



## COMPOSIÇÃO MENSAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO E ATIVO (JUNHO 2024)

## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO COM ESTRUTURAS E LIMITES

A carteira de investimentos do Fundo Municipal de Previdência de Salvador (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 2024, 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<br>4.963/2021 | % DO CAPITAL<br>ALOCADO | % ALOCAÇÃO POR PL<br>DO FUNDO | % ALOCAÇÃO<br>POR FUNDO |
|--------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|-------------------------|-------------------------------|-------------------------|
| REND A FIXA        | TÍTULOS DE EMISSÃO DO TESOURO NACIONAL,                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | ART. 7º, I, "A"             | ATÉ 100%                | NÃO SE APLICA                 | -                       |
| REND A FIXA        | COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CLASSIFICADOS COMO RENDA FIXA, CONFORME REGULAMENTAÇÃO ESTABELECID A 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. 7º, I, "B"             | ATÉ 100%                | ATÉ 15%                       | -                       |
| REND A FIXA        | ATÉ 5% (CINCO POR CEN TO) DIRETAMENTE EM OPERAÇÕES COMPROMISSADAS, LASTREADAS EXCLUSIVAMENTE PELOS TÍTULOS DEFINIDOS NA ALÍNEA "A" DO INCISO I;                                                                                                                                                                                                          | ART. 7º, II                 | ATÉ 5%                  | NÃO SE APLICA                 | -                       |
| REND A FIXA        | COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CLASSIFICADOS COMO RENDA FIXA, CONFORME REGULAMENTAÇÃO ESTABELECID A PELA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CONSTITUÍDOS SOB A FORMA DE CONDOMÍNIO ABERTO (FUNDOS DE RENDA FIXA);                                                                                                                                         | ART. 7º, III<br>"A"         | ATÉ 60%                 | ATÉ 15%                       | ATÉ 20%                 |
| REND A FIXA        | ATÉ 20% (VINTE POR CEN TO) 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. 7º, IV                 | ATÉ 40%                 | ATÉ 15%                       | ATÉ 20%                 |
| REND A FIXA        | COTAS DE FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS, CONSTITUÍDOS SOB A FORMA DE CONDOMÍNIO                                                                                                                                                                                                                                                                              | ART. 7º, VI                 | ATÉ 15%                 | NÃO SE APLICA                 | -                       |
| REND A FIXA        | DEPÓSITOS DE POUPANÇA EM INSTITUIÇÃO FINANCEIRA CONSIDERADA DE BAIXO RISCO DE CRÉDITO (LETRAS IMOBILIÁRIAS GARANTIDAS)                                                                                                                                                                                                                                   | ART. 7º, V                  | ATÉ 20%                 | NÃO SE APLICA                 | -                       |
| REND A<br>VARIÁVEL | FUNDOS DE AÇÕES EM GERAL                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | ART. 8º, II, a              | ATÉ 20%                 | ATÉ 5%                        | -                       |
|                    | FUNDOS MULTIMERCADO                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | ART. 8º, III                | ATÉ 10%                 | ATÉ 5%                        | -                       |
| EXTERIOR           | FUNDOS BDR NÍVEL I                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | ART. 9º, III                | ATÉ 10%                 | 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 2024 (até **JUNHO**).

Observamos que a carteira é composta por:

- Dois fundos classificados como de **risco muito baixo** (com rentabilidade de **0,63%** e **0,73%** em 2024);
- Um fundo classificado como de **risco baixo** (com rentabilidade de **0,78%** em 2024).

| FUNDO CREDENCIADO                                                   | CLASSIFICAÇÃO DE RISCO | TAXA DE ADMINISTRAÇÃO | RENTABILIDADE JUNHO 2024 | BENCHMARK | % BENCHMARK JUNHO 2024 |
|---------------------------------------------------------------------|------------------------|-----------------------|--------------------------|-----------|------------------------|
| BRADESCO FIC FI RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER                        | MUITO BAIXO            | 1,5% A.A.             | 0,63%                    | CDI       | 79,74%                 |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO                | MUITO BAIXO            | 0,50% A.A.            | 0,73%                    | CDI       | 92,40%                 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FIC | BAIXO                  | 0,20% A.A.            | 0,78%                    | CDI       | 98,73%                 |