



RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Dezembro/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 NOVEMBRO..... | PG 18 |
| ANÁLISE DE DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS | PG 19 |
| QUADRO-RESUMO DO DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS | PG 22 |
| POUPANÇA PÚBLICA PREVIDENCIÁRIA..... | PG 23 |
| ENQUADRAMENTO..... | PG 24 |



[Handwritten signatures in blue ink]

ANÁLISE DO CENÁRIO ECONÔMICO



Pg 03



✓

Ipea revisa de 2,8% para 3,1% a previsão de crescimento do PIB em 2022

A queda do PIB projetada para o quarto trimestre de 2022 (-0,2%) reflete o desempenho de diversos indicadores, cujos resultados já divulgados para outubro e novembro apontam para um arrefecimento da atividade econômica. O encarecimento do crédito, lado a lado com uma inflação ainda elevada, vem deteriorando a situação financeira das famílias. Com isso, os níveis de inadimplência seguem aumentando, em função do comprometimento cada vez maior da renda familiar com o pagamento de dívidas passadas. Diante desse cenário, as previsões do Ipea para o mês de novembro incluem crescimento nulo na produção industrial, novo recuo (-0,3%) no setor de serviços e queda de 1,2% no setor de comércio, todos na comparação com o mês anterior.

Em relação às contas públicas do governo central, há expectativa que encerrem 2022 com bons resultados. Para o próximo ano, as incertezas dizem respeito às mudanças no orçamento federal e no arcabouço de regras fiscais, com o objetivo de acomodar os aumentos de despesas desejados pelo governo eleito e garantir uma trajetória sustentável para as contas públicas. As finanças públicas estaduais também mantiveram bom desempenho nos primeiros dez meses de 2022. Já as contas do setor externo seguem com comportamento positivo, mesmo com as incertezas e turbulências externas e internas.

O mercado de trabalho brasileiro apresenta cenário positivo, com pequena queda da desocupação, recuperação dos rendimentos e crescimento da massa salarial real. A taxa de desocupação dessazonalizada ficou em 8,2% em outubro deste ano, atingindo o menor patamar desde abril de 2015. Entretanto, a queda da desocupação nos últimos meses não ocorreu em função da expansão da ocupação, mas pela retração da força de trabalho. Em outubro de 2022, apesar do aumento de 5,4% da população ocupada, na comparação com o mesmo período do ano anterior, o contingente de trabalhadores vem perdendo o dinamismo. Mesmo assim, a massa salarial real continua crescendo e supera o nível anterior à pandemia.

No que diz respeito à inflação, observa-se que, após encerrar o primeiro semestre do ano com taxa de variação acumulada em 12 meses de 11,9%, a inflação veio reduzindo, de modo que a alta verificada já era de 5,9% em novembro. Para 2022, tanto a projeção para o Índice de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) quanto a variação do Índice Nacional de Preços ao Consumidor (INPC) foram mantidas em 5,7% e 6,0%, respectivamente. Já para 2023, apesar da pequena revisão para cima desde a última previsão (alta de 4,9% ante taxa de 4,7% projetada em setembro), as estimativas para IPCA e INPC permanecem baseadas na continuidade do processo de desinflação pelo qual a economia brasileira vem passando.

Confiança empresarial cai 0,8 ponto em dezembro, menor nível desde abril de 2021

O Índice de Confiança Empresarial (ICE) caiu 0,8 ponto em dezembro, para 90,7 pontos, informou nesta segunda-feira (2) a Fundação Getúlio Vargas. Este é o menor nível desde abril de 2021, quando chegou a 89,6 pontos.

Na média móvel por trimestre, o indicador recuou 3,6 pontos. Assim, acumula queda de 10,8 pontos no quarto trimestre de 2022, após ter acumulado 7,4 pontos nos três trimestres anteriores.

"A confiança empresarial se manteve em queda pelo terceiro mês consecutivo embora em menor intensidade que nos meses anteriores. A percepção sobre situação atual e perspectivas futuras se mantém em compasso de espera frente às decisões sobre a condução da política econômica do novo Governo. O cenário de incerteza contribui para essa paralização no momento", avalia Viviane Seda Bittencourt, economista do FGV IBRE.

De acordo com a economista, a queda foi puxada pelo setor de serviços. "Apesar de uma percepção de melhora no setor industrial relacionada a uma ligeira recuperação de demanda e redução de estoques, a piora do setor de serviços foi o responsável por jogar a confiança para baixo em dezembro. A confiança das empresas melhorou para mais de 50% dos segmentos pesquisados, mas isso não é suficiente para garantir sua sustentação nos próximos meses", diz.

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 dezembro, a confiança empresarial subiu em 53% dos 49 segmentos integrantes do ICE. Em relação aos setores, o índice caminhou para todas as direções:

Fonte: Ipea

*m
Trib
C
faz*

Demanda chinesa faz exportações brasileiras darem salto em novembro.

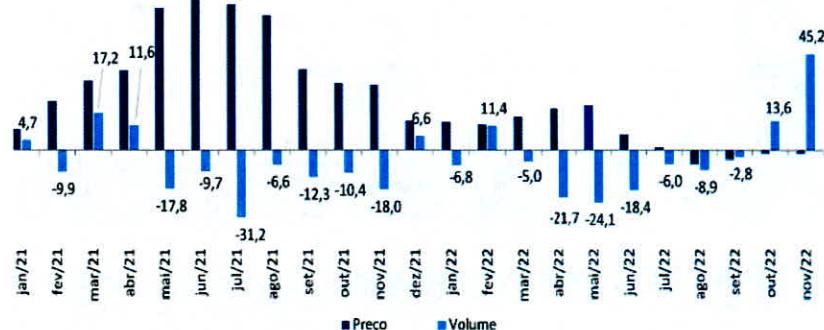
O Indicador de Comércio Exterior do FGV IBRE divulgado na semana passada apontou uma melhora significativa na balança comercial brasileira, com um saldo de US\$ 6,7 bilhões em novembro, maior resultado para o mês e no acumulado do ano até novembro registrado na série histórica, iniciada em 1998. No acumulado do ano até novembro, o saldo comercial somou US\$ 57,7 bilhões - acima do estimado pelo Ministério da Economia em outubro. Para alcançar o resultado de 2021, entretanto, de US\$ 61 bilhões, ainda será preciso emplacar um saldo em torno dos US\$ 4 bi em dezembro. A projeção do FGV IBRE, registrada no Boletim Macro de dezembro, é de que a balança brasileira feche 2022 com superávit de R\$ 59 bilhões.

O motivo desse impulso foi a China. Da mesma forma que durante o ano os chineses levaram o Brasil a revisar suas perspectivas de venda externa para baixo, em função da queda de volume contratado - efeito parcialmente compensado pelo aumento de preços - também foram eles os responsáveis por essa disparada no mês. O superávit da balança bilateral Brasil-China passou de US\$ 500 milhões para US\$ 2,1 bilhões.

No acumulado do ano, entretanto, a contribuição da China para as exportações continua negativa em termos de volume. Na comparação entre o acumulado do ano até novembro de 2021 e 2022, aponta o Icomex, a queda no volume exportado foi de 5,7%, enquanto para todos os outros mercados a variação foi positiva. As maiores variações positivas nesse período são com a União Europeia, com 16,7%, e Argentina, com 12,7%.

