



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

## RELATÓRIO SEMESTRAL DE DILIGÊNCIAS

Posição 31/08/2023

### 1. INTRODUÇÃO

Considerando o princípio da transparência na gestão dos recursos do Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Varginha – INPREV;

Considerando a necessidade quanto ao acompanhamento com maior diligência dos produtos que compõe a carteira de investimentos;

Considerando as novas diretrizes de modernização, e adesão às boas práticas de governança corporativa impostas aos RPPS pelo Ministério do Trabalho e Previdência, através da Secretaria de Previdência, com o Programa Pró-Gestão, relativo ao item 3.2.6 do respectivo manual do programa;

Assim, apresentamos estudo com relação a composição da carteira de investimentos do INPREV, informações patrimonial, fiscal, comercial e jurídica de cada Instituição Financeira (Administrador e Gestor) que recebem recursos do INPREV.

O objetivo principal deste Relatório de Diligência é obter controle e acompanhamento dos recursos financeiros para prevenção de impactos negativos sobre o patrimônio líquido do INPREV.

### 2. METODOLOGIA

O Gestor de Recursos e Comitê de Investimentos, mensalmente, fazem o acompanhamento dos ativos investidos. Este trabalho consiste na consulta dos extratos bancários, rentabilidades, análise de riscos e alinhamento à Política de Investimentos e à legislação que rege os investimentos dos Regimes Próprios de Previdência Social.

Passamos apresentar os pontos trabalhados ao longo do período, especificamente no que se refere ao processo de diligência:

#### 2.1. Atualização e credenciamento das Instituições Financeiras

Conforme o Edital de Credenciamento nº 001-2019 e definido na Portaria MTP nº 1.467/2022, o processo de atualização dos credenciamentos é padronizado e deve ocorrer a cada 24 meses.



## INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

Neste processo de atualização do credenciamento é possível verificar a situação patrimonial, fiscal, comercial e jurídica das instituições investidas.

A lista das instituições credenciadas está publicada no site do instituto no seguinte caminho:

<https://inprev.varginha.mg.gov.br/wp-content/uploads/2023/08/investimentos-instituicoes-credenciadas-21-07-2023.pdf>

Esta análise auxiliou a gestão com informações para o item 3, Credenciamento, e o item 4, Instituições Financeiras.

Em agosto/2023 o Conselho Deliberativo aprovou o Edital de Credenciamento nº 002/2023, porém as atualizações e credenciamentos realizados até agosto/2023 tiveram como diretrizes o Edital de Credenciamento nº 001/2019.

### **2.2. Acompanhamento mensal: Visitas Técnicas e Atendimentos**

Foram realizadas, periodicamente, reuniões virtuais, com as instituições, verificando o controle das estratégias de alocação, a saúde financeira dos ativos investidos e das próprias instituições investidas.

As reuniões foram do tipo virtual e presencial na sede do INPREV.

Esta análise auxiliou a gestão com informações para o item 4, Instituições Financeiras.

### **2.3. Relatório de Investimentos**

O Relatório de Investimentos, o qual apresenta o resultado da carteira no mês, ano e trimestre, é apreciado pelo Comitê de Investimentos, Conselho Fiscal e Conselho Deliberativo. Além do panorama mensal, o relatório trata a análise de risco contendo:

Índice de Sharpe e VAR;

Análise de Risco x Retorno e análise por indicadores de riscos;

Análise de volatilidade e liquidez;

Acompanhamento das principais movimentações financeiras;

Análise do Gestor de Recursos.



## INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

Esta análise auxiliou a gestão com informações item 5, Análise dos lastros dos Ativos investidos.

### **2.4. Análise dos Lastros dos Ativos Investidos**

Lastro é um ativo secundário que serve como uma garantia implícita para um ativo principal. Ou seja, o lastro é utilizado para relacionar um ativo inicialmente sem valor (como uma fração de papel utilizado como título) com um algo que possua um valor explícito e visível (como um bem físico).

Por exemplo, ao lastrear um título, o seu emissor está oferecendo um segundo ativo, de valor reconhecido por todos, para garantir a avaliação do primeiro. Dessa forma, o lastro “transfere” seu valor ao ativo principal, possibilitando que ele seja reconhecido e negociado com outras pessoas.

No mercado financeiro, o lastro é utilizado nas operações com títulos. Na prática, é o lastro dado como garantia em um título que permite que ele seja aceito e negociado no mercado pelos investidores.

Diante a exposição acima, se deu a análise do item 5, Análise dos lastros dos Ativos Investidos, que busca identificar e avaliar os seguintes pontos:

Vinculação dos ativos investidos e a legislação vigente;

Vinculação entre as estratégias pretendidas e os ativos investidos;

Veracidade das informações prestadas pelas Instituições Financeiras;

Controle eficiente dos riscos dos ativos.

### **3. CREDENCIAMENTO**

O INPREV, com base na Portaria MTP 1.467/2022 e Edital de Credenciamento nº 001-2019, analisa a cada 24 meses a situação patrimonial, fiscal, jurídica e comercial das instituições financeiras que possuem ou pretendem possuir ativos investidos com recursos previdenciários.

Este processo tem como objetivos:

- Avaliar as Instituições no que se refere aos requisitos de saúde institucional (patrimonial, fiscal, jurídica e comercial);



## INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

- Fornecer ao Gestor de Recursos e ao Comitê de Investimentos parâmetros atualizados, para identificar, mensalmente, possíveis desvios das informações fornecidas;
- Prover informações para este relatório semestral.

A seguir os itens verificados e recebidos para cada critério de análise:

### **a) Patrimonial:**

Os documentos buscam identificar a situação atual do patrimônio da Instituição como um todo e o controle de riscos internos para sua prevenção.

Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimentos – QDD, preenchido e assinado pelos responsáveis pela instituição financeira, com as informações sobre a empresa e seus anexos, ou, Termo de análise de credenciamento conforme modelo específico divulgado pela Secretaria de Previdência – SPREV, nos casos em que o credenciado seja instituição autorizada a funcionar pelo BACEN, obrigada a instituir comitê de auditoria e comitê de riscos.

Para Gestor de fundos de investimentos, apresentar relatório de rating de gestão vigente.

### **b) Fiscal:**

Os documentos permitem comprovar as situações fiscais em dia, no ato do credenciamento e no decorrer a utilização dos produtos financeiros das instituições aptas.

Certificado de Regularidade do FGTS – CRF;

Certidão da Fazenda Municipal, Estadual e Federal e Dívida Ativa da União;

Certidão Estadual de Distribuições Cíveis (Falência e Concordata);

### **c) Jurídico:**

Os documentos permitem avaliar os atos de constituição da empresa, seus registros de funcionamento junto aos órgãos de regulação e suas vinculações legais perante a legislação vigente para os Institutos de Previdência.

Ato de registro ou autorização expedido pelo Banco Central do Brasil ou Comissão de Valores Mobiliários ou órgão competente;



## INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

Prova de inscrição no cadastro nacional de pessoa jurídica (CNPJ);

Contrato Social ou Estatuto Social.

### d) Comercial:

Os documentos identificam a estrutura organizacional da equipe comercial que terá relacionamento com a gestão, estrutura própria ou via Agente Autônomo de Investimentos (AAI). Permite também dar ciência quanto os contratos de remuneração com terceiros, sem entrar no mérito de valores.

Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence – Estrutura de distribuição dos produtos de investimentos (Própria ou por meio de Agente Autônomo de Investimentos – AAI).

## 4. INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS

Segue tabela de alocação por Gestor e análise das principais condições de mercado de cada empresa:

Alocação por Gestor - Posição 31/08/2023		
Gestor	Valor	% s/ Carteira
BB DTVM S/A	166.040.109,47	33,24%
CAIXA DTVM S.A.	54.912.707,54	10,99%
ITAU DTVM S.A.	14.553.941,54	2,91%
ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA	12.370.868,15	2,48%
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A	6.587.864,50	1,32%
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS	9.189.287,13	1,84%
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S/A DTVM	7.354.817,44	1,47%
OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	7.419.636,60	1,49%
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	7.679.370,53	1,54%
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	6.234.766,00	1,25%
VINCII EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA	5.976.482,37	1,20%
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA	3.328.688,93	0,67%
VINCI SOLUÇÃO DE INVESTIMENTOS LTDA	3.118.173,51	0,62%
VINCI GESTORA DE RECURSOS LTDA	952.961,25	0,19%
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	3.618.682,13	0,72%
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE RECURSOS LTDA.	1.622.507,53	0,32%
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	1.751.252,63	0,35%
SECRETARIA DO TESOURO NACIONAL	186.732.644,70	37,39%
<b>TOTAL</b>	<b>499.444.761,95</b>	<b>100,00%</b>



## INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

### **BB DTVM S/A**

Principal instituição da carteira do INPREV, em alocação de recursos. Banco Público com concentração de recursos do seguimento de RPPS. Credenciamento em dia de acordo com as exigências legais. Durante o período de credenciamento não foram encontrados indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial própria com atendimento através de agência bancária. O contato se dá por meio de visitas, reuniões virtuais e via e-mails.

A instituição gere os seguintes fundos que compõe a carteira do INPREV:

BB PREVID RF IMA-B 5 (CNPJ 03.543.447/0001-03)

BB PREVID RF IMA-B TP (CNPJ 07.442.078/0001-05)

BB PREVID RF PERFIL (CNPJ 13.077.418/0001-49)

BB PREVID AÇÕES GOVERNANÇA (CNPJ 10.418.335/0001-88)

BB PREVID AÇÕES ALOCAÇÃO FIC FI (CNPJ 18.270.783/0001-99)

BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FI (CNPJ 29.258.294/0001-38)

BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI (CNPJ 09.005.805/0001-00)

BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FICFI (CNPJ 35.292.588/0001-89)

BB MULTIMERCADO NORDEA IE FI (CNPJ 21.752.617/0001-33)

BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE PRIVATE FI (CNPJ 38.110.528/0001-96)

BB AÇÕES AGRO FIC FI (CNPJ 40.054.357/0001-77)

BB PREVID RF FLUXO (CNPJ 13.077.415/0001-05)

### **CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (CAIXA DTVM S.A.)**

Uma das principais instituições da carteira do INPREV, em alocação de recursos. Banco Público com concentração de recursos do seguimento de RPPS. Credenciamento em dia de acordo com as exigências legais. Durante o período de credenciamento não foram encontrados indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial própria com atendimento através de agência bancária. O contato se dá por meio de visitas, reuniões virtuais e via e-mails.

A instituição gere os seguintes fundos que compõe a carteira do INPREV:



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA**

FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP (CNPJ 10.740.658/0001-93)

FI CAIXA BRASIL IMA-B5 TP RF LP (CNPJ 11.060.913/0001-10)

CAIXA FIC BRASIL DISPONIBILIDADES RF (CNPJ 14.508.643/0001-55)

FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I (CNPJ 17.502.937/0001-68)

FI CAIXA FIC AÇÕES VALOR DIVIDENDOS RPPS (CNPJ 15.154.441/0001-15)

**GRUPO ITAÚ UNIBANCO (ITAÚ DTVM S/A e ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA.)**

A instituição detém parcela relevante dos recursos do INPREV. Um dos maiores bancos privados do país. Credenciamento em dia de acordo com as exigências legais. Durante o período de credenciamento não foram encontrados indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial própria. O contato se dá por meio de visitas, reuniões virtuais e via e-mails.

