

IPM

(INVESTIMENTOS\_2023)

**LEMA** 

# APRESENTAÇÃO

Este relatório atende ao parágrafo terceiro do art. 101 da Portaria MTP nº 1.467 de 2022:

§ 3º No início de cada exercício, a unidade gestora deverá apresentar aos conselhos deliberativo e fiscal o relatório de acompanhamento da execução da política de investimentos relativo ao ano anterior.

Os dados aqui apresentados foram extraídos do Uno, sistema de gestão de investimentos utilizado pelo IPM.

## CARTEIRA CONSOLIDADA\_DEZ/2023

<b>ATIVO</b>	<b>SALDO</b>	<b>CARTEIRA(%)</b>	<b>RESG.</b>	<b>4.963</b>
TERRA NOVA IMA-B FIC RF	R\$ 1.362.968,30	1.11%	D+1464	D - RF
TERRA NOVA IMA-B II FIC RF	R\$ 1.236.660,78	1.01%	D+1464	D - RF
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 14.178.434,46	11.54%	D+1	7, I "b"
BB IRF-M 1+ FI RF PREVID	R\$ 428.357,71	0.35%	D+1	7, I "b"
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	R\$ 10.056.502,25	8.18%	D+0	7, I "b"
BB PERFIL FIC RF REF DI...	R\$ 8.102.463,94	6.59%	D+0	7, III "a"
INVEST DUNAS FIDC...	R\$ 358,17	0.00%	VR	7, V "a"
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	R\$ 5.541.437,18	4.51%	D+32	8, I
BB FATORIAL FIC AÇÕES	R\$ 5.677.161,54	4.62%	D+3	8, I
FONTAINE VILLE URBANISMO...	R\$ 5.990.872,69	4.88%	-	10, II
JT PREV DESENVOLVIMENTO...	R\$ 2.575.583,66	2.10%	-	11
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 67.722.879,45	55,12%	-	7, I "a"
<b>Total investimentos</b>	<b>R\$ 122.873.680,13</b>	<b>100.00%</b>		
Disponibilidade	R\$ 16.808,66	-		
<b>Total patrimônio</b>	<b>R\$ 122.890.488,79</b>	<b>100.00%</b>		





# CARTEIRA PREVIDENCIÁRIO\_DEZ/2023

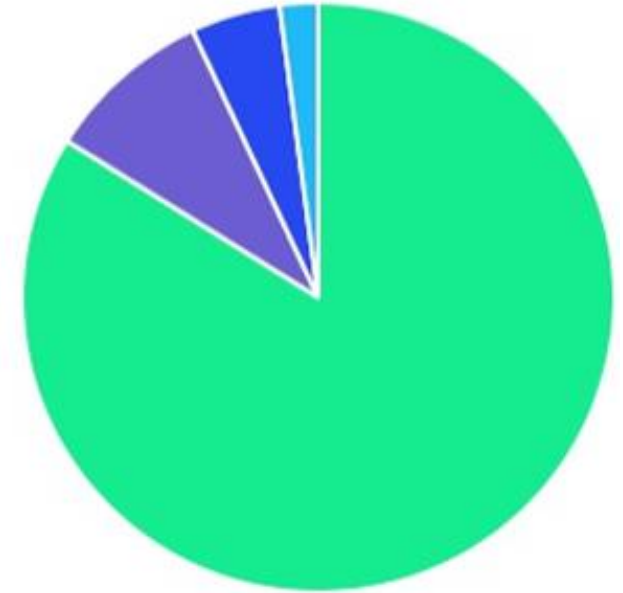
ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963
TERRA NOVA IMA-B FIC RF	R\$ 1.362.968,30	1.14%	D+1464	D - RF
TERRA NOVA IMA-B II FIC RF	R\$ 1.236.660,78	1.04%	D+1464	D - RF
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 11.173.212,30	9.36%	D+1	7, I "b"
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	R\$ 10.056.502,25	8.42%	D+0	7, I "b"
BB PERFIL FIC RF REF DI...	R\$ 8.091.939,89	6.78%	D+0	7, III "a"
INVEST DUNAS FIDC...	R\$ 358,17	0.00%	VR	7, V "a"
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	R\$ 5.541.437,18	4.64%	D+32	8, I
BB FATORIAL FIC AÇÕES	R\$ 5.677.161,54	4.75%	D+3	8, I
FONTAINE VILLE URBANISMO...	R\$ 5.990.872,69	5.02%	-	10, II
JT PREV DESENVOLVIMENTO...	R\$ 2.575.583,66	2.16%	-	11
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 67.722.879,45	56,70%	-	7, I "a"
<b>Total investimentos</b>	<b>R\$ 119.429.576,21</b>	<b>100.00%</b>		
Disponibilidade	R\$ 0,00	-		
<b>Total patrimônio</b>	<b>R\$ 119.429.576,21</b>	<b>100.00%</b>		

