



RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

AGOSTO/2024

SUMÁRIO

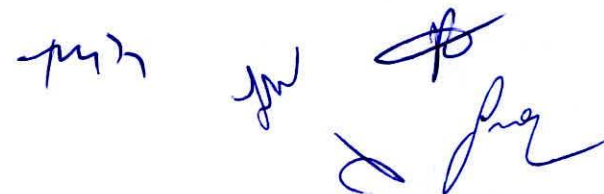
INTRODUÇÃO	PG 03
ANÁLISE DO CENÁRIO ECONÔMICO.....	PG 05
ECONOMIA BRASILEIRA.....	PG 06
ECONOMIA MUNDIAL.....	PG 07
CARTEIRA DE INVESTIMENTOS.....	PG 08
COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS	PG 09
FUNDO BB RENDA FIXA CURTO PRAZO DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO	PG 13
FUNDO BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL	PG 15
TÍTULOS PÚBLICOS E PRIVADO/XP INVESTIMENTOS	PG 17
PLANO DE AÇÃO.....	PG 18
PLANO DE AÇÃO MENSAL.....	PG 19
COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM AGOSTO.....	PG 20
ANÁLISE DE DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS	PG 21
QUADRO-RESUMO DO DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS	PG 24
RENDIMENTO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS	PG 25
RESUMO GERAL DO PATRIMÔNIO DO RPPS.....	PG 27
POUPANÇA PÚBLICA PREVIDENCIÁRIA.....	PG 29
ENQUADRAMENTO.....	PG 30

Handwritten signatures in blue ink.

Com foco no segurado e total transparência, o Fundo Municipal da Previdência de Salvador - Financeiro – FUMPRES FIN e o Fundo Municipal da Previdência de Salvador - Previdenciário – FUMPRES PREV, responsáveis pela execução e acompanhamento da Política de Investimentos do Regime Próprio de Previdência de Salvador, apresenta o relatório de investimentos, referente ao mês de agosto de 2024, refletindo todas as decisões do comitê de investimentos, a fim de garantir a sustentabilidade e segurança das aplicações financeiras. Neste relatório é possível observar a evolução, tanto quantitativa quanto qualitativa dos investimentos realizados, bem como os resultados satisfatórios obtidos através das metodologias de investimentos aplicadas e parametrizadas com a política de Investimentos para o exercício 2024. Dentro da nossa estratégia de gerenciamento de risco de investimentos, permanecemos em agosto de 2024 num cenário econômico propenso à aversão a riscos, bem como a manutenção da posição consolidada em ativos de renda fixa (100% da carteira), na qual a opção por Títulos Públicos do Tesouro Nacional permanece como a melhor relação risco x retorno, rentabilidade e segurança. Em agosto, nossa rentabilidade ultrapassou R\$ 5,3 milhões de reais, um resultado expressivo, equivalente a 0,82% em relação ao nosso Patrimônio Líquido médio mensal, o que representa um resultado que supera mais uma vez a meta atuarial que alcançou 0,41% no mês.

Cenário Econômico Interno

A recente divulgação do surpreendente PIB do segundo trimestre de 2024 trouxe bastante otimismo para a equipe econômica do governo em melhorar os indicadores fiscais e abrir margem de revisão dos parâmetros da arrecadação em 2025. Aliado a esse fator, a queda brusca do câmbio, a melhora nos índices de emprego e recorde na Bolsa de Valores, contribuem para euforia com a economia no Brasil. Os indicadores que melhoraram, contrastam com o cenário ainda nebuloso enxergado pela autoridade monetária ao não sinalizar em julho passado que não vê campo para aliviar os juros, ainda em patamar elevado de 10,5%. Para os próximos meses o governo espera consolidar os dados positivos da economia e com isso, utilizar de trunfo para aumentar a pressão sobre o BC reiniciar a curva descendente dos juros. Portanto, este comitê de Investimento mantém-se atento às oportunidades de mercado para alocar recursos em produtos de investimento atrelados à inflação. O resultado expressivo em agosto já foi uma amostra do quanto podemos avançar na rentabilidade mantendo a nossa carteira ativa e gerenciada de acordo com as dinâmicas do mercado financeiro. Para os próximos meses, vislumbramos um ambiente propício à alocações pontuais em produtos que rentabilizem com indexador IPCA, com a prevista elevação da SELIC, ante o comunicado do BACEN em julho passado.



Cenário Econômico Externo

A criação de vagas de trabalho nos Estados Unidos ficou abaixo do esperado em agosto. No entanto, a taxa de desemprego caiu para 4,2% no período. Combinados, os números sugerem que a desaceleração no mercado de trabalho continuou. No entanto, não justifica um corte maior na taxa de juros pelo Federal Reserve neste mês. Segundo o Departamento do Trabalho dos EUA, a economia norte-americana criou 142 mil postos de trabalho no mês passado. Em julho, houve a abertura de 89 mil vagas, após revisão. Economistas consultados pela Reuters previam a criação de 160 mil vagas no mês passado, depois de 114 mil em julho, conforme divulgação original.

Ainda assim, o resultado menor do que o esperado não sinaliza uma piora nas condições do mercado de trabalho nos EUA. Na véspera, a secretária do Tesouro dos EUA, Janet Yellen, disse que a situação do emprego no país permanece “saudável”, embora o ritmo de geração de vagas tenha diminuído nos últimos meses. No mercado futuro, investidores veem o Fed iniciando o ciclo de cortes de juros neste mês com uma redução de 0,50 ponto percentual (pp). Essa possibilidade ganhou força e está agora em 55% de chance, após os dados do relatório oficial de emprego nos EUA. Antes do relatório, havia 43% de chance, com apostas maiores de redução de 0,25 pp.

No entanto, o dado de agosto tende a ser inicialmente mais fraco em relação à estimativa e à tendência recente, sendo posteriormente revisado para cima. Trata-se de um fator que é previsto pelo modelo que o governo usa de modo a eliminar as flutuações sazonais dos dados. Isso acontece porque as contratações no setor educacional aumentam. O início do novo ano letivo, entretanto, varia em todo o país, o que pode desequilibrar os chamados fatores sazonais. As contagens iniciais do relatório de agosto foram revisadas para cima em 10 dos últimos 13 anos. Já as demissões permanecem em níveis historicamente baixos. Tanto que a taxa de desemprego caiu em agosto pela primeira vez depois de quatro aumentos mensais consecutivos. Em julho, a taxa estava perto de um recorde de três anos, a 4,3%.



ANÁLISE DO CENÁRIO ECONÔMICO

Handwritten signature in blue ink.

Confiança do Consumidor sobe pelo terceiro mês consecutivo

“A confiança do consumidor sobe pela terceira vez seguida, embora em um ritmo mais lento. O resultado modesto foi influenciado igualmente pela melhora das percepções sobre o presente e as expectativas futuras. Entre as faixas de renda, diferente do que vinha ocorrendo ao longo desse ano, o resultado no mês foi motivado pelas faixas de renda mais altas, especialmente para consumidores com renda superior a R\$9.600,00. A resiliência da atividade doméstica, com mercado de trabalho aquecido e inflação controlada tem contribuído para sustentar a confiança dos consumidores, mas o menor ritmo indica cautela para o futuro”, afirma Anna Carolina Gouveia, economista do FGV IBRE.

Em agosto, a alta da confiança foi influenciada tanto pelas expectativas em relação aos próximos meses quanto pelas avaliações sobre o momento atual. O Índice de Expectativas (IE) avançou em 0,3 ponto, para 101,4 pontos, em sua terceira alta consecutiva. No mesmo sentido, o Índice da Situação Atual (ISA) avançou 0,3 ponto, para 81,9 pontos, mantendo-se no maior nível desde novembro de 2023 (82,0 pontos).

Entre os quesitos que compõem o ICC, o que mede as perspectivas para a situação futura da economia foi o que apresentou a maior contribuição para a alta da confiança no mês ao avançar 2,0 pontos, para 111,4 pontos, maior nível desde abril deste ano (113,0 pontos). No mesmo sentido, o que mede o ímpeto de compras de bens duráveis aumentou pela terceira vez consecutiva, agora em 1,1 ponto, para 87,8 pontos. Apenas as perspectivas para as finanças futuras das famílias apresentaram resultado negativo no mês ao recuar 2,3 pontos, para 104,8.

A alta observada no ISA foi resultado de movimentos opostos entre os indicadores que o compõem: na percepção sobre as finanças pessoais das famílias, o indicador recuou 0,3 ponto, para 70,7 pontos, enquanto o que mede a percepção sobre a economia local subiu 0,9 ponto, para 93,4 pontos.

Fonte: FGV IBRE

PIB do Brasil cresce 1,4% no 2º trimestre de 2024, acima do previsto

O Produto Interno Bruto (PIB) brasileiro cresceu 1,4% no segundo trimestre de 2024 ante o trimestre anterior, mostrando aceleração ante o 1,0% de crescimento (revisado para cima) observado no primeiro trimestre.

O PIB, que é a soma dos bens e serviços finais produzidos no Brasil, chegou a R\$ 2,9 trilhões em valores correntes, informou o Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE) nesta terça-feira (3).

Na comparação com o segundo trimestre de 2023, o PIB cresceu 3,3%.

O desempenho ficou bem acima da estimativa do consenso LSEG de analistas, que previa alta de 0,9% na comparação com o primeiro trimestre de 2,7% ante o mesmo trimestre de 2023.

As altas nos Serviços (1,0%) e na Indústria (1,8%) contribuíram para a taxa positiva no trimestre, embora a Agropecuária tenha recuado 2,3% no período.

Pela ótica da demanda, na mesma comparação, houve altas nos três componentes: o consumo das famílias e o consumo do governo cresceram à mesma taxa (1,3%, ambos) e a Formação Bruta de Capital Fixo, uma medida dos investimentos, subiu 2,1%.