A instituição gere os seguintes fundos que compõe a carteira do INPREV:

ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FICFI (CNPJ 32.972.942/0001-28)

ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI (CNPJ 08.817.414/0001-10)

ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FI (CNPJ 23.731.629/0001-07)

ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FOF GENESIS FICFI (CNPJ 32.665.845/0001-92)

ITAÚ AÇÕES EUROPA IE FIC FI (CNPJ 35.727.628/0001-78)

**GRUPO BANCO BRADESCO (BRAM – BRADESCO ASSET MANAGEMENT S/A)**

A instituição detém parcela relevante dos recursos do INPREV. Um dos maiores bancos privados do país. Credenciamento em dia de acordo com as exigências legais. Durante o período de credenciamento não foram encontrados indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial própria com atendimento através de agência bancária. O contato se dá por meio de visitas, reuniões virtuais e via e-mails.

A instituição gere os seguintes fundos que compõe a carteira do INPREV:

BRADESCO FIA SELECTION (CNPJ 03.660.879/0001-96)



## **INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA**

BRADESCO FIM S&P 500 MAIS (CNPJ 18.079.540/0001-78)

### **GRUPO BANCO SANTANDER (SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS)**

A instituição detém parcela relevante dos recursos do INPREV. Um dos maiores bancos privados do país. Credenciamento em dia de acordo com as exigências legais. Durante o período de credenciamento não foram encontrados indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial própria. O contato se dá por meio de visitas, reuniões virtuais e via e-mails.

A instituição gere os seguintes fundos que compõe a carteira do INPREV:

SANTANDER RF REF DI TP PREMIUM FIC FI (CNPJ 09.577.447/0001-00)

### **GRUPO BANCO BTG PACTUAL (BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S/A DTVM)**

A instituição detém parcela relevante dos recursos do INPREV. Um dos maiores bancos privados de investimentos do país. Credenciamento em dia de acordo com as exigências legais. Durante o período de credenciamento não foram encontrados indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial própria. O contato se dá por meio de visitas, reuniões virtuais e via e-mails.

A instituição gere os seguintes fundos que compõe a carteira do INPREV:

BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIQ FIA (CNPJ 11.977.794/0001-64)

### **OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA**

A instituição detém parcela relevante dos recursos do INPREV. Gestora privada de recursos. Credenciamento em dia de acordo com as exigências legais. Durante o período de credenciamento não foram encontrados indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial representada por Agente Autônomo de Investimentos (AAI), GRID Investimentos, que também encaminhou documentação de credenciamento. O contato se dá por meio de visitas, reuniões virtuais e via e-mails.

A instituição gere os seguintes fundos que compõe a carteira do INPREV:

OCCAM FIC FIA (CNPJ 11.628.883/0001-03)





INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

### **GRUPO XP INVESTIMENTOS (XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA e XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA)**

A instituição detém parcela relevante dos recursos do INPREV. O Banco XP foi fundado em 2019 se firmando como uma das novas empresas financeiras do mercado doméstico. Credenciamento em dia de acordo com as exigências legais. Durante o período de credenciamento não foram encontrados indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial própria para atendimento exclusivo a RPPS. Como corretora de recursos, distribui fundos de investimentos de outras gestoras, assim como Morgan Stanley. O contato se dá por meio de visitas, reuniões virtuais e via e-mails.

A instituição gere os seguintes fundos que compõe a carteira do INPREV:

XP INVESTOR 30 FIC FIA (CNPJ 26.718.169/0001-75)

MORGAN STANLEY GLOBAL OPPORTUNITIES DOLAR ADVISORY FIC FIA (CNPJ 33.913.562/0001-85)

TREND CASH FIC FI RF SIMPES (CNPJ 45.823.918/0001-79)

SYSTEMÁTICA BLUE TREND ADVISORY FIC FIM IE (CNPJ 39.723.347/0001-06)

### **AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA**

A instituição detém parcela relevante dos recursos do INPREV. Gestora privada de recursos. Credenciamento em dia de acordo com as exigências legais. Durante o período de credenciamento não foram encontrados indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial representada por Agente Autônomo de Investimentos (AAI), Privatiza Investimentos, que também encaminhou documentação de credenciamento. O contato se dá por meio de visitas, reuniões virtuais e via e-mails.

A instituição gere os seguintes fundos que compõe a carteira do INPREV:

AZ QUEST AÇÕES FIC FIA (CNPJ 07.279.657/0001-89)

AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA (CNPJ 11.392.165/0001-72)

### **GRUPO VINCI (VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA; VINCE SOLUÇÃO DE INVESTIMENTOS LTDA e VINCI GESTÃO DE RECURSOS LTDA)**

A instituição detém parcela relevante dos recursos do INPREV. Gestora privada de recursos. Credenciamento em dia de acordo com as exigências legais. Durante o período de



## **INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA**

credenciamento não foram encontrados indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial própria para atendimento exclusivo a RPPS. O contato se dá por meio de visitas, reuniões virtuais e via e-mails.

A instituição gere os seguintes fundos que compõe a carteira do INPREV:

VINCI MOSAICO FIA (CNPJ 28.470.587/0001-11)

VINCI SELECTION EQUITIES FIA (CNPJ 15.603.945/0001-75)

VINCI AUGURI SYNCHRONY FIC FI MULTIMERCADO (CNPJ 35.002.795/0001-51)

### **SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA**

A instituição detém parcela relevante dos recursos do INPREV. Gestora privada de recursos. Credenciamento em dia de acordo com as exigências legais. Durante o período de credenciamento não foram encontrados indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial representada por Agente Autônomo de Investimentos (AAI), Privatiza Investimentos, que também encaminhou documentação de credenciamento. O contato se dá por meio de visitas, reuniões virtuais e via e-mails.