# CARTEIRA TX ADMINISTRAÇÃO\_DEZ/2023

<b>ATIVO</b>	<b>SALDO</b>	<b>CARTEIRA(%)</b>	<b>RESG.</b>	<b>4.963</b>
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 3.005.222,16	87.26%	D+1	7, I "b"
BB IRF-M 1+ FI RF PREVID	R\$ 428.357,71	12.44%	D+1	7, I "b"
BB PERFIL FIC RF REF DI...	R\$ 10.524,05	0.31%	D+0	7, III "a"
Total investimentos	R\$ 3.444.103,92	100.00%		
Disponibilidade	R\$ 16.808,66	-		
<b>Total patrimônio</b>	<b>R\$ 3.460.912,58</b>	<b>100.00%</b>		

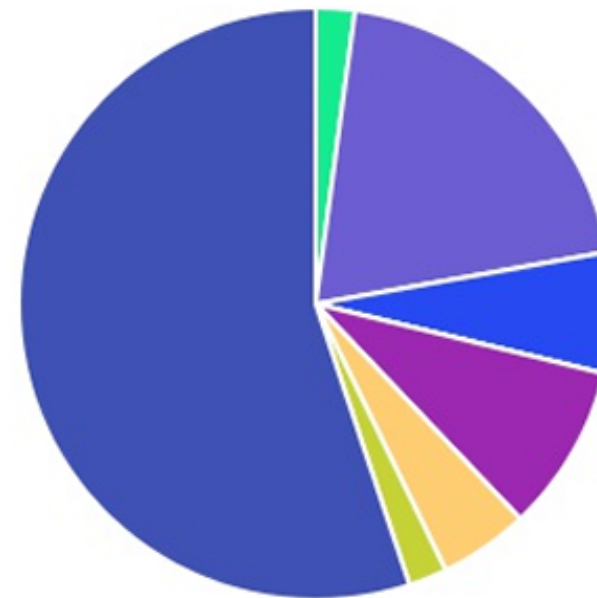
# DISTRIBUIÇÃO\_CLASSE

CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	<u>83,90%</u>	R\$ 103.088.625,06	
Renda Variável	<u>9,13%</u>	R\$ 11.218.598,72	
Estruturados	<u>4,88%</u>	R\$ 5.990.872,69	
Fundos Imobiliários	<u>2,10%</u>	R\$ 2.575.583,66	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 122.873.680,13</b>	