Segundo Rebeca Palis, coordenadora de Contas Nacionais do IBGE, “com o fim do protagonismo da Agropecuária, a Indústria se destacou nesse trimestre, em especial na Eletricidade e gás, água, esgoto, atividades de gestão de resíduos e na Construção”.

Em nota, ela comentou que na análise do PIB pela ótica da demanda interna, os três componentes cresceram nas três comparações, incentivados pelas condições do mercado de trabalho, pelos juros mais baixos e pelo crédito disponível, entre outros fatores.

Segundo Rebeca, também contribuíram para a performance dos componentes da demanda, “a alta dos investimentos, beneficiados pelo crescimento da importação e a produção nacional de bens de capital, o desempenho da construção e, também, o desenvolvimento de software.

Fonte: INFOMONEY

Economia dos EUA continua sólida e dose do corte de juros em setembro está em aberto

Embora os dados do relatório de emprego nos Estados Unidos, o payroll, de agosto tenham novamente reforçado a tendência de desaquecimento do mercado de trabalho, a opinião majoritária dos economistas é que isso não significa necessariamente um corte agressivo de juros pelo Federal Reserve (Fed, o banco central americano) em setembro.

Na verdade, as opiniões estão divididas entre uma redução de 0,25 ponto percentual e 0,50 p.p. A plataforma FedWatch, do CME Group, por exemplo, estava nesta manhã com uma probabilidade maior de o corte inicial ser mais leve (51% a 49%).

Para André Valério, economista sênior do Inter, os dados de hoje, que mostraram a economia americana adicionando 142 mil novos empregos em agosto, abaixo da expectativa de 165 mil, e um recuo na taxa de desemprego de 4,3% para 4,2%, apontam que mercado de trabalho americano deu indícios de enfraquecimento, mas sem apontar para uma recessão. Além disso, os salários aceleraram no mês, crescendo 0,4% ante 0,2% em julho. "O cenário é de normalização. Os empregos em construção residencial, setor altamente cíclico, atingira novo máximo no atual ciclo, alcançando 951 mil empregos, mas com a queda nas unidades em construção devemos observar uma moderação nesses empregos. É um resultado com bastante nuances, mas os dados são em linha com um melhor equilíbrio entre oferta e demanda por emprego", comenta Valério.

O economista lembra que o objetivo do Fed seria levar a economia americana para uma adição média de 200 mil empregos, vista hoje como o número que mantém a taxa de desemprego constante. "Sendo assim, esperamos que o Fed inicie o ciclo de cortes na próxima reunião do dia 18, cortando 25 pontos-base em cada uma das três reuniões restantes nesse ano."

Essa visão de que a desaceleração não aponta para um recuo forte e acelerado da economia é compartilhada por Francisco Nobre, economista da XP. "Quando a gente olha para o filme do mercado de trabalho nos EUA, vê uma desaceleração acontecendo, que é consistente com a política monetária, que está contracionista, mas não vê uma preocupação com uma desaceleração muito grande", explica. Ele lembra que os dados de atividade, como PIB, produção industrial e vendas no varejo ainda indicam que a economia continua bastante sólida, o que é consistente com projeções de um pouso suave. Ao mesmo tempo, o lucro das empresas continuam crescendo e os bancos parecem estar bem capitalizados, cita Nobre.

Fonte: INFOMONEY

carteira de investimentos

Handwritten signatures in blue ink.

ESTRUTURAS E LIMITES

A carteira de investimentos do Regime Próprio de Previdência Social – RPPS de Salvador/BA em agosto teve aplicação em 03 (três) fundos de investimentos, sendo que existem 62 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 2024, elaborada e aprovada pelo Comitê de Investimentos, as aplicações do RPPS de Salvador deverão ser efetuadas em produtos 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 TESOUREIRO NACIONAL,	ART. 7º, 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. 7º, 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. 7º, 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. 7º, 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 COBRIGAÇÃO 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%
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	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%	-

A tabela abaixo relaciona os fundos credenciados do RPPS com aplicações no mês de agosto de 2024, com a sua classificação de risco, taxa de administração, rentabilidade em 2024, rentabilidade nos últimos 12 meses, o índice de comparação (benchmark), e o percentual da rentabilidade do fundo em relação ao seu benchmark em 2024 e nos últimos 12 meses.

Observamos que a carteira é composta por dois fundos classificados como de risco muito baixo (com rentabilidades de 0,69% e 0,81% em agosto de 2024) e um de risco baixo (com rentabilidade de 0,89% em agosto de 2024).

FUNDO CREDENCIADO	CLASSIFICAÇÃO DE RISCO	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	RENTABILIDADE AGOSTO 2024	RENTABILIDADE 12 MESES	BENCHMARK	% BENCHMARK EM AGOSTO 2024	%BENCHMARK 12 MESES
BRADESCO FIC FI RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER	MUITO BAIXO	1,5%A.A	0,69%	9,02%	CDI	79,31%	80,67%
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO	MUITO BAIXO	0,50% A.A.	0,81%	10,47%	CDI	93,10%	93,64%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FIC	BAIXO	0,20% A.A.	0,89%	11,31%	CDI	102,29%	101,16%

Handwritten signatures and initials in blue ink.

A tabela abaixo relaciona os Títulos Públicos e Privados com aplicação do RPPS referente a Receita Geral no mês de agosto/2024 com seus respectivos resultados. Dentre os Títulos relacionados o que obteve o melhor desempenho no mês em apreço foi uma NTN-F 2025 que é um título Pré-Fixado, com um percentual de 0,87%.

RESULTADO DAS APLICAÇÕES DO FUMPRES EM TÍTULOS PÚBLICOS RECEITA GERAL NO MÊS DE AGOSTO /2024											
DATA DA APLICAÇÃO	VENCIMENTO /RESGATE	TIPO DE TÍTULO	TAXA CONTRATADA	FUNDOS CONSTITUIDOS	SALDO EM 31/07/2024	APLICAÇÃO	RESGATE	SALDO ATUAL 30/08/2024	RENDIMENTO MÊS AGOSTO	% RENTABILIDADE AGOSTO	% DO PL DO FUNFIN - RECEITA GERAL APLICADO EM TITULOS PUBLICOS E PRIVADOS
19/03/2021	01/01/2025	NTN- F 2025	7,53%	FUNFIN	R\$ 180.003,94			R\$ 181.148,44	R\$ 1.144,50	0,64%	68,98%
20/04/2021	01/01/2025	NTN-F 2025	7,92%		R\$ 183.789,09			R\$ 185.016,13	R\$ 1.227,04	0,67%	
19/05/2021	01/01/2025	NTN- F 2025	8,25%		R\$ 184.565,08			R\$ 185.846,82	R\$ 1.281,74	0,69%	
17/06/2021	01/01/2025	NTN- F 2025	7,97%		R\$ 184.768,16			R\$ 186.009,25	R\$ 1.241,09	0,67%	
22/07/2021	01/01/2025	NTN- F 2025	8,04%		R\$ 193.851,69			R\$ 195.164,84	R\$ 1.313,15	0,68%	
01/07/2021	01/01/2025	NTN- F 2025	8,08%		R\$ 33.487,44			R\$ 33.715,37	R\$ 227,93	0,68%	
22/09/2021	01/01/2025	NTN- F 2025	9,98%		R\$ 206.494,40			R\$ 208.216,44	R\$ 1.722,04	0,83%	
20/10/2021	01/01/2025	NTN- F 2025	10,40%		R\$ 208.171,79			R\$ 209.977,69	R\$ 1.805,90	0,87%	
23/11/2021	15/08/2024	NTN-B 2024	5,26%+IPCA		R\$ 247.754,50		R\$ 248.812,34	R\$ 0,00	R\$ 1.057,84	0,43%	
21/01/2022	10/01/2025	LETRA FINANCEIRA DO BRADESCO	6,00%+IPCA		R\$ 6.484.348,03			R\$ 6.537.810,32	R\$ 53.462,29	0,82%	
15/03/2023	15/08/2024	NTN -B 2024	6,03%+IPCA		R\$ 54.148.032,28		R\$ 54.396.597,88	R\$ 0,00	R\$ 248.565,60	0,46%	
22/05/2023	15/08/2024	NTN-B 2024	7,49%+IPCA		R\$ 107.321.081,51		R\$ 107.877.921,79	R\$ 0,00	R\$ 556.840,28	0,52%	
16/02/2024	15/08/2024	NTN-B 2024	6,54%+IPCA		R\$ 4.788.867,00		R\$ 4.811.852,93	R\$ 0,00	R\$ 22.985,93	0,48%	
22/02/2024	15/08/2024	NTN-B 2024	6,74%+IPCA		R\$ 105.027.902,41		R\$ 105.540.863,03	R\$ 0,00	R\$ 512.960,62	0,49%	
22/02/2024	15/05/2025	NTN-B 2024	5,75%+IPCA		R\$ 50.799.606,25			R\$ 51.154.300,21	R\$ 354.693,96	0,70%	
20/05/2024	15/08/2024	NTN-B 2024	9,01%+IPCA		R\$ 102.577.244,78		R\$ 103.172.702,72	R\$ 0,00	R\$ 595.457,94	0,58%	
18/06/2024	15/08/2024	NTN-B 2024	9,8%+ IPCA		R\$ 10.152.473,73		R\$ 10.214.635,18	R\$ 0,00	R\$ 62.161,46	0,61%	
15/08/2024	15/08/2026	NTN-B 2026	6,31%+IPCA			R\$ 219.307.497,63		R\$ 219.905.000,08	R\$ 597.502,45	0,27%	
15/08/2024	17/08/2026	LETRA FINANCEIRA XP	12%			R\$ 10.000.000,00		R\$ 10.049.591,43	R\$ 49.591,43	0,50%	
15/08/2024	15/05/2025	NTN-B 2025	6,1%+IPCA			R\$ 100.000.625,92		R\$ 100.264.450,37	R\$ 263.824,45	0,26%	
26/05/2023	15/05/2025	NTN-B 2025	6,23%+IPCA	FUNPREV	R\$ 5.281.971,26			R\$ 5.320.929,80	R\$ 38.958,54	0,74%	
26/05/2023	15/08/2024	NTN-B 2024	7,52%+IPCA		R\$ 5.352.736,27		R\$ 5.380.566,85	R\$ 0,00	R\$ 27.830,58	0,52%	
28/08/2023	15/05/2033	NTN-B 2033	5,27%+ IPCA		R\$ 3.410.299,91			R\$ 3.432.718,97	R\$ 22.419,06	0,66%	
18/06/2024	15/08/2024	NTN-B 2024	9,8%+ IPCA		R\$ 15.226.502,57		R\$ 15.319.731,23	R\$ 0,00	R\$ 93.228,66	0,61%	
16/08/2024	15/08/2026	NTN-B 2026	6,31+IPCA			R\$ 20.688.981,63		R\$ 20.745.348,69	R\$ 56.367,06	0,27%	
TOTAIS					R\$ 472.193.952,09	R\$ 349.997.105,18	R\$ 406.963.683,95	R\$ 418.795.244,84	R\$ 3.567.871,53	0,57%	

A tabela abaixo relaciona os Títulos Públicos com aplicação do RPPS referente aos recursos da Poupança Pública Previdenciária no mês de agosto/2024 com seus respectivos resultados. Dentre os Títulos relacionados o que obteve o melhor desempenho no mês em apreço foi a LF – XP 2029 que é um título privado pré-fixado, com um percentual de 1,05%.