A instituição gere os seguintes fundos que compõe a carteira do INPREV:

SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC FIA IE (CNPJ 37.308.394/0001-50)

### **PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE RECURSOS LTDA**

A instituição detém parcela relevante dos recursos do INPREV. Gestora privada de recursos. Credenciamento em dia de acordo com as exigências legais. Durante o período de credenciamento não foram encontrados indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial representada por Agente Autônomo de Investimentos (AAI), GRID Investimentos, que também encaminhou documentação de credenciamento. O contato se dá por meio de visitas, reuniões virtuais e via e-mails.

A instituição gere os seguintes fundos que compõe a carteira do INPREV:

GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE (CNPJ 37.331.365/0001-09)



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA**

**ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA**

A instituição detém parcela relevante dos recursos do INPREV. Gestora privada de recursos. Credenciamento em dia de acordo com as exigências legais. Durante o período de credenciamento não foram encontrados indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial representada por Agente Autônomo de Investimentos (AAI), GRID Investimentos, que também encaminhou documentação de credenciamento. O contato se dá por meio de visitas, reuniões virtuais e via e-mails.

A instituição gere os seguintes fundos que compõe a carteira do INPREV:

ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA (CNPJ 08.279.304/0001-41)

**5. ANÁLISE DE LASTRO DOS ATIVOS**

**5.1. Carteira**

Carteira de Investimentos - Posição 31/08/2023			
<b>Taxa de Administração</b>		<b>2.747.587,87</b>	<b>Gestor</b>
BB PREVID RF IMA-B 5	03.543.447/0001-03	2.552.408,29	BB DTVM S.A
BB PREVID RF FLUXO	13.077.415/0001-05	195.179,58	BB DTVM S.A
<b>Reserva Administrativa</b>		<b>1.557.543,95</b>	
BB PREVID RF IMA-B 5	03.543.447/0001-03	1.557.543,95	BB DTVM S.A
<b>Plano Financeiro</b>		<b>30.221.665,24</b>	
BB PREVID RF FLUXO - PLANO FINANCEIRO	13.077.415/0001-05	11.978,75	BB DTVM S.A
BB PREVID RF PERFIL - PLANO FINANCEIRO	13.077.418/0001-49	22.505.578,54	BB DTVM S.A
BB PREVID RF ALOC ATIVA RETORNO TOTAL FICFI	35.292.588/0001-89	7.704.107,95	BB DTVM S.A
<b>Plano Previdenciário</b>		<b>464.917.964,88</b>	
BB PREVID RF IMA-B 5	03.543.447/0001-03	9.190.614,59	BB DTVM S.A
BB PREVID RF IMA-B TP	07.442.078/0001-05	68.816.201,51	BB DTVM S.A
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	19.284.492,53	BB DTVM S.A
BB PREVID AÇÕES GOVERNANÇA	10.418.335/0001-88	8.066.582,58	BB DTVM S.A
BB PREVID AÇÕES ALOCAÇÃO FIC FI	18.270.783/0001-99	7.048.865,99	BB DTVM S.A
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FI	29.258.294/0001-38	6.757.479,65	BB DTVM S.A
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	09.005.805/0001-00	6.064.748,22	BB DTVM S.A
BB MULTIMERCADO NORDEA IE FI	21.752.617/0001-33	1.879.700,27	BB DTVM S.A
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE PRIVATE FI	38.110.528/0001-96	2.387.935,95	BB DTVM S.A
BB AÇÕES AGRO FIC FI	40.054.357/0001-77	1.966.329,15	BB DTVM S.A
BB PREVID RF FLUXO	13.077.415/0001-05	1.030,15	BB DTVM S.A
BB PREVID RF FLUXO	13.077.415/0001-05	49.331,82	BB DTVM S.A



