



GOVERNO DO ESTADO DO RIO GRANDE DO NORTE
MUNICÍPIO DE EXTREMOZ
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE EXTREMOZ
RUA PRESIDENTE CAFÉ FILHO, 30 A, CENTRO – EXTREMOZ

APRESENTAÇÃO DO RELATÓRIO DO COMITÊ DE INVESTIMENTO para o
CONSELHO ADMINISTRATIVO REFERENTE AO 1º TRIMESTRE 2024

CONSIDERANDO a Resolução do Conselho Monetário Nacional nº 4.963/2021 (**"Resolução 4.963"**);

CONSIDERANDO a Portaria do Ministério do Trabalho e Previdência nº 1.467/2022 (**"Portaria 1.467"**) que dispõem sobre as aplicações dos recursos dos RPPS;

CONSIDERANDO a Lei nº 936/2018, que Dispõe sobre a criação do Regime Próprio de Previdência Social do Município de Extremoz, do Estado do Rio Grande do Norte, em conformidade com a Legislação Federal e Municipal e adota outras providências.

CONSIDERANDO o Art. 8º Ao Conselho de Administração compete: I – Aprovar a política de investimentos e deliberar sobre regime interno do EXTREMOZ - PREV;

CONSIDERANDO o Art. 8º Ao Conselho de Administração compete: V - Deliberar sobre as diretrizes gerais de atuação do EXTREMOZ - PREV;

CONSIDERANDO o Art. 8º Ao Conselho de Administração compete VIII - Deliberar sobre os balancetes Mensais bem como o balanço e as contas anuais do EXTREMOZ - PREV, após apreciados pelo Conselho Fiscal;

CONSIDERANDO o Art. 8º Ao Conselho de Administração compete XII - Funcionar como órgão de aconselhamento da Diretoria Executiva do EXTREMOZ - PREV nas questões por ele suscitadas;

O COMITÊ de investimento do Instituto de Previdência dos Servidores Públicos Municipais de Extremoz – EXTREMOZPREV, vem executar a apresentação do relatório acerca dos investimentos e demais decisões tomadas ao Conselho Administrativo, levando em consideração as carteiras referentes ao 1º TRIMESTRE DO

ANO DE 2024, ESPECIFICAMENTE, AOS MESES DE JANEIRO, FEVEREIRO E MARÇO.

Levando em consideração o fato do **RPPS adotar o modelo de gestão própria**, onde as decisões são tomadas pela **Diretoria Executiva, Comitê de Investimentos e Conselho**, o COMITÊ DE INVESTIMENTO se reuniu no mês de dezembro de 2023, para analisar e avaliar a política de investimento referente ao ano de 2024, tendo como objetivo central **promover a maximização da rentabilidade dos seus ativos**, buscando primeiramente a preservação e integridade de seu patrimônio e, posteriormente, a constituição de reservas para o pagamento de benefícios aos seus segurados.

Conforme calendário anual de reuniões, aos 17º dia do **mês de janeiro do ano de dois mil e vinte e quatro**, reuniram-se extraordinariamente nas dependências da sala de reuniões da sede da autarquia do ExtremozPrev, situada na Rua Presidente Café Filho nº30 Centro, Extremoz/, as 10hs (dez horas), Os membros do Comitê de Investimentos: Presidente do Comitê da Unidade Gestora, Sra. Soligia Maria De Freitas Oliveira, CPF nº023.188.564-43, Matrícula 0000132-1, Representante do Poder Executivo, Sr. Edivan Souza dos Santos, CPF nº026.493.694-93, Matrícula 4873-2 e a Sra. Lizélia Maria de Souza de Matrícula 0000173, para tratar acerca do balanço dos investimento e outras demandas.

A Sra, Soligia Maria apresentou o balanço dos investimentos e rendimentos referentes ao mês de dezembro/2023, onde foi observado o rendimento bruto, totalizando um retorno de R\$ 435,924,56 (quatrocentos e trinta e cinco mil, novecentos e vinte e quatro reais e cinquenta e seis centavos) sobre o investimentos de 36.412.453,76 (trinta e seis milhões, quatrocentos e doze mil, quatrocentos e cinquenta e três reais e setenta e seis centavos).

Para a tomada de decisões nos investimentos, foi realizado um estudo acerca do cenário econômico, observou-se que o mês de Dezembro continuou a ser favorável para investimentos de maior risco, como renda variável e renda fixa de maior duration. O destaque do mês foi novamente o IBOVESPA, que subiu 5,38%, após alta de 12,54% em novembro. Após estes resultados, o índice fechou o ano acima de 134 mil pontos, com alta de 22,28%. O S&P 500 também apresentou forte valorização, subindo 4,42%, após alta de 8,92% em novembro, e fechou o ano com alta de 24,23%. Do lado da renda fixa, destacaram-se os índices compostos por títulos mais longos, como o IMA-B 5+, IMA-B e IRF-M 1+, que apresentaram alta de 3,94%, 2,75% e 1,73%, respectivamente.