RESULTADO DAS APLICAÇÕES DO FUMPREM EM TÍTULOS PÚBLICOS RECEITA POUPANÇA PREVIDENCIÁRIA NO MÊS AGOSTO/2024										
DATA DA APLICAÇÃO	VENCIMENTO/ RESGATE	TIPO DE TÍTULO	TAXA CONTRATADA	SALDO EM 31/07/2024	RESGATE	APLICAÇÃO	SALDO ATUAL 30/08/2024	RENDIMENTO AGOSTO	% RENTABILIDADE AGOSTO	% DO PL DA POUPANÇA PÚBLICA APLICADO EM TÍTULOS PÚBLICOS
05/05/2022	15/05/2035	NTN - B 2035	5,67%+IPCA	R\$ 860.638,59			R\$ 866.586,01	R\$ 5.947,42	0,69%	75,90%
04/08/2021	01/01/2031	NTN- F 2031	9,54%	R\$ 822.944,69			R\$ 829.517,23	R\$ 6.572,54	0,80%	
17/05/2022	15/05/2035	NTN-B 2035	5,56%+IPCA	R\$ 320.931,34			R\$ 323.119,96	R\$ 2.188,62	0,68%	
05/03/2021	01/01/2031	NTN- F 2031	8,45%	R\$ 6.787.100,44			R\$ 6.835.336,07	R\$ 48.235,63	0,71%	
31/03/2021	01/01/2031	NTN- F 2031	9,16%	R\$ 905.199,65			R\$ 912.152,36	R\$ 6.952,71	0,77%	
04/05/2021	01/01/2031	NTN- F 2031	9,12%	R\$ 806.998,88			R\$ 813.171,30	R\$ 6.172,42	0,76%	
19/05/2021	01/01/2031	NTN- F 2031	9,35%	R\$ 79.042,07			R\$ 79.661,27	R\$ 619,20	0,78%	
07/06/2021	01/01/2031	NTN- F 2031	8,89%	R\$ 799.449,91			R\$ 805.416,22	R\$ 5.966,31	0,75%	
01/07/2021	01/01/2031	NTN- F 2031	9,09%	R\$ 424.034,03			R\$ 427.267,04	R\$ 3.233,01	0,76%	
06/07/2021	01/01/2031	NTN- F 2031	9,25%	R\$ 826.344,63			R\$ 832.751,57	R\$ 6.406,94	0,78%	
09/09/2021	01/01/2031	NTN- F 2031	10,85%	R\$ 832.347,68			R\$ 839.866,53	R\$ 7.518,85	0,90%	
05/10/2021	01/01/2031	NTN-F 2031	11,00%	R\$ 783.417,76			R\$ 790.587,93	R\$ 7.170,17	0,92%	
05/10/2021	01/01/2031	NTN- F 2031	11,00%	R\$ 44.490,39			R\$ 44.897,59	R\$ 407,20	0,92%	
05/03/2021	15/05/2035	NTN-B 2035	3,66%+IPCA	R\$ 4.156.740,21			R\$ 4.178.453,34	R\$ 21.713,13	0,52%	
27/10/2021	15/05/2035	NTN-B 2035	5,40%+IPCA	R\$ 928.867,10			R\$ 935.077,11	R\$ 6.210,01	0,67%	
17/11/2021	15/05/2035	NTN- B 2035	5,12%+IPCA	R\$ 126.227,02			R\$ 127.041,53	R\$ 814,51	0,65%	
02/12/2021	15/05/2035	NTN- B 2035	5,13%+IPCA	R\$ 972.041,97			R\$ 978.317,78	R\$ 6.275,81	0,65%	
23/12/2021	15/05/2035	NTN-B 2035	5,12%+IPCA	R\$ 2.136.509,11			R\$ 2.150.295,54	R\$ 13.786,43	0,65%	
11/04/2022	15/05/2035	NTN-B 2035	5,37%+IPCA	R\$ 449.448,86			R\$ 452.442,59	R\$ 2.993,73	0,67%	
04/01/2022	01/01/2031	NTN- F 2031	10,90%	R\$ 616.833,79			R\$ 622.430,34	R\$ 5.596,55	0,91%	
02/02/2022	15/05/2035	NTN-B 2035	5,52% + IPCA	R\$ 961.200,15			R\$ 967.722,03	R\$ 6.521,88	0,68%	
03/03/2022	15/05/2035	NTN-B 2035	5,69% + IPCA	R\$ 930.943,09			R\$ 937.392,17	R\$ 6.449,08	0,69%	
03/06/2022	15/05/2035	NTN-B 2035	5,72%+IPCA	R\$ 888.636,69			R\$ 894.814,55	R\$ 6.177,86	0,70%	
28/06/2022	15/05/2035	NTN-B 2035	5,75%+IPCA	R\$ 989.089,91			R\$ 995.991,48	R\$ 6.901,57	0,70%	
03/08/2022	15/05/2035	NTN - B 2035	6,17%+IPCA	R\$ 1.018.675,88			R\$ 1.026.139,21	R\$ 7.463,33	0,73%	
18/06/2024	15/08/2024	NTN - B 2024	9,8% + IPCA	R\$ 10.152.473,72	R\$ 10.214.635,18			R\$ 62.161,46	0,61%	
14/06/2024	13/06/2029	LETRA FINANCEIRA DO BANCO XP	12,70%	R\$ 10.157.797,73			R\$ 10.264.377,14	R\$ 106.579,41	1,05%	
15/08/2024	15/08/2026	NTN-B 2026	6,35%+IPCA			R\$ 10.212.666,77	R\$ 10.240.664,93	R\$ 27.998,16	0,27%	
TOTAIS				R\$ 48.778.425,29	R\$ 10.214.635,18	R\$ 10.212.666,77	R\$ 49.171.490,82	R\$ 395.033,94	0,74%	

75,90%

75,90%

75,90%

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).

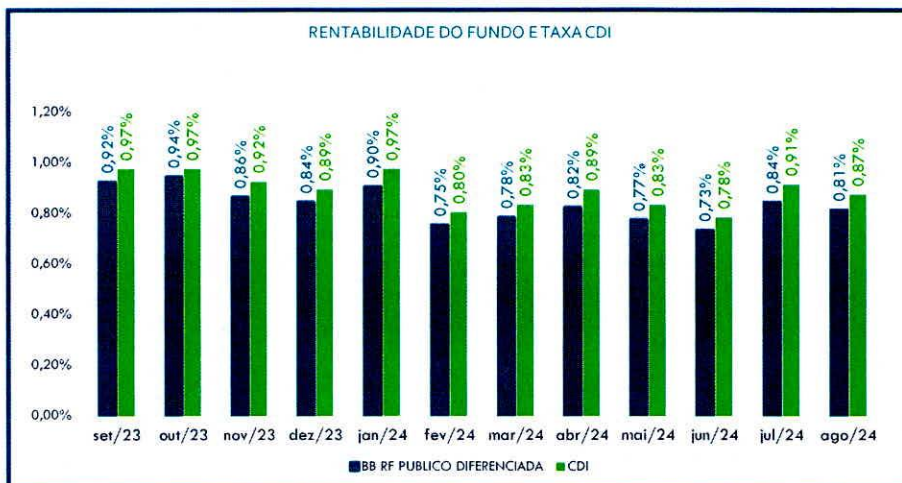
O fundo, que funciona desde **21 de dezembro de 2005**, tem grau de risco classificado como **muito baixo** e categoria ANBIMA **Renda Fixa Duração Baixa Soberano**, com taxa de administração de 0,50% ao ano e liquidez imediata (D+0).

RESULTADO HISTÓRICO

O BB Renda Fixa Curto Prazo Diferenciado Setor Público possui rentabilidade de 0,81% em agosto do fundo ante um desempenho de 0,87 % do CDI (93,10 % acumulado no mesmo período).