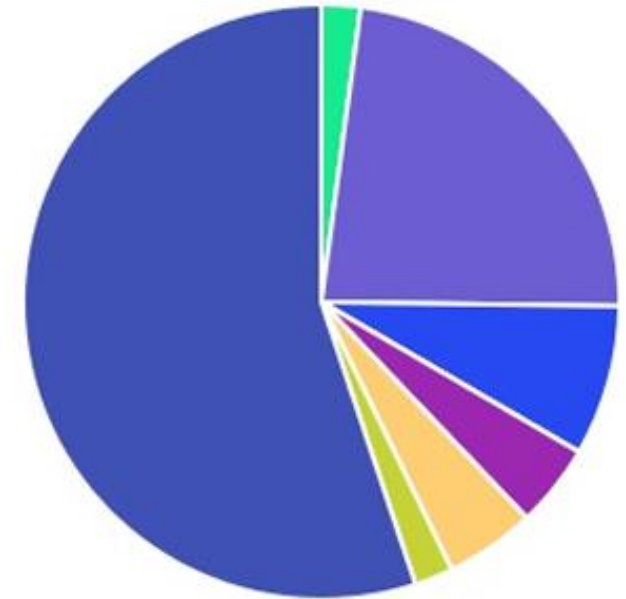
# DISTRIBUIÇÃO\_ENQUADRAMENTO

ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	55,12%	R\$ 67.722.879,45	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	20,07%	R\$ 24.663.294,42	
Artigo 8º, Inciso I	9,13%	R\$ 11.218.598,72	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	6,59%	R\$ 8.102.463,94	
Artigo 10º, Inciso II	4,88%	R\$ 5.990.872,69	
Desenquadrado - RF	2,12%	R\$ 2.599.629,08	
Artigo 11º	2,10%	R\$ 2.575.583,66	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	0,00%	R\$ 358,17	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 122.873.680,13</b>	



# DISTRIBUIÇÃO\_GESTOR

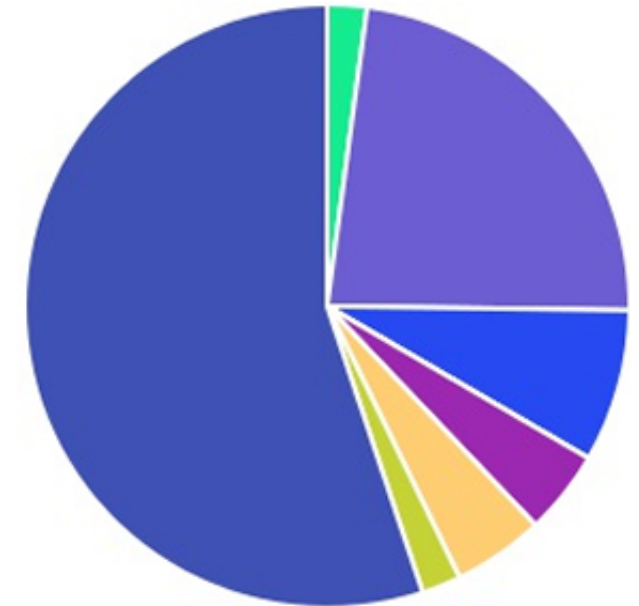
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
TÍTULOS	55,12%	R\$ 67.722.879,45	
BB GESTAO	23,10%	R\$ 28.386.417,65	
BANCO DO NORDESTE	8,18%	R\$ 10.056.502,25	
ARENA CAPITAL	4,88%	R\$ 5.990.872,69	
SUL AMÉRICA	4,51%	R\$ 5.541.437,18	
VCM GESTÃO	2,12%	R\$ 2.599.629,08	
PLANNER CORRETORA	2,10%	R\$ 2.575.583,66	
QLZ GESTÃO	0,00%	R\$ 358,17	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 122.873.680,13</b>	






# DISTRIBUIÇÃO\_ADMINISTRADOR

ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
TÍTULOS	55,12%	R\$ 67.722.879,45	
BB GESTAO	23,10%	R\$ 28.386.417,65	
S3 CACEIS	8,18%	R\$ 10.056.502,25	
MDL TRUST	4,88%	R\$ 5.990.872,69	
BEM - DISTRIBUIDORA	4,51%	R\$ 5.541.437,18	
RJI CORRETORA	2,12%	R\$ 2.599.629,08	
PLANNER CORRETORA	2,10%	R\$ 2.575.583,66	
SINGULARE CORRETORA	0,00%	R\$ 358,17	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 122.873.680,13</b>	