Seria esse impulso de final de ano um bom presságio para as relações comerciais entre China e Brasil em 2023? Pesquisadores do FGV IBRE sugerem duas ponderações importantes antes de se embarcar numa onda de otimismo. Lia Valls, coordenadora do Icomex, ressalta que o resultado de novembro, contraposto ao mesmo mês de 2021, é fortemente influenciado pelo mau desempenho do ano passado, devido à proibição feita pelo governo chinês de importações de carne bovina do Brasil - quarto principal produto vendido pelo país em novembro deste ano, no agregado -, que durou de setembro a meados de dezembro. Em termos de valor, as vendas externas de carne bovina registraram um aumento de acima de 23.000 % em relação ao mesmo período de 2021. "Não se pode garantir uma variação dessa mesma ordem adiante", ressalta Lia. Outro destaque registrado este ano foi a variação do valor do petróleo bruto, 127% acima do registrado em novembro do ano passado. Apesar desse forte resultado, observando evolução dos preços de exportação desde 2021, fica claro que no agregado dos produtos exportados para a China a tendência já não é mais de ganhos expressivos como os registrados no ano passado.

Variação (%) nos índices de volume e preços das exportações brasileiras para a China



Elaboração: FGV IBRE. Base ICOMEX. Fonte: Secretaria de Comércio Exterior/Ministério da Economia.

lia valls
FGV IBRE
2022

carteira de investimentos



Pg 06



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

Pg 07

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 (LETRAS IMOBILIÁRIAS GARANTIDAS) | ART. 7º, V | ATÉ 20% | NÃO SE APLICA | - |
| RENDA VARIÁVEL EXTERIOR | FUNDOS DE AÇÕES EM GERAL | ART. 8º, II, a | ATÉ 20% | ATÉ 5% | - |
| | FUNDOS MULTIMERCADO | ART. 8º, III | ATÉ 10% | ATÉ 5% | - |
| | FUNDOS BDR NÍVEL I | ART. 9º, III | ATÉ 10% | ATÉ 5% | - |

D m fny pmy
[Signature]

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

A tabela abaixo relaciona os fundos credenciados do FUMPRES com aplicações no mês de dezembro 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 12,58% em 2022) e dois de risco muito baixo (com rentabilidade de 9,76% e 11,52% 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 FI RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER | MUITO BAIXO | 1,5% A.A. | 9,76% | 9,76% | CDI | 83,60% | 83,60% |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO | MUITO BAIXO | 0,50% A.A. | 11,52% | 11,52% | CDI | 93,05% | 93,05% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FIC | BAIXO | 0,20% A.A. | 12,58% | 12,58% | CDI | 101,61% | 101,61% |

*m
m77
ga
A*

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 dezembro/2022 com seus respectivos resultados. Dentre os Títulos relacionados o que obteve o melhor desempenho no mês em apreço foi uma Letra Financeira do Bradesco que é um título privado, pré-fixado com um percentual de 1,15%.

| RESULTADO DAS APLICAÇÕES DO FUMPRES EM TÍTULOS PÚBLICOS E PRIVADOS RECEITA GERAL NO MÊS DE DEZEMBRO/2022 | | | | | | | | |
|--|--------------------|------------------------------|-----------------|---------------------|--------------------|------------------------|-------------------------|-----------------------|
| DATA DA APLICAÇÃO | VENCIMENTO/RESGATE | TIPO DE TÍTULO | TAXA CONTRATADA | SALDO EM 30/11/2022 | APLICAÇÃO DEZEMBRO | SALDO ATUAL 30/12/2022 | RENDIMENTO MÊS DEZEMBRO | % RENDIMENTO DEZEMBRO |
| 18/08/2021 | 01/01/2023 | NTN-F 2023 | 8,45% | 10.093.197,25 | | 10.164.929,17 | 71.721,92 | 0,71% |
| 19/03/2021 | 01/01/2025 | NTN- F 2025 | 7,53% | 192.094,43 | | 193.315,81 | 1.221,38 | 0,64% |
| 20/04/2021 | 01/01/2025 | NTN-F 2025 | 7,92% | 195.110,05 | | 196.422,67 | 1.302,62 | 0,67% |
| 19/05/2021 | 01/01/2025 | NTN- F 2025 | 8,25% | 195.073,54 | | 196.426,25 | 1.354,71 | 0,69% |
| 17/06/2021 | 01/01/2025 | NTN- F 2025 | 7,97% | 196.018,18 | | 197.334,84 | 1.316,66 | 0,67% |
| 22/07/2021 | 01/01/2025 | NTN- F 2025 | 8,04% | 205.462,10 | | 206.854,10 | 1.391,80 | 0,68% |
| 03/07/2021 | 01/01/2025 | NTN- F 2025 | 8,08% | 35.474,17 | | 35.715,62 | 241,45 | 0,68% |
| 22/09/2021 | 01/01/2025 | NTN- F 2025 | 9,98% | 213.316,21 | | 215.095,14 | 1.778,93 | 0,83% |
| 01/10/2021 | 01/01/2023 | NTN-F 2023 | 9,17% | 30.331.019,99 | | 30.564.232,52 | 233.212,53 | 0,77% |
| 13/10/2021 | 01/01/2023 | NTN- F 2023 | 9,00% | 166.494,70 | | 167.752,04 | 1.257,34 | 0,76% |
| 20/10/2021 | 01/01/2025 | NTN- F 2025 | 10,40% | 213.872,65 | | 215.728,00 | 1.855,35 | 0,87% |
| 26/10/2021 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 4,84%+IPCA | 15.618.011,45 | | 15.739.541,12 | 121.529,67 | 0,78% |
| 04/11/2021 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 5,52%+IPCA | 5.210.928,72 | | 5.254.443,30 | 43.514,58 | 0,84% |
| 17/11/2021 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 5,05%+IPCA | 605.085,94 | | 609.900,92 | 4.814,98 | 0,80% |
| 23/11/2021 | 15/08/2024 | NTN-B 2024 | 5,26%+IPCA | 229.305,40 | | 231.170,39 | 1.864,99 | 0,81% |
| 22/12/2021 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 5,84%+IPCA | 26.265.797,10 | | 26.492.346,06 | 226.548,96 | 0,86% |
| 21/01/2021 | 10/01/2025 | LETRA FINANCEIRA DO BRADESCO | 6,00%+IPCA | 5.427.092,78 | | 5.479.923,89 | 52.831,11 | 0,97% |
| 17/05/2022 | 16/05/2024 | LETRA FINANCEIRA DO BANCO XP | 6,2% + IPCA | 2.182.797,95 | | 2.202.295,75 | 19.497,80 | 0,89% |
| 28/10/2022 | 09/05/2023 | LETRA FINANCEIRA DO BRADESCO | 14,00% | 10.065.639,15 | | 10.181.440,81 | 115.801,66 | 1,15% |
| 16/12/2022 | 22/03/2023 | LETRA FINANCEIRA DO BRADESCO | 7,15%+IPCA | | 3.481.195,13 | 3.497.436,23 | 16.241,10 | 0,47% |
| 16/12/2022 | 29/07/2023 | LETRA FINANCEIRA DO BRADESCO | 7,15%+IPCA | | 1.126.322,37 | 1.131.525,78 | 5.203,41 | 0,46% |
| 16/12/2022 | 29/06/2023 | LETRA FINANCEIRA DO BRADESCO | 7,15%+IPCA | | 1.016.084,25 | 1.020.778,38 | 4.694,13 | 0,46% |
| 19/12/2022 | 29/06/2023 | LETRA FINANCEIRA DO BRADESCO | 7,15%+IPCA | | 112.950,19 | 113.419,82 | 469,63 | 0,42% |
| 04/01/2022 | 15/05/2023 | NTN- B 2023 | 5,59%+IPCA | 2.054.965,88 | | 2.072.246,05 | 17.280,17 | 0,84% |
| 16/02/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 6,26% + IPCA | 681.720,17 | | 687.832,11 | 6.111,94 | 0,90% |
| 02/02/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 6,48% + IPCA | 3.114.683,38 | | 3.143.176,18 | 28.492,80 | 0,91% |
| 12/04/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 5,79% + IPCA | 1.993.304,36 | | 2.010.396,93 | 17.092,57 | 0,86% |
| 12/04/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 6,00% + IPCA | 1.492.652,17 | | 1.505.712,12 | 13.059,95 | 0,87% |
| 31/03/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 5,42% + IPCA | 11.034.429,46 | | 11.125.648,67 | 91.219,21 | 0,83% |
| 25/02/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 6,36% + IPCA | 4.108.519,01 | | 4.145.696,60 | 37.177,59 | 0,90% |
| 29/07/2022 | 15/05/2023 | NTN - B 2023 | 7,95% + IPCA | 9.943.901,39 | | 10.046.882,40 | 102.983,01 | 1,04% |
| 18/08/2022 | 01/01/2023 | LTN - 2023 | 13,70% | 669.112,93 | | 676.655,16 | 7.542,23 | 1,13% |
| 16/08/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 7,88%+IPCA | 17.897.886,59 | | 18.082.212,89 | 184.326,30 | 1,03% |
| 16/08/2022 | 01/01/2023 | LTN - 2023 | 13,68% | 31.118.823,18 | | 31.468.990,03 | 350.166,85 | 1,13% |
| TOTALS | | | | 191.751.788,48 | - | 199.273.467,80 | 1.785.127,38 | 0,80% |