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA**

FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	10.740.658/0001-93	35.858.783,97	CAIXA DTVM S.A.
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	11.060.913/0001-10	10.199.536,68	CAIXA DTVM S.A.
CAIXA FIC BRASIL DISPONIBILIDADE	14.508.643/0001-55	79.822,96	CAIXA DTVM S.A.
FI CAIXA FIC AÇÕES VALOR DIVIDENDOS RPPS	15.154.441/0001-15	7.549.952,88	CAIXA DTVM S.A.
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	1.224.611,05	CAIXA DTVM S.A.
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FICFI	32.972.942/0001-28	4.013.689,48	ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	08.817.414/0001-10	8.185.386,18	ITAÚ DTVM S.A.
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FI	23.731.629/0001-07	6.460.470,65	ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FOF GENESIS FICFI	32.665.845/0001-92	6.368.555,36	ITAÚ DTVM S.A.
ITAÚ AÇÕES EUROPA IE FIC FI	35.727.628/0001-78	1.896.708,02	ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA
BRADESCO FIA SELECTION	03.660.879/0001-96	5.628.166,69	BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A
BRADESCO FIM S&P 500 MAIS	18.079.540/0001-78	959.697,81	BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A
SANTANDER RF REF DI TP PREMIUM FIC FI	09.577.447/0001-00	9.189.287,13	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIQ FIA	11.977.794/0001-64	7.354.817,44	BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S/A DTVM
XP INVESTOR 30 FIC FIA	26.718.169/0001-75	7.679.370,52	XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA
MORGAN STANLEY GLOBAL OPPORTUNITIES DOLAR ADVISORY FIC FIA IE	33.913.562/0001-85	2.707.695,85	XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FIM IE	39.723.347/0001-06	906.574,09	XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA
TREND CASH FIC FIRF SIMPLES	45.823.918/0001-79	4.412,19	XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA
OCCAM FIC FIA	11.628.883/0001-03	7.419.636,60	OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA
VINCI MOSAICO FIA	28.470.587/0001-11	5.976.482,37	VINCII EQUITIES GSTORA DE RECURSOS LTDA
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	15.603.945/0001-75	3.118.173,51	VINCI SOLUÇÃO DE INVESTIMENTOS LTDA
VINCI AUGURI FC FI MULTIMERCADO	35.002.795/0001-51	952.961,25	VINCI GESTORA DE RECURSOS LTDA
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	08.279.304/0001-41	1.751.252,63	ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA
AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	07.279.657/0001-89	4.872.161,65	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	11.392.165/0001-72	1.362.604,35	AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	37.331.365/0001-09	1.622.507,53	PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - IE	37.308.394/0001-50	3.328.688,93	SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA
NTN-B 2024 - 15/08/2024 - 6,7830%	Marcação na CURVA	10.299.104,59	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
NTN-B 2024 - 15/08/2024 - 6,9410%	Marcação na CURVA	10.696.294,83	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
NTN-B 2025 - 15/05/2025 - 6,1150%	Marcação na CURVA	20.251.481,84	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
NTN-B 2030 - 15/08/2030 - 6,2800%	Marcação na CURVA	12.334.124,30	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
NTN-B 2032 - 15/08/2032 - 6,2951%	Marcação na CURVA	10.583.458,00	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
NTN-B 2035 - 15/05/2035 - 5,8198%	Marcação na CURVA	5.131.487,66	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
NTN-B 2035 - 15/05/2035 - 5,8310%	Marcação na CURVA	10.681.035,78	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
NTN-B 2035 - 15/05/2035 - 6,1000%	Marcação na CURVA	10.454.602,41	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
NTN-B 2040 - 15/08/2040 - 5,9400%	Marcação na CURVA	11.959.580,22	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
NTN-B 2045 - 15/05/2045 - 5,8900%	Marcação na CURVA	10.427.126,05	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
NTN-B 2045 - 15/05/2045 - 5,7865%	Marcação na CURVA	10.808.897,58	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
NTN-B 2045 - 15/05/2045 - 5,8950%	Marcação na CURVA	10.672.950,72	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
NTN-B 2045 - 15/05/2045 - 6,0200%	Marcação na CURVA	10.519.437,97	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
NTN-B 2045 - 15/05/2045 - 6,1600%	Marcação na CURVA	10.351.378,33	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
NTN-B 2050 - 15/08/2050 - 5,9720%	Marcação na CURVA	10.430.006,05	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
NTN-B 2050 - 15/08/2050 - 6,0200%	Marcação na CURVA	10.365.335,91	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
NTN-B 2055 - 15/05/2055 - 5,8500%	Marcação na CURVA	10.766.342,46	SECRETARIA DO TESOUREO NACIONAL
<b>TOTAL</b>		<b>499.444.761,94</b>	



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA**

**5.2. Enquadramento**

Enquadramento Res. 4963/2021	Valor Investido	% Recursos	Limites					
			Resolução	Pró-Gestão	Política de Investimentos			Sugestão
					Nível II	Mínimo	Objetivo	
Art. 7º, I, a - Títulos Públicos	186.732.644,70	37,39%	100%	100%	10%	30%	100%	50%
Art. 7º, I, b - Fundos 100% TP - Ref.	145.072.896,26	29,05%	100%	100%	10%	27%	100%	10%
Art. 7º, III, a - Fundos Renda Fixa em Geral	46.141.103,81	9,24%	60%	70%	2%	12%	70%	15%
Art. 7º, IV - Ativos de RF (Inst. Financeiras)	0,00	0,00%	20%	20%	0%	1%	20%	0%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>377.946.644,77</b>	<b>75,67%</b>				<b>70%</b>		
Art. 8º, I - Fundos de Ações	103.631.036,43	20,75%	30%	40%	6%	17%	40%	5%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>103.631.036,43</b>	<b>20,75%</b>				<b>17%</b>		
Art. 9º, II - FI no Exterior	14.729.810,64	2,95%	10%	10%	0%	5%	10%	5%
Art. 9º, III - Ações - BDR Nível I	1.224.611,05	0,25%	10%	10%	0%	2%	10%	5%
<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>15.954.421,69</b>	<b>3,19%</b>				<b>7%</b>		
Art. 10, I - Fundos Multimercados	1.912.659,06	0,38%	10%	10%	0%	5%	10%	10%
<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>1.912.659,06</b>	<b>0,38%</b>				<b>5%</b>		
Art. 12, II - Emprést. Consignado-C/ Pró Gestão	0,00	0,00%	10%	10%	0%	1%	10%	0%
<b>Total Investimentos Em Consignado</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>				<b>1%</b>		
<b>Total dos Investimentos</b>	<b>499.444.761,95</b>	<b>100,00%</b>				<b>100%</b>		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