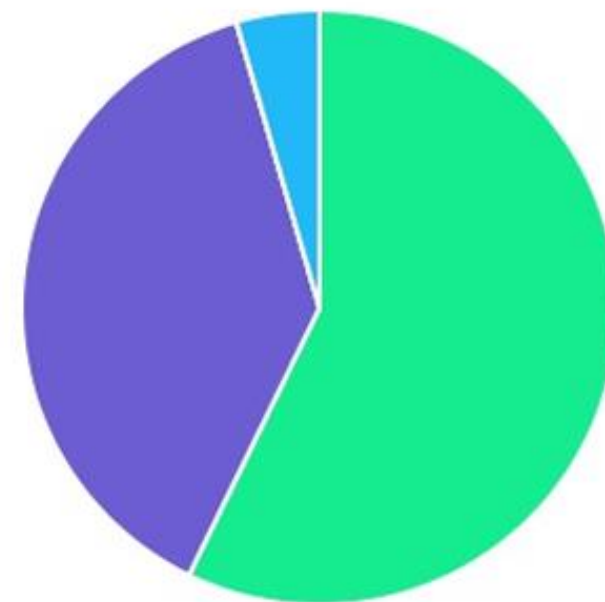
# DISTRIBUIÇÃO\_BENCHMARK

BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
TÍTULOS	55,12%	R\$ 67.722.879,45	
<u>CDI</u>	19,65%	R\$ 24.150.197,05	
IRF-M	11,54%	R\$ 14.178.434,46	
IBOVESPA	9,13%	R\$ 11.218.598,72	
IMA-B	2,12%	R\$ 2.599.629,08	
IPCA	2,10%	R\$ 2.575.583,66	
IRF-M 1+	0,35%	R\$ 428.357,71	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 122.873.680,13</b>	



# DISTRIBUIÇÃO\_LIQUIDEZ

LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Acima 2 anos	57,23%	R\$ 70.322.508,53	
0 a 30 dias	38,26%	R\$ 47.009.376,25	
31 a 180 dias (vide regulamento)	4,51%	R\$ 5.541.437,18	
(vide regulamento)	0,00%	R\$ 358,17	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 122.873.680,13</b>	



# DISTRIBUIÇÃO\_TÍTULOS PÚBLICOS

TÍTULO	VENC.	COMPRA	QTD.	P.U.		MARCAÇÃO	VALOR COMPRA	VALOR ATUAL
				COMPRA	ATUAL			
NTN-F 2033	01/01/33	26/08/22	14426	894,17	936,09	CURVA 12,20%	R\$ 12.899.361,11	R\$ 13.504.095,01
<u>NTN-B 2045</u>	15/05/45	<u>26/08/22</u>	7358	4.090,26	4.271,18	<u>CURVA</u> <u>5,90%</u>	R\$ 30.096.155,42	R\$ 31.427.345,40
NTN-F 2029	01/01/29	12/12/22	2155	928,37	947,73	CURVA 12,96%	R\$ 2.000.626,59	R\$ 2.042.358,57
NTN-F 2029	01/01/29	12/12/22	10773	928,37	947,73	CURVA 12,96%	R\$ 10.001.276,22	R\$ 10.209.897,41
<u>NTN-B 2045</u>	15/05/45	<u>12/12/22</u>	2555	3.915,28	4.124,92	<u>CURVA</u> <u>6,20%</u>	R\$ 10.003.549,87	R\$ 10.539.183,06
Total Públicos							R\$ 65.000.969,21	R\$ 67.722.879,45
Total Privados							R\$ 0,00	R\$ 0,00
<b>Total Global</b>							<b>R\$ 65.000.969,21</b>	<b>R\$ 67.722.879,45</b>