No que se refere a investimentos mais conservadores, como IRF-M 1 (0,91%) e CDI (0,90%), ambos permaneceram levemente acima da meta do mês. Destaca-se que, apesar da continuidade do ciclo de cortes de juros pelo Banco Central, os investimentos de menor risco continuaram a entregar retornos condizentes com a meta até o fechamento do último mês do ano. Sendo assim, todos os Índices superaram a meta em dezembro, assim como ocorreu no mês anterior.

Nesse contexto, ficou decidido em manter a estratégia de alongamento de carteira, conforme discutido nos últimos meses, levando em consideração as particularidades de cada RPPS. Destaca-se, ainda, a preferência por alocar uma parcela significativa do patrimônio em investimentos mais conservadores, como IRF-M 1 e CDI, visando mitigar a volatilidade da carteira.

Dando continuidade, a conselheira Solígia Maria ressaltou a importância do comitê analisar sobre como serão realizados os investimentos futuros junto à MIRAI INVESTIMENTOS, empresa financeira que está em fase de credenciamento. Após análises feitas, o comitê viu, enquanto sugestão a possibilidade de fazer a retirada de um milhão de reais, sendo R\$ 500.000,00 (quinhentos mil reais) da FI CAIXA BRASIL MATRIZ RF e R\$ 500.000,00 (quinhentos mil reais) da CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF, mas que aguardaria as devidas orientações da assessoria de investimentos da LEMA, através de nova reunião junto com o comitê.

Aos 07 dias do mês de fevereiro do ano 2024, às 11h, na sede do EXTREMOZPREV, reuniram-se novamente, em assembleia os membros do comitê de investimento, os conselheiros: Sr Edivan Souza dos Santos, a Sra. Rosângela Souza Rocha Costa (Diretora financeira do referido Instituto), e a Sra. Lizélia Maria de Souza. Iniciada a reunião, a Sra. Solígia Maria apresentou o balanço dos investimentos e rendimentos referentes ao mês de janeiro/2024, onde foi observado o rendimento bruto, totalizando um retorno de R\$ R\$ 262.613,91 (Duzentos e sessenta e dois mil, seiscentos e treze reais e noventa e um centavos), ficando com um total de patrimônio de R\$ 37.603.331,63 (trinta e sete milhões, seiscentos e três mil, trezentos e trinta e um reais, e sessenta e três centavos).

Na oportunidade, conselheira Solígia Maria ressaltou novamente a importância de analisarmos sobre como seriam realizados os investimentos futuros junto à MIRAI INVESTIMENTOS, enfatizando novamente o que havia dialogado na reunião passada.

Após análises feitas, o comitê levou em consideração exposição da LEMA consultoria, que observou que o movimento de fechamento da curva de juros doméstica continuou durante o mês de dezembro, proporcionado pela continuidade de melhores perspectivas para o ciclo de juros nacional e internacional. Analisando ainda que a Ata do Copom, de 13 de dezembro, reiterou a preferência de cortes de 0,50 ponto percentual nas próximas reuniões. Além disso, também houve a promulgação da reforma tributária pelo Congresso Nacional, melhorando as perspectivas para a economia doméstica, frisando que, apesar da conclusão do processo legislativo, a implementação efetiva da reforma tributária está condicionada à regulamentação, fator este que pode causar volatilidade aos mercados em 2024. O comitê analisou ainda que, externamente, a rentabilidade dos Treasuries também manteve o movimento de queda observado em novembro.

Nesse contexto, em conjunto com a LEMA CONSULTORIA, o comitê decidiu manter a estratégia de alongamento de carteira, conforme discutido nos últimos meses, levando em consideração as particularidades do instituto de previdência.

Concluindo, objetivando o estudo para novas aplicações futuras, observou-se novamente que as estratégias de compra direta de títulos públicos e privados, assim como aplicação em fundos de vértice, mostraram-se viáveis, pois a rentabilidade esperada destes investimentos permanece condizente com a meta atuarial, porém, com relevância menor do que a observada no ano passado, devido à queda das taxas de referência desses títulos.

Na última reunião do 1º trimestre de 2024, realizada aos treze (13) dias do mês de março do ano 2024, às 9h, na sede do EXTREMOZPREV, reuniram-se em assembleia o comitê de investimento: Sr. Edivan Souza dos Santos; Sra. Lizelia Maria, Sra. Solígia Maria de Freitas Oliveira, a Sra. Rosângela Rocha (diretora financeira) e o conselheiro Fernando Hortêncio. Iniciando a reunião, a Sra. Rosângela repassou as informações referentes aos investimentos do mês de janeiro de 2024. Aproveitando a oportunidade, a conselheira Lizélia repassou informações para o conselheiro Fernando acerca dos investimentos realizados pelo instituto, considerando a política de investimento do instituto, enfatizando o comportamento das carteiras e o posicionamento do comitê de investimento, em relação às decisões que devem ser tomadas. Em relação aos investimentos realizados no mês de janeiro de 2024, foi observado que dois investimentos deram negativos: CAIXA BRASIL DE AÇÕES com porcentagem de -2,73%, E CAIXA CAPITAL PROTEGIDO com -1,44%, que após análise, o comitê decidiu por aguardar o comportamento futuro dos mesmos, para tomar alguma decisão.