5.3. Rentabilidade

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	1,88	-0,73	0,57	1,10	1,77	2,57	1,31	-0,81					7,88
IPCA + 5,17%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67	0,34	0,54	0,69					6,76
p.p. indexador	0,90	-1,93	-0,60	0,13	1,10	2,23	0,76	-1,50					1,12
2022	0,17	-0,01	2,84	-1,90	0,83	-2,46	1,48	1,76	-0,00	2,64	-1,20	-0,34	3,70
IPCA + 5,04%	0,95	1,39	2,06	1,44	0,90	1,08	-0,27	0,09	0,12	0,98	0,80	1,05	11,10
p.p. indexador	-0,78	-1,40	0,79	-3,34	-0,08	-3,55	1,75	1,67	-0,12	1,66	-2,01	-1,40	-7,39
2021	-0,97	-1,44	0,98	1,41	1,79	0,28	-1,10	-1,35	-1,83	-2,54	1,17	0,89	-2,61
IPCA + 5,47%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,06
p.p. indexador	-1,64	-2,69	-0,45	0,68	0,51	-0,70	-2,53	-2,69	-3,24	-4,22	-0,21	-0,33	-18,66
2020	0,55	-1,24	-8,46	2,27	2,48	2,56	3,01	-0,97	-1,72	-0,22	3,95	4,23	5,91
IPCA + 5,89%	0,71	0,96	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,95
p.p. indexador	-0,16	-1,90	-9,03	2,12	2,41	1,82	2,13	-1,69	-2,84	-1,57	2,61	2,37	-4,74
2019	3,10	0,22	0,40	1,09	1,95	2,61	1,40	0,25	1,73	1,86	-0,47	2,58	17,98
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	2,27	-0,67	-0,79	0,03	1,31	2,16	0,68	-0,37	1,28	1,23	-1,45	0,94	7,39
2018	2,04	0,65	1,18	0,36	-2,44	-0,16	2,01	-0,78	0,83	4,35	0,82	1,33	10,51
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,24	-0,09	0,61	-0,35	-3,33	-1,92	1,17	-1,23	-0,10	3,38	0,57	0,72	0,59
2017	1,65	1,97	1,08	0,59	-0,38	0,69	2,77	1,61	1,69	-0,02	-0,21	1,35	13,52
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,76	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	0,76	1,22	0,29	0,04	-1,21	0,44	2,04	0,89	1,07	-0,93	-0,95	0,44	4,47

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	40	50,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	40	50,00
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,35	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-8,46	2020-03

Relatório

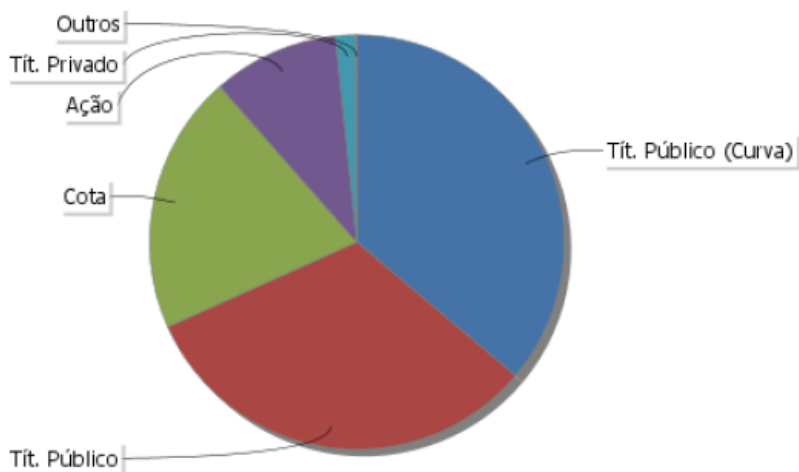
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,07	1,58	1,49	3,55
06 meses	6,67	4,47	2,19	3,55
12 meses	9,02	9,95	-0,93	4,82
24 meses	9,46	25,74	-16,28	5,56
36 meses	15,76	45,82	-29,86	5,92
48 meses	22,07	58,01	-35,94	7,79
60 meses	46,33	73,11	-26,79	7,26
Desde 30/12/2016	70,79	101,89	-31,11	6,74



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

#### 5.4. Distribuição da Carteira Aberta por Ativos

CARTEIRA VARGINHA



Ativo	Financeiro	% P.L.
Futuro	0,00	0,00
Termo Renda Fixa	0,00	0,00
Opção	32.812,13	0,01
Caixa	281.293,42	0,06
Tít. Privado	8.287.364,16	1,66
Ação	50.697.110,57	10,15
Cota	104.567.321,98	20,94
Tít. Público	166.048.354,80	33,25
Tít. Público (Curva)	186.732.644,70	37,39



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

### 5.5. Análise dos Rating dos Créditos Privados da Carteira

Os créditos privados abaixo relacionados compõem a carteira dos fundos de investimentos BB Previdenciário RF Perfil FIC FI, BB Previdenciário RF Fluxo FICFI, FICFI Caixa Brasil Disponibilidades RF e Itaú Global Dinâmico RF LP FICFI.

Posição em 31/08/2023		
Fundo	Qtde. Cotistas	PL (R\$)
BB Previdenciário RF Perfil FICFI	1116	14.734.335.445,36
BB Previdenciário RF Fluxo FICFI	996	3.554.344.878,79
FICFI Caixa Brasil Disponibilidades RF	240	2.919.877.676,62
Itaú Global Dinâmico RF LP FICFI	360	875.310.436,12

Ativo	Contraparte	Agência	Rating	Valor (R\$)
CDB	BANCO C6 S.A.			45.282,59
CDB	CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF			5.365,41
CDB	CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF			1.505,04
CDB	BCO BRASIL SA			758,56
CDB	BCO BRASIL SA			212,57
CDB	BCO BRASIL SA			658,77
CDB	BCO BRASIL SA			611,56
CDB	BCO BRASIL SA			384,57
CDB	BCO BRASIL SA	MOODY'S	AAA	75,86
CDB	BCO BRASIL SA			64,20
CDB	BCO BRASIL SA			273,20
CDB	BCO BRASIL SA			116,32
CDB	BCO BRASIL SA			109,30
CDB	BCO BRASIL SA			1.436,43
CDB	BCO BRASIL SA	MOODY'S	AAA	144,35
CDB	BCO BRASIL SA			234,01
CDB	BCO BRASIL SA			825,97
CDB	BCO BRASIL SA			371,00
CDB	BCO BRASIL SA			1.017,13





