinar o seu grau de sucesso; | mensal |
| | Analizar, mensalmente, o cenário macroeconômico e as expectativas de mercado de modo a auxiliar na tomada de decisão de investimento ou desinvestimento; | mensal |
| | Acompanhar e monitorar o enquadramento dos investimentos de acordo com os limites previstos na Resolução CMN nº 4.963/2021 e na Política de Investimentos. | mensal |

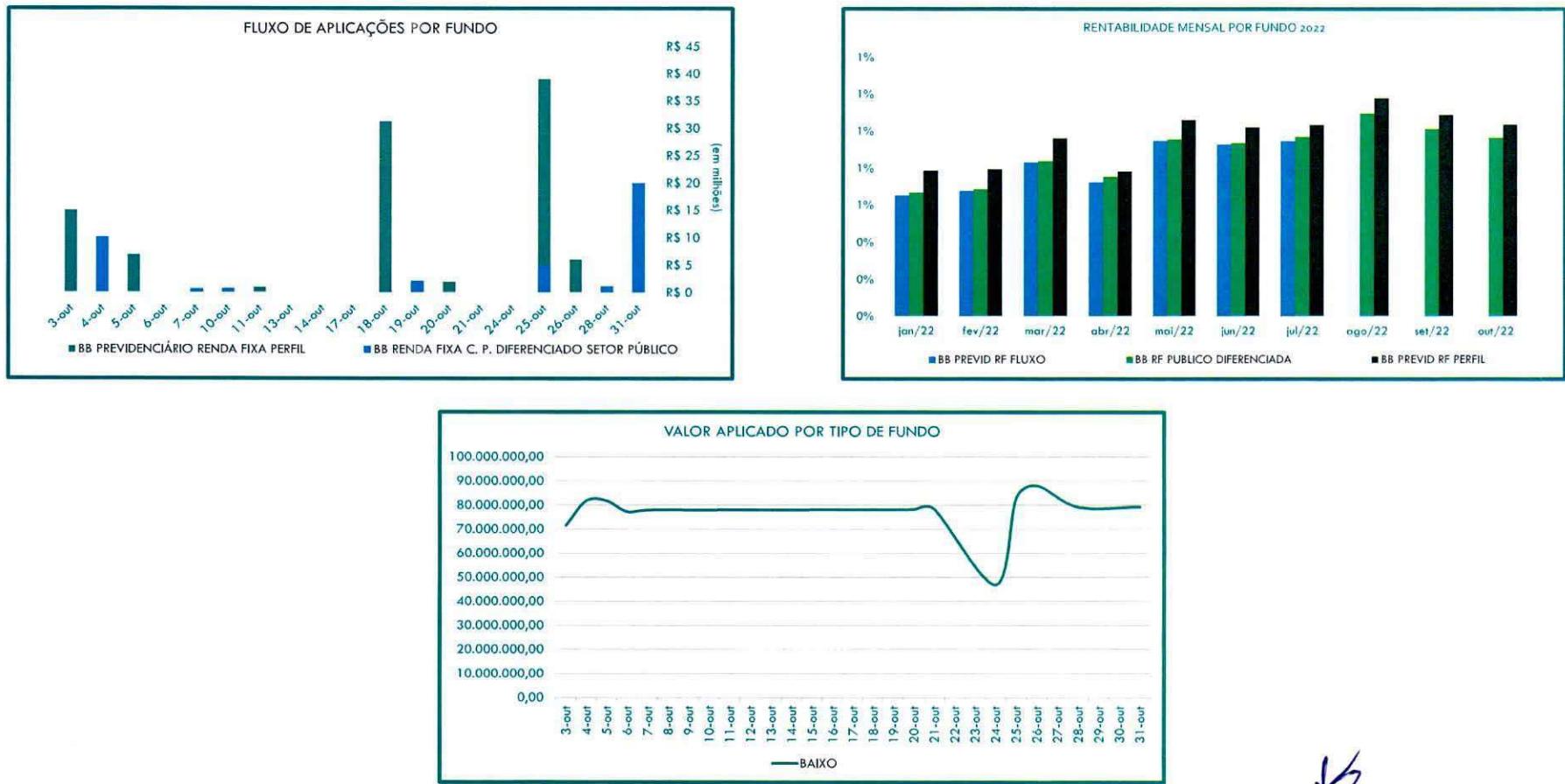
[Handwritten signatures and initials]

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

Pg 18

Os gráficos “Valor Aplicado por Fundo (em %)” e “Valor Aplicado por Tipo de Fundo (em %)” a seguir apresentam a composição da carteira de investimentos do FUMPRES durante o mês de outubro. Podemos observar que há variações na distribuição do capital investido por tipo de classificação de risco do fundo.

