

Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário do Município de Olinda - OLINDAPREV

133.610.305,02

Saldo

-R\$ 260.441,98

Rentabilidade

R\$ 130,91 Mi

Saldo Renda Fixa

0,00 Mi

Saldo Estruturados

R\$ 2,7 Mi

Saldo Renda Variável

0,00 Mi

Saldo Exterior

novembro

dezembro

Evolução Patrimonial

R\$ 132,92 Mi

novembro

R\$ 136,84 Mi

dezembro

Tipo de Ativo

Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b

83,18%

Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III, a

14,79%

Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I

2,02%

Fundos de Investimento em Direitos Creditórios (FIDC) - Cota Sênior - Art. 7º, V, a

0,01%

Carteira por Segmento

novembro

dezembro

Carteira Renda Fixa

Nome	Saldo Atual	% Participação na Carteira	% PL do Fundo	Classificação de Risco	Retorno mensal	Retorno anual
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	20.126.283,30	15,06%	11,66%	1	0,92%	10,57%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	17.046.268,27	12,76%	8,24%	2	-0,72%	7,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.748.870,96	12,54%	0,28%	2	0,92%	10,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.500.251,49	12,35%	0,22%	3	-0,71%	7,71%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.607.112,10	10,93%	0,10%	1	1,04%	11,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.471.562,07	9,33%	0,54%	2	-1,03%	8,23%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.002.786,36	6,74%	0,12%	3	-0,65%	8,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.232.504,98	5,41%	1,38%	3	-0,83%	
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.076.052,50	3,80%	0,13%	3	-0,08%	7,68%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	4.478.177,69	3,35%	0,19%	1	0,48%	10,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.578.342,81	2,68%	0,06%	2	0,91%	10,45%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1.195.315,75	0,89%	0,15%	2	-0,06%	8,87%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	684.945,04	0,51%	0,02%	3	-0,12%	8,47%
Total	128.748.473,32	96,36%				

Carteira por Segmento

novembro

dezembro

Carteira Renda Fixa

Nome	Saldo Atual	% Participação na Carteira	% PL do Fundo	Classificação de Risco	Retorno mensal	Retorno anual
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.135.974,44	0,85%	1,13%	3	-0,51%	9,07%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	677.052,50	0,51%	0,06%	2	0,98%	11,02%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	335.748,46	0,25%	0,21%	4	-1,19%	4,30%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL LP SÊNIOR 1	9.136,10	0,01%	12,10%	1	0,10%	
Total	2.157.911,50	1,62%				

Carteira Renda Variável

Nome	Saldo Atual	% Participação na Carteira	% PL do Fundo	Retorno mensal	Retorno anual	Classificação de Risco
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.359.471,43	1,02%	0,33%	-11,45%	-4,95%	5
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	606.639,12	0,45%	0,03%	-8,52%	3,30%	5
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	445.859,66	0,33%	0,19%	-11,77%	-3,46%	5
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	291.950,00	0,22%	0,03%	-3,00%	-1,02%	4
Total	2.703.920,21	2,02%				

Carteira por Segmento

novembro

dezembro

Carteira Renda Fixa

Nome	Gestor	Administrador	Taxa de Administração	Índice de Referência	Taxa de Performance	Prazo de Liquidação	Enquadramento Res CMN 4.963/2021
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	Banco do Nordeste	SANTANDER SECURITIES SERVICES BRASIL DTVM S.A	0,50%	CDI	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III, a
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	Banco do Brasil	0,30%	IPCA	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	Banco do Brasil	0,30%	IPCA	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	Banco do Brasil	0,20%	IDKa IPCA 2 anos	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	Banco do Brasil	0,10%	IRF-M 1	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	Banco do Brasil	0,20%	IPCA+	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	Banco do Brasil	0,20%	IPCA + 5 a.a	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Caixa DTVM	Caixa Econômica Federal	0,20%	CDI	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III, a
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Caixa DTVM	Caixa Econômica Federal	0,20%	IDKa IPCA 2 anos	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b

Carteira por Segmento

novembro

dezembro

Carteira Renda Fixa

Nome	Gestor	Administrador	Taxa de Administração	Índice de Referência	Taxa de Performance	Prazo de Liquidação	Enquadramento Res CMN 4.963/2021
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa DTVM	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	Itaú Unibanco S. A.	Itaú Unibanco S. A.	0,18%	IDkA IPCA 2 anos	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	Itaú Unibanco S. A.	Itaú Unibanco S. A.	0,18%	IMA-B 5+	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	Itaú Unibanco S. A.	Itaú Unibanco S. A.	0,50%	CDI	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	Itaú Unibanco S. A.	Itaú Unibanco S. A.	0,40%	IPCA	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	Itaú Unibanco S. A.	Itaú Unibanco S. A.	0,50%	CDI	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III, a
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	Itaú Unibanco S. A.	Itaú Unibanco S. A.	0,18%	IRF-M 1	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL LP SÊNIOR 1	SINGULARE CTVM S.A	SINGULARE CTVM S.A	0,30%	CDI	Não possui	Longo Prazo (+ de 1 ano)	Fundos de Investimento em Direitos Creditórios (FIDC) - Cota Sênior - Art. 7º, V, a