**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA**

CDB	BCO BRASIL SA			344,47
CDB	BCO BRASIL SA			362,41
CDB	BCO BRASIL SA			837,34
CDB	BCO BRASIL SA			78,25
CDB	BCO BRASIL SA			114,82
CDB	BCO BRASIL SA			1.357,10
CDB	BCO BRASIL SA			693,52
CDB	BCO BRASIL SA			1.295,86
CDB	BCO BRASIL SA			737,49
CDB	BCO BRASIL SA			70,47
CDB	BCO BRASIL SA			68,69
CDB	BCO BRASIL SA			99,95
CDB	BCO BRASIL SA			1.276,92
CDB	BCO BRASIL SA			110,98
CDB	BCO BRASIL SA			19,32
CDB	BCO BRASIL SA			229,26
CDB	BCO BRASIL SA			334,25
CDB	BCO BRASIL SA			342,87
CDB	BCO BRASIL SA			43,96
CDB	BCO BRASIL SA			54,17
CDB	BCO BRASIL SA			46,26
CDB	BCO BRASIL SA			166,81
CDB	BCO BRASIL SA			212,19
CDB	BCO BRASIL SA			120,20
CDB	BCO BRASIL SA			589,61
CDB	BCO BRASIL SA			721,53
CDB	BCO BRASIL SA			162,49
CDB	BCO BRASIL SA			144,88
CDB	BCO BRASIL SA			53,09
CDB	BCO BRASIL SA			7,49
CDB	BCO BRASIL SA			370,65
CDB	BCO BRASIL SA			78,90
CDB	BCO BRASIL SA			36,96
CDB	BCO BRASIL SA			950,07
CDB	BCO BRASIL SA	MOODY'S	AAA	171,12
CDB	BCO BRASIL SA			684,09
CDB	BCO BRASIL SA			113,21
CDB	BCO BRASIL SA			1.091,38
CDB	BCO BRASIL SA			417,67
CDB	BCO BRASIL SA			709,09
DEBÊNTURE	AES TIETE ENERGIA SA	FITCH	AA	32.437,21



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA**

DEBÊNTURE	ATACADAO SA			147.144,26
DEBÊNTURE	ATACADAO SA			45.436,41
DEBÊNTURE	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	FITCH	AAA	160.365,24
DEBÊNTURE	CCR SA	MOODY'S	AA	12.590,04
DEBÊNTURE	CCR SA	S&P	AAA	8.108,21
DEBÊNTURE	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	S&P	AAA	121.965,77
DEBÊNTURE	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COELBA	S&P	AAA	6.853,49
DEBÊNTURE	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COELBA	S&P	AAA	59.554,43
DEBÊNTURE	CIA ENERGETICA PERNAMBUCO CELPE	S&P	AAA	23.635,21
DEBÊNTURE	CIELO SA	FITCH	AAA	112.031,79
DEBÊNTURE	CIELO SA	FITCH	AAA	12.003,41
DEBÊNTURE	CIELO SA	FITCH	AAA	88.024,98
DEBÊNTURE	COMPANHIA SANEAMENTO PARANA SANEPAR	FITCH	AAA	15.383,37
DEBÊNTURE	COPEL DISTRIBUICAO SA			29.290,46
DEBÊNTURE	COPEL DISTRIBUICAO SA			39.073,93
DEBÊNTURE	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	FITCH	AAA	4.630,19
DEBÊNTURE	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	FITCH	AAA	6.713,77
DEBÊNTURE	ENEVA S.A.	S&P	AAA	89.983,62
DEBÊNTURE	EQUATORIAL PARÁ DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.	S&P	AAA	17.384,24
DEBÊNTURE	ESTACIO PARTICIPACOES SA	S&P	AAA	3.002,52
DEBÊNTURE	HAPVIDA PARTICIPACOES INVESTIMENTO SA	FITCH	AAA	12.726,53
DEBÊNTURE	IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	FITCH	AAA	7.711,25
DEBÊNTURE	ITAUSA INVESTS ITAU SA			12.122,77
DEBÊNTURE	LOCALIZA RENT A CAR SA	FITCH	AAA	34.416,63
DEBÊNTURE	LOCALIZA RENT A CAR SA	S&P	AAA	31.160,66
DEBÊNTURE	LOCALIZA RENT A CAR SA	S&P	AAA	16.460,62
DEBÊNTURE	LOCALIZA RENT A CAR SA	FITCH	AAA	63.194,78
DEBÊNTURE	MRS LOGISTICA SA	FITCH	AAA	32.545,51
DEBÊNTURE	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	S&P	AAA	8.501,88
DEBÊNTURE	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	FITCH	AAA	17.404,53
DEBÊNTURE	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	FITCH	AAA	94.077,11
DEBÊNTURE	OI SA			72.127,09
DEBÊNTURE	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	FITCH	AA	18.883,16
DEBÊNTURE	REDE D OR SAO LUIZ SA	FITCH	AAA	42.702,85
DEBÊNTURE	SABESP	S&P	AAA	84.429,26
DEBÊNTURE	SABESP	S&P	AAA	79.070,56
DEBÊNTURE	SANTOS BRASIL PARTICIPACOES SA	S&P	AAA	4.401,78
DEBÊNTURE	SUZANO S.A.	S&P	AAA	53.687,14
DEBÊNTURE	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA			29.068,92
DEBÊNTURE	UNIDAS SA	S&P	AAA	22.166,83
LETRA FINANCEIRA	BANCO VOTORANTIM S.A.	S&P	AAA	89.847,79