Além disso, mostramos nos gráficos abaixo as rentabilidades percebidas mês a mês, e acumuladas nos últimos 12 meses, em cada um dos fundos credenciados pelo FUMPRES. Podemos notar que o fundo **BB PREVID RF PERFIL**, obteve a maior rentabilidade no mês de outubro, com o percentual de 1,03%. Em análise dos gráficos agosto foi o mês de melhor movimento dos últimos 12 meses, que apresentou maior rentabilidade.



7 8 9 10

Xm) X

ANÁLISE DE DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO

ANÁLISE DE DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

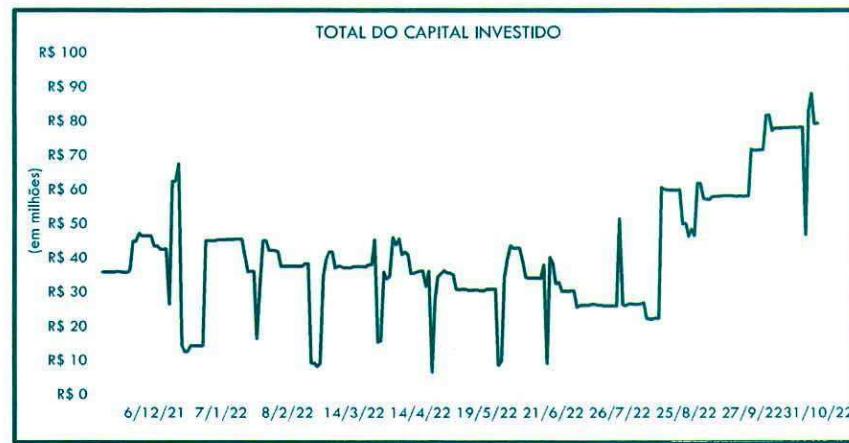
| FUNDO CREDENCIADO | CAPITAL MÉDIO INVESTIDO | RENDIMENTO | TAXA MÉDIA DE RETORNO | RENTABILIDADE | GANHO TOTAL | PERDA TOTAL | TOTAL EM APlicações |
|----------------------------------------------|-------------------------|----------------|-----------------------|---------------|----------------|-------------|---------------------|
| BRADESCO FIC FI RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER | R\$ 6.756.873,95 | R\$ 52.316,99 | 0,84% | 0,84% | R\$ 52.316,99 | R\$ 0,00 | R\$ 36.300.769,75 |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO DIFERENCIADO SETOR | R\$ 3.263.702,36 | R\$ 28.234,78 | 0,97% | 0,97% | R\$ 28.234,78 | R\$ 0,00 | R\$ 40.072.267,82 |
| BB PREVID RF PERFIL | R\$ 74.027.430,05 | R\$ 766.395,91 | 1,03% | 1,03% | R\$ 766.395,61 | R\$ 0,00 | R\$ 96.083.749,44 |

an m77 r k

ANÁLISE DE DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO

Pg 20

Os gráficos abaixo ilustram a dinâmica de aplicações por fundo, bem como a capacidade de investimento do FUMPRES, ao longo do mês. O rendimento mensal apresentou variação de saldo, quando comparado com o período anterior, R\$ 2.232.366,05 no período corrente, e R\$ 1.702.286,05 no período anterior. Desta rendimento total mensal, o fundo que apresentou maior rendimento foi o BB RF PERFIL que rendeu o total de R\$ 766.395,91.