Carteira por Segmento

novembro

dezembro

Carteira Renda Variável

Nome	Gestor	Administrador	Taxa de Administração	Índice de Referência	Taxa de Performance	Prazo de Liquidação	Enquadramento Res CMN 4.963/2021
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	BB DTVM	Banco do Brasil	2,00%	Ibovespa	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	Itaú Unibanco S. A.	Itaú Unibanco S. A.	1,90%	Ibovespa	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	Itaú Unibanco S. A.	Itaú Unibanco S. A.	2,00%	Ibovespa	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	Itaú Unibanco S. A.	Itaú Unibanco S. A.	2,50%	Ibovespa	Não possui	Curto Prazo (Até 1 ano)	Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I

CONSULTORIA EMPRESARIAL

Carteira - Gestores e Administradores

novembro

dezembro

Administradores

Administrador	Saldo Atual	% Participação na Carteira	Volume Aplicado x Volume Administrador	Volume com RPPS x Volume sob Administração
Itaú Unibanco S. A.	58.065.325,75	43,46%	0,01%	0,00%
Caixa Econômica Federal	47.856.234,54	35,82%	0,02%	11,73%
Banco do Brasil	27.002.556,12	20,21%	0,00%	5,36%
SANTANDER SECURITIES SERVICES BRASIL DTVM S.A	677.052,50	0,51%	0,00%	0,87%
SINGULARE CTVM S.A	9.136,10	0,01%		
Total	133.610.305,02	100,00%		

Gestores

Gestor	Saldo Atual	% Participação na Carteira	Volume Aplicado x Volume sob Gestão
Itaú Unibanco S. A.	58.065.325,75	43,46%	0,01%
Caixa DTVM	47.856.234,54	35,82%	0,02%
BB DTVM	27.002.556,12	20,21%	0,00%
Banco do Nordeste	677.052,50	0,51%	0,02%
SINGULARE CTVM S.A	9.136,10	0,01%	0,00%
Total	133.610.305,02	100,00%	

Credenciamento de Instituições

Credenciamento Administradores

Instituições Credenciadas	Tipo de Instituição	A instituição atende ao previsto nos incisos I e II do § 2º art. 21 da Resolução CMN nº 4.963/2021?	Data do Credenciamento	Data de Validade
BB DTVM	ADMINISTRADOR	SIM	01/01/22	31/12/23
Caixa DTVM	ADMINISTRADOR	SIM	01/01/22	31/12/23
Itaú Unibanco S. A.	ADMINISTRADOR	SIM	01/02/22	31/01/24
SINGULARE CTVM S.A	ADMINISTRADOR	SIM	01/02/22	31/01/24

Credenciamento Gestores

Instituições Credenciadas	Tipo de Instituição	A instituição atende ao previsto nos incisos I e II do § 2º art. 21 da Resolução CMN nº 4.963/2021?	Data do Credenciamento	Data de Validade
Banco do Nordeste do Brasil	GESTOR	SIM	18/03/22	17/03/24
BB DTVM	GESTOR	SIM	01/01/22	31/12/23
Caixa DTVM	GESTOR	SIM	01/01/22	31/12/23
Itaú Unibanco S. A.	GESTOR	SIM	01/02/22	31/01/24
SINGULARE CTVM S.A	GESTOR	SIM	01/02/22	31/01/24

Rating de Gestão

novembro

dezembro

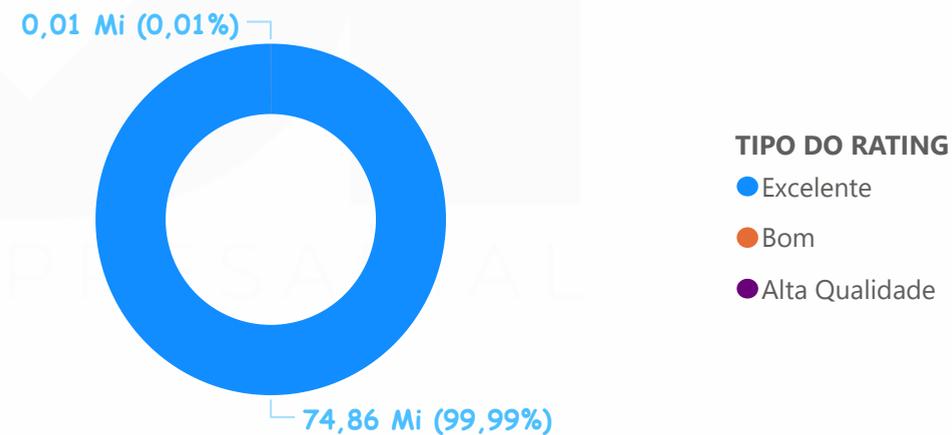
Gestores

GRUPO ECONÔMICO	AGÊNCIA DE RATING	NOTA	TIPO DO RATING	DATA	VENCIMENTO DO RATING	Saldo Atual
SINGULARE CTVM S.A	Austing Rating	QG3	Bom	20/10/2020	31/10/2021	9.136,10
CAIXA ECONÔMICA	Fitch Ratings	Excelente	Excelente	09/12/2022	09/12/2023	47.856.234,54
ITAÚ	Fitch Ratings	Excelente	Excelente	26/10/2021	26/10/2022	0,00
BANCO DO NORDESTE	Moody's	AAbr	Alta Qualidade	01/05/2022	01/05/2023	0,00
BANCO DO BRASIL	Moody's	MQ1	Excelente	16/05/2022	16/05/2023	27.002.556,12

Distribuição por Rating



Distribuição por Rating Ex-Tesouro Nacional



Carteira por Artigo da Resolução CMN 4.963/2021

novembro

dezembro

Artigo da Resolução CMN 4.963/2021

Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b

Fundos de Investimento em Direitos Creditórios (FIDC) - Cota Sênior - Art. 7º, V, a