# ENQUADRAMENTOS

Tipo de Ativo	Carteira Atual (R\$)	Carteira Atual (%)	Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)
Títulos Tesouro Nacional – SELIC - Art. 7º, I, “a”.	R\$ 67.722.879,45	55,12%	10,00%	30,00%	80,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	R\$ 24.663.294,42	20,07%	10,00%	30,00%	50,00%
FI Renda Fixa - Art. 7º, III, “a”	R\$ 8.102.463,94	6,59%	5,00%	15,00%	50,00%
Ativos Bancários – Art. 7,II, “a”	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) – sênior – Art. 7, V, “a”	R\$ 358,17	0,01%	0,00%	1,00%	5,00%
FI Renda Fixa “Crédito Privado” – Art. 7º, V, “b”	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%
FI Ações – Art. 8º, I	R\$ 11.218.598,72	9,13%	0,00%	5,00%	20,00%
FI Ações – BDR Nível 1 – Art. 9º, III	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%
FI Multimercado – aberto – Art. 10º, I	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%
FI em Participações – Art. 10º, II	R\$ 5.990.872,69	4,88%	0,00%	5,00%	5,00%
FI Imobiliário – Art. 11	R\$ 2.575.583,66	2,10%	0,00%	2,00%	5,00%
<b>Total Geral</b>	<b>R\$ 122.873.680,13</b>	<b>100,00%</b>	<b>25,00%</b>	<b>100,00%</b>	

# MOVIMENTAÇÕES\_2023

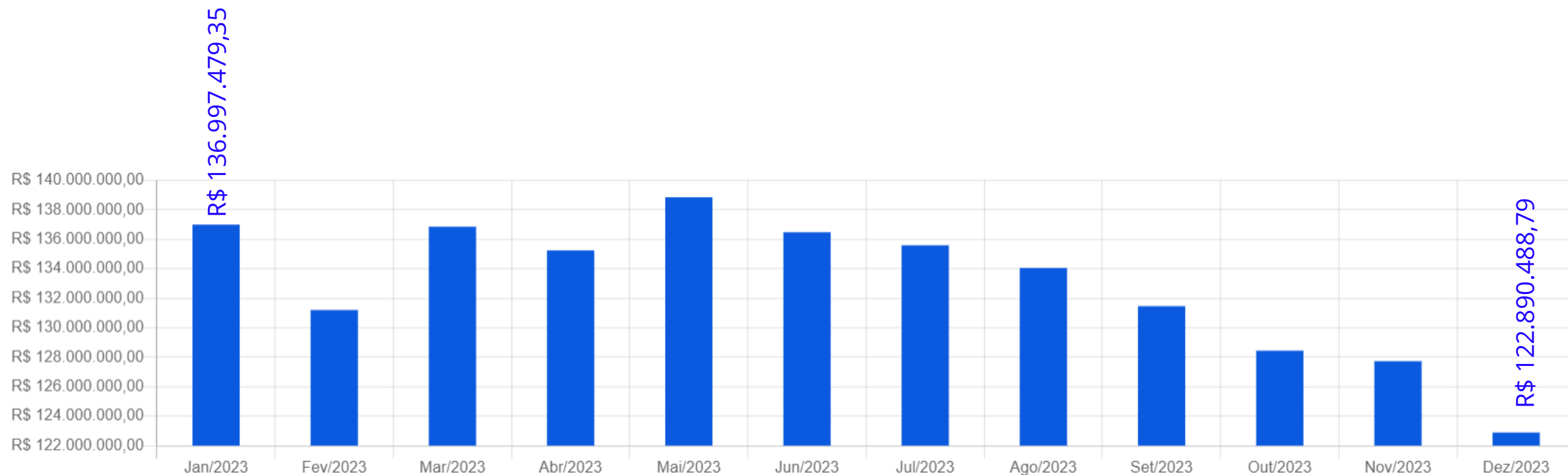
PERÍODO	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO FINAL
JANEIRO	R\$ 2.065.411,63	R\$ 25.047,50	R\$ 136.997.479,35
FEVEREIRO	R\$ 1.110.642,54	R\$ 8.549.186,76	R\$ 131.202.654,91
MARÇO	R\$ 6.698.977,80	R\$ 829.696,44	R\$ 136.857.203,11
ABRIL	R\$ 4.529.740,64	R\$ 6.768.476,97	R\$ 135.246.274,06
MAIO	R\$ 9.700.292,30	R\$ 6.448.736,23	R\$ 138.855.260,97
JUNHO	R\$ 18.453.186,83	R\$ 22.581.011,51	R\$ 136.480.406,54
JULHO	R\$ 8.193.822,93	R\$ 9.084.598,68	R\$ 135.593.450,50
AGOSTO	R\$ 5.626.872,28	R\$ 7.546.868,40	R\$ 134.055.497,15
SETEMBRO	R\$ 27.981.139,61	R\$ 32.736.478,77	R\$ 131.463.072,61
OUTUBRO	R\$ 5.716.159,30	R\$ 7.039.267,14	R\$ 128.443.987,35
NOVEMBRO	R\$ 7.858.840,42	R\$ 9.939.827,71	R\$ 127.729.128,32
DEZEMBRO	R\$ 15.367.495,98	R\$ 21.202.094,28	R\$ 122.890.488,79