Acerca das demais aplicações, foi observado que o instituto obteve um rendimento positivo, sendo de R\$ 283.323,19 (duzentos e oitenta e três mil, trezentos e vinte e três reais e dezenove centavos), no mês de março de 2024, tendo um patrimônio total de R\$ 40.308.048,77 (trinta e seis milhões, trezentos e oito mil, quarenta reais e setenta e sete centavos).

A Sra. Solígia, em conjunto com os demais conselheiros, fez um comparativo dos rendimentos referentes ao mês de janeiro de 2023 com o mês de janeiro de 2024, e, levando essa questão em consideração propuseram solicitar à LEMA CONSULTORIA a abertura das carteiras para verificação da composição das mesmas: BB FLUXO, CAIXA BRASIL AÇÕES E CAIXA CAPITAL PROTEGIDO.

Na reunião, o Sr. Edivan Souza fez exposição acerca dos estudos relevantes, realizados no último congresso de investimentos, na cidade de Florianópolis, onde foram tratados ASPECTOS IMPORTANTES DOS INVESTIMENTOS, levando em consideração o cenário atual da economia, enfatizando acerca da AVALIAÇÃO E MONITORAMENTO DOS RISCOS, nos investimentos.

Ressaltou ainda acerca da importância de estar observando sempre a execução e fiscalização da política de investimentos, indagando também sobre a relevância da certificação profissional, para aqueles conselheiros que ainda não tem, ver a possibilidade junto ao instituto de fazê-la.

A Gestora Solígia, durante a reunião, expôs sobre o quanto o congresso foi relevante para os estudos, e o quanto mostrou que o instituto está no caminho certo, em relação aos investimentos que estamos fazendo. A conselheira Lizélia ressaltou sua fala no evento, quanto a questão de vereadores, prefeitos e vice prefeitos participarem dos institutos de previdência e não precisarem de certificação, sendo contrária a tal decisão, para qual pediu um chamado dos presentes, para debater acerca do assunto, em momento futuro

Após a fala da Sra. Solígia, o Sr. Edivan Souza pediu para o comitê analisar e dialogar sobre o comportamento do cenário econômico, e o comitê continuou a ressaltar que as estratégias de compra direta de títulos públicos e privados, para os investimentos futuros, assim como a aplicação em fundos de vértice, ainda se mostram viáveis, pois estes investimentos continuam a apresentar rentabilidades condizentes com a meta atuarial.

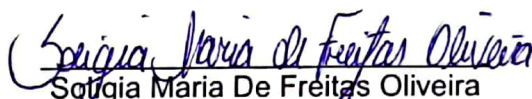
Contudo, para finalizar a reunião o comitê também fez uma análise dos rendimentos financeiros referentes ao 1º trimestre – meses de janeiro, fevereiro e março 2024, observando que, mesmo tendo uma diferença de rendimentos no mês de janeiro, tivemos rendimentos positivos, uma vez que finalizamos o mês de março, ou seja, o trimestre com **R\$ 40.308.048,77** (Quarenta milhões, trezentos e oito mil, quarenta e oito reais e setenta e sete centavos), obtendo um rendimento total no trimestre de **R\$ 824.901,03** (Oitocentos e vinte e quatro mil, novecentos e um reais e três centavos), tendo, portanto, um cenário equilibrado, conforme podemos analisar nas informações, anexos abaixo descritos.

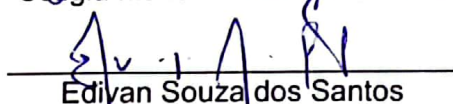
EXTREMOZPREV

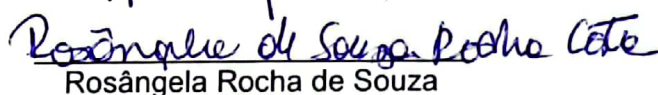
Metas - Janeiro a Março de 2024

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2024			IPCA + 4.86% a.a.			
Janeiro	R\$ 36.412.453,76	R\$ 37.603.331,63	0,82%	R\$ 262.613,91	0,71%	-0,10p.p.
Fevereiro	R\$ 37.603.331,63	R\$ 38.895.640,60	1,23%	R\$ 278.963,93	0,73%	-0,50p.p.
Março	R\$ 38.895.640,60	R\$ 40.308.048,77	0,56%	R\$ 283.323,19	0,72%	0,16p.p.
Total	R\$ 38.895.640,60	R\$ 40.308.048,77	2,63%	R\$ 824.901,03	2,17%	-0,46p.p.