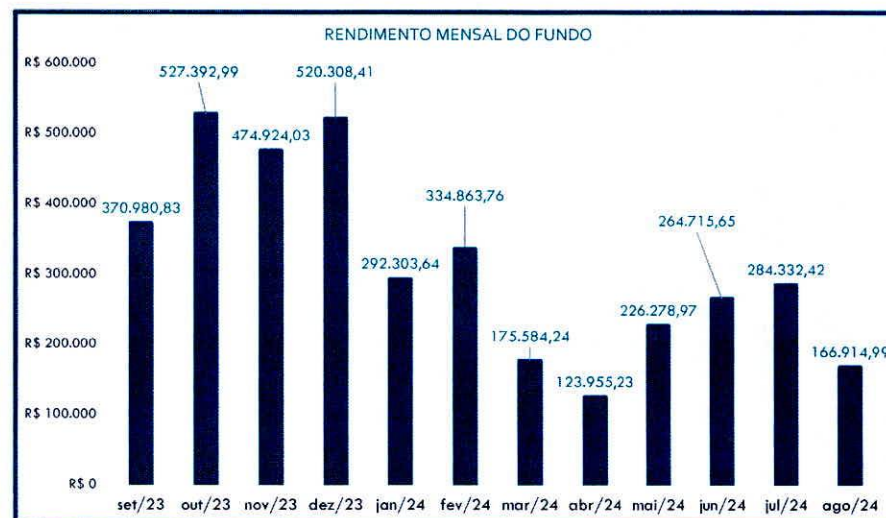
O patrimônio líquido do fundo em agosto de 2024 foi de R\$ 22.713.381.981,74

A rentabilidade mensal quando comparada com o CDI, ficou em 93,10 %, como indica o gráfico "Rentabilidade do Fundo e Taxa CDI" a seguir.



Em agosto de 2024 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 R\$ 166.914,99 no mês corrente e R\$ 4.716.017,67 milhões de saldo acumulado nos últimos 12 meses.



DESEMPENHO EM AGOSTO

O fundo BB Renda Fixa Curto Prazo Diferenciado Setor Público começou agosto com um saldo de R\$ 32.334.253,55. Ao longo do mês foram aplicados R\$ 163.644.555,49 e R\$ 127.027.097,05 de resgates. O saldo final, registrado no mês de agosto de 2024, foi de R\$ 69.118.626,98 com um rendimento acumulado de R\$ 166.914,99 no mês.

Em agosto o montante do capital médio investido (por dia) no mês girou em torno de R\$ 22.484.914,28. O rendimento médio por dia chegou a R\$ 7.948,33. A média da taxa de retorno do investimento (TRI), calculada com o rendimento total em razão do capital médio investido, fechou agosto em 0,037225%.

Assinaturas manuscritas:

A planilha a seguir detalha a movimentação financeira do fundo BB Renda Fixa Curto Prazo Diferenciado Setor Público durante o mês de agosto de 2024, e foi elaborada com base nos extratos bancários emitidos dia-a-dia.

A movimentação líquida entre aplicações e resgates foi de de (R\$ -36.617.458,44). Ocorreram movimentações de aplicações e resgates durante o período sendo a maior aplicação ocorrida no dia 15 de agosto no valor de R\$ 47.048.700,95.

O saldo total de resgates foi de (R\$ -127.027.097,05), sendo a maior movimentação ocorrida no dia 16 de agosto no valor de (R\$ -71.559.111,45)

O mês de agosto iniciou com o saldo de aproximadamente R\$ 32.334.253,55 e finalizou com o saldo de R\$ 69.118.626,98. O saldo de rendimento acumulado foi de R\$ 166.914,99.

DATA	SALDO INICIAL	APLICAÇÃO	RESGATE	CAPITAL INVESTIDO	RENDIMENTO DIÁRIO	SALDO FINAL	VALOR DA COTA	RENTABILIDADE DIÁRIA	RENDIMENTO ACUMULADO	TRI
30/08/2024	10.347.270,60	58.764.349,67	0,00	69.111.620,27	7.006,71	69.118.626,98	6,198485814	0,257629%	R\$ 166.914,99	0,010138%
28/08/2024	3.286.674,38	7.089.255,59	-32.455,64	10.343.474,33	3.796,27	10.347.270,60	6,196214164	0,294690%	R\$ 159.908,28	0,036702%
27/08/2024	1.553.936,56	40.000.000,00	-38.268.480,02	3.285.456,54	1.217,84	3.286.674,38	6,193940855	0,294645%	R\$ 156.112,01	0,037068%
26/08/2024	1.592.485,01	0,00	-39.119,81	1.553.365,20	571,36	1.553.936,56	6,191645764	0,294290%	R\$ 154.894,17	0,036782%
23/08/2024	2.037.480,25	0,00	-445.581,92	1.591.898,33	586,68	1.592.485,01	6,189369199	0,294727%	R\$ 154.322,81	0,036854%
22/08/2024	2.036.636,92	0,00	0,00	2.036.636,92	843,33	2.037.480,25	6,187088948	0,294011%	R\$ 153.736,13	0,041408%
21/08/2024	2.035.988,06	0,00	0,00	2.035.988,06	648,86	2.036.636,92	6,184528080	0,288948%	R\$ 152.892,80	0,031870%
20/08/2024	2.060.761,05	0,00	-25.525,53	2.035.235,52	752,54	2.035.988,06	6,182557726	0,330220%	R\$ 152.243,94	0,036976%
19/08/2024	12.082.252,01	0,00	-10.022.245,98	2.060.006,03	755,02	2.060.761,05	6,1802725110	0,330337%	R\$ 151.491,40	0,036651%
16/08/2024	73.636.935,96	10.000.000,00	-71.559.111,45	12.077.824,51	4.427,50	12.082.252,01	6,178008210	0,330812%	R\$ 150.736,38	0,036658%
15/08/2024	26.845.823,28	47.048.700,95	-284.613,09	73.609.911,14	27.024,82	73.636.935,96	6,175744315	0,330914%	R\$ 146.308,88	0,036714%
14/08/2024	26.916.679,27	11.439,05	-92.282,56	26.835.835,76	9.987,52	26.845.823,28	6,173477812	0,330926%	R\$ 119.284,06	0,037217%
13/08/2024	26.910.933,84	0,00	-3.978,94	26.906.954,90	9.724,37	26.916.679,27	6,171181079	0,367286%	R\$ 109.296,54	0,036141%
12/08/2024	26.901.153,23	46.888,34	-46.888,34	26.901.153,23	9.780,61	26.910.933,84	6,168951573	0,331026%	R\$ 99.572,17	0,036358%
09/08/2024	26.953.927,89	0,00	-62.658,66	26.891.269,23	9.884,00	26.901.153,23	6,166709506	0,331426%	R\$ 89.791,56	0,036755%
08/08/2024	26.944.156,12	0,00	0,00	26.944.156,12	9.771,77	26.953.927,89	6,164443740	0,294562%	R\$ 79.907,56	0,036267%
07/08/2024	33.007.029,26	0,00	-6.072.863,75	26.934.165,51	9.990,61	26.944.156,12	6,162208903	0,295219%	R\$ 70.135,79	0,037093%
06/08/2024	33.066.071,45	0,00	-71.291,36	32.994.780,09	12.249,17	33.007.029,26	6,159924022	0,295396%	R\$ 60.145,18	0,037125%
05/08/2024	32.646.333,12	407.587,59	0,00	33.053.920,71	12.150,74	33.066.071,45	6,157638028	0,294751%	R\$ 47.896,01	0,036760%
02/08/2024	32.368.959,53	265.388,49	0,00	32.634.348,02	11.985,10	32.646.333,12	6,155375288	0,294506%	R\$ 35.745,27	0,036725%
01/08/2024	32.334.253,55	10.945,81	0,00	32.345.199,36	23.760,17	32.368.959,53	6,153115530	0,294766%	R\$ 23.760,17	0,073458%

th d 2024
for

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.

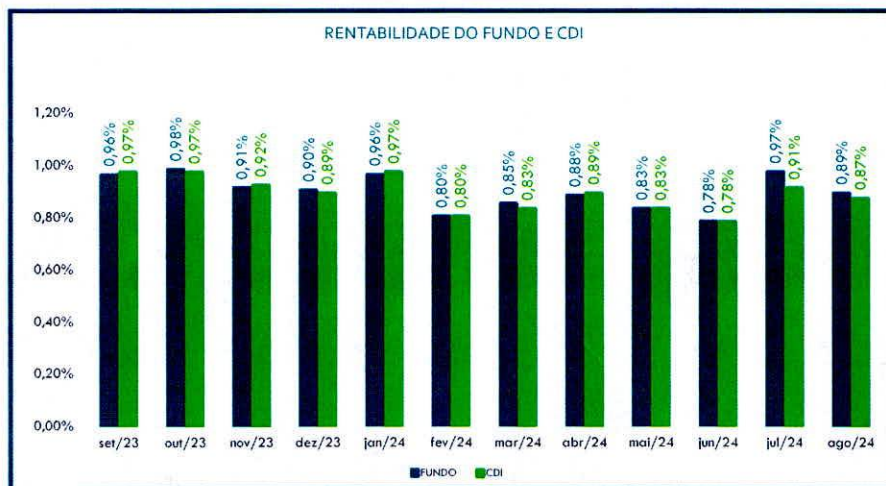
O fundo, que funciona desde 28 de JANEIRO de 2011, tem grau de risco classificado como **baixo** e categoria ANBIMA Renda Fixa Duração Baixo Grau de Investimento, com taxa de administração de 0,20% ao ano e liquidez D+0. Destacamos que, por aplicar seus recursos em fundo de investimento que possui taxa 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 Perfil 0,89 % em agosto de 2024, ante um desempenho de 0,89% do CDI Longo Prazo Perfil FIC. 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%.

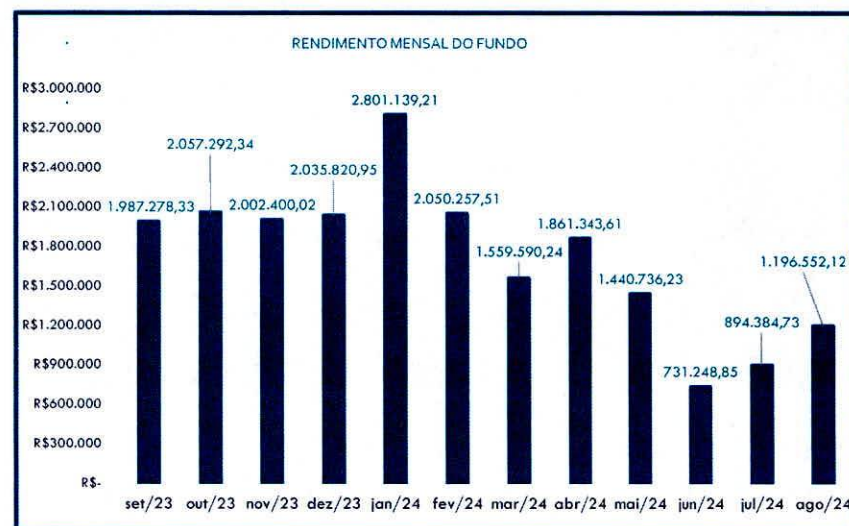
O patrimônio líquido do fundo em agosto de 2024 foi de R\$ 20.250.525.135,03 e concentra seus investimentos em espécies de ativos.