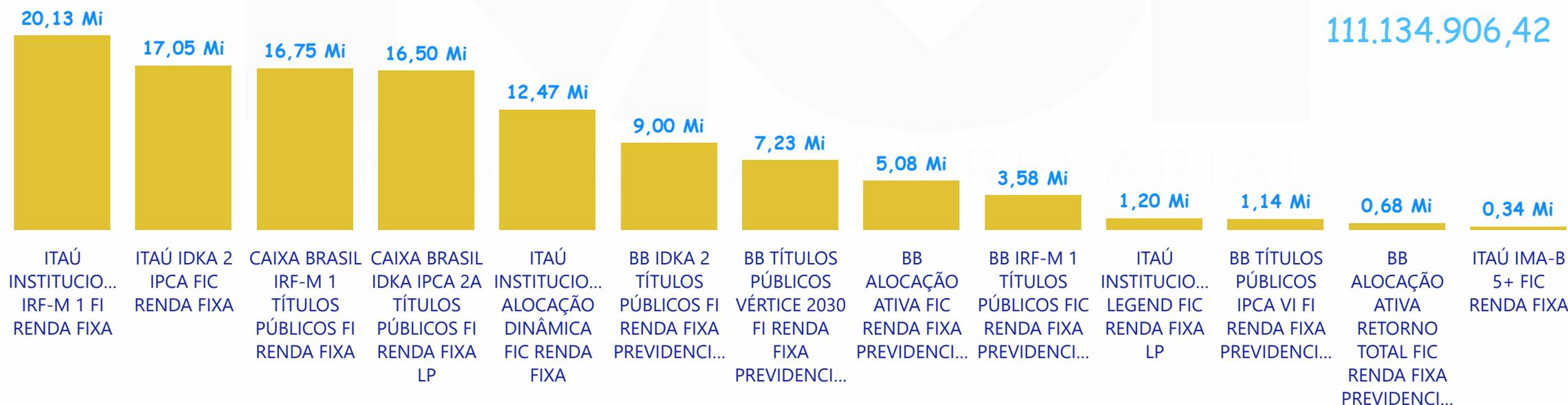
Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I

Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III, a

Carteira

Saldo Total/Segmento

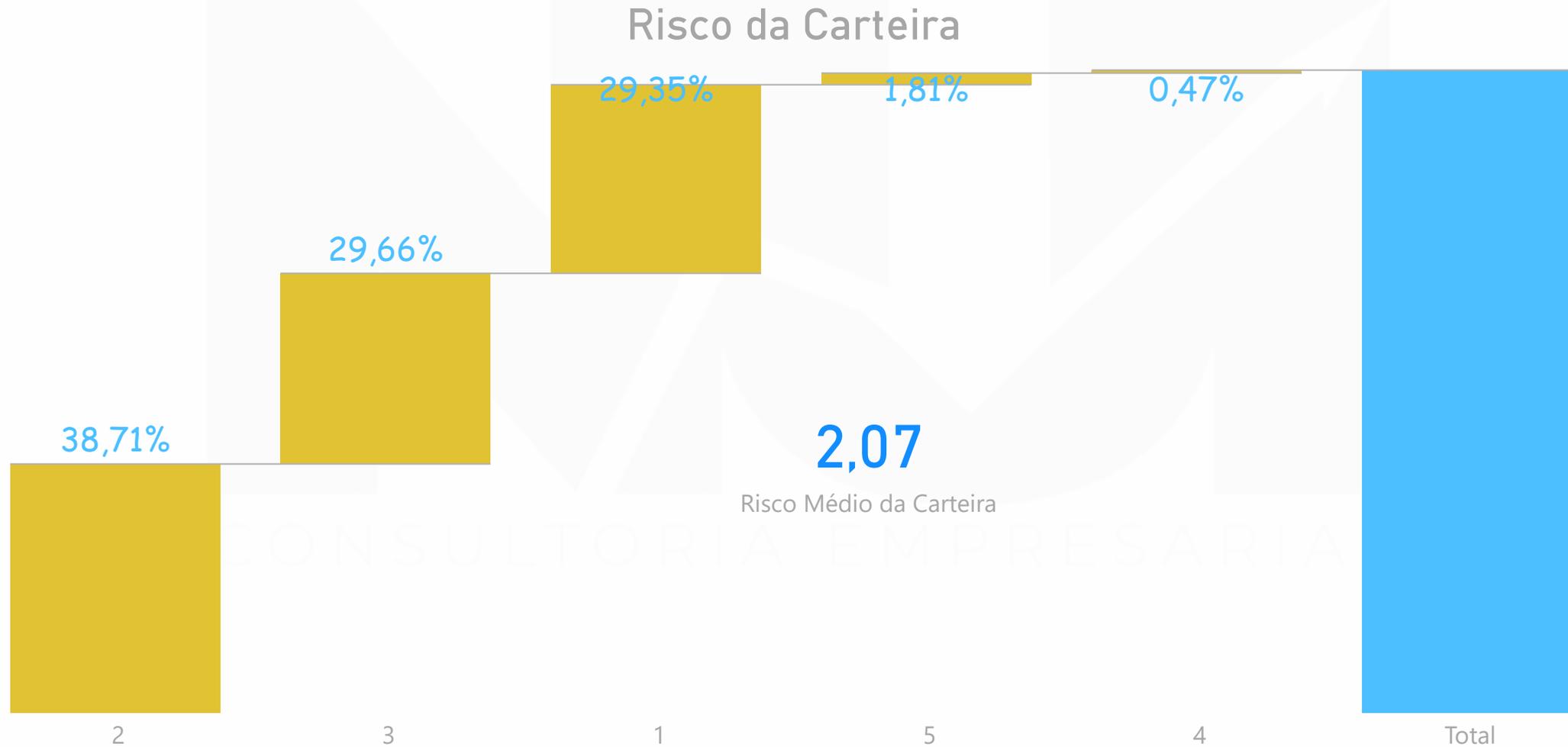
111.134.906,42



Carteira - Risco (Volatilidade)

