



RELATÓRIO GERENCIAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 1º SEMESTRE 2024

[Handwritten signatures and initials]

0

RELATÓRIO GERENCIAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

Este documento contempla o Relatório Semestral de Diligências, que demonstra a verificação dos lastros relativos aos Fundos de Investimentos, Títulos Públicos e demais papéis incluídos nas carteiras de ativos dos fundos de investimentos aplicados pelo RPPS, utilização do ALM, além da análise da situação patrimonial, fiscal, comercial e jurídica das instituições investidas, tendo como suporte as informações prestadas pelas administradoras e gestoras dos fundos de investimentos e demais informações disponíveis na internet de conhecimento público, ou outros meios disponíveis no mercado acessíveis pelos RPPS.

Além disso, este presente documento contempla também o Relatório de Acompanhamento da Implementação das Estratégias, que demonstra o acompanhamento da implementação das estratégias de carteiras específicas para os compromissos do plano com seus segurados e beneficiários.



1

Sumário

1. APLICAÇÕES FINANCEIRAS	3
2. ESTRATÉGIAS NA MOVIMENTAÇÃO FINANCEIRA	3
3. FUNDOS DE INVESTIMENTOS	4
4. TÍTULOS PÚBLICOS E PRIVADOS	5
5. POLÍTICA DE INVESTIMENTOS	6
6. RENTABILIDADE FINANCEIRA	7
7. LASTROS DOS PAPEIS COM INVESTIMENTO DO RPPS.....	7

7/17

✓

for

2

W

1. APLICAÇÕES FINANCEIRAS

A Unidade de Contabilidade e Gestão de Recursos - UCGR, procura de forma responsável desempenhar diariamente a movimentação nos Fundos Credenciados do Regime Próprio de Previdência Social – RPPS de Salvador/BA e Títulos Públicos do Tesouro, em busca das melhores rentabilidades ofertadas no mercado financeiro.

2. ESTRATÉGIAS NA MOVIMENTAÇÃO FINANCEIRA

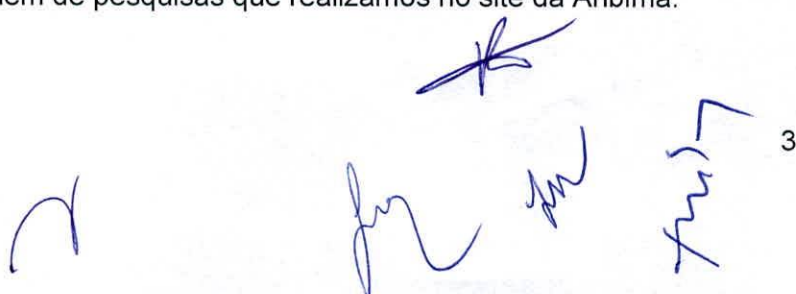
O Setor de Gestão de Investimentos, extrai os extratos bancários junto aos sites das Instituições Financeiras, busca as informações sobre os saldos das contas, taxas de aplicações diárias, mensal, anual e dos últimos 12 meses e através de planilha analisa a forma de distribuição das aplicações financeiras nos Fundos Credenciados.

As informações obtidas por meio dos Sites da Anbima, UOL Economia, FGV, IPEA Infomoney, dentre outros, oferecem o acompanhamento do comportamento diário do Mercado Financeiro, IBOVESPA, CÂMBIO e taxas de Títulos Públicos e Privados, além de outros papéis, consolidando os principais indicadores de investimentos. Após análise desses índices, busca-se alocar os recursos nos papéis com maior projeção de rentabilidade futura.

Utilizamos também, a estratégia para enquadramento dos limites de investimentos em atenção à Resolução nº 4.963/2021, obedecendo a participação de cada papel de investimentos, considerando ainda os limites estabelecidos na política de Investimentos.

O histórico de cada Fundo Credenciado, também serve como parâmetro na análise e decisão de alterações na alocação dos recursos. Através de índices financeiros pode-se acompanhar a rentabilidade e a relação risco retorno dos fundos, além de verificar se os resultados estão aderentes ao benchmark estabelecido.