67,29%

fus
m
fus
fus

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 dezembro/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 0,92%.

| RESULTADO DAS APLICAÇÕES DO FUMPRES EM TÍTULOS PÚBLICOS RECEITA POUPANÇA PREVIDENCIÁRIA NO MÊS DE DEZEMBRO/2022 | | | | | | | | | |
|---|--------------------|----------------|-----------------|---------------------|--------------------|------------------------|-------------------------|-----------------------|--|
| DATA DA APLICAÇÃO | VENCIMENTO/RESGATE | TIPO DE TÍTULO | TAXA CONTRATADA | SALDO EM 30/11/2022 | APLICAÇÃO DEZEMBRO | SALDO ATUAL 30/12/2022 | RENDIMENTO MÊS DEZEMBRO | % RENDIMENTO DEZEMBRO | % DO PL DA POUPANÇA PÚBLICA APLICADO EM TÍTULOS PÚBLICOS |
| 05/05/2022 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,67%+IPCA | 788.977,70 | | 795.664,24 | 6.686,54 | 0,85% | |
| 04/08/2021 | 01/01/2031 | NTN- F 2031 | 9,54% | 850.939,29 | | 857.735,41 | 6.796,12 | 0,80% | |
| 17/05/2022 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,56%+IPCA | 294.506,24 | | 296.075,24 | 2.469,00 | 0,84% | |
| 05/03/2021 | 01/01/2031 | NTN- F 2031 | 8,45% | 7.068.645,82 | | 7.128.882,38 | 50.236,56 | 0,71% | |
| 31/03/2021 | 01/01/2031 | NTN- F 2031 | 9,16% | 938.292,53 | | 945.499,41 | 7.206,88 | 0,77% | |
| 04/05/2021 | 01/01/2031 | NTN- F 2031 | 9,12% | 836.720,59 | | 843.120,34 | 6.399,75 | 0,76% | |
| 19/05/2021 | 01/01/2031 | NTN- F 2031 | 9,35% | 81.830,67 | | 82.471,72 | 641,05 | 0,78% | |
| 07/06/2021 | 01/01/2031 | NTN- F 2031 | 8,89% | 830.151,89 | | 836.347,32 | 6.195,43 | 0,75% | |
| 01/07/2021 | 01/01/2031 | NTN- F 2031 | 9,09% | 439.737,64 | | 443.090,39 | 3.352,75 | 0,76% | |
| 06/07/2021 | 01/01/2031 | NTN- F 2031 | 9,25% | 856.052,49 | | 862.689,77 | 6.637,28 | 0,78% | |
| 09/09/2021 | 01/01/2031 | NTN- F 2031 | 10,85% | 853.780,05 | | 861.492,50 | 7.712,45 | 0,90% | |
| 05/10/2021 | 01/01/2031 | NTN-F 2031 | 11,00% | 802.885,92 | | 810.234,27 | 7.348,35 | 0,92% | |
| 05/10/2021 | 01/01/2031 | NTN- F 2031 | 11,00% | 45.595,99 | | 46.013,30 | 417,31 | 0,92% | |
| 05/03/2021 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 3,66%+IPCA | 3.885.381,19 | | 3.911.746,02 | 26.364,83 | 0,68% | 81,85% |
| 27/10/2021 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,40%+IPCA | 853.646,36 | | 860.688,58 | 7.042,22 | 0,82% | |
| 17/11/2021 | 15/05/2035 | NTN- B 2035 | 5,12%+IPCA | 116.309,38 | | 117.241,75 | 932,37 | 0,80% | |
| 02/12/2021 | 15/05/2035 | NTN- B 2035 | 5,13%+IPCA | 895.625,67 | | 902.808,62 | 7.182,95 | 0,80% | |
| 23/12/2021 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,12%+IPCA | 1.968.643,96 | | 1.984.425,18 | 15.781,22 | 0,80% | |
| 11/04/2022 | 15/05/2023 | NTN-B 2023 | 5,70%+IPCA | 415.596,68 | | 419.129,73 | 3.533,05 | 0,85% | |
| 11/04/2022 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,37%+IPCA | 413.166,97 | | 416.565,43 | 3.398,46 | 0,82% | |
| 04/01/2022 | 01/01/2031 | NTN- F 2031 | 10,90% | 632.531,31 | | 638.270,28 | 5.738,97 | 0,91% | |
| 02/02/2022 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,52% + IPCA | 882.380,58 | | 889.748,50 | 7.367,92 | 0,84% | |
| 03/03/2022 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,69% + IPCA | 853.272,49 | | 860.518,45 | 7.245,96 | 0,85% | |
| 03/06/2022 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,72%+IPCA | 814.272,69 | | 821.207,10 | 6.934,41 | 0,85% | |
| 28/06/2022 | 15/05/2035 | NTN-B 2035 | 5,75%+IPCA | 906.071,99 | | 913.810,99 | 7.739,00 | 0,85% | |
| 03/08/2022 | 15/05/2035 | NTN - B 2035 | 6,17%+IPCA | 929.656,20 | | 937.921,62 | 8.265,42 | 0,89% | |
| TOTALS | | | | 28.254.672,29 | - | 28.474.298,54 | 219.626,25 | 0,82% | |

H
P
J
D

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 1,06% em dezembro 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%).

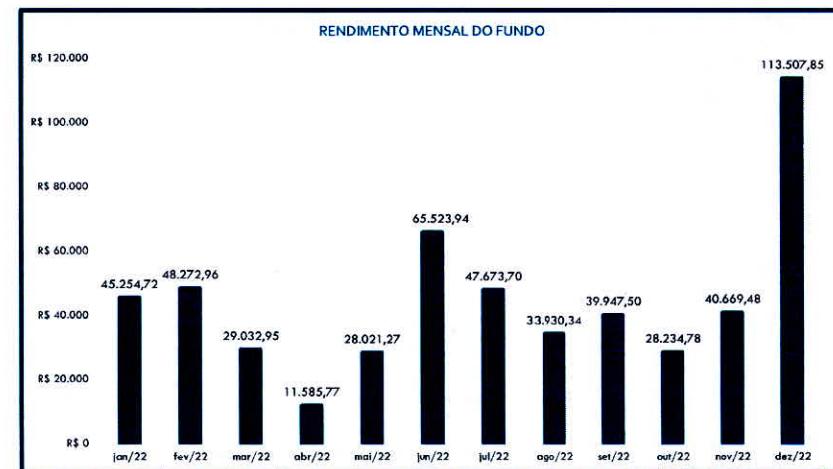
O patrimônio líquido do fundo em dezembro de 2022 foi de R\$ 19.826.656.157,02.

A rentabilidade mensal quando comparada com o CDI, ficou em 93,05%, como indica o gráfico "Rentabilidade do Fundo e Taxa CDI" a seguir.