A rentabilidade mensal foi de 102,29% do CDI no período, como indica o gráfico "Rentabilidade do Fundo e CDI" a seguir.



Em agosto de 2024 a posição da carteira do fundo 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 agosto de R\$ 894.384,73 e nos últimos 12 meses, com um ganho acumulado de R\$ 20.618.044,14.



DESEMPENHO EM AGOSTO

O fundo BB Fixa Previdenciário Renda Referenciado DI Longo Prazo Perfil FIC começou agosto com um saldo de R\$ 102.824.859,36.

O saldo final registrado em agosto de 2024, foi de R\$ 95.535.552,08 e um rendimento de R\$ 1.196.552,12 no mês.

O capital médio investido (por dia) no mês girou em torno de R\$ 133.533.731,98 milhões. O rendimento médio por dia chegou a R\$ 56.978,67. A média da taxa de retorno do investimento (TRI), calculada como o rendimento total em razão do capital médio investido, fechou em 0,044007%.

Assinaturas manuscritas:

FUNDO BB PREVIDENCIÁRIO RENTA FIXA PERFIL

Pg 16

A planilha a seguir detalha a movimentação financeira do fundo BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI Longo Prazo Perfil FIC durante o mês de agosto de 2024, e foi elaborada com base nos extratos bancários emitidos dia-a-dia.

Houveram movimentações liquidas no valor -8.485.859,40. A média do capital investido no período foi de R\$ 133.533.731,98, enquanto que a média do rendimento diário foi R\$ 56.978,67. O fundo iniciou o período com saldo aplicado de R\$ 102.824.859,36 e finalizou o período com um montante de R\$ 95.535.552,08. A média da TRI do mês de agosto ficou em 0,044007%.

DATA	SALDO INICIAL	APLICAÇÃO	RESGATE	CAPITAL INVESTIDO	RENDIMENTO DIÁRIO	SALDO FINAL	VALOR DA COTA	RENTABILIDADE DIÁRIA	RENDIMENTO ACUMULADO	TRI
30/08/2024	145.418.668,24	0,00	-50.000.000,00	95.418.668,24	116.883,84	95.535.552,08	3,280836430	0,021355%	1.196.552,12	0,122496%
28/08/2024	145.360.609,38	0,00	0,00	145.360.609,38	58.058,86	145.418.668,24	3,281446100	0,083615%	1.079.668,28	0,039941%
27/08/2024	185.279.723,00	0,00	-40.000.000,00	145.279.723,00	80.886,38	145.360.609,38	3,280135972	0,083235%	1.021.609,42	0,055676%
26/08/2024	185.206.453,37	0,00	0,00	185.206.453,37	73.269,63	185.279.723,00	3,278704609	0,079354%	940.723,04	0,039561%
23/08/2024	185.132.813,18	0,00	0,00	185.132.813,18	73.640,19	185.206.453,37	3,277408032	0,080855%	867.453,41	0,039777%
22/08/2024	185.056.825,20	0,00	0,00	185.056.825,20	75.987,98	185.132.813,18	3,276104897	0,081514%	793.813,22	0,041062%
21/08/2024	184.972.030,95	10.000,01	0,00	184.982.030,96	74.794,24	185.056.825,20	3,274760216	0,082226%	717.825,24	0,040433%
20/08/2024	184.904.790,21	0,00	-10.000,00	184.894.790,21	77.240,74	184.972.030,95	3,273436588	0,081484%	643.031,00	0,041776%
19/08/2024	174.835.390,41	10.000.000,00	0,00	184.835.390,41	69.399,80	184.904.790,21	3,272069738	0,078467%	565.790,26	0,037547%
16/08/2024	103.271.224,87	71.524.140,59	0,00	174.795.365,46	40.024,95	174.835.390,41	3,270771426	0,079107%	496.390,46	0,022898%
15/08/2024	103.229.587,87	0,00	0,00	103.229.587,87	41.637,00	103.271.224,87	3,269504260	0,081909%	456.365,51	0,040334%
14/08/2024	103.186.705,70	0,00	0,00	103.186.705,70	42.882,17	103.229.587,87	3,268186058	0,082616%	414.728,51	0,041558%
13/08/2024	103.144.374,48	0,00	0,00	103.144.374,48	42.331,22	103.186.705,70	3,266828435	0,077529%	371.846,34	0,041041%
12/08/2024	103.106.768,13	0,00	0,00	103.106.768,13	37.606,35	103.144.374,48	3,265488254	0,077066%	329.515,12	0,036473%
09/08/2024	103.064.946,17	0,00	0,00	103.064.946,17	41.821,96	103.106.768,13	3,264297660	0,081818%	291.908,77	0,040578%
08/08/2024	103.022.477,48	0,00	0,00	103.022.477,48	42.468,69	103.064.946,17	3,262973602	0,082266%	250.086,81	0,041223%
07/08/2024	102.980.228,53	0,00	0,00	102.980.228,53	42.248,95	103.022.477,48	3,261629069	0,080455%	207.618,12	0,041026%
06/08/2024	102.939.657,77	0,00	0,00	102.939.657,77	40.570,76	102.980.228,53	3,260291493	0,079137%	165.369,17	0,039412%
05/08/2024	102.898.798,00	0,00	0,00	102.898.798,00	40.859,77	102.939.657,77	3,259007047	0,080071%	124.798,41	0,039709%
02/08/2024	102.857.298,62	0,00	0,00	102.857.298,62	41.499,38	102.898.798,00	3,257713452	0,081637%	83.938,64	0,040347%
01/08/2024	102.824.859,36	0,00	-10.000,00	102.814.859,36	42.439,26	102.857.298,62	3,256399617	0,080089%	42.439,26	0,041277%

Handwritten signatures and initials.

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-F25 - 31	R\$ 114.814,92
TÍTULOS PÚBLICOS – NTN-B24, 25 e 35	R\$ 3.638.457,42
LETRAS FINANCEIRAS BRADESCO E XP	R\$ 209.633,13
TOTAL	R\$ 3.962.905,47



PLANO DE AÇÃO



Handwritten signatures in blue ink:

- Signature 1: A stylized signature, possibly "Mh".
- Signature 2: A signature that appears to be "W".
- Signature 3: A signature that appears to be "J. B. Freire".

Plano de Ação Mensal

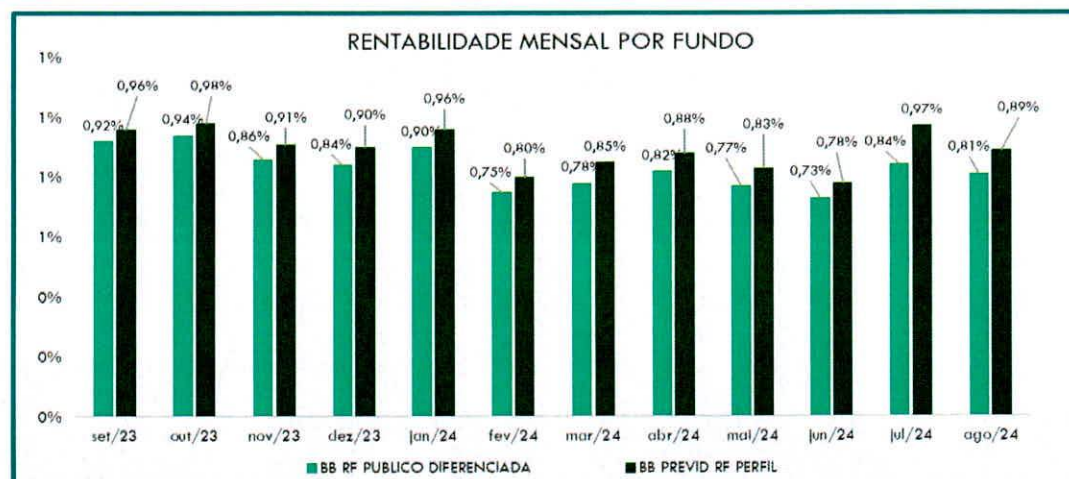
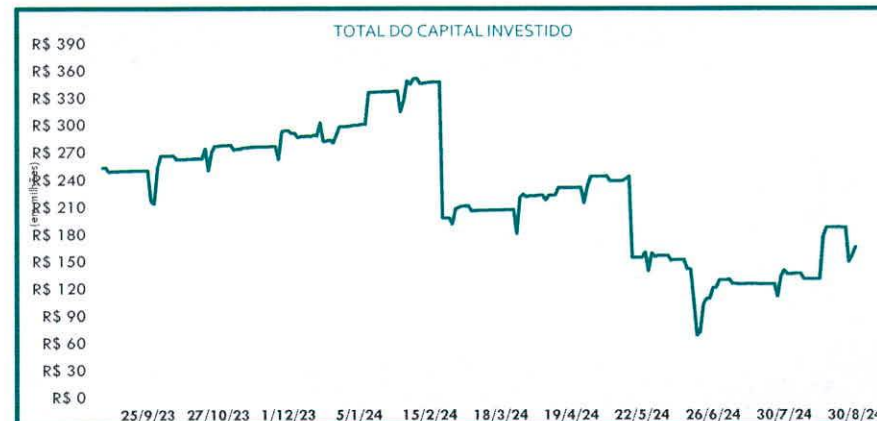
O Plano de ação mensal de investimentos consiste no planejamento de atividades visando um atingimento da Meta Atuarial, definida na política de Investimentos do RPPS. A Meta Atuarial do RPPS definida na política de Investimentos para o exercício 2024 é de 5,10% + IPCA.