Para os investimentos em Títulos Públicos do Tesouro e Títulos Privados, recebemos diariamente através de e-mail, as informações das taxas e P.U atualizados das corretoras credenciadas por este RPPS, além de pesquisas que realizamos no site da Anbima.



3

3. FUNDOS DE INVESTIMENTOS

O Credenciamento dos Fundos de Investimentos, tem como objetivo diversificar as aplicações em ativos que estejam enquadrados na Resolução nº 4.963/2021.

Este RPPS busca ter conhecimento dos aspectos que caracterizam cada Fundo de Investimento, em relação ao conteúdo do seu Regulamento e de fatos relevantes que possam contribuir para seu desempenho, além de sua compatibilidade ao perfil da carteira e à Política de investimentos do RPPS.

Apresentamos os fundos de Investimento que compõem a carteira de investimentos do RPPS de Salvador/BA no 1º semestre de 2024, junto ao Banco do Brasil e Bradesco.

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA TÍTULO PÚBLICO - Art. 7º, I, b	JUNHO	GESTOR	CREDENCIAMENTO	ADMINISTRADOR
BB RF DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO	86.069.808,16	BB GESTÃO DE RECURSOS	03/05/2019	BB GESTÃO DE RECURSOS
SUBTOTAL	86.069.808,16	-	-	-
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA TÍTULO PÚBLICO - Art. 7º, III, a	JUNHO	GESTOR	CREDENCIAMENTO	ADMINISTRADOR
BB Previd RF Perfil FI	42.930.474,62	BB GESTÃO DE RECURSOS	03/05/2019	BB GESTÃO DE RECURSOS
BDN CP PODER PUBLICO - 118.743-0 APLICAÇÃO	275.304,61	BANCO BRADESCO	20/11/2017	BRAM-BRADESCO ASSET
BDN CP PODER PUBLICO - 118738-4 APLICAÇÃO	808,81	BANCO BRADESCO	20/11/2017	BRAM-BRADESCO ASSET
SUBTOTAL	43.206.588,04	-	-	-
TOTAL GERAL	129.276.396,20			

[Handwritten signatures and initials]

4. TÍTULOS PÚBLICOS E PRIVADOS

Apresentamos os Títulos Públicos e Privados que compõem a carteira de investimentos do RPPS de Salvador/BA no 1º semestre de 2024, custodiados junto a Corretora XP Investimentos:

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS DE SALVADOR/BA 1º SEMESTRE 2024				
TÍTULOS PÚBLICOS - TESOIRO NACIONAL - Art. 7º, I, a	JUNHO	GESTOR	CREDENCIAMENTO	ADMINISTRADOR
NTN-B24	106.342.636,72	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B24	104.136.491,56	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B24	101.511.860,57	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B24	53.721.316,83	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B25	50.411.315,75	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B24	4.749.057,24	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B24	20.080.832,25	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B35	4.132.505,55	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B35	2.121.345,52	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B35	1.010.528,89	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B35	981.534,08	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B35	965.137,77	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B35	954.046,71	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B35	923.879,73	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B35	922.049,69	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B35	881.870,47	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B35	854.122,64	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B35	446.161,79	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B35	318.532,02	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B24	245.966,06	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B35	125.331,14	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F31	7.042.822,81	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F31	940.094,96	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F31	866.273,55	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F31	858.293,41	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F31	855.064,46	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F31	838.068,20	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F31	830.000,31	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP

NTN-F31	815.509,99	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F31	642.017,55	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F31	440.343,39	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F25	216.399,88	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F25	214.711,34	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F25	201.807,93	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F25	192.360,01	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F25	192.114,94	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F25	191.346,71	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F25	187.451,83	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F31	82.108,02	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F31	46.312,91	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-F25	34.860,99	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B24	15.058.440,54	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B24	5.303.825,83	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B25	5.239.452,57	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
NTN-B33	3.385.669,36	TESOURO NACIONAL	05/03/2021	XP
SUBTOTAL	500.511.874,47	-	-	-
TITULOS PRIVADOS Art. 7º, IV	JUNHO	GESTOR	CREDENCIAMENTO	ADMINISTRADOR
LF-25 BRADESCO	6.428.979,29	BANCO XP S.A	05/03/2021	XP
LF-29 BANCO XP	10.047.556,87	BANCO XP S.A	05/03/2021	XP
SUBTOTAL	16.476.536,16	-	-	-
TOTAL	516.988.410,63			

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]

5. POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

Todos os ativos que compõem a carteira de investimentos do RPPS no 1º semestre de 2024, estão de acordo com a política de investimentos para o ano de 2024 e, também, preenchem os requisitos de liquidez, baixo risco de crédito e rentabilidade exigidos nos editais de credenciamentos.