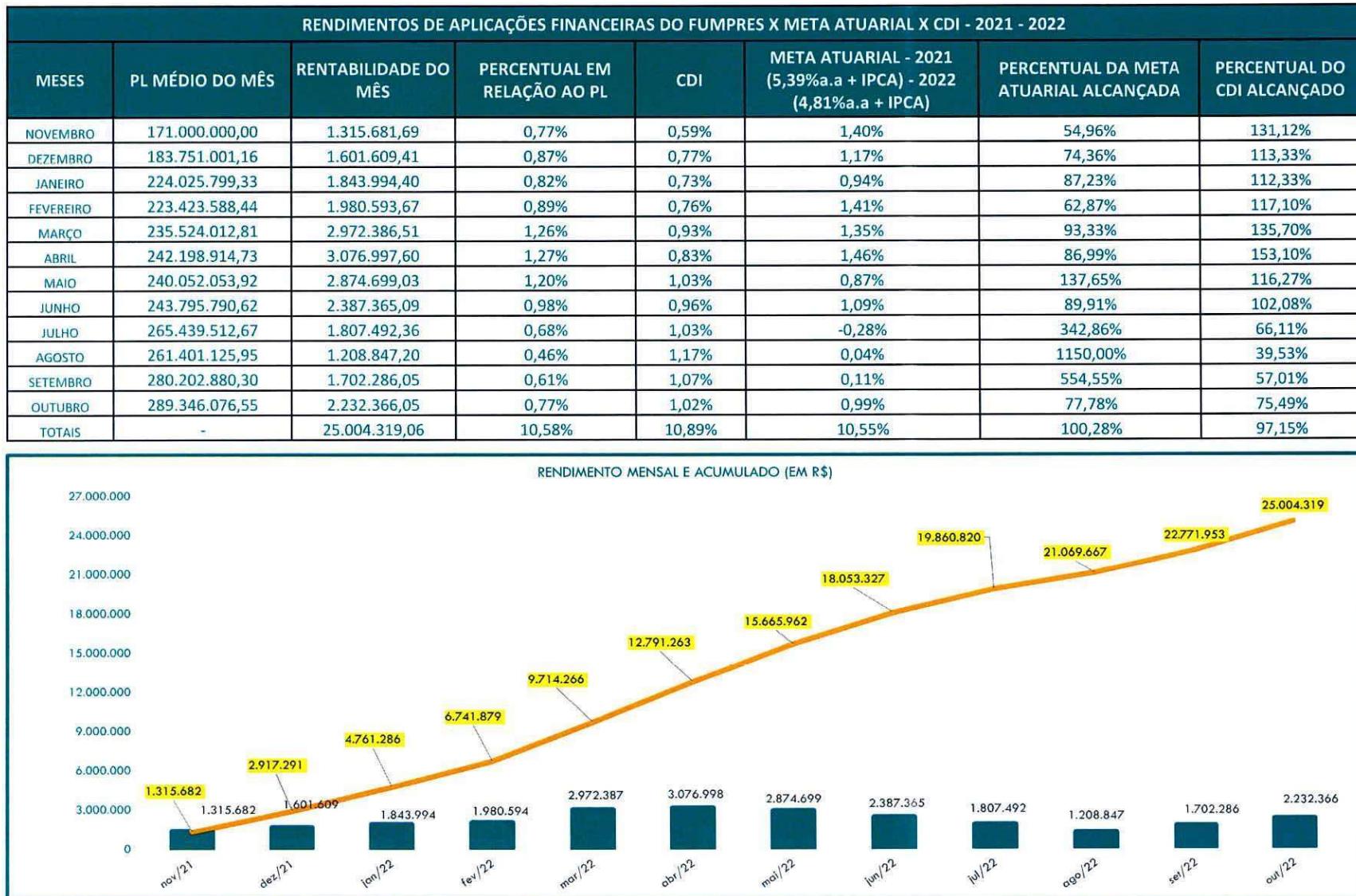


J
f
m

m
m
*

ANÁLISE DE DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO

Pg 21



m *an* *d* *m77* *h*

POUPANÇA PÚBLICA

Pg 22

| MESES | VALOR |
|------------------------|--------------------------|
| abr/20 | R\$ 832.064,78 |
| mai/20 | R\$ 819.170,81 |
| jun/20 | R\$ 817.922,54 |
| jul/20 | R\$ 820.513,04 |
| ago/20 | R\$ 817.578,64 |
| set/20 | R\$ 814.187,01 |
| out/20 | R\$ 815.414,30 |
| nov/20 | R\$ 918.982,61 |
| dez/20 | R\$ 2.187.945,77 |
| TOTAL 2020 (a) | R\$ 8.843.779,50 |
| jan/21 | R\$ 840.873,16 |
| fev/21 | R\$ 841.869,96 |
| mar/21 | R\$ 834.864,70 |
| abr/21 | R\$ 834.594,85 |
| mai/21 | R\$ 833.801,54 |
| jun/21 | R\$ 827.235,56 |
| jul/21 | R\$ 827.543,87 |
| ago/21 | R\$ 831.548,45 |
| set/21 | R\$ 829.448,24 |
| out/21 | R\$ 831.898,67 |
| nov/21 | R\$ 848.908,43 |
| dez/21 | R\$ 1.875.065,22 |
| TOTAL 2021 (b) | R\$ 11.057.652,65 |
| jan/22 | R\$ 833.893,95 |
| fev/22 | R\$ 833.357,75 |
| mar/22 | R\$ 825.409,42 |
| abr/22 | R\$ 821.051,16 |
| mai/22 | R\$ 792.166,66 |
| jun/22 | R\$ 925.922,23 |
| jul/22 | R\$ 941.221,52 |
| ago/22 | R\$ 917.516,91 |
| set/22 | R\$ 914.404,88 |
| out/22 | R\$ 914.042,70 |
| TOTAL 2022 (c) | R\$ 8.718.987,18 |
| RENDIMENTOS (d) | R\$ 2.581.064,50 |
| TOTAL (a+b+c+d) | R\$ 31.201.483,83 |

A poupança pública previdenciária foi aprovada pela Lei Complementar nº 075/2020, aprovada em 04 de março de 2020, publicada no Diário Oficial do Município nº 7611, publicado no dia 30 março de 2020.