novembro

dezembro

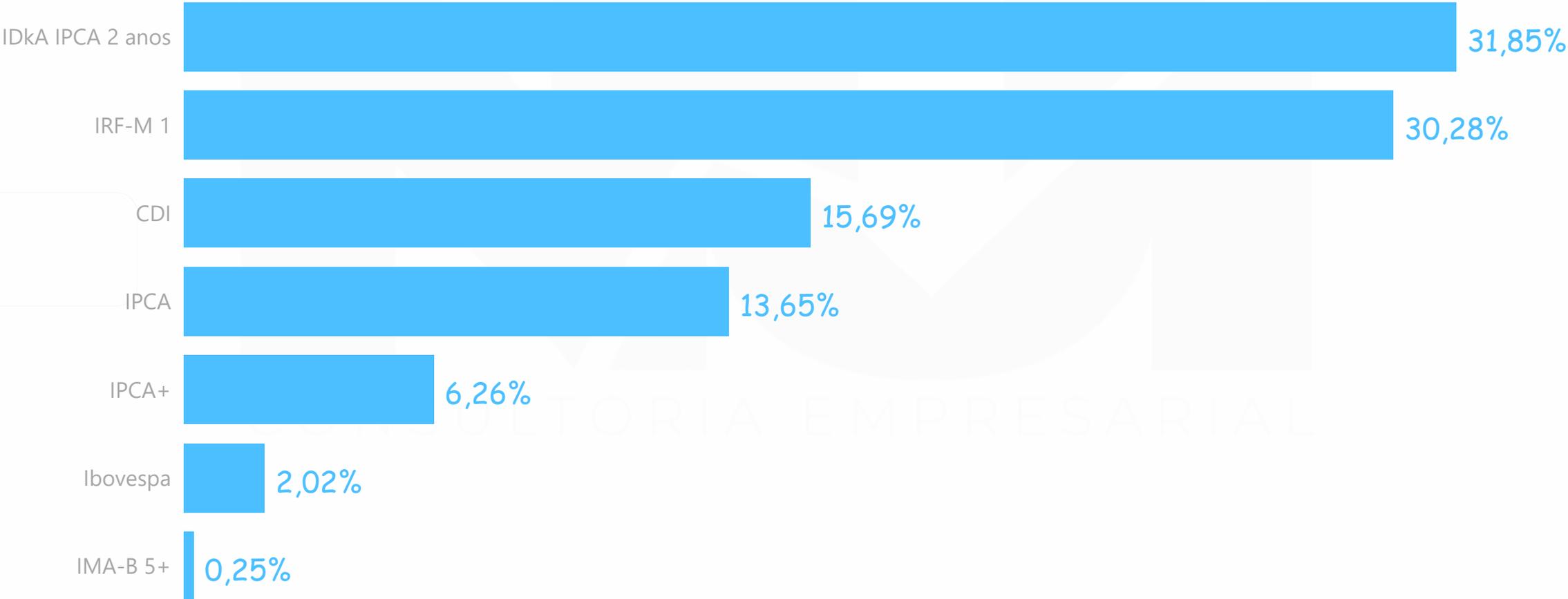


Carteira por Índices

novembro

dezembro

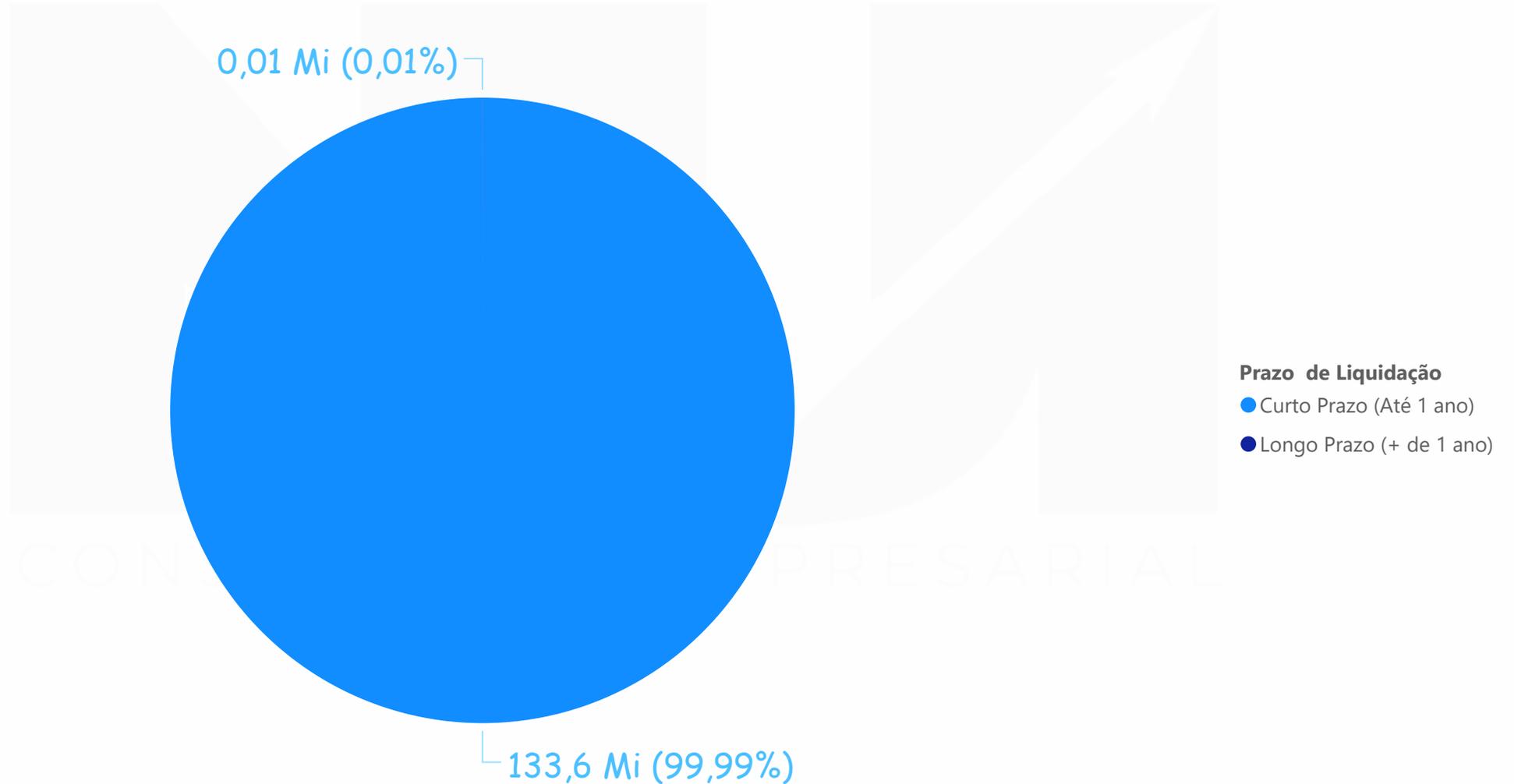
% Participação na Carteira por Grupo de Benchmark



Carteira - Prazo de Liquidação

novembro

dezembro



Política de Investimentos

novembro

dezembro

Política de Investimentos - Renda Fixa

Artigo da Resolução CMN 4.963/2021	Carteira Atual	Saldo Atual	Limite Inferior	Estratégia Alvo	Limite da Resolução (Superior)	Segmento
Fundos de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC - Art. 7º, I, b	83,18%	111.134.906,42	0,00%	55,00%	100,00%	Renda Fixa
Fundos de Investimento em Renda Fixa - Geral - Art. 7º, III, a	14,79%	19.762.342,29	0,00%	15,00%	60,00%	Renda Fixa
Fundos de Investimento em Direitos Creditórios (FIDC) - Cota Sênior - Art. 7º, V, a	0,01%	9.136,10	0,00%	1,00%	5,00%	Renda Fixa
