COMPOSIÇÃO MENSAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO E ATIVO (SETEMBRO 2023)

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO COM ESTRUTURAS E LIMITES

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

De acordo com a Política de Investimentos 2023, elaborada pelo Comitê de Investimentos, as aplicações do FUMPRES deverão ter predominância em investimentos de **renda fixa** obedecendo aos seguintes critérios:

SEGMENTO	COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DO FUNDO DE INVESTIMENTO	RESOLUÇÃO CMN 4.963/2021	% DO CAPITAL ALOCADO	% ALOCAÇÃO POR PL DO FUNDO	% ALOCAÇÃO POR FUNDO
RENDA FIXA	TÍTULOS DE EMISSÃO DO TESOURO NACIONAL,	ART. 7°, I, “A”	ATÉ 100%	NÃO SE APLICA	-
RENDA FIXA	COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CLASSIFICADOS COMO RENDA FIXA, CONFORME REGULAMENTAÇÃO ESTABELECIDA PELA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CONSTITUÍDOS SOB A FORMA DE CONDOMÍNIO ABERTO, CUJOS REGULAMENTOS DETERMINEM QUE SEUS RECURSOS SEJAM APLICADOS EXCLUSIVAMENTE EM TÍTULOS DEFINIDOS NA ALÍNEA "A", OU COMPROMISSADAS LASTREADAS NESSES TÍTULOS	ART. 7°, I, “B”	ATÉ 100%	ATÉ 15%	-
RENDA FIXA	ATÉ 5% (CINCO POR CENTO) DIRETAMENTE EM OPERAÇÕES COMPROMISSADAS, LASTREADAS EXCLUSIVAMENTE PELOS TÍTULOS DEFINIDOS NA ALÍNEA "A" DO INCISO I;	ART. 7°, II	ATÉ 5%	NÃO SE APLICA	-
RENDA FIXA	COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CLASSIFICADOS COMO RENDA FIXA, CONFORME REGULAMENTAÇÃO ESTABELECIDA PELA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CONSTITUÍDOS SOB A FORMA DE CONDOMÍNIO ABERTO (FUNDOS DE RENDA FIXA);	ART. 7°, III “A”	ATÉ 60%	ATÉ 15%	ATÉ 20%
RENDA FIXA	ATÉ 20% (VINTE POR CENTO) DIRETAMENTE EM ATIVOS FINANCEIROS DE RENDA FIXA DE EMISSÃO COM OBRIGAÇÃO OU COOBRIGAÇÃO DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS BANCÁRIAS AUTORIZADAS A FUNCIONAR PELO BANCO CENTRAL DO BRASIL, QUE ATENDAM ÀS CONDIÇÕES PREVISTAS NO INCISO I DO § 2º DO ART. 21;	ART. 7°, IV	ATÉ 40%	ATÉ 15%	ATÉ 20%
RENDA FIXA	COTAS DE FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS, CONSTITUÍDOS SOB A FORMA DE CONDOMÍNIO	ART. 7°, VI	ATÉ 15%	NÃO SE APLICA	-

RENDA FIXA	DEPÓSITOS DE POUPANÇA EM INSTITUIÇÃO FINANCEIRA CONSIDERADA DE BAIXO RISCO DE CRÉDITO (LETRAS IMOBILIÁRIAS GARANTIDAS)	ART. 7°, V	ATÉ 20%	NÃO SE APLICA	-
RENDA VARIAVEL	FUNDOS DE AÇÕES EM GERAL	ART. 8°, II, a	ATÉ 20%	ATÉ 5%	-
	FUNDOS MULTIMERCADO	ART. 8º, III	ATÉ 10%	ATÉ 5%	-
EXTERIOR	FUNDOS BDR NÍVEL I	ART. 9°, III	ATÉ 10%	ATÉ 5%	-

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR ATIVO COM CLASSIFICAÇÃO DE RISCO

A tabela abaixo relaciona os fundos credenciados do FUMPRES com a sua classificação de risco, taxa de administração, rentabilidade, o índice de comparação (benchmark), e o percentual da rentabilidade do fundo em relação ao seu benchmark em 2023 (até **SETEMBRO**).

Observamos que a carteira é composta por:

- Dois fundos classificados como de **risco muito baixo** (com rentabilidade de **0,81% e 0,92%** em 2023);
- Um fundo classificado como de **risco baixo** (com rentabilidade de **0,96%** em 2023).

FUNDO CREDENCIADO	CLASSIFICAÇÃO DE RISCO	TAXA DE ADMNISTRAÇÃO	RENTABILIDADE EM 2023	BENCHMARK	% BENCHMARK EM 2023
BRADESCO FIC FI RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER	**MUITO BAIXO**	**1,5% A.A.**	**0,81%**	**CDI**	**83,33%**
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO	**MUITO BAIXO**	**0,50% A.A.**	**0,92%**	**CDI**	**94,84%**
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FIC	**BAIXO**	**0,20% A.A.**	**0,96%**	**CDI**	**98,96%**