Em dezembro 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\$ 113.507,85 no mês corrente e aproximadamente R\$ 531.655,26 de saldo acumulado nos últimos 12 meses.



DESEMPENHO EM DEZEMBRO

O fundo BB Renda Fixa Curto Prazo Diferenciado Setor Público começou dezembro com um saldo de aproximadamente R\$ 35.236.786,40 . Ao longo do mês foram aplicados aproximadamente R\$ 138.222 milhões e (R\$ 115.422) milhões de resgates. O saldo final, registrado no mês de dezembro de 2022, foi de 22.800.421,79 milhões – com um rendimento acumulado de R\$ 113.507,85 no mês.

Em dezembro o montante do capital médio investido (por dia) no mês girou em torno de R\$ 12.866 milhões. O rendimento médio por dia chegou a R\$ 5.675,39 A média da taxa de retorno do investimento (TRI), calculada com o rendimento total em razão do capital médio investido, fechou dezembro em 0,0670%.

[Assinatura]

**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 dezembro de 2022, e foi elaborada com base nos extratos bancários emitidos dia-a-dia.

A movimentação líquida entre aplicações e resgates foi de 22.800.421,79 milhões. Ocorreram movimentações de aplicações e resgates durante o período. As aplicações financeiras totalizaram aproximadamente R\$ 138.222 milhões, sendo a maior ocorrida no dia 29 de dezembro no valor de R\$ 52.546.870,70.

O saldo total de resgates foi de aproximadamente (115.422)milhões, sendo a maior movimentação ocorrida no dia 20 de dezembro valor de 47.891.716,37 milhões.O mês de dezembro iniciou com o saldo de aproximadamente R\$ 22.667 milhões e finalizou com o saldo aproximado de R\$ 58.150 milhões. O saldo de rendimento acumulado foi de R\$ 113.507,85 .

| DATA | SALDO INICIAL | APLICAÇÃO | RESGATE | CAPITAL INVESTIDO | RENDIMENTO DIÁRIO | SALDO FINAL | VALOR DA COTA | RENTABILIDADE DIÁRIA | RENDIMENTO ACUMULADO | TRI |
|-------------|----------------------|------------------|-----------------------|--------------------------|--------------------------|----------------------|----------------------|-----------------------------|-----------------------------|------------|
| 30/12/2022 | 58.150.716,04 | 0,00 | 0,00 | 58.150.716,04 | 0,00 | 58.150.716,04 | 5,177030990 | 0,000000% | R\$ 113.507,85 | 0,000000% |
| 29/12/2022 | 5.576.017,10 | 52.546.870,70 | 0,00 | 58.122.887,80 | 27.828,24 | 58.150.716,04 | 5,177030990 | 0,047878% | R\$ 113.507,85 | 0,047878% |
| 28/12/2022 | 5.217.782,87 | 355.569,57 | 0,00 | 5.573.352,44 | 2.664,66 | 5.576.017,10 | 5,174553503 | 0,047811% | R\$ 85.679,61 | 0,047811% |
| 27/12/2022 | 8.046.422,63 | 0,00 | -2.831.137,52 | 5.215.285,11 | 2.497,76 | 5.217.782,87 | 5,172080695 | 0,047893% | R\$ 83.014,95 | 0,047893% |
| 26/12/2022 | 5.736.394,34 | 2.313.301,32 | -7.148,52 | 8.042.547,14 | 3.875,49 | 8.046.422,63 | 5,169604817 | 0,048187% | R\$ 80.517,19 | 0,048187% |
| 23/12/2022 | 28.466.621,32 | 40.655,14 | -22.773.682,31 | 5.733.594,15 | 2.800,19 | 5.736.394,34 | 5,167114925 | 0,048838% | R\$ 76.641,70 | 0,048838% |
| 22/12/2022 | 16.844.198,76 | 12.665.314,60 | -1.056.634,64 | 28.452.878,72 | 13.742,60 | 28.466.621,32 | 5,164592628 | 0,048300% | R\$ 73.841,51 | 0,048300% |
| 21/12/2022 | 14.625.417,32 | 2.410.615,49 | -200.056,93 | 16.835.975,88 | 8.222,88 | 16.844.198,76 | 5,162099358 | 0,048841% | R\$ 60.098,91 | 0,048841% |
| 20/12/2022 | 32.489.106,50 | 30.020.874,89 | -47.891.716,37 | 14.618.265,02 | 7.152,30 | 14.625.417,32 | 5,159579360 | 0,048927% | R\$ 51.876,03 | 0,048927% |
| 19/12/2022 | 1.130.172,39 | 31.343.653,16 | -404,73 | 32.473.420,82 | 15.685,68 | 32.489.106,50 | 5,157056155 | 0,048303% | R\$ 44.723,73 | 0,048303% |
| 16/12/2022 | 1.275.669,82 | 0,00 | -146.045,89 | 1.129.623,93 | 548,46 | 1.130.172,39 | 5,154566339 | 0,048552% | R\$ 29.038,05 | 0,048552% |
| 15/12/2022 | 1.292.324,81 | 0,00 | -17.270,56 | 1.275.054,25 | 615,57 | 1.275.669,82 | 5,152064925 | 0,048278% | R\$ 28.489,59 | 0,048278% |
| 14/12/2022 | 895.700,78 | 1.000.000,00 | -604.002,31 | 1.291.698,47 | 626,34 | 1.292.324,81 | 5,149578836 | 0,048490% | R\$ 27.874,02 | 0,048490% |
| 13/12/2022 | 3.237.699,95 | 0,00 | -2.342.433,69 | 895.266,26 | 434,52 | 895.700,78 | 5,147083018 | 0,048535% | R\$ 27.247,68 | 0,048535% |
| 12/12/2022 | 428.455,25 | 4.926.010,78 | -2.118.275,03 | 3.236.191,00 | 1.508,95 | 3.237.699,95 | 5,144586073 | 0,046627% | R\$ 26.813,16 | 0,046627% |
| 09/12/2022 | 710.501,62 | 0,00 | -282.668,30 | 427.833,32 | 621,93 | 428.455,25 | 5,142188406 | 0,145367% | R\$ 25.304,21 | 0,145367% |
| 06/12/2022 | 4.724.727,66 | 600.000,00 | -4.614.571,17 | 710.156,49 | 345,13 | 710.501,62 | 5,134724225 | 0,048599% | R\$ 24.682,28 | 0,048599% |
| 05/12/2022 | 5.223.623,87 | 0,00 | -501.152,30 | 4.722.471,57 | 2.256,09 | 4.724.727,66 | 5,132230016 | 0,047774% | R\$ 24.337,15 | 0,047774% |
| 02/12/2022 | 5.221.093,94 | 0,00 | 0,00 | 5.221.093,94 | 2.529,93 | 5.223.623,87 | 5,129779331 | 0,048456% | R\$ 22.081,06 | 0,048456% |
| 01/12/2022 | 35.236.786,40 | 0,00 | -30.035.243,59 | 5.201.542,81 | 19.551,13 | 5.221.093,94 | 5,127294864 | 0,096363% | R\$ 19.551,13 | 0,375872% |

*W
M
J
C
A*

FUNDO BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL

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.