COMITÊ DE INVESTIMENTO


Solgia Maria De Freitas Oliveira


Edryan Souza dos Santos


Rosângela Rocha de Souza

EXTREMOZPREV

Carteira - Fevereiro/2024

ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)	TX ADM
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	R\$ 4.857.694,13	12,50%	D+0	7,1 "b"	R\$ 36.735,13	0,74%	0,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	R\$ 2.427.137,23	6,24%	D+0	7,1 "b"	R\$ 13.390,37	0,55%	0,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI RF	R\$ 9.277,14	0,02%	D+0	7,1 "b"	R\$ 53,20	0,58%	0,20%
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	R\$ 2.094.586,10	5,39%	D+0	7,1 "b"	R\$ 15.550,71	0,73%	0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PR...	R\$ 2.879.474,56	7,41%	D+360	7,1 "b"	R\$ 21.347,08	0,73%	0,20%
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVID	R\$ 2.013.865,69	5,18%	D+0	7,1 "b"	R\$ 13.865,69	0,69%	0,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RF...	R\$ 4.331.246,92	11,14%	D+3	7,1 "b"	R\$ 32.275,64	0,75%	0,30%
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF	R\$ 4.640.794,39	11,94%	D+0	7,1 "b"	R\$ 20.074,52	0,43%	0,20%
BNB AUTOMÁTICO FI RF CURTO PRAZO	R\$ 0,00	0,00%	D+0	7,1 "b"	R\$ 350,49	0,63%	1,70%
BB IMA-B TP FI RF	R\$ 2.007.869,48	5,17%	D+1	7,1 "b"	R\$ 7.869,48	0,39%	0,20%
BNB RPPS IMA-B FI RF	R\$ 1.009.243,23	2,60%	D+1	7,1 "b"	R\$ 3.962,46	0,39%	0,20%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 3.332.120,95	8,57%	D+0	7,1 "a"	R\$ 22.960,24	0,60%	1,00%
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RF	R\$ 3.333.882,89	8,58%	D+0	7,1 "a"	R\$ 27.082,80	0,82%	0,20%
BB PERFIL FIC RF REF DI PREVIDENC	R\$ 2.015.191,57	5,19%	D+0	7,1 "a"	R\$ 15.191,57	0,76%	0,20%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FI...	R\$ 1.352.711,06	3,48%	D+15	8,1	R\$ 30.293,24	2,29%	2,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO MUL...	R\$ 452.843,44	1,17%	D+2	10,1	R\$ 4.629,60	1,03%	0,90%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCAD...	R\$ 797.901,82	2,05%	D+3	10,1	R\$ 4.441,69	0,56%	0,50%
CAIXA JÚROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	R\$ 1.309.652,38	3,37%	D+0	10,1	R\$ 8.890,02	0,68%	0,70%
Total Investimentos	R\$ 38.865.492,98	100,00%			R\$ 278.963,93	0,73%	
Disponibilidade	R\$ 30.147,62				-	-	
Total patrimônio	R\$ 38.895.640,60	100,00%			-	-	

EXTREMOZPREV

Carteira - Fevereiro/2024

ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)	TX ADM
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	R\$ 4.857.694,13	12,50%	D+0	7, I "b"	R\$ 36.735,13	0,74%	0,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	R\$ 2.427.137,23	6,24%	D+0	7, I "b"	R\$ 13.390,37	0,55%	0,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI RF	R\$ 9.277,14	0,02%	D+0	7, I "b"	R\$ 53,20	0,58%	0,20%
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	R\$ 2.094.586,10	5,39%	D+0	7, I "b"	R\$ 15.550,71	0,73%	0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PR...	R\$ 2.879.474,56	7,41%	D+360	7, I "b"	R\$ 21.347,08	0,73%	0,20%
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVID	R\$ 2.013.865,69	5,18%	D+0	7, I "b"	R\$ 13.865,69	0,69%	0,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RF...	R\$ 4.331.246,92	11,14%	D+3	7, I "b"	R\$ 32.275,64	0,75%	0,30%
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF	R\$ 4.640.794,39	11,94%	D+0	7, I "b"	R\$ 20.074,52	0,43%	0,20%
BNB AUTOMATICO FI RF CURTO PRAZO	R\$ 0,00	0,00%	D+0	7, I "b"	R\$ 350,49	0,63%	1,70%
BB IMA-B TP FI RF	R\$ 2.007.869,48	5,17%	D+1	7, I "b"	R\$ 7.869,48	0,39%	0,20%
BNB RPPS IMA-B FI RF	R\$ 1.009.243,23	2,60%	D+1	7, I "b"	R\$ 3.962,46	0,39%	0,20%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 3.332.120,95	8,57%	D+0	7, III "a"	R\$ 22.960,24	0,60%	1,00%
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RF	R\$ 3.333.882,89	8,58%	D+0	7, III "a"	R\$ 27.082,80	0,82%	0,20%
BB PERFIL FIC RF REF DI PREVIDENC	R\$ 2.015.191,57	5,19%	D+0	7, III "a"	R\$ 15.191,57	0,76%	0,20%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FI...	R\$ 1.352.711,06	3,48%	D+15	8, I	R\$ 30.293,24	2,29%	2,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO MUL...	R\$ 452.843,44	1,17%	D+2	10, I	R\$ 4.629,60	1,03%	0,90%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCAD...	R\$ 797.901,82	2,05%	D+3	10, I	R\$ 4.441,69	0,56%	0,50%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	R\$ 1.309.652,38	3,37%	D+0	10, I	R\$ 8.890,02	0,68%	0,70%
Total Investimentos	R\$ 38.865.492,98	100,00%			R\$ 278.963,93	0,73%	
Disponibilidade	R\$ 30.147,62	-			-	-	
Total patrimônio	R\$ 38.895.640,60	100,00%			-	-	