Ativos financeiros de renda fixa de emissão com obrigação ou coobrigação de instituições financeiras (Lista BACEN) Art. 7º, IV	0,00%	0,00	0,00%	3,00%	20,00%	Renda Fixa
Fundos de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado - Art. 7º, V, b	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	5,00%	Renda Fixa
Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Art. 7º, I, "a"	0,00%	0,00	0,00%	5,00%	100,00%	Renda Fixa

Política de Investimentos - Renda Variável

Artigo da Resolução CMN 4.963/2021	Carteira Atual	Saldo Atual	Limite Inferior	Estratégia Alvo	Limite da Resolução (Superior)	Segmento
Fundos de Investimento em Ações - Art. 8º, I	2,02%	2.703.920,21	0,00%	5,00%	30,00%	Renda Variável
ETF RV CVM Art. 8º, II	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	30,00%	Renda Variável

Política de Investimentos

novembro

dezembro

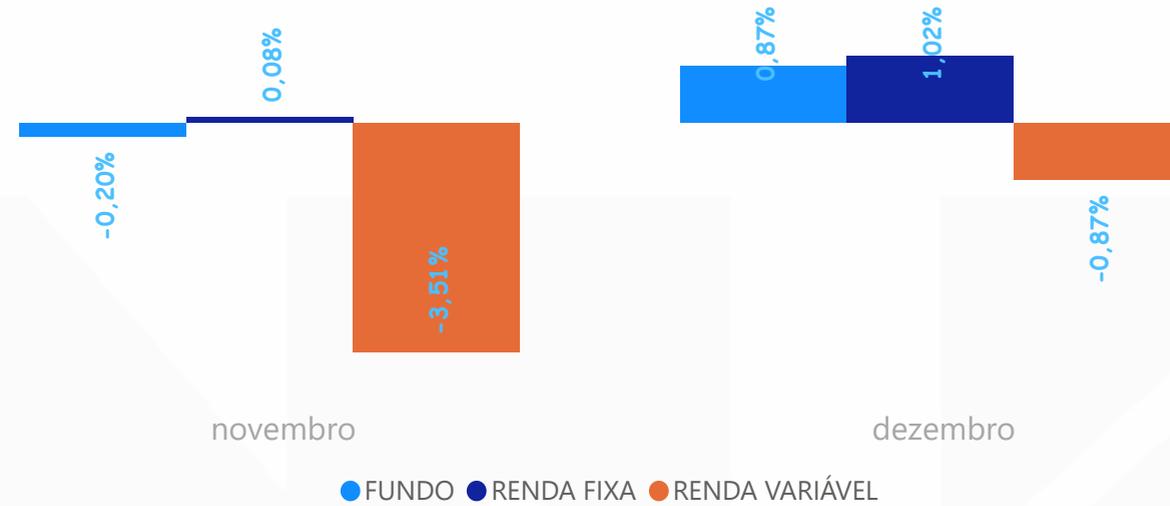
Política de Investimentos - Fundos Estruturados