Para o mês de setembro/2024, 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, 5,10% + 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
	Analisar, 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

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 RPPS durante o mês de agosto. 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 RPPS. Podemos notar que o fundo BB RF PERFIL, obteve maior rentabilidade no mês de agosto, com o percentual de 0,89%. Em análise dos gráficos agosto de 2023 foi o mês de melhor rendimento dos últimos 12 meses.



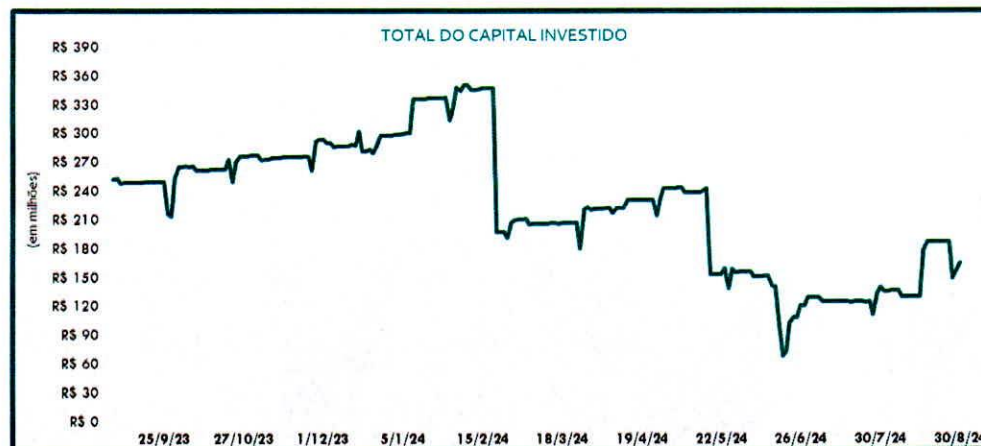
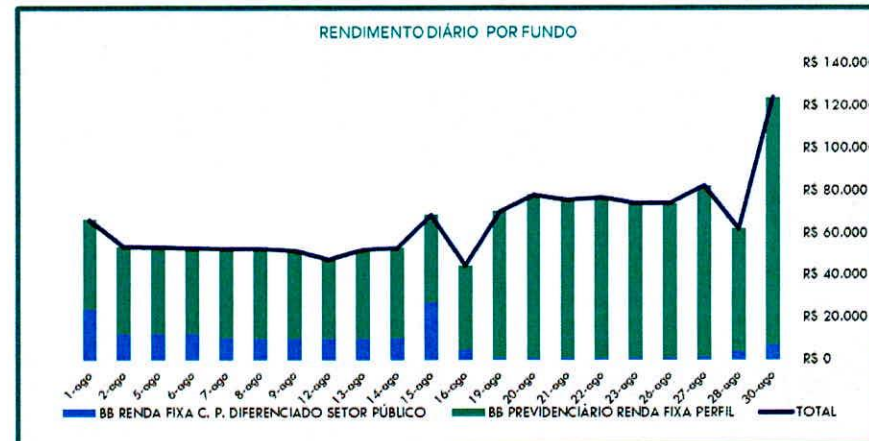
Handwritten signatures and initials in blue ink.

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
BRDESCO FIC FI RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER	R\$ 6.002.025,58	R\$ 27.103,87	0,69%	0,69%	R\$ 27.103,87	R\$ 0,00	R\$ 42.910.061,49
BB RENDA FIXA CURTO PRAZO DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO	R\$ 22.484.914,28	R\$ 166.914,99	0,81%	0,81%	R\$ 166.914,99	R\$ 0,00	R\$ 163.644.555,49
BB PREVID RF PERFIL	R\$ 133.533.731,98	R\$ 1.196.552,12	0,89%	0,89%	R\$ 1.196.552,12	R\$ 0,00	R\$ 81.534.140,60



Os gráficos abaixo ilustram a dinâmica de aplicações por fundo, bem como a capacidade de investimento do RPPS, ao longo do mês. O rendimento mensal apresentou variação de saldo, quando comparado com o período anterior, R\$ 5.353.476,45 no período corrente, e R\$ 5.895.402,06 no período anterior. Deste rendimento total mensal, o fundo que apresentou maior rendimento nominal foi o BB RF PERFIL que rendeu o total de R\$ 1.196.552,12.

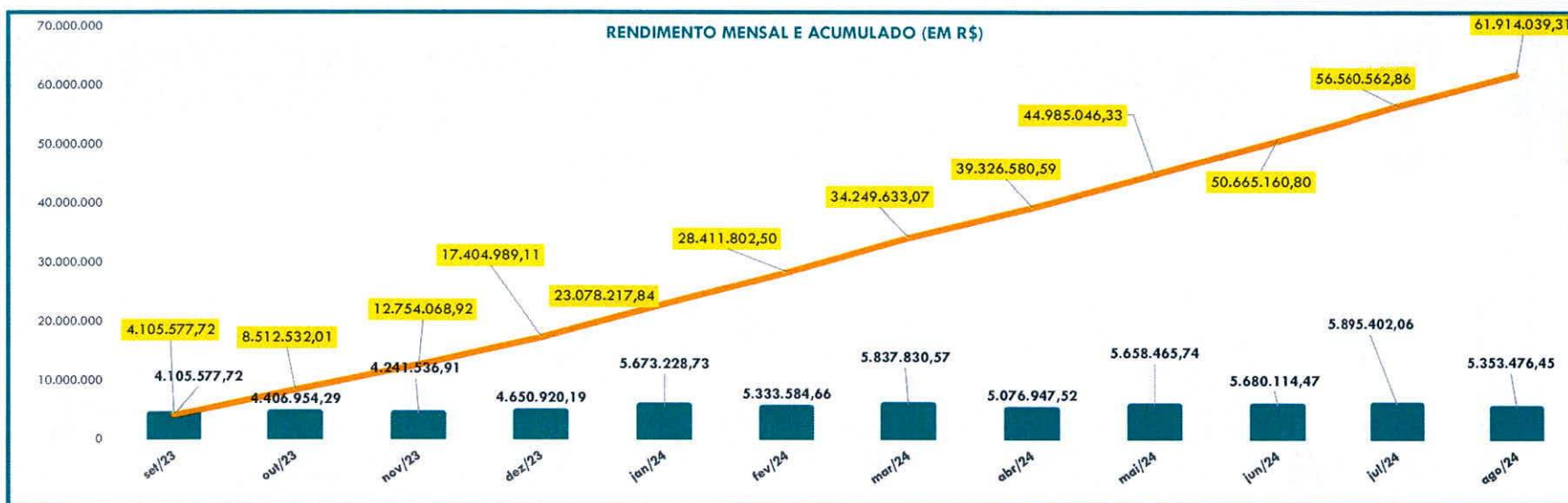


Handwritten signatures and initials at the bottom of the page.

ANÁLISE DE DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO

Pg 23

RENDIMENTOS DE APLICAÇÕES FINANCEIRAS DO FUMPRES X META ATUARIAL X CDI - 12 MESES							
MESES	PL MÉDIO DO MÊS	RENTABILIDADE DO MÊS	PERCENTUAL EM RELAÇÃO AO PL	CDI	META ATUARIAL - 2024 (5,10%a.a + IPCA)	PERCENTUAL DA META ATUARIAL ALCANÇADA	PERCENTUAL DO CDI ALCANÇADO
SETEMBRO	459.576.995,05	4.105.577,72	0,89%	0,97%	0,65%	137,44%	92,10%
OUTUBRO	480.782.343,20	4.406.954,29	0,92%	0,97%	0,63%	145,50%	94,50%
NOVEMBRO	507.573.041,54	4.241.536,91	0,84%	0,92%	0,67%	124,72%	90,83%
DEZEMBRO	532.250.593,32	4.650.920,19	0,87%	0,85%	0,95%	91,98%	102,80%
JANEIRO	567.146.027,74	5.673.228,73	1,00%	0,97%	0,70%	142,90%	103,12%
FEVEREIRO	589.146.158,66	5.333.584,66	0,91%	0,80%	1,25%	72,80%	113,75%
MARÇO	599.274.973,18	5.837.830,54	0,97%	0,83%	0,59%	166,52%	117,37%
ABRIL	615.947.534,17	5.076.947,52	0,82%	0,89%	0,81%	101,76%	92,61%
MAIO	632.281.664,16	5.658.465,74	0,89%	0,83%	0,89%	100,55%	107,82%
JUNHO	639.972.444,23	5.680.114,47	0,89%	0,79%	0,64%	138,68%	112,35%
JULHO	651.386.744,71	5.895.402,06	0,91%	0,91%	0,81%	111,74%	99,46%
AGOSTO	655.233.387,82	5.353.476,45	0,82%	0,87%	0,41%	200,00%	94,25%
TOTAIS	-	61.914.039,28	10,73%	10,60%	9,00%	119,22%	101,23%



Handwritten signature: m m y b f

INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	FUNDOS/TÍTULOS	SALDO MÉDIO	TIR MÊS	CDI	% CDI
BANCO DO BRASIL	FUNDO DIFERENCIADO	R\$ 22.492.862,61	0,81%	0,87%	93,10%
	FUNDO REF. PERFIL	R\$ 133.590.710,65	0,89%	0,87%	102,30%
XP INVESTIMENTOS	TÍTULOS PÚBLICOS E PRIVADOS	R\$ 467.966.735,66	0,79%	0,87%	90,80%
BRDESCO	FUNDO CP PODER PÚBLICO	R\$ 6.002.025,58	0,69%	0,87%	79,31%
			0,82%	0,87%	94,25%