EXTREMOZPREV

Carteira - Março/2024

ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)	TX ADM
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	R\$ 4.644.195,55	11,53%	D+0	7, I "b"	R\$ 38.122,36	0,80%	0,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	R\$ 2.441.161,80	6,06%	D+0	7, I "b"	R\$ 14.024,57	0,58%	0,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI RF	R\$ 9.346,97	0,02%	D+0	7, I "b"	R\$ 69,83	0,75%	0,20%
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	R\$ 2.113.797,37	5,25%	D+0	7, I "b"	R\$ 19.211,27	0,92%	0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PR...	R\$ 2.905.892,51	7,21%	D+360	7, I "b"	R\$ 26.417,95	0,92%	0,20%
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVID	R\$ 2.030.044,20	5,04%	D+0	7, I "b"	R\$ 16.178,51	0,80%	0,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RF...	R\$ 4.364.451,44	10,83%	D+3	7, I "b"	R\$ 33.204,52	0,77%	0,30%
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF	R\$ 4.664.002,52	11,58%	D+0	7, I "b"	R\$ 23.208,13	0,50%	0,20%
BB IMA-B TP FI RF	R\$ 2.009.066,42	4,99%	D+1	7, I "b"	R\$ 1.196,94	0,06%	0,20%
BNB RPPS IMA-B FI RF	R\$ 1.009.975,60	2,51%	D+1	7, I "b"	R\$ 732,37	0,07%	0,20%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 4.747.724,40	11,79%	D+0	7, III "a"	R\$ 29.855,56	0,63%	1,00%
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RF	R\$ 3.362.183,38	8,35%	D+0	7, III "a"	R\$ 28.300,49	0,85%	0,20%
BB PERFIL FIC RF REF DI PREVIDENC	R\$ 2.032.377,22	5,05%	D+0	7, III "a"	R\$ 17.185,65	0,85%	0,20%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FI...	R\$ 1.371.065,75	3,40%	D+15	8, I	R\$ 18.354,69	1,36%	2,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO MUL...	R\$ 455.466,18	1,13%	D+2	10, I	R\$ 2.622,74	0,58%	0,90%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCAD...	R\$ 803.393,66	1,99%	D+3	10, I	R\$ 5.491,84	0,69%	0,50%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	R\$ 1.318.798,15	3,27%	D+0	10, I	R\$ 9.145,77	0,70%	0,70%
Total investimentos	R\$ 40.282.943,12	100,00%			R\$ 283.323,19	0,72%	
Disponibilidade	R\$ 25.105,65						
Total patrimônio	R\$ 40.308.048,77	100,00%					

Patrimônio
R\$ 40.308.048,77

Rentabilidade
Mês Acum.
0,72% 2,17%

Meta
Mês Acum.
0,56% 2,63%

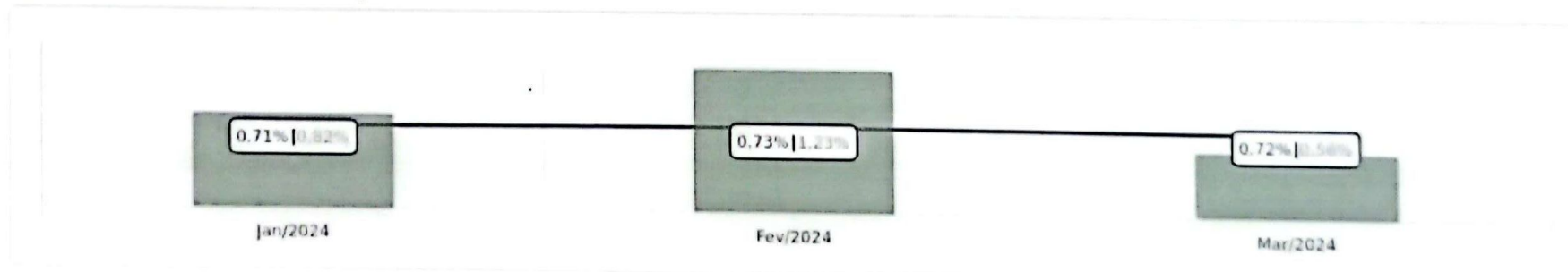
Gap
Mês Acum.
0,16p.p. -0,46p.p.