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA**

LETRA FINANCEIRA	BCO BRADESCO SA	S&P	AAA	767.947,09
LETRA FINANCEIRA	BCO BRADESCO SA			83.355,56
LETRA FINANCEIRA	BCO BRADESCO SA	S&P	AAA	463.279,91
LETRA FINANCEIRA	BCO BRADESCO SA	S&P	AAA	125.052,31
LETRA FINANCEIRA	BCO BRADESCO SA	S&P	AAA	568.498,22
LETRA FINANCEIRA	BCO BRADESCO SA	S&P	AAA	17.959,56
LETRA FINANCEIRA	BCO BRADESCO SA	S&P	AAA	16.761,09
LETRA FINANCEIRA	BCO BRADESCO SA			83.485,39
LETRA FINANCEIRA	BCO BRASIL SA	MOODY'S	AAA	119.246,38
LETRA FINANCEIRA	BCO BRASIL SA	MOODY'S	AAA	98.694,56
LETRA FINANCEIRA	BCO BRASIL SA	MOODY'S	AAA	127.097,14
LETRA FINANCEIRA	BCO BRASIL SA	MOODY'S	AAA	405.381,18
LETRA FINANCEIRA	BCO BTG PACTUAL SA	MOODY'S	AAA	24.785,60
LETRA FINANCEIRA	BCO CITIBANK SA	S&P	AAA	54.235,36
LETRA FINANCEIRA	BCO ITAU SA	FITCH	AAA	327.207,58
LETRA FINANCEIRA	BCO SAFRA SA	S&P	AAA	15.263,85
LETRA FINANCEIRA	BCO SAFRA SA	S&P	AAA	89.675,13
LETRA FINANCEIRA	BCO SAFRA SA	S&P	AAA	24.761,11
LETRA FINANCEIRA	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	S&P	AAA	13.584,09
LETRA FINANCEIRA	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	S&P	AAA	310.157,91
LETRA FINANCEIRA	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	S&P	AAA	378.320,23
LETRA FINANCEIRA	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	S&P	AAA	567.480,35
LETRA FINANCEIRA	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	S&P	AAA	773.540,61
LETRA FINANCEIRA	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	S&P	AAA	567.480,35
LETRA FINANCEIRA	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	S&P	AAA	13.582,51
LETRA FINANCEIRA	BCO VOTORANTIM SA	S&P	AAA	26.005,76
LETRA FINANCEIRA	BCO VOTORANTIM SA	S&P	AAA	31.764,17
LETRA FINANCEIRA	CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	MOODY'S	AAA	217.684,83
NOTA COMERCIAL ESCRITURAL 1ª EMISSÃO SERIE ÚNICA	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA			37.989,46
<b>Total de Crédito Privado</b>				<b>8.287.364,16</b>

<b>Maiores Posições</b>	
<b>Contraparte</b>	<b>Valor (R\$)</b>
BCO BRADESCO SA	2.126.339,12
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	2.624.146,06
BANCO DO BRASIL SA	773.032,85
<b>Totalizando</b>	<b>5.523.518,03</b>



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA**

**6. CONCLUSÃO**

O objetivo desse relatório foi apresentar a metodologia de acompanhamento dos ativos investidos e instituições financeiras de acordo com os propósitos de gestão adotados no programa Pró-Gestão, especificamente no item 3.2.6 Relatório de Diligências do manual do programa. O INPREV faz mensalmente a análise de seus investimentos e acompanham as informações de mercado relacionadas as instituições financeiras que se relacionam diretamente com o Instituto. O Credenciamento é o momento em que se faz uma análise minuciosa das instituições e avaliam a situação patrimonial, fiscal, jurídica e comercial. O lastro dos ativos é realizado periodicamente ou sempre que houver necessidade.

**Quadro Resumo – Relatório de Diligências**

<b>INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</b>	<b>PATRIMONIAL</b>	<b>FISCAL</b>	<b>JURÍDICO</b>	<b>COMERCIAL</b>	<b>LASTRO ATIVOS</b>
BB DTVM	✓	✓	✓	✓	✓
CAIXA DTVM S.A.	✓	✓	✓	✓	✓
ITAÚ DTVM S.A.	✓	✓	✓	✓	✓
BRAM-BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A	✓	✓	✓	✓	✓
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS	✓	✓	✓	✓	✓
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S/A DTVM	✓	✓	✓	✓	✓
OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	✓	✓	✓	✓	✓
XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA	✓	✓	✓	✓	✓
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	✓	✓	✓	✓	✓
VINCII EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA	✓	✓	✓	✓	✓
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMANT BRASIL LTDA	✓	✓	✓	✓	✓
VINCI SOLUÇÃO DE INVESTIMENTOS LTDA	✓	✓	✓	✓	✓
VINCI GESTÃO DE RECURSOS LTDA	✓	✓	✓	✓	✓
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA	✓	✓	✓	✓	✓
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE RECURSOS LTDA	✓	✓	✓	✓	✓
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	✓	✓	✓	✓	✓



**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA**

Ressalta-se que o INPREV possui Estudo de ALM, que é mais uma ferramenta de apoio as decisões do Comitê de Investimentos do INPREV, o qual define as diretrizes de investimentos, com base na gestão integrada de ativos e passivos. O Instituto busca ainda reposicionar a carteira, em linha com o Estudo de ALM, de forma gradual ao longo do tempo, sem nenhum movimento brusco e imediato, que possa gerar eventual prejuízo ao INPREV.

Varginha(MG), 24/10/2023.

Paulo Alexandre Praxedes  
Diretor Financeiro  
CPA-20 ANBIMA