Artigo da Resolução CMN 4.963/2021	Carteira Atual	Saldo Atual	Limite Inferior	Estratégia Alvo	Limite da Resolução (Superior)	Segmento
FI em Participações Art. 10, II	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	5,00%	Fundos Estruturados
Fundos de Investimento Multimercado (FIM) - Art. 10, I	0,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	Fundos Estruturados

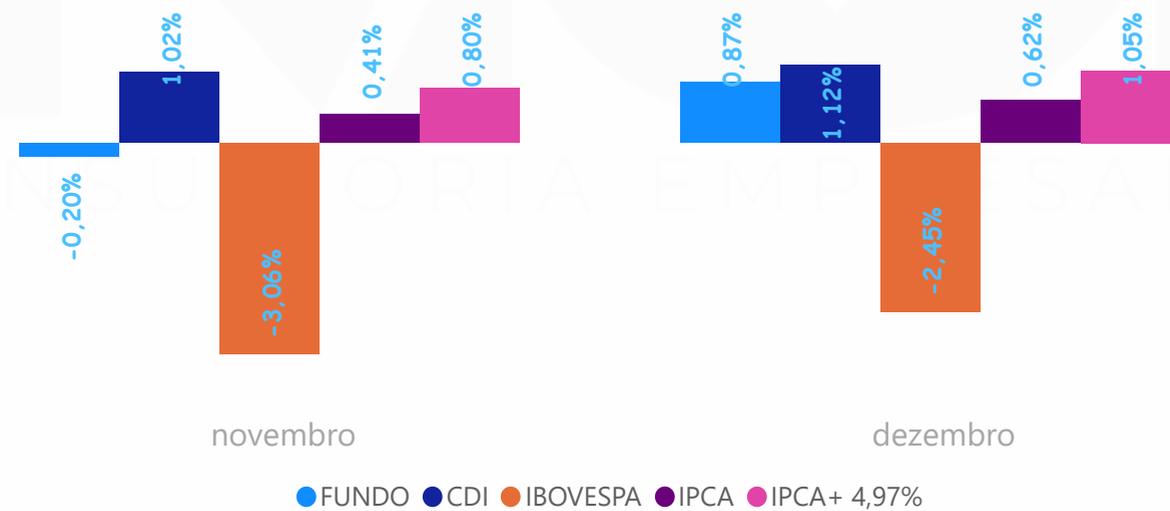
Política de Investimentos - Fundos Exterior

Artigo da Resolução CMN 4.963/2021	Carteira Atual	Saldo Atual	Limite Inferior	Estratégia Alvo	Limite da Resolução (Superior)	Segmento
FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa Art. 9º,I	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	10,00%	Exterior
Fundos de Investimento - Investimento no Exterior - Art. 9º, II	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	10,00%	Exterior
Fundos de Investimento em Ações - BDR Nível I - Art. 9º, III	0,00%	0,00	0,00%	4,00%	10,00%	Exterior