VaR_{1,252}
0,15%

Evolução do Patrimônio



Comparativo (Rentabilidades | Metas)



EXTREMOZPREV

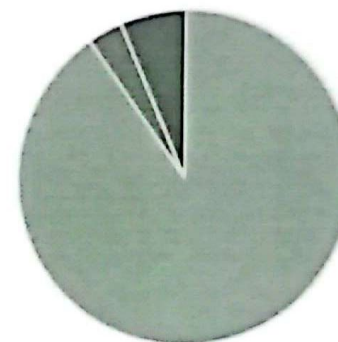
Carteira - Janeiro a Março de 2024

ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)	TX ADM
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	R\$ 4.644.195,55	11,53%	D+0	7, I "b"	R\$ 121.559,26	2,44%	0,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	R\$ 2.441.161,80	6,06%	D+0	7, I "b"	R\$ 43.123,82	1,80%	0,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI RF	R\$ 9.346,97	0,02%	D+0	7, I "b"	R\$ 248,15	2,01%	0,20%
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	R\$ 2.113.797,37	5,25%	D+0	7, I "b"	R\$ 58.176,10	2,78%	0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PR...	R\$ 2.905.892,51	7,21%	D+360	7, I "b"	R\$ 79.962,68	2,78%	0,20%
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVID	R\$ 2.030.044,20	5,04%	D+0	7, I "b"	R\$ 30.044,20	1,50%	0,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RF...	R\$ 4.364.451,44	10,83%	D+3	7, I "b"	R\$ 100.482,45	2,39%	0,30%
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF	R\$ 4.664.002,52	11,58%	D+0	7, I "b"	R\$ 74.111,28	1,61%	0,20%
BNB AUTOMATICO FI RF CURTO PRAZO	R\$ 0,00	0,00%	D+0	7, I "b"	R\$ 6.994,61	1,30%	1,70%
BB IMA-B TP FI RF	R\$ 2.009.066,42	4,99%	D+1	7, I "b"	R\$ 9.066,42	0,45%	0,20%
BNB RPPS IMA-B FI RF	R\$ 1.009.975,60	2,51%	D+1	7, I "b"	R\$ 4.694,83	0,47%	0,20%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 4.747.724,40	11,79%	D+0	7, III "a"	R\$ 119.476,18	2,07%	1,00%
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RF	R\$ 3.362.183,38	8,35%	D+0	7, III "a"	R\$ 88.342,07	2,70%	0,20%
BB PERFIL FIC RF REF DI PREVIDENC	R\$ 2.032.377,22	5,05%	D+0	7, III "a"	R\$ 32.377,22	1,62%	0,20%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FI...	R\$ 1.371.065,75	3,40%	D+15	8, I	R\$ 11.525,29	0,85%	2,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CESTA AGRO MUL...	R\$ 455.466,18	1,13%	D+2	10, I	R\$ 725,59	0,16%	0,90%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCAD...	R\$ 803.393,66	1,99%	D+3	10, I	R\$ 13.971,10	1,77%	0,50%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	R\$ 1.318.798,15	3,27%	D+0	10, I	R\$ 30.019,78	2,33%	0,70%
Total investimentos	R\$ 40.282.943,12	100,00%			R\$ 824.901,03	2,17%	
Disponibilidade	R\$ 25.105,65	-			-	-	
Total patrimônio	R\$ 40.308.048,77	100,00%			-	-	

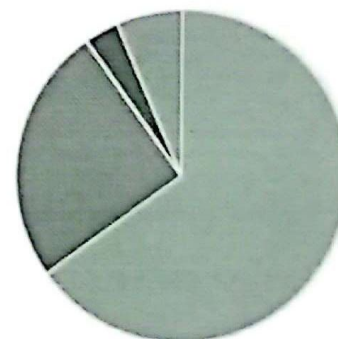
EXTREMOZPREV

Distribuição - Janeiro a Março de 2024

CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	90,20%	R\$ 36.334.219,38	
Estruturados	6,40%	R\$ 2.577.657,99	
Renda Variável	3,40%	R\$ 1.371.065,75	
Total	100,00%	R\$ 40.282.943,12	