COMPARATIVO DO RESULTADO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – XP			
INDEXADORES	MÊS (%)	ANO (%)	12 MESES
CARTEIRA	0,79%	7,80%	11,30%
CDI	0,87%	6,17%	11,51%
IPCA	-0,02%	2,85%	4,24%
IBOVESPA	6,54%	0,13%	14,07%

7/11/17 MW

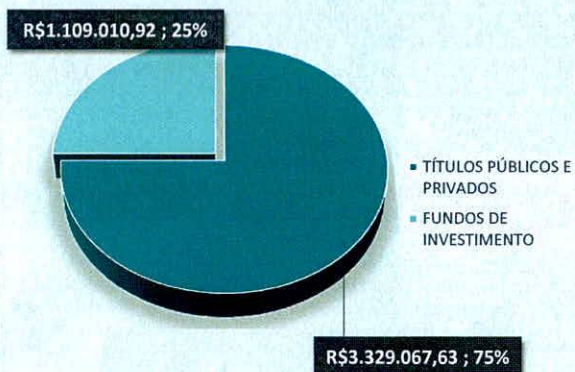




FUMPRES FIN

TÍTULOS PÚBLICOS E PRIVADOS	R\$ 3.329.067,63
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 1.109.010,92
RENDIMENTO TOTAL	R\$ 4.438.078,55

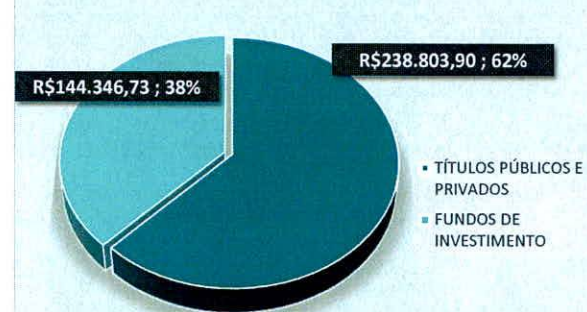
FUMPRES FIN



FUMPRES PREV

TÍTULOS PÚBLICOS E PRIVADOS	R\$ 238.803,90
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 144.346,73
RENDIMENTO TOTAL	R\$ 383.150,63

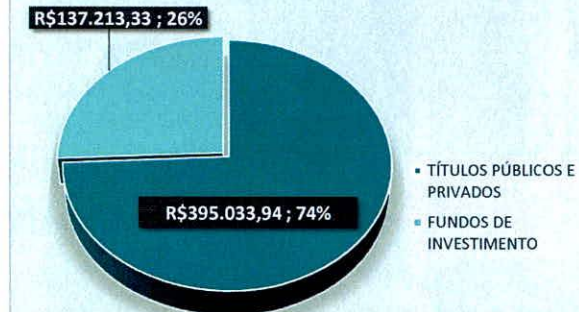
FUMPRES PREV



FUMPRES FIN POUPANÇA PREVIDENCIÁRIA

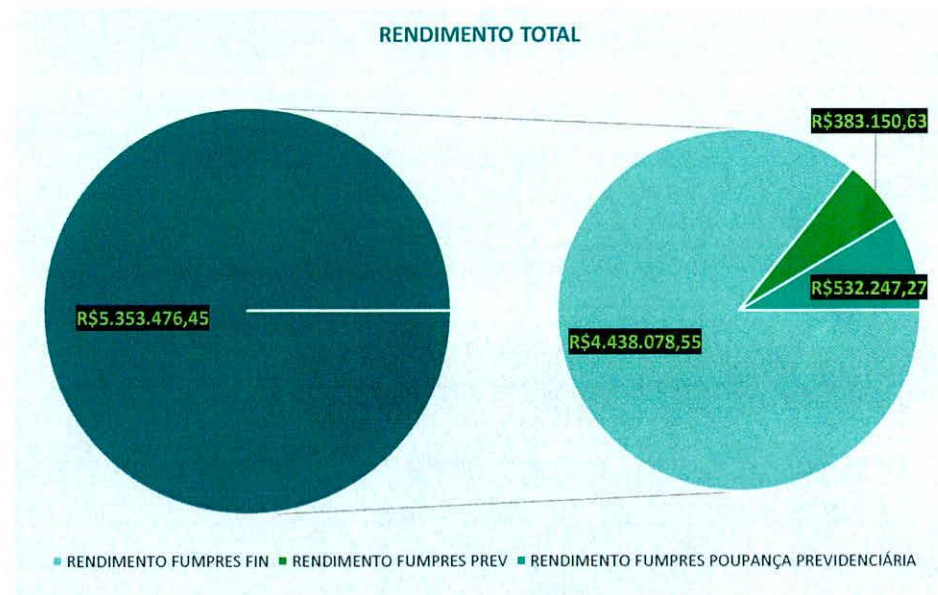
TÍTULOS PÚBLICOS E PRIVADOS	R\$ 395.033,94
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 137.213,33
RENDIMENTO TOTAL	R\$ 532.247,27

POUPANÇA PREVIDENCIÁRIA



Handwritten signature and initials in blue ink.

RENDIMENTO TOTAL DOS TÍTULOS, FUNDOS / POUPANÇA	
RENDIMENTO FUMPRES FIN	R\$ 4.438.078,55
RENDIMENTO FUMPRES PREV	R\$ 383.150,63
RENDIMENTO FUMPRES FIN POUPANÇA PREVIDENCIÁRIA	R\$ 532.247,27
RENDIMENTO TOTAL	5.353.476,45

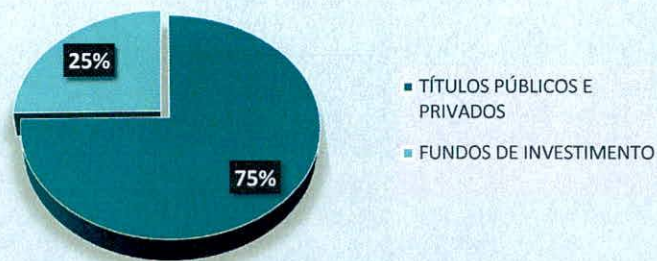


Handwritten notes and signatures in blue ink, including the word "para" and a signature.

FUMPRES FIN

TÍTULOS PÚBLICOS E PRIVADOS	R\$ 438.467.738,22
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 147.642.002,87
PATRIMÔNIO TOTAL	R\$ 586.109.741,09

PATRIMÔNIO FUMPRES FIN



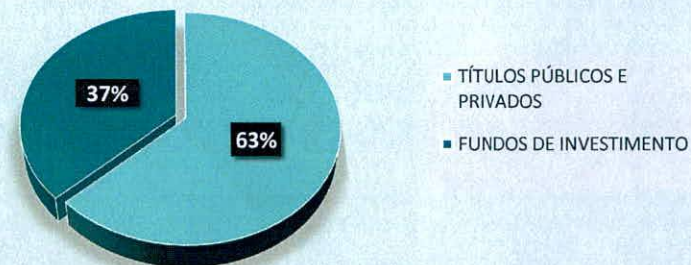
PATRIMÔNIO TOTAL DO RPPS

FUMPRES FIN	R\$ 586.109.741,09
FUMPRES PREV	R\$ 46.822.438,12
PATRIMÔNIO TOTAL	R\$ 632.932.179,21

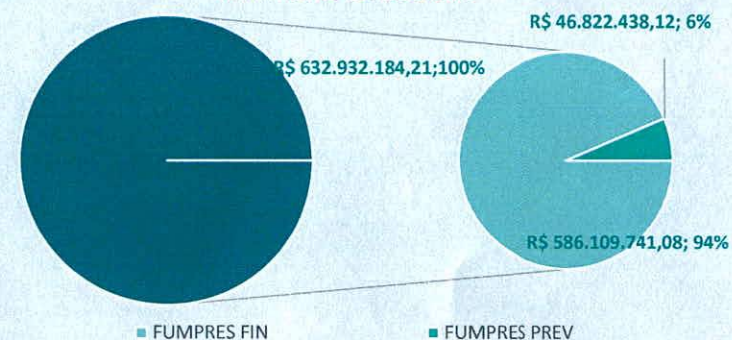
FUMPRES PREV

TÍTULOS PÚBLICOS E PRIVADOS	R\$ 29.498.997,45
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 17.323.440,67
PATRIMÔNIO TOTAL	R\$ 46.822.438,12