Se refere a uma alíquota extraordinária de 0,8% a.m. que incidirá sobre os salários de contribuição ativos, sendo este valor custeado exclusivamente com recursos do tesouro municipal. O montante da aplicação não poderá ser utilizado pelo prazo de 25 anos e será destinado para equacionar o déficit atuarial que alcança a cifra aproximada de R\$ 5,1 bilhões com base no estudo atuarial de 2019.

Conforme art. 11 inciso II da supracitada legislação, os recursos do fundo serão aplicados conforme política de investimentos aprovada pelo Conselho Deliberativo do RPPS.

DOM - 7611

TÍTULO II DA POUPANÇA PÚBLICA PREVIDENCIÁRIA

Art. 11. Fica estabelecida a alíquota de contribuição extraordinária do Tesouro Municipal para equacionamento do déficit atuarial, no percentual mensal de 0,8% (zero vírgula oito) por cento sobre os salários de contribuição dos ativos, pelo período de 25 (vinte e cinco) anos, a ser recolhida nas mesmas condições e prazos da alíquota patronal ordinária.

Parágrafo único. A alíquota extraordinária prevista no caput será destinada à composição de um fundo financeiro e os recursos a ele destinados:

I - não poderão ser utilizados durante o período de 25 (vinte e cinco) anos, a contar da data de publicação desta Lei Complementar;

II - serão aplicados conforme política de investimentos aprovada pelo Conselho Deliberativo do RPPS.