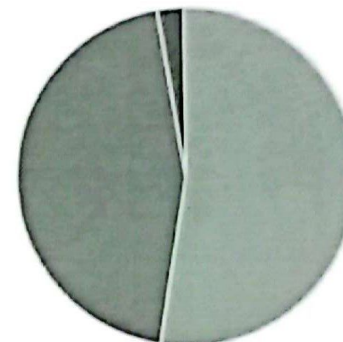
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	65,02%	R\$ 26.191.934,38	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	25,18%	R\$ 10.142.285,00	
Artigo 10, Inciso I	6,40%	R\$ 2.577.657,99	
Artigo 8º, Inciso I	3,40%	R\$ 1.371.065,75	
Total	100,00%	R\$ 40.282.943,12	



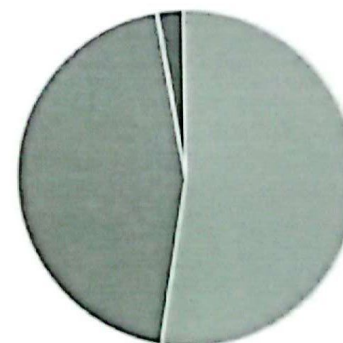
EXTREMOZPREV

Distribuição - Janeiro a Março de 2024

GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA DISTRIBUIDORA	52,59%	R\$ 21.183.411,33	
BB GESTAO	44,91%	R\$ 18.089.556,19	
BANCO DO NORDESTE	2,51%	R\$ 1.009.975,60	
Total	100,00%	R\$ 40.282.943,12	



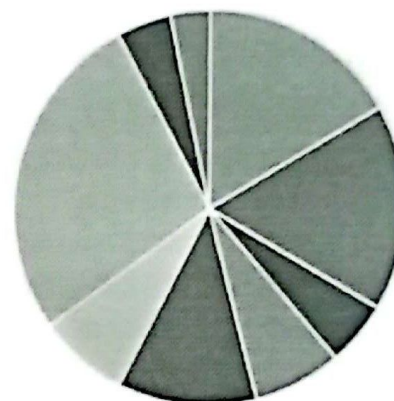
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA ECONOMICA	52,59%	R\$ 21.183.411,33	
BB GESTAO	44,91%	R\$ 18.089.556,19	
S3 CACEIS	2,51%	R\$ 1.009.975,60	
Total	100,00%	R\$ 40.282.943,12	



EXTREMOZPREV

BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CDI	27,17%	R\$ 10.945.678,66	
IMA Geral ex-C	16,89%	R\$ 6.805.613,24	
IRF-M 1	16,57%	R\$ 6.674.239,75	
IRF-M	11,58%	R\$ 4.664.002,52	
IMA-B	7,49%	R\$ 3.019.042,02	
IPCA	7,21%	R\$ 2.905.892,51	
IMA-B 5	5,27%	R\$ 2.123.144,34	
IBOVESPA	4,53%	R\$ 1.826.531,93	
125% do CDI	3,27%	R\$ 1.318.798,15	
Total	100,00%	R\$ 40.282.943,12	

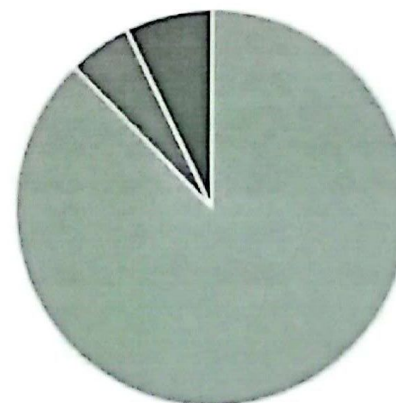
Distribuição - Janeiro a Março de 2024



EXTREMOZPREV

LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	87,54%	R\$ 35.263.253,24	
181 a 365 dias	7,21%	R\$ 2.905.892,51	
31 a 180 dias	5,25%	R\$ 2.113.797,37	
Total	100,00%	R\$ 40.282.943,12	

Distribuição - Janeiro a Março de 2024



RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - 7, I "a"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	5,00%	20,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 26.191.934,38	65.02%	20,00%	50,00%	80,00%
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Operações Compromissadas - 7, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa - 7, III "a"	60%	R\$ 10.142.285,00	25.18%	10,00%	20,00%	50,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Ativos Bancários - 7, IV	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	5,00%	10,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	5,00%	5,00%
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa		R\$ 36.334.219,38	90,20%			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 1.371.065,75	3.40%	0,00%	5,00%	20,00%
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável		R\$ 1.371.065,75	3,40%			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Renda Fixa - Dívida Externa - 9, I	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Investimento no Exterior - 9, II	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Ações - BDR Nível I - 9, III	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	2,00%	10,00%
Total Investimentos no Exterior		R\$ 0,00	0,00%			

EXTREMOZPREV

Enquadramentos 4.963 - Janeiro a Março de 2024

FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 2.577.657,99	6.40%	0,00%	8,00%	10,00%
FI em Participações - 10, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Fundos Estruturados		R\$ 2.577.657,99	6,40%			
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Imobiliário - 11	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Fundos Imobiliários		R\$ 0,00	0,00%			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Empréstimos Consignados		R\$ 0,00	0,00%			
Total Global		R\$ 40.282.943,12	100,00%			