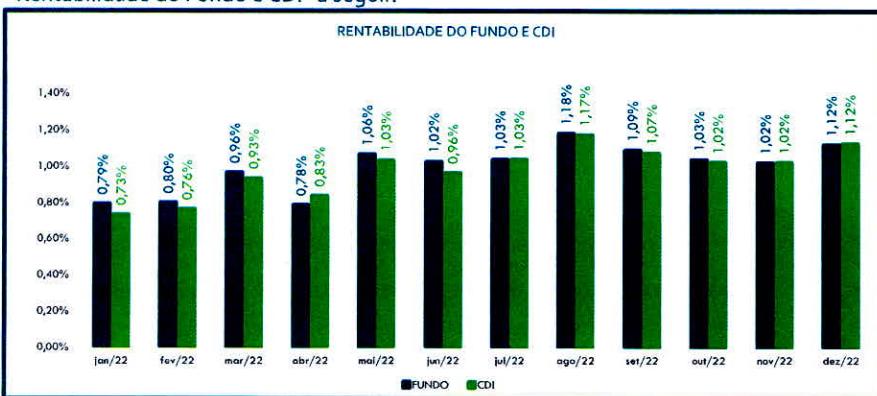
O fundo, que funciona desde **28 de fevereiro de 2011**, tem grau de risco classificado como **baixo** e categoria ANBIMA **Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento**, com taxa de administração de 0,20% ao ano e liquidez D+0. Destacamos que, por aplicar seus recursos em fundo de investimento que 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 1,12% em dezembro de 2022, ante um desempenho de 1,12% 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 dezembro de 2022 foi de R\$ 12.858.761.791,29 e concentra seus investimentos em espécies de ativos.

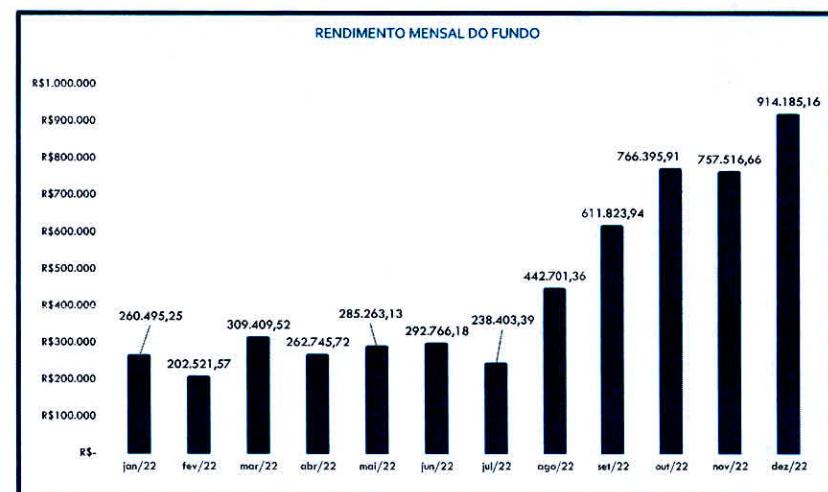
A rentabilidade mensal foi de 100% do CDI no período, como indica o gráfico "Rentabilidade do Fundo e CDI" a seguir.



Pg 13

Em dezembro 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 dezembro no valor de R\$ 914.185,16 e nos últimos 12 meses, com um ganho acumulado de R\$ 5.344.227,79



DESEMPENHO EM DEZEMBRO

O fundo BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI Longo Prazo Perfil FIC começou dezembro com um saldo superior a R\$ 58.962 milhões. O saldo final registrado em dezembro de 2022, foi de aproximadamente R\$ 67.880.134,80 milhões – com um rendimento de R\$ no mês.

O capital médio investido (por dia) no mês girou em torno de R\$ 74.540 milhões. O rendimento médio por dia chegou a R\$ 39.869,30. A média da taxa de retorno do investimento (TRI), calculada como o rendimento total em razão do capital médio investido, fechou em 0,053847% .

2
m
fz
10

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 dezembro de 2022, e foi elaborada com base nos extratos bancários emitidos dia-a-dia.

Houveram movimentações líquidas no valor de R\$ 8.003.379 milhões. O mês de dezembro finalizou com o rendimento acumulado de R\$ 914.185,16. A média do capital investido no período foi de aproximadamente R\$ 81.566 milhões, enquanto que a média do rendimento diário foi R\$ 45.709,26. O fundo iniciou o período com o saldo de aproximadamente R\$ 58.962 milhões e finalizou o período com o saldo aproximado de R\$ 67.880.134,80 milhões. A média da TRI do mês de dezembro ficou em 0,05569%.

| DATA | SALDO INICIAL | APUCAÇÃO | RESGATE | CAPITAL INVESTIDO | RENDIMENTO DIÁRIO | SALDO FINAL | VALOR DA COTA | RENTABILIDADE DIÁRIA | RENDIMENTO ACUMULADO | TRI |
|------------|----------------|---------------|----------------|-------------------|-------------------|----------------|---------------|----------------------|----------------------|-----------|
| 30/12/2022 | 67.845.776,92 | 0,00 | 0,00 | 67.845.776,92 | 34.357,88 | 67.880.134,80 | 2,711319038 | 0,050641% | 914.185,16 | 0,050641% |
| 29/12/2022 | 101.792.862,57 | 0,00 | -34.000.000,00 | 67.792.862,57 | 52.914,35 | 67.845.776,92 | 2,709946690 | 0,051982% | 879.827,28 | 0,078053% |
| 28/12/2022 | 101.740.311,52 | 0,00 | 0,00 | 101.740.311,52 | 52.551,05 | 101.792.862,57 | 2,708538727 | 0,051652% | 826.912,93 | 0,051652% |
| 27/12/2022 | 101.687.428,95 | 0,00 | 0,00 | 101.687.428,95 | 52.882,57 | 101.740.311,52 | 2,707140431 | 0,052005% | 774.361,88 | 0,052005% |
| 26/12/2022 | 104.634.420,02 | 0,00 | -3.000.000,00 | 101.634.420,02 | 53.008,93 | 101.687.428,95 | 2,705733314 | 0,050661% | 721.479,31 | 0,052156% |
| 23/12/2022 | 63.991.434,93 | 40.609.752,04 | 0,00 | 104.601.186,97 | 33.233,05 | 104.634.420,02 | 2,704363254 | 0,051934% | 668.470,38 | 0,031771% |
| 22/12/2022 | 63.158.856,42 | 1.000.000,00 | -200.000,00 | 63.958.856,42 | 32.578,51 | 63.991.434,93 | 2,702959510 | 0,051582% | 635.237,33 | 0,050937% |
| 21/12/2022 | 47.619.565,58 | 15.514.901,56 | 0,00 | 63.134.467,14 | 24.389,28 | 63.158.856,42 | 2,701565992 | 0,051217% | 602.658,82 | 0,038631% |
| 20/12/2022 | 77.580.095,62 | 0,00 | -30.000.000,00 | 47.580.095,62 | 39.469,96 | 47.619.565,58 | 2,700183041 | 0,050876% | 578.269,54 | 0,082955% |
| 19/12/2022 | 69.745.376,01 | 34.000.000,00 | -26.200.000,00 | 77.545.376,01 | 34.719,61 | 77.580.095,62 | 2,698809984 | 0,049781% | 538.799,58 | 0,044773% |
| 16/12/2022 | 59.407.189,93 | 10.308.726,21 | 0,00 | 69.715.916,14 | 29.459,87 | 69.745.376,01 | 2,697467171 | 0,049590% | 504.079,97 | 0,042257% |
| 15/12/2022 | 86.993.050,75 | 0,00 | -27.630.000,00 | 59.363.050,75 | 44.139,18 | 59.407.189,93 | 2,696130167 | 0,050739% | 474.620,10 | 0,074355% |
| 14/12/2022 | 87.948.777,30 | 0,00 | -1.000.000,00 | 86.948.777,30 | 44.273,45 | 86.993.050,75 | 2,694762878 | 0,050340% | 430.480,92 | 0,050919% |
| 13/12/2022 | 85.906.063,13 | 2.000.000,00 | 0,00 | 87.906.063,13 | 42.714,17 | 87.948.777,30 | 2,693407016 | 0,049722% | 386.207,47 | 0,048591% |
| 12/12/2022 | 88.662.299,63 | 0,00 | -2.800.000,00 | 85.862.299,63 | 43.763,50 | 85.906.063,13 | 2,692068467 | 0,049360% | 343.493,30 | 0,050969% |
| 09/12/2022 | 88.528.039,66 | 0,00 | 0,00 | 88.528.039,66 | 134.259,97 | 88.662.299,63 | 2,690740324 | 0,151658% | 299.729,80 | 0,151658% |
| 06/12/2022 | 89.082.842,18 | 0,00 | -600.000,00 | 88.482.842,18 | 45.197,48 | 88.528.039,66 | 2,686665777 | 0,050736% | 165.469,83 | 0,051081% |
| 05/12/2022 | 89.038.022,25 | 0,00 | 0,00 | 89.038.022,25 | 44.819,93 | 89.082.842,18 | 2,685303349 | 0,050338% | 120.272,35 | 0,050338% |
| 02/12/2022 | 88.992.135,14 | 0,00 | 0,00 | 88.992.135,14 | 45.887,11 | 89.038.022,25 | 2,683952302 | 0,051563% | 75.452,42 | 0,051563% |
| 01/12/2022 | 58.962.569,83 | 30.000.000,00 | 0,00 | 88.962.569,83 | 29.565,31 | 88.992.135,14 | 2,682569086 | 0,050142% | 29.565,31 | 0,033233% |

