



## COMPOSIÇÃO MENSAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS POR SEGMENTO E ATIVO (DEZEMBRO 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 |
|-------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|-------------------------|-------------------------------|-------------------------|
| RENTA FIXA        | TÍTULOS DE EMISSÃO DO TESOURO NACIONAL,                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | ART. 7º, I, "A"             | ATÉ 100%                | NÃO SE APLICA                 | -                       |
| RENTA FIXA        | COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CLASSIFICADOS COMO RENDA FIXA, CONFORME REGULAMENTAÇÃO ESTABELECIDADA 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%                       | -                       |
| RENTA FIXA        | ATÉ 5% (CINCO POR CETO) DIRETAMENTE EM OPERAÇÕES COMPROMISSADAS, LASTREADAS EXCLUSIVAMENTE PELOS TÍTULOS DEFINIDOS NA ALÍNEA "A" DO INCISO I;                                                                                                                                                                                                             | ART. 7º, II                 | ATÉ 5%                  | NÃO SE APLICA                 | -                       |
| RENTA FIXA        | COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CLASSIFICADOS COMO RENDA FIXA, CONFORME REGULAMENTAÇÃO ESTABELECIDADA 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%                 |
| RENTA FIXA        | ATÉ 20% (VINTE POR CETO) 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%                 |
| RENTA FIXA        | COTAS DE FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS, CONSTITUÍDOS SOB A FORMA DE CONDOMÍNIO                                                                                                                                                                                                                                                                               | ART. 7º, VI                 | ATÉ 15%                 | NÃO SE APLICA                 | -                       |
| RENTA FIXA        | DEPÓSITOS DE POUPANÇA EM INSTITUIÇÃO FINANCEIRA CONSIDERADA DE BAIXO RISCO DE CRÉDITO (LETRAS IMOBILIÁRIAS GARANTIDAS)                                                                                                                                                                                                                                    | ART. 7º, V                  | ATÉ 20%                 | NÃO SE APLICA                 | -                       |
| RENTA<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 **DEZEMBRO**).

Observamos que a carteira é composta por dois fundos classificados como de risco muito baixo (com rentabilidades de 0,76% e 0,86% em dezembro de 2024) , três de risco baixo (com rentabilidade de 0,79% , 0,84% e 0,89 %) e três com risco alto com rentabilidade de 7,41%, -3,92% e 0,00%.

| FUNDO CREDENCIADO                                                   | CLASSIFICAÇÃO DE RISCO | TAXA DE ADMINISTRAÇÃO | RENTABILIDADE DEZEMBRO 2024 | BENCHMARK | % BENCHMARK DEZEMBRO 2024 |
|---------------------------------------------------------------------|------------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|---------------------------|
| BRDESCO FIC FI RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER                         | MUITO BAIXO            | 1,5% A.A.             | 0,76%                       | CDI       | 81,72%                    |
| BB RENDA FIXA CURTO PRAZO DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO                | MUITO BAIXO            | 0,50% A.A.            | 0,86%                       | CDI       | 92,47%                    |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FIC | BAIXO                  | 0,20% A.A.            | 0,79%                       | CDI       | 84,94%                    |
| PÁTRIA PE VII ADVISORY FIP MULTI-CLASSE D                           | ALTO                   | 0,20% A.A.            | 7,41%                       | CDI       | 796,77%                   |
| TREND PÓS -FIXADO FIC FIRF SIMPLES                                  | BAIXO                  | 0,20% A.A.            | 0,84%                       | CDI       | 90,32%                    |
| FUNDO VINCI RF DI                                                   | BAIXO                  | 0,20% A.A.            | 0,89%                       | CDI       | 95,69                     |
| VCP IV FEEDER B FIP MULTIELSTRATÉGIA                                | ALTO                   | 0,20% A.A.            | -3,92%                      | CDI       | -                         |
| FUNDO IMOBILIÁRIO SPXL15                                            | ALTO                   | 0,20% A.A.            | 0,00%                       | CDI       | 0,00%                     |