Rentabilidade Mensal por Segmento



Rentabilidade Mensal Índices



novembro

dezembro

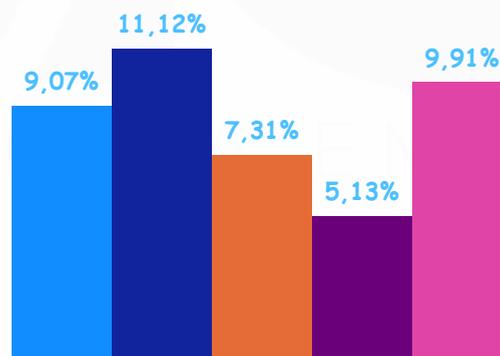
Rentabilidade Acumulada da Carteira

9,07%



novembro

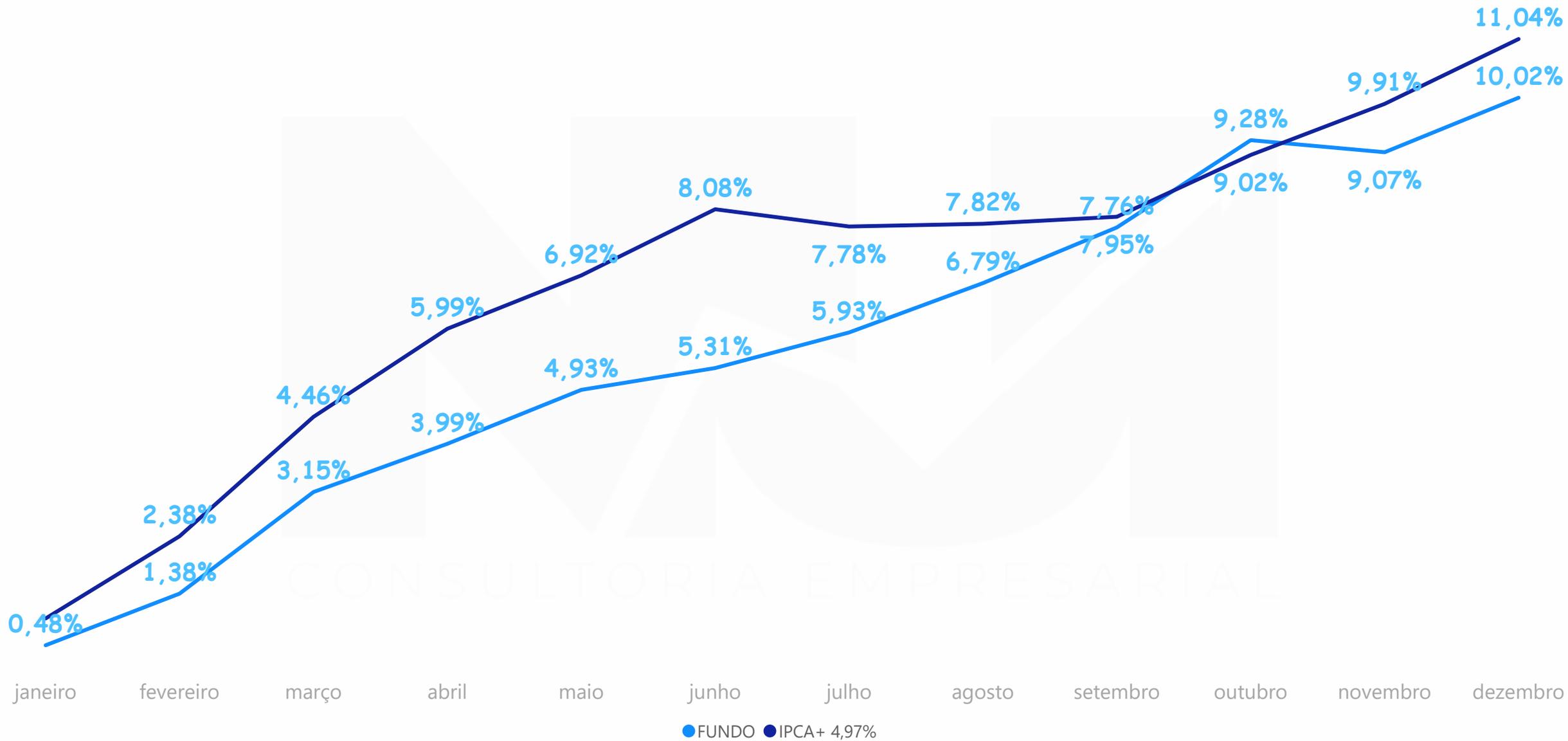
Rentabilidade Acumulada Índices



novembro

● FUNDO ● CDI ● IBOVESPA ● IPCA ● IPCA+ 4,97%

Fundo x Meta Atuarial - Acumulado



Estatísticas da Carteira

Carteira Renda Fixa

Fundo	Índice	Retorno Médio Mensal	Retorno Médio Anual	Desde o Início	Número de Retorno Positivo no Ano	Número de Retorno Negativo no Ano	Número de Retorno Positivo 24 Meses	Número de Retorno negativo 24 Meses
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	Ibovespa	0,16%	0,16%	51,00%	13	9	264	240
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IPCA	0,03%	0,03%	17,95%	12	10	280	224
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IDkA IPCA 2 anos	0,06%	0,06%	235,51%	15	7	297	207
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IRF-M 1	0,05%	0,05%	215,82%	19	3	412	92
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IPCA+	0,06%	0,06%	179,67%	17	5	323	181
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IPCA+	0,01%	0,01%	0,71%	12	10		
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	CDI	0,05%	0,05%	525,65%	22	0	487	17
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CDI	0,05%	0,05%	345,50%	22	0	497	7
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IDkA IPCA 2 anos	0,06%	0,06%	177,43%	15	7	288	216
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IRF-M 1	0,05%	0,05%	203,22%	20	2	414	89
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	Ibovespa	0,12%	0,12%	122,61%	13	9	257	247
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	IDkA IPCA 2 anos	0,06%	0,06%	31,42%	15	7	289	215
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	IMA-B 5+	-0,06%	-0,06%	172,47%	12	10	252	252
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	CDI	0,03%	0,03%	46,02%	12	10	345	159

Estatísticas da Carteira

Carteira Renda Fixa

Fundo	Índice	% do CDI no ano	% do CDI desde o Início	Volatilidade no ano	Volatilidade desde o Início	VaR Histórico no mês	VaR Histórico 12 meses
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	Ibovespa	297,06%	138,59%	20,97%	25,93%	9,96%	9,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IPCA	57,66%	85,89%	3,04%	3,79%	1,44%	1,13%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IDkA IPCA 2 anos	127,86%	135,96%	2,43%	2,70%	1,15%	1,34%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IRF-M 1	94,09%	101,89%	0,54%	0,56%	0,26%	0,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IPCA+	122,99%	160,78%	1,95%	5,58%	0,93%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IPCA+	24,98%	8,59%	6,42%	6,97%	3,05%	
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	CDI	99,13%	93,60%	0,03%	0,29%	0,01%	0,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CDI	97,41%	96,91%	0,04%	0,22%	0,02%	0,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IDkA IPCA 2 anos	125,42%	127,04%	2,51%	2,75%	1,19%	1,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IRF-M 1	99,81%	101,66%	0,51%	0,52%	0,24%	0,21%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	Ibovespa	215,21%	214,27%	21,67%	24,57%	10,29%	9,75%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	IDkA IPCA 2 anos	125,58%	123,57%	2,54%	3,21%	1,21%	1,41%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	IMA-B 5+	-113,73 %	117,02%	9,79%	11,87%	4,65%	4,11%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	CDI	52,51%	139,89%	2,36%	1,79%	1,12%	0,82%