D W J M J Z J

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

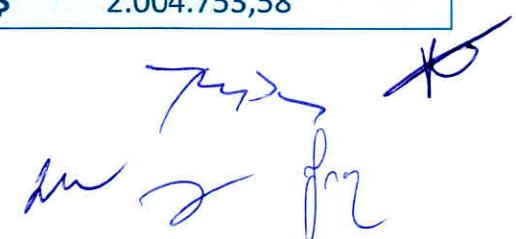
É um título do Tesouro Direto com prazo e rentabilidade prefixada. Ou seja, é sabido exatamente quanto tempo levará para sacar o dinheiro e quanto receberá ao final do investimento.

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\$ 425.347,59 |
| TÍTULOS PÚBLICOS – NTN-B22, 23, 24 e 35 | R\$ 1.006.958,07 |
| TÍTULOS PÚBLICOS LTN/23 | R\$ 357.709,08 |
| TÍTULO PRIVADO (LF BRADESCO/ XP) | R\$ 214.738,84 |
| TOTAL | R\$ 2.004.753,58 |



PLANO DE AÇÃO



e

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 2023 é de 4,71% + IPCA.

Para o mês de janeiro /2023, 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 |

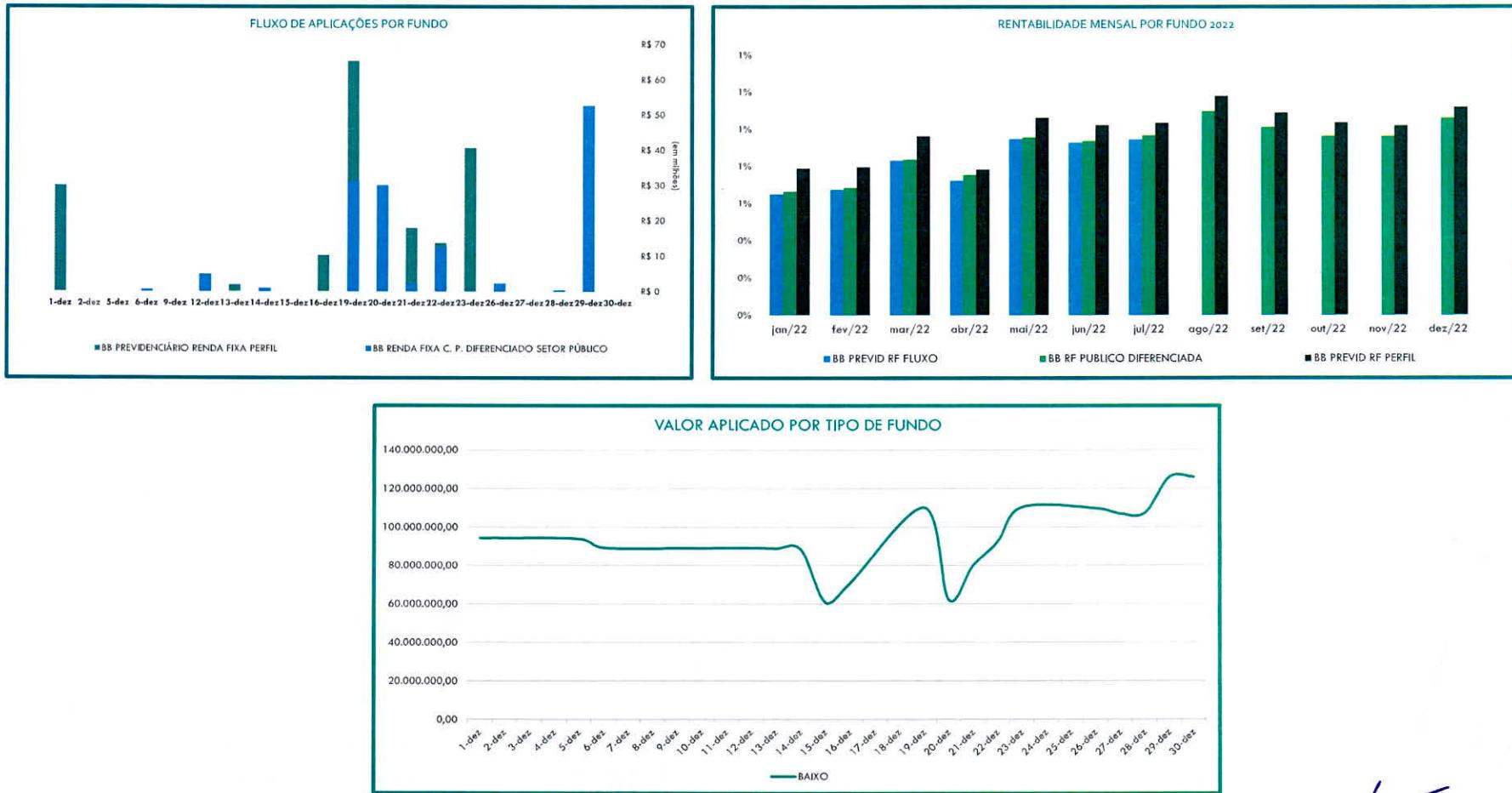
m 27/01/2023

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 dezembro. 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 dezembro, com o percentual de 1,12%. Em análise dos gráficos agosto foi o mês de melhor movimento dos últimos 12 meses, que apresentou maior rentabilidade.

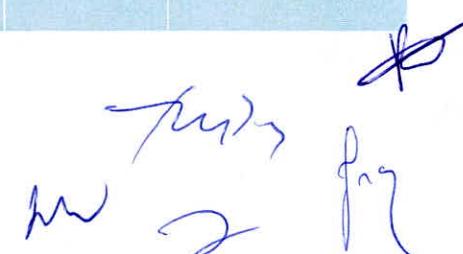


K
MM
P
fz

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\$ 12.516.728,83 | 87.398,53 | 0,94% | 0,94% | 87.398,53 | R\$ 0,00 | 57.594.739,75 |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO DIFERENCIADO SETOR | R\$ 12.866.492,76 | R\$ 113.507,85 | 1,06% | 1,06% | R\$ 113.507,85 | R\$ 0,00 | R\$ 138.222.865,65 |
| BB PREVID RF PERFIL | R\$ 81.566.024,91 | R\$ 914.185,16 | 1,12% | 1,12% | R\$ 914.185,16 | R\$ 0,00 | R\$ 133.433,79 |