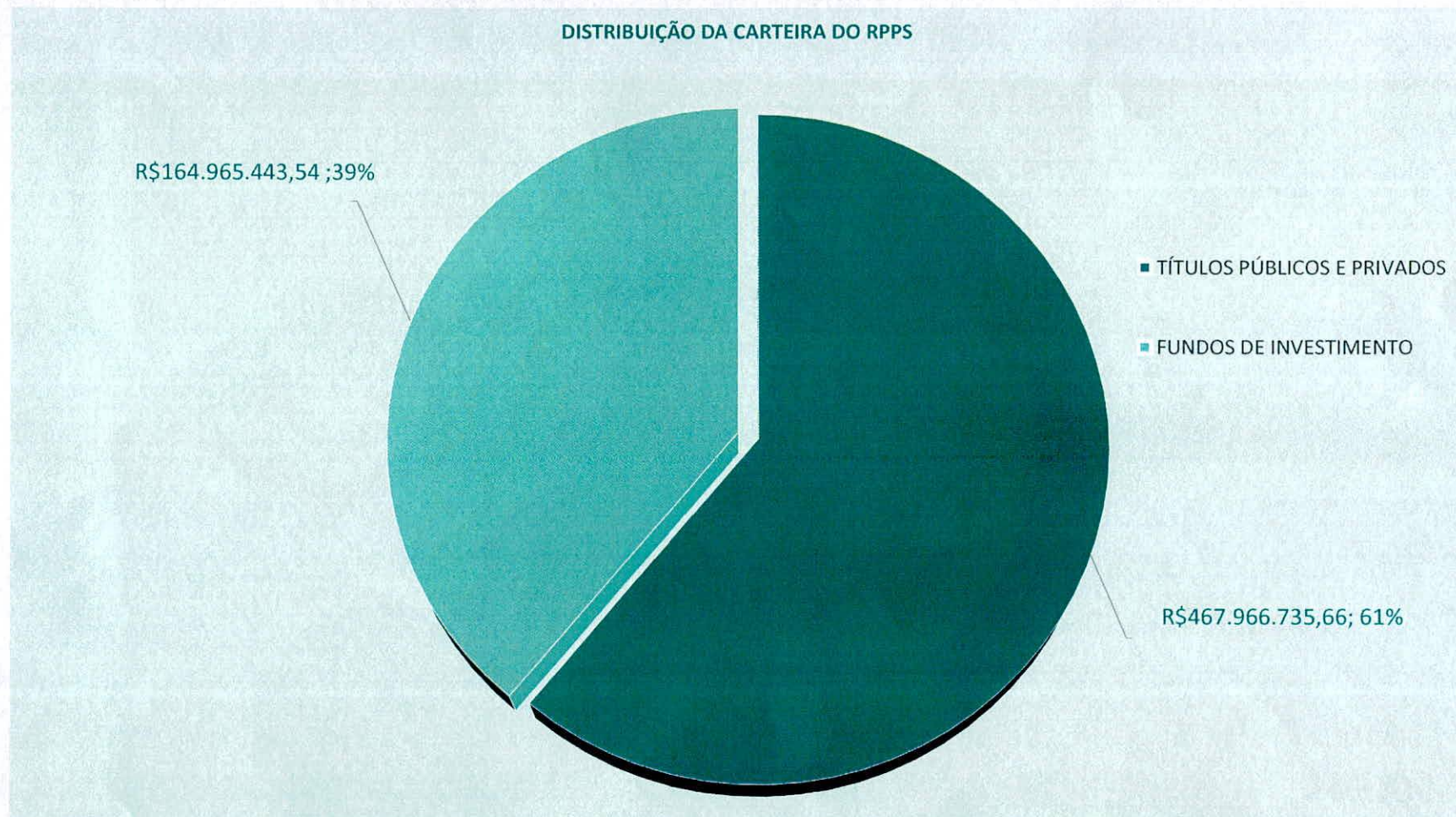
PATRIMÔNIO FUMPRES PREV



PATRIMÔNIO TOTAL DO RPPS



Handwritten signature and initials.



SW
D
T
F
P

MESES	VALOR
TOTAL 2020 (a)	R\$ 8.843.779,50
TOTAL 2021 (b)	R\$ 11.057.652,65
TOTAL 2022 (c)	R\$ 11.755.677,81
TOTAL 2023 (d)	R\$ 12.433.082,55
jan/24	R\$ 2.167.539,62
fev/24	R\$ 1.040.728,29
mar/24	R\$ 1.033.234,84
abr/24	R\$ 1.039.267,39
mai/24	R\$ 1.097.357,88
jun/24	R\$ 1.081.196,47
jul/24	R\$ 1.097.568,21
ago/24	R\$ 19.906,99
TOTAL 2024(e)	R\$ 8.576.799,69
TOTAL ARRECADAÇÃO 2020-2024 (f)	R\$ 52.666.992,20
RENDIMENTOS (g)	R\$ 12.116.522,08
TOTAL GERAL (f+g)	R\$ 64.783.514,28

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.

Handwritten signatures and initials:
 m
 2 m) 7
 Jua

DISTRIBUIÇÃO GERAL DOS FUNDOS CREDENCIADOS DO FUMPRE FIN, TÍTULOS PÚBLICOS E PRIVADOS DO TESOURO e LETRAS FINANCEIRAS								Art. 7º, III, a	TP e FUNDOS DE INVESTIMENTOS 100% TP - 100%	LF - BRADESCO e LF XP 20%
FUNDOS CREDENCIADOS/TÍTULOS TESOURO	CNPJ	Limite Legal	Limite por Fundo/Título	Aplicação	Participação	Grau de Risco	Resgate			
BB Previd RF Perfil FI	13.077.418/0001-49	20%	20%	95.535.552,07	15,09%	Baixo	D+0	15,14%	80,62%	4,24%
BDN - BRADESCO 118.738-4 e 118.743-0	13.397.466/0001-14	20%	20%	289.146,94	0,05%	Baixo	D+0			
LF-25 BRADESCO 21-01-2022 JANEIRO/25	02.332.886/0001-04	20%	20%	6.537.810,32	1,03%	Baixo	N/A			
LF-29 BANCO XP 14-06-2024 JUNHO/29	02.332.886/0001-04	20%	20%	10.264.377,14	1,62%	Baixo	N/A			
LF-26 BANCO XP 15-08-2024 AGOSTO/26	02.332.886/0001-04	20%	20%	10.049.591,43	1,59%	Baixo	N/A			
BB RF DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO	07.214.377/0001-92	100%	100%	69.118.626,99	10,92%	Baixo	D+0			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F-3104-01-2022	02.332.886/0001-04	100%	100%	622.430,34	0,10%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 05-03-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	6.835.336,07	1,08%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 02-02-2022	02.332.886/0001-04	100%	100%	967.722,03	0,15%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 03-08-2022	02.332.886/0001-04	100%	100%	1.026.139,21	0,16%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 28-06-2022	02.332.886/0001-04	100%	100%	995.991,48	0,16%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 11-04-2022	02.332.886/0001-04	100%	100%	452.442,59	0,07%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 03-03-2022	02.332.886/0001-04	100%	100%	937.392,17	0,15%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 02-12-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	978.317,78	0,15%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 03-06-2022	02.332.886/0001-04	100%	100%	894.814,55	0,14%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 06-05-2022	02.332.886/0001-04	100%	100%	866.586,01	0,14%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 26-10-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	935.077,11	0,15%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 05-03-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	4.178.453,34	0,66%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 04-05-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	832.751,57	0,13%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 07-06-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	813.171,30	0,13%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 04-08-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	805.416,22	0,13%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 19-05-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	79.661,27	0,01%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 01-07-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	427.267,04	0,07%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 22-09-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	209.977,69	0,03%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 22-07-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	195.164,84	0,03%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 09-09-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	829.517,23	0,13%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 05-10-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	790.587,93	0,12%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 05-10-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	44.897,59	0,01%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 22-07-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	839.866,53	0,13%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 19-05-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	208.216,44	0,03%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 19-05-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	186.009,25	0,03%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 19-03-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	185.846,82	0,03%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F31 31-03-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	912.152,36	0,14%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 17-06-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	181.148,44	0,03%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 20-04-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	33.715,37	0,01%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-F25 01-07-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	185.016,13	0,03%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 17-11-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	127.041,53	0,02%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 17-05-2022	02.332.886/0001-04	100%	100%	323.119,96	0,05%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B25 15-08-2024	02.332.886/0001-04	100%	100%	219.905.000,08	34,75%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B26 15-08-2024	02.332.886/0001-04	100%	100%	10.240.664,93	1,62%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B35 23-12-2021	02.332.886/0001-04	100%	100%	2.150.295,54	0,34%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B25 15-08-2024	02.332.886/0001-04	100%	100%	100.264.450,37	15,84%	Baixo	N/A			
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B24 22-02-2024	02.332.886/0001-04	100%	100%	51.154.300,21	8,08%	Baixo	N/A			
TÍTULO PÚBLICO NTN-B26 AGO/2026	02.332.886/0001-04	100%	100%	20.745.348,69	3,28%	Baixo	N/A			
TÍTULO PÚBLICO NTN-B25 MAI/2025	02.332.886/0001-04	100%	100%	5.320.929,80	0,84%	Baixo	N/A			
TÍTULO PÚBLICO NTN-B33 MAI/2033	02.332.886/0001-04	100%	100%	3.432.718,97	0,54%	Baixo	N/A			
		TOTAL	INVESTIMENTOS	632.910.061,67	100%					

W
N
m77
Juc

COMITÊ DE INVESTIMENTOS BIÊNIO 2023-2025



Daniel Ribeiro Silva
Presidente



Luciana Rodrigues Vieira Lopes
Membro



Francisco Elde Oliveira Junior
Membro



Rosevaldo C. C. de Carvalho
Membro



Thiago Martins Dantas
Membro

SALVADOR-BAHIA, AGOSTO DE 2024

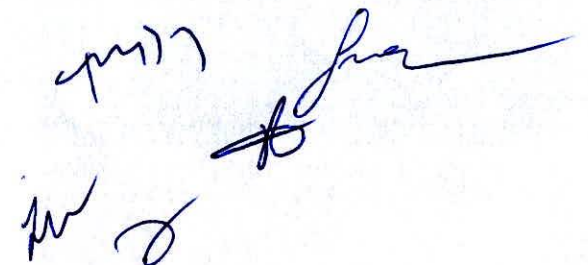
Bruno Soares Reis– Prefeito Municipal

Ana Paula Matos Moreira – Vice-prefeita

Júlio Fon Simões – Secretário de Governo em exercício

Rodrigo Santos Alves – Secretário Municipal de Gestão

Daniel Ribeiro Silva– Diretor Geral de Previdência

Handwritten signatures of the officials listed above. The signatures are in blue ink and are located to the right of the text. The first signature is for Bruno Soares Reis, the second for Ana Paula Matos Moreira, the third for Júlio Fon Simões, the fourth for Rodrigo Santos Alves, and the fifth for Daniel Ribeiro Silva.

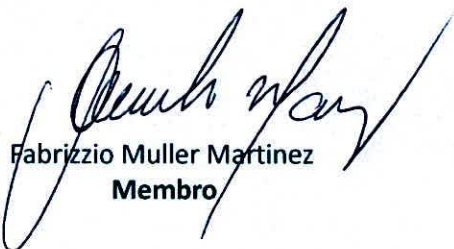
APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL



Antonio Ricardo Góis Pereira
Presidente



David Bittencourt Ludovice Neto
Membro



Fabrizio Muller Martinez
Membro



Kaio Vinicius Moraes Leal
Membro

SALVADOR-BAHIA, AGOSTO DE 2024



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