Estatísticas da Carteira

Carteira Renda Fixa

Fundo	Índice	Retorno Médio Mensal	Retorno Médio Anual	Desde o Início	Número de Retorno Positivo no Ano	Número de Retorno Negativo no Ano	Número de Retorno Positivo 24 Meses	Número de Retorno negativo 24 Meses	Volatilidade desde o Início
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	CDI	0,03%	0,03%	46,02%	12	10	345	159	1,79%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	IPCA	0,02%	0,02%	104,20%	12	10	393	111	3,16%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	CDI	0,05%	0,05%	26,41%	20	2	395	109	0,85%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	IRF-M 1	0,05%	0,05%	292,36%	19	3	416	88	0,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	Ibovespa	0,20%	0,20%	79,95%	14	8	253	251	23,79%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	Ibovespa	0,19%	0,19%	72,38%	14	8	254	250	24,76%

Estatísticas da Carteira

Carteira Renda Fixa

Fundo	Índice	% do CDI no ano	% do CDI desde o Início	Volatilidade no ano	Volatilidade desde o Início	VaR Histórico no mês	VaR Histórico 12 meses
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	CDI	52,51%	139,89%	2,36%	1,79%	1,12%	0,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	IPCA	44,68%	121,01%	4,69%	3,16%	2,23%	1,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	CDI	91,99%	113,99%	0,49%	0,85%	0,23%	0,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	IRF-M 1	95,74%	100,47%	0,52%	0,47%	0,25%	0,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	Ibovespa	377,30%	58,71%	22,94%	23,79%	10,89%	11,05%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	Ibovespa	363,92%	122,07%	23,05%	24,76%	10,95%	10,90%

CONSULTORIA EMPRESARIAL

Carteira por Segmento

novembro

dezembro

Movimentações Renda Fixa - Fundo Capitalizado

Fundo	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	RENDIMENTOS	SALDO ATUAL
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 5.080.343,71	R\$ 0	R\$ 0	-R\$ 4.291,21	R\$ 5.076.052,5
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 685.733,63	R\$ 0	R\$ 0	-R\$ 788,59	R\$ 684.945,04
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 9.062.006,08	R\$ 0	R\$ 0	-R\$ 59.219,72	R\$ 9.002.786,36
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 3.545.927,02	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 32.415,79	R\$ 3.578.342,81
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 1.141.826,62	R\$ 0	R\$ 0	-R\$ 5.852,18	R\$ 1.135.974,44
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 7.292.930,49	R\$ 0	R\$ 0	-R\$ 60.425,51	R\$ 7.232.504,98
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	R\$ 670.463,1	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 6.589,4	R\$ 677.052,5
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	R\$ 10.329.690,96	R\$ 371.799,84	R\$ 10.000.000	R\$ 78.964,56	R\$ 780.455,36
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	R\$ 14.457.033,44	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 150.078,66	R\$ 14.607.112,1
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	R\$ 16.617.452,44	R\$ 0	R\$ 0	-R\$ 117.200,97	R\$ 16.500.251,47
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	R\$ 75,24	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0,7	R\$ 75,94
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	R\$ 16.595.914,63	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 152.956,37	R\$ 16.748.871
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL LP SÊNIOR 1	R\$ 9.127,23	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 8,87	R\$ 9.136,1
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	R\$ 17.170.154,02	R\$ 0	R\$ 0	-R\$ 123.885,87	R\$ 17.046.268,15
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	R\$ 339.800,65	R\$ 0	R\$ 0	-R\$ 4.052,23	R\$ 335.748,42
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	R\$ 1.196.048,43	R\$ 0	R\$ 0	-R\$ 732,72	R\$ 1.195.315,71
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	R\$ 12.601.407,79	R\$ 0	R\$ 0	-R\$ 129.845,97	R\$ 12.471.561,82
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	R\$ 3.301.455,83	R\$ 1.156.402,36	R\$ 0	R\$ 20.319,49	R\$ 4.478.177,68
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	R\$ 19.966.974,05	R\$ 0	R\$ 24.883,93	R\$ 184.192,83	R\$ 20.126.282,95

Carteira por Segmento

novembro

dezembro

Movimentações Renda Variável - Fundo Capitalizado

Fundo	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	RENDIMENTOS	SALDO ATUAL
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	R\$ 300.981,31	R\$ 0	R\$ 0	-R\$ 9.031,31	R\$ 291.950
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	R\$ 663.106,2	R\$ 0	R\$ 0	-R\$ 56.467,17	R\$ 606.639,03
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	R\$ 1.535.205,7	R\$ 0	R\$ 0	-R\$ 175.734,32	R\$ 1.359.471,38
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	R\$ 505.335,22	R\$ 0	R\$ 0	-R\$ 59.475,62	R\$ 445.859,6

CONSULTORIA EMPRESARIAL

Carteira por Segmento

novembro

dezembro

Disponibilidades Financeiras

BANCO	CONTA	SALDO
ITAÚ	33133-8	R\$ 45.536,99
ITAÚ	32772-4	R\$ 123.938,2
Total		R\$ 169.475,19

Total Geral da Carteira (Fundo Capitalizado + Fundo Financeiro + Disponibilidades)

R\$ 134.560.310,53

CONSULTORIA EMPRESARIAL



<https://previdencia.olinda.pe.gov.br/>