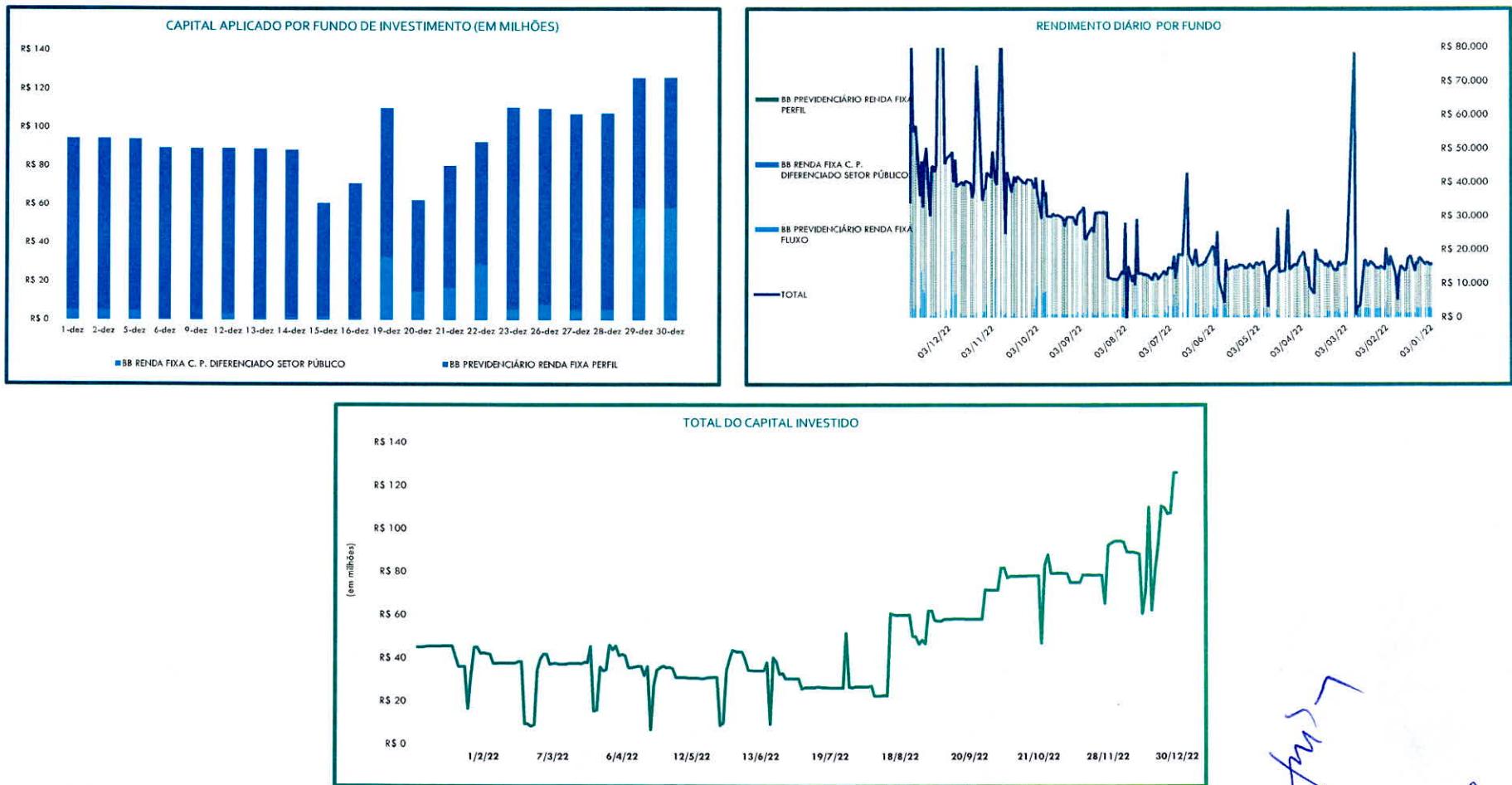


 m 2 f

ANÁLISE DE DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO

Pg 20

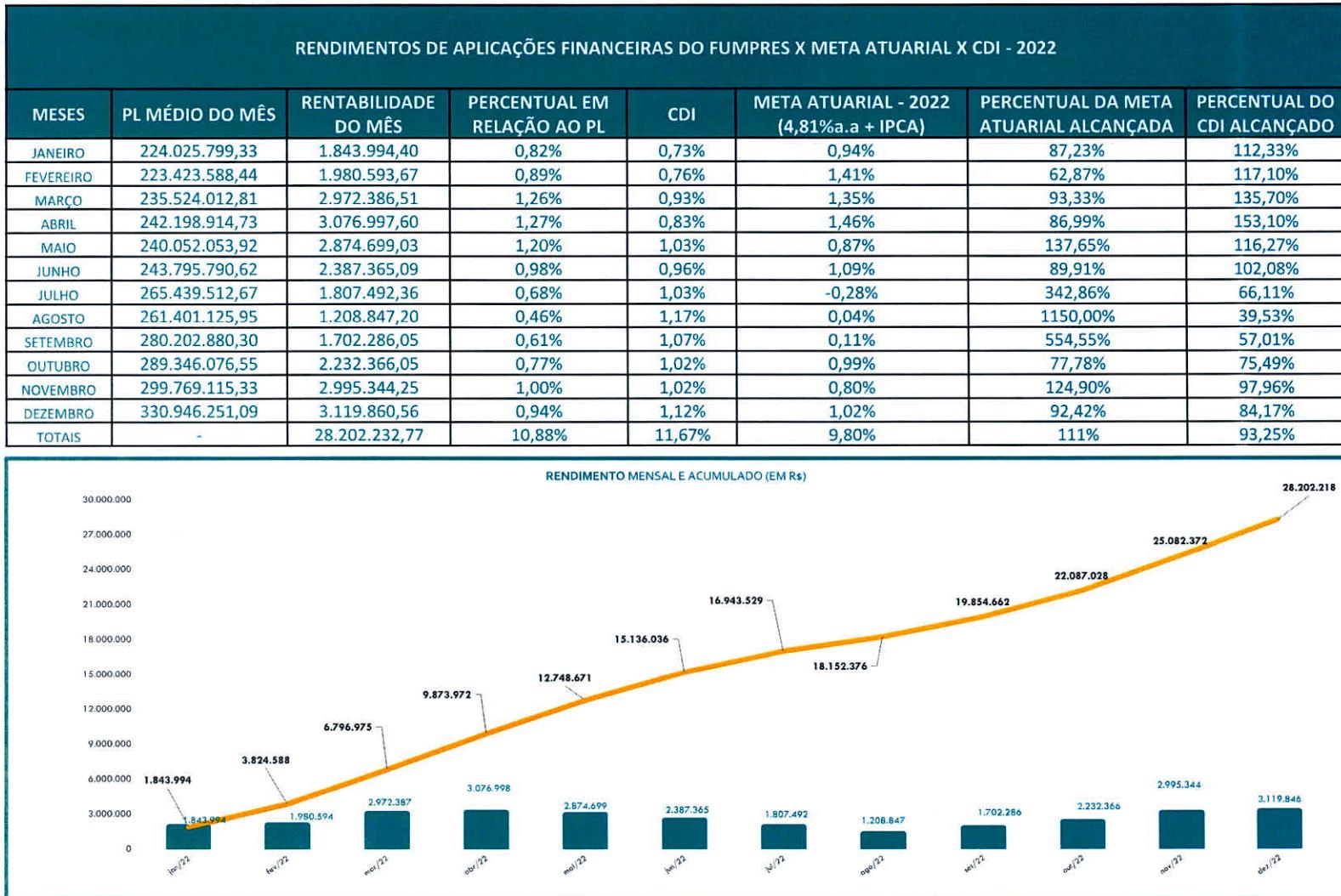
Os gráficos abaixo ilustram a dinâmica de aplicações por fundo, bem como a capacidade de investimento do FUMPRES, ao longo do mês. O rendimento mensal apresentou variação de saldo, quando comparado com o período anterior, R\$ 3.119.860,56 no período corrente, e R\$ 2.995.344,25 no período anterior. Deste rendimento total mensal, o fundo que apresentou maior rendimento foi o BB RF PERfil que rendeu o total de R\$ 914.185,16