EXTREMOZPREV

Metas - Janeiro a Março de 2024

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2024			IPCA + 4.86% a.a.			
Janeiro	R\$ 36.412.453,76	R\$ 37.603.331,63	0,82%	R\$ 262.613,91	0,71%	-0,10p.p.
Fevereiro	R\$ 37.603.331,63	R\$ 38.895.640,60	1,23%	R\$ 278.963,93	0,73%	-0,50p.p.
Março	R\$ 38.895.640,60	R\$ 40.308.048,77	0,56%	R\$ 283.323,19	0,72%	0,16p.p.
Total	R\$ 38.895.640,60	R\$ 40.308.048,77	2,63%	R\$ 824.901,03	2,17%	-0,46p.p.

EXTREMOZPREV

Rentabilidade dos ativos - Janeiro a Março de 2024

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE			
		Jan (%)	Fev (%)	Mar (%)	Trimestre (%)
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	11.328.882/0001-35	-	0,69%	0,80%	1,50%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,82%	0,60%	0,63%	2,07%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	03.737.206/0001-97	-	-	-	-
BB PERFIL FIC RF REF DI...	13.077.418/0001-49	-	0,76%	0,85%	1,62%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	23.215.097/0001-55	0,66%	0,55%	0,58%	1,80%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	10.740.670/0001-06	0,89%	0,74%	0,79%	2,44%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...	11.060.913/0001-10	0,66%	0,58%	0,75%	2,01%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	03.543.447/0001-03	-	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP...	14.386.926/0001-71	-	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	17.502.937/0001-68	-	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RF	08.266.261/0001-60	-	0,39%	0,07%	0,47%
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI...	20.139.595/0001-78	1,11%	0,73%	0,92%	2,78%
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF...	14.508.605/0001-00	0,67%	0,43%	0,50%	1,61%
BB IMA-B TP FI RF	07.442.078/0001-05	-	0,39%	0,06%	0,45%
CAIXA JUROS E...	14.120.520/0001-42	0,93%	0,68%	0,70%	2,33%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO...	08.070.841/0001-87	0,51%	0,56%	0,69%	1,77%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	0,85%	0,75%	0,77%	2,39%
CAIXA BRASIL AÇÕES...	30.068.169/0001-44	-2,73%	2,29%	1,36%	0,85%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	44.345.590/0001-60	1,11%	0,73%	0,92%	2,78%
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RF	23.215.008/0001-70	1,01%	0,82%	0,85%	2,70%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO...	42.229.068/0001-97	-1,44%	1,03%	0,58%	0,16%

EXTREMOZPREV

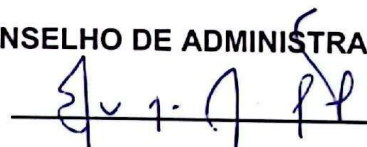
Rentabilidade dos ativos - Janeiro a Março de 2024

BNB AUTOMATICO FI RF CURTO PRAZO	00.812.433/0001-41	0,66%	0,63%	-	1,30%
----------------------------------	--------------------	-------	-------	---	-------

TÍTULO	VENC.	COMPRA	QTD.	P.U. COMPRA ATUAL	MARCAÇÃO	VALOR COMPRA	VALOR ATUAL	RETORNO
Total Públicos						R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)
Total Privados						R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)
Total Global						R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (NaN%)

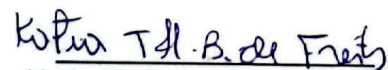
Considerando o que é preceituado na **Portaria do Ministério do Trabalho e Previdência nº 1.467/2022** ("**Portaria 1.467**") que dispõem sobre as aplicações dos recursos dos RPPS, bem como na Lei 936/2018, que Dispõe sobre a criação do Regime Próprio de Previdência Social do Município de Extremoz, do Estado do Rio Grande do Norte, em conformidade com a Legislação Federal e Municipal e adota outras providências, precisamente expostas no Art. 8º da referida lei, no que concerne às competências e deliberações sobre as diretrizes gerais de atuação do EXTREMOZ – PREV, o Conselho Administrativo aprova o relatório do comitê de investimento, referente ao 1º trimestre do ano de 2024, especificamente em relação aos meses de janeiro, fevereiro e março.

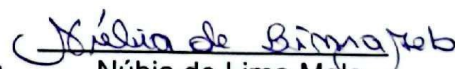
CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO

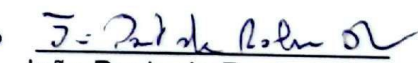

Edivan Souza dos Santos
Presidente


Francilene de Souza


Cláudia Alves Cavalcante


Katia Tatiane Medeiros Borba


Núbia de Lima Melo


João Paulo da Rocha Oliveira