AMM *JM* *PM*

PMN *AB*

ENQUADRAMENTO

Pg 23

| FUNDOS CREDENCIADOS/TÍTULOS TESOURO | CNPJ | Limite Legal | Limite por Fundo/Título | Aplicação | Participação | Grau de Risco | Resgate | Alinea "A" 40% | TP/LTN - SELIC 100% | LF - BRADESCO e LF XP 20% |
|------------------------------------------|--------------------|---------------|-------------------------|----------------|--------------|---------------|---------|----------------|---------------------|---------------------------|
| BB RF DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO | 07.214.377/0001-92 | 40% | 20% | 22.667.212,20 | 7,5% | Baixo | D+O | | | |
| BB Previd RF Perfil Fi | 13.077.418/0001-49 | 40% | 20% | 56.638.000,66 | 18,7% | Baixo | D+O | | | |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 00.834.074/0001-23 | 40% | 20% | 53,74 | 0,0% | Baixo | N/A | | | |
| BON CP PODER PUBLICO - 90020-6 APLICAÇÃO | 13.397.466/0001-14 | 40% | 20% | 187.539,94 | 0,1% | Baixo | N/A | | | |
| BON CP PODER PUBLICO - 90024-9 APLICAÇÃO | 13.397.466/0001-14 | 40% | 20% | 2.588.826,45 | 0,9% | Baixo | N/A | | | |
| LF-25 BRADESCO 21-01-2022 | 02.332.886/0001-04 | 20% | 20% | 5.385.950,22 | 1,8% | Baixo | N/A | | | |
| LF-23 BRADESCO 28-10-2022 | 02.332.886/0001-04 | 20% | 20% | 9.961.508,25 | 3,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS LTN-23 16-08-2022 | 02.332.886/0001-04 | 20% | 20% | 2.159.014,72 | 0,7% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS LTN-23 18-08-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 30.803.872,05 | 10,2% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F23 18-08-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 662.329,33 | 0,2% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F23 01-10-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 10.028.425,77 | 3,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F-31 04-01-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 30.120.553,13 | 9,9% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 05-03-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 627.358,86 | 0,2% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 25-02-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 7.023.283,91 | 2,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 16-02-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 4.183.010,07 | 1,4% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 02-02-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 694.122,68 | 0,2% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 02-02-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 3.170.921,66 | 1,0% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 31-03-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 897.836,64 | 0,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 29-07-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 11.241.013,27 | 3,7% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 25-10-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 10.114.381,00 | 3,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 25-10-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 15.916.156,49 | 5,2% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 12-04-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 5.308.160,63 | 1,8% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 03-08-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 1.520.051,80 | 0,5% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 28-06-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 946.960,10 | 0,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 12-04-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 922.288,08 | 0,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B24 04-01-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 2.030.158,29 | 0,7% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B24 11-04-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 2.093.219,53 | 0,7% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 11-04-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 423.304,21 | 0,1% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 03-03-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 420.303,43 | 0,1% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 02-12-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 868.458,43 | 0,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 03-06-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 910.743,82 | 0,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 06-05-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 828.805,16 | 0,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 26-10-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 802.993,14 | 0,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 05-03-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 868.431,60 | 0,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 04-05-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 3.942.545,71 | 1,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 07-06-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 846.828,66 | 0,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 04-08-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 830.944,80 | 0,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 19-05-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 824.559,51 | 0,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 01-07-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 81.252,22 | 0,0% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 22-09-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 436.711,71 | 0,1% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 22-07-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 212.199,82 | 0,1% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 09-09-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 204.205,15 | 0,1% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 05-10-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 844.807,74 | 0,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 05-10-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 796.263,44 | 0,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F22 22-07-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 45.219,90 | 0,0% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 19-05-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 850.062,92 | 0,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 19-05-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 211.711,76 | 0,1% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 19-03-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 194.828,84 | 0,1% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 01-03-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 193.933,35 | 0,1% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F23 13-10-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 931.788,49 | 0,3% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 17-06-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 165.359,85 | 0,1% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 20-04-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 190.990,79 | 0,1% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 01-07-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 35.256,08 | 0,0% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 17-11-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 193.848,10 | 0,1% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 17-11-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 616.556,37 | 0,2% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 17-05-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 118.271,73 | 0,0% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B24 23-11-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 299.684,12 | 0,1% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 22-12-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 226.940,15 | 0,1% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 16-08-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 26.750.416,83 | 8,8% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 23-12-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 18.205.520,16 | 6,0% | Baixo | N/A | | | |
| | TOTAL | INVESTIMENTOS | | 303.267.816,02 | 100% | | | 27,07% | 67,2% | 5,8% |

an *fog* *pm77* *7* *AB*

an

BRUNO SOARES REIS – Prefeito Municipal

Ana Paula Matos Moreira – Vice-prefeita

Julio Fon – Secretário de Governo em exercício

Thiago Martins Dantas – Secretário Municipal de Gestão

Isabela Loureiro M Cabral – Subsecretária Municipal de Gestão

Daniel Ribeiro Silva – Diretor Geral de Previdência

*fm
D
pw*

*miz
**

Comitê de Investimentos Biênio 2021-2023



Daniel Ribeiro Silva
Presidente



Luciana Rodrigues Vieira Lopes
Membro



Francisco Elde Oliveira Júnior
Membro



Rosevaldo C. C. de Carvalho
Membro



Thiago Martins Dantas
Membro

SALVADOR-BAHIA, outubro de 2022

APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL



Antonio Ricardo Góis Pereira
Presidente



David Bittencourt Luduvice Neto
Membro



Fabrizzio Muller Martinez
Membro



Kaio Vinicius Moraes Leal
Membro

SALVADOR-BAHIA, outubro de 2022



FUMPRES
FUNDO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DO SERVIDOR



PREFEITURA MUNICIPAL DO SALVADOR
SECRETARIA MUNICIPAL DE GESTÃO
DIRETORIA GERAL DE PREVIDÊNCIA
COMITÊ DE INVESTIMENTOS