Maria
Silvana
Dra. Ana
Flávia

ANÁLISE DE DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO

Pg 21



[Assinaturas]

QUADRO-RESUMO DO
DESEMPENHO DA CARTEIRA DE
INVESTIMENTOS

QUADRO-RESUMO DO DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

| INSTITUIÇÃO FINANCEIRA | FUNDOS/TÍTULOS | SALDO MÉDIO | TIR Mês | CDI | % CDI |
|------------------------|-----------------------------|--------------------|--------------|--------------|---------------|
| BANCO DO BRASIL | Fundo Diferenciado | R\$ 12.866.492,76 | 0,96% | 1,12% | 85,71% |
| | Fundo Ref. Perfil | R\$ 81.566.024,91 | 1,12% | 1,12% | 100,00% |
| XP INVESTIMENTOS | Títulos Públicos e Privados | R\$ 227.747.766,32 | 0,81% | 1,12% | 72,32% |
| BRADESCO | Fundo CP Poder Público | R\$ 12.516.728,83 | 0,94% | 1,12% | 83,93% |
| | TOTAL | | 0,94% | 1,12% | 84,17% |

COMPARATIVO DO RESULTADO DOS TÍTULOS PÚBLICOS - XP

| INDEXADORES | MÊS (%) | ANO (%) | 12 MESES | DESDE MARÇO/2021 (%) |
|-------------|---------|---------|----------|----------------------|
| Carteira | 0,81% | 10,95% | 10,95% | 19,24% |
| CDI | 0,97% | 12,20% | 12,20% | 16,76% |
| IPCA | 0,62% | 5,79% | 5,79% | 14,89% |
| IBOVESPA | -3,47% | 3,58% | 2,86% | 5,75% |

POUPANÇA PÚBLICA

| 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 |
| nov/22 | R\$ 1.005.310,59 |
| dez/22 | R\$ 2.031.380,04 |
| TOTAL 2022 (c) | R\$ 11.755.677,81 |
| RENDIMENTOS (d) | 3.129.207,99 |
| TOTAL (a+b+c+d) | R\$ 34.786.317,95 |

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 de 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.

ENQUADRAMENTO

Pg 24

| FUNDOS CREDENCIADOS/TÍTULOS TESOURO | CNPJ | Limite Legal | Limite por Fundo/Título | Aplicação | Participação | Grau de Risco | Resgate | Alínea "A" 40% | TP/LTN - SELIC 100% | LF - BRADESCO e LF XP 20% |
|--|--------------------|--------------|-------------------------|---------------|--------------|---------------|---------|----------------|---------------------|---------------------------|
| BB RF DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO | 07.214.377/0001-92 | 40% | 20% | 58.150.716,03 | 16,31% | Baixo | D+O | | | |
| BB Previd RF Perfil Fi | 13.077.418/0001-49 | 40% | 20% | 67.880.134,80 | 19,04% | Baixo | D+O | | | |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 00.834.074/0001-23 | 40% | 20% | 54,66 | 0,00% | Baixo | N/A | | | |
| BDN CP PODER PUBLICO - 90020-6 APLICAÇÃO | 13.397.466/0001-14 | 40% | 20% | 285.112,40 | 0,08% | Baixo | N/A | | | |
| BDN CP PODER PUBLICO - 90024-9 APLICAÇÃO | 13.397.466/0001-14 | 40% | 20% | 2.497.731,82 | 0,70% | Baixo | N/A | | | |
| LF-25 BRADESCO 21-01-2022 JANEIRO/25 | 02.332.886/0001-04 | 20% | 20% | 5.479.923,89 | 1,54% | Baixo | N/A | | | |
| LF-23 BRADESCO 28-10-2022 MAIO/23 | 02.332.886/0001-04 | 20% | 20% | 10.181.440,81 | 2,86% | Baixo | N/A | | | |
| LF-24 BANCO XP 17-05-2022 MAIO/24 | 02.332.886/0001-04 | 20% | 20% | 2.202.295,75 | 0,62% | Baixo | N/A | | | |
| LF-23 BRADESCO 16-12-2022 MARÇO/23 | 02.332.886/0001-04 | 20% | 20% | 3.497.436,23 | 0,98% | Baixo | N/A | | | |
| LF-23 BRADESCO 16-12-2022 JULHO/23 | 02.332.886/0001-04 | 20% | 20% | 1.131.152,78 | 0,32% | Baixo | N/A | | | |
| LF-23 BRADESCO 16-12-2022 JUNHO/23 | 02.332.886/0001-04 | 20% | 20% | 1.020.778,38 | 0,29% | Baixo | N/A | | | |
| LF-23 BRADESCO 19-12-2022 JUNHO/23 | 02.332.886/0001-04 | 20% | 20% | 113.419,82 | 0,03% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS LTN-23 16-08-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 31.468.990,03 | 8,83% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS LTN-23 18-08-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 676.655,16 | 0,19% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F23 18-08-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 10.164.929,17 | 2,85% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F23 01-10-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 30.564.232,52 | 8,57% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F-31 04-01-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 638.270,28 | 0,18% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 05-03-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 7.118.882,38 | 2,00% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 25-02-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 4.145.696,60 | 1,16% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 16-02-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 687.832,11 | 0,19% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 02-02-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 3.143.176,18 | 0,88% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 02-02-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 889.748,50 | 0,25% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 31-03-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 11.125.648,67 | 3,12% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 29-07-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 10.046.882,40 | 2,82% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 25-10-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 15.739.541,12 | 4,41% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 25-10-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 5.254.443,30 | 1,47% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 12-04-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 1.505.712,12 | 0,42% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 03-08-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 937.921,62 | 0,26% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 28-06-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 913.810,99 | 0,26% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 12-04-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 2.010.396,93 | 0,56% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 04-01-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 2.072.246,05 | 0,58% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 11-04-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 419.129,73 | 0,12% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 11-04-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 416.565,43 | 0,12% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 03-03-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 860.688,58 | 0,24% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 02-12-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 902.808,62 | 0,25% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 03-06-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 821.207,10 | 0,23% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 06-05-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 795.664,24 | 0,22% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 26-10-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 860.518,45 | 0,24% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F35 05-03-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 3.911.746,02 | 1,10% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 04-05-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 861.492,50 | 0,24% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 07-06-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 843.120,34 | 0,24% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 04-08-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 836.347,32 | 0,23% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 19-05-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 82.471,72 | 0,02% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 01-07-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 443.090,39 | 0,12% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 22-09-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 215.728,00 | 0,06% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 22-07-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 206.854,10 | 0,05% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 09-09-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 857.735,41 | 0,24% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 05-10-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 810.234,27 | 0,23% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 05-10-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 46.013,30 | 0,01% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 22-07-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 862.689,77 | 0,24% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 19-05-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 215.095,14 | 0,06% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 19-05-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 197.334,84 | 0,05% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 19-03-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 196.426,25 | 0,06% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 31-03-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 945.499,41 | 0,27% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F23 13-10-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 167.752,04 | 0,05% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 17-06-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 193.315,81 | 0,05% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 20-04-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 35.715,62 | 0,01% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 01-07-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 196.412,67 | 0,06% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 17-11-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 609.900,92 | 0,17% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 17-11-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 117.241,75 | 0,03% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 17-05-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 296.975,24 | 0,08% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B24 23-11-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 231.170,39 | 0,06% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 22-12-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 26.492.346,06 | 7,43% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B23 16-08-2022 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 18.082.212,89 | 5,07% | Baixo | N/A | | | |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 23-12-2021 | 02.332.886/0001-04 | 100% | 100% | 1.984.425,18 | 0,56% | Baixo | N/A | | | |
| TOTAL INVESTIMENTOS | | | | | | | | 356.561.516,00 | 100,0% | |
| | | | | | | | | | | |

36,13%

57,25%

6,63%

J
W
fay

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

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, dezembro 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, dezembro de 2022



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