6. RENTABILIDADE FINANCEIRA

No que tange a rentabilidade Financeira, cabe ressaltar que o rendimento do 1º semestre de 2024, foi de R\$ 33.260.171,66. Observa-se que o desempenho das aplicações quando comparado o primeiro semestre de 2024 (R\$ 33.260.171,66) com o segundo semestre de 2023 (R\$ R\$ 25.452.857,92) tivemos um crescimento de 31%, o que pode ser justificado pela ampliação do Patrimônio Líquido e a maior alocação dos investimentos em fundos atrelados ao CDI E Performance dos títulos públicos indexados ao IPCA.

7. LASTROS DOS PAPÉIS COM INVESTIMENTO EM FUNDOS

No que tange aos Lastro dos papeis com aplicação do Regime Próprio de Previdência Social – RPPS de Salvador/BA, no 1º semestre do exercício 2024, podemos destacar:

FUNDO	CNPJ
BB RF DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO	07.214.377/0001-92
BB PREVID RF PERFIL FI	13.077.418/0001-49
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTOS EM COTA DE FI RF CP PODER PÚBLICO	13.397.466/0001-14

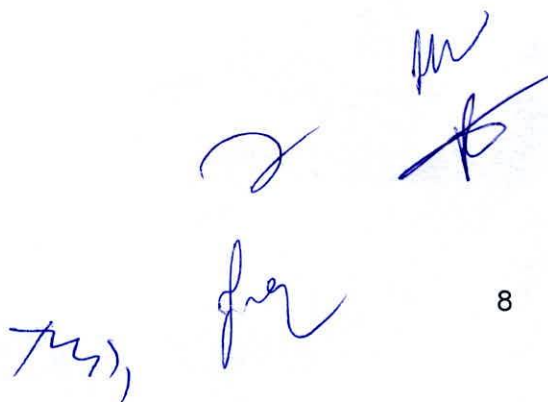
Todos os fundos de investimentos relacionados acima, tem sua carteira formada majoritariamente por Ativos de Renda Fixa e tem seu lastro atrelado a esses produtos.

O acompanhamento das aplicações em fundos de investimentos e Títulos Públicos e Privados do RPPS de Salvador/BA, se enquadram na metodologia ALM, tendo em vista que é feito um acompanhamento diário dos saldos aplicados em cada ATIVO, além da automação do processo com a implantação do SISPREVWEB.

Quanto aos lastros de cada Fundo e Títulos Privados, anexamos Demonstrações Financeiras do BBDMVM, Balanço da XP Investimentos, Balanços do Banco XP e do Banco Bradesco. Ressaltamos que a XP Investimentos faz a custódia dos Títulos Públicos e Privados, entretanto quem garante os Títulos Públicos é o Tesouro Nacional e os Privados as respectivas emissoras.

Os Relatórios anexados, demonstram de forma clara e inequívoca a garantia dos recursos aplicados em tais produtos, tendo vista a composição de suas carteiras, além do Banco do Brasil se tratar de instituição financeira brasileira, constituída na forma de sociedade de economia mista, com participação do Governo Federal do Brasil em 50% das ações. Podemos ainda acrescentar, ser o Banco do Brasil o maior banco da América Latina, com a maior rede de agências do Brasil no Exterior.

Por fim, ressaltamos que no 1º semestre de 2024, este RPPS aplicou apenas nos fundos credenciados do Banco do Brasil e Bradesco. No que tange aos Títulos Públicos e Privados, foram adquiridos através da XP Investimentos.



Comitê de Investimentos Biênio 2023-2025



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, junho de 2024.