# RENTABILIDADES\_2023

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2023			IPCA + 4.81% a.a.			
Janeiro	R\$ 134.391.521,09	R\$ 136.997.479,35	0,92%	R\$ 1.892.359,81	1,37%	0,44p.p.
Fevereiro	R\$ 136.997.479,35	R\$ 131.202.654,91	1,23%	R\$ 135.603,82	0,11%	-1,12p.p.
Março	R\$ 131.202.654,91	R\$ 136.857.203,11	1,10%	R\$ 882.204,99	0,63%	-0,47p.p.
Abril	R\$ 136.857.203,11	R\$ 135.246.274,06	1,00%	R\$ 1.046.758,63	0,82%	-0,18p.p.
Maió	R\$ 135.246.274,06	R\$ 138.855.260,97	0,62%	R\$ 1.560.423,73	1,18%	0,56p.p.
Junho	R\$ 138.855.260,97	R\$ 136.480.406,54	0,31%	R\$ 1.686.243,92	1,29%	0,98p.p.
Julho	R\$ 136.480.406,54	R\$ 135.593.450,50	0,51%	R\$ 70.503,27	0,19%	-0,32p.p.
Agosto	R\$ 135.593.450,50	R\$ 134.055.497,15	0,62%	R\$ 368.495,79	0,32%	-0,30p.p.
Setembro	R\$ 134.055.497,15	R\$ 131.463.072,61	0,65%	R\$ 399.098,52	0,45%	-0,20p.p.
Outubro	R\$ 131.463.072,61	R\$ 128.443.987,35	0,63%	R\$ 33.585,49	0,13%	-0,50p.p.
Novembro	R\$ 128.443.987,35	R\$ 127.729.128,32	0,67%	R\$ 2.228.861,12	1,86%	1,19p.p.
Dezembro	R\$ 127.729.128,32	R\$ 122.890.488,79	0,95%	R\$ 1.387.944,80	1,29%	0,34p.p.
Total	R\$ 127.729.128,32	R\$ 122.890.488,79	9,65%	R\$ 11.692.083,90	10,07%	0,42p.p.

A rentabilidade de R\$ 11.692.083,90 corresponde a 9,51% do Patrimônio Líquido (PL) do IPM.

# EVOLUÇÃO PATRIMONIAL\_2023





# CONCLUSÃO

O IPM encerrou 2023 superando a meta atuarial em 0,42 p.p.

Os investimentos permaneceram aderentes aos limites impostos pela Política de Investimentos e pela Resolução CMN nº 4.963/2021.

A composição da carteira de investimentos do IPM respeita o seu perfil de risco considerado como conservador.

Os processos decisórios das aplicações dos recursos são sempre avaliados e aprovados pelo Comitê de Investimentos com o apoio da LEMA.

A análise dos riscos e a avaliação e acompanhamento do retorno dos investimentos foi realizada mensalmente através de relatórios específicos gerados pelo Uno e monitorados conjuntamente pelo Comitê de Investimentos e pela LEMA.

IPM

(INVESTIMENTOS\_2023)

**LEMA** 