

Carteira de Investimentos 2024

CONSOLIDADO
IPREVILLE – JOINVILLE

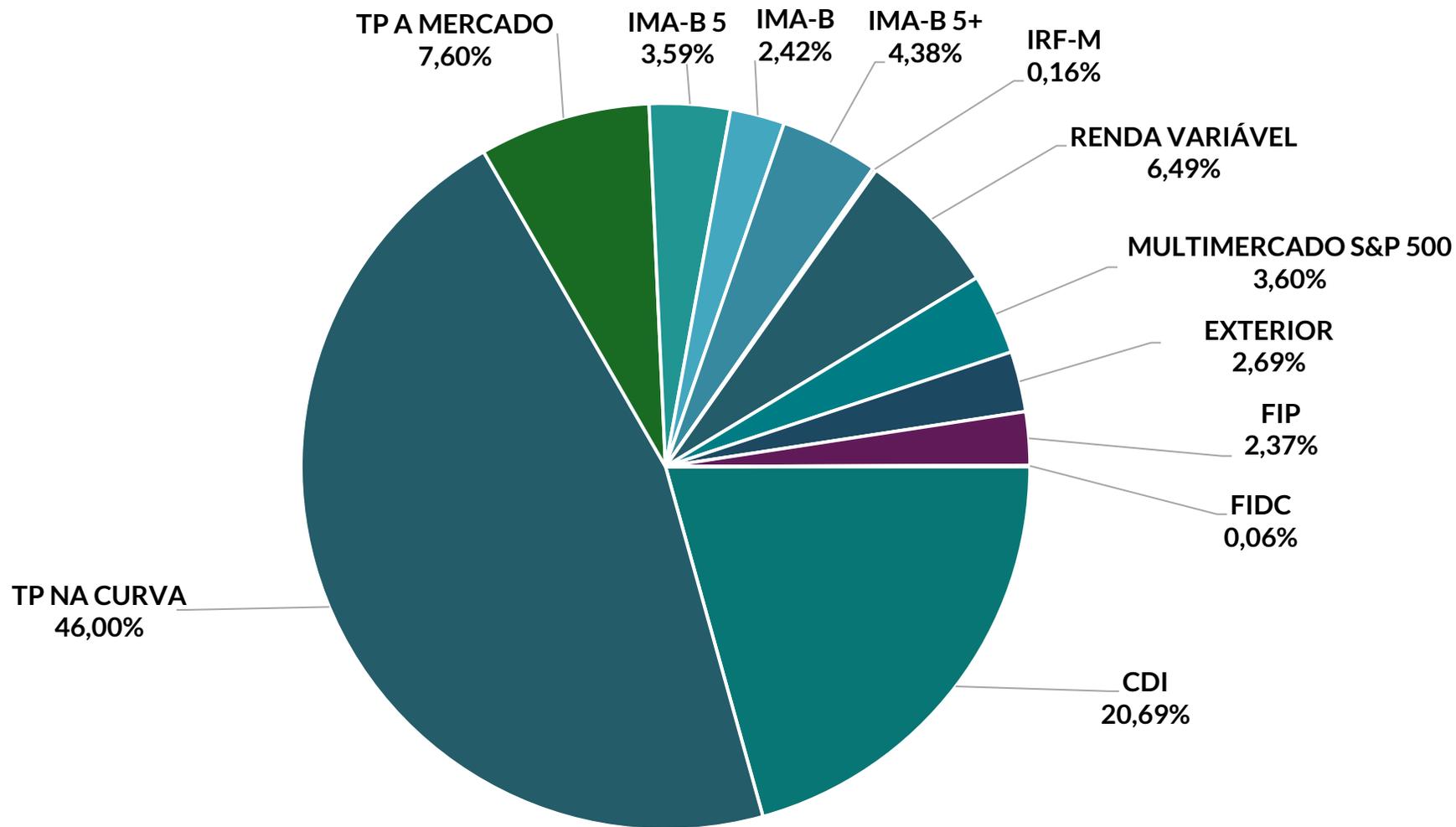
Eduardo Barão | eduardo@smiconsult.com.br



DISCLAIMER

Esta apresentação foi elaborada pela SMI Consultoria de Investimentos, para uso exclusivo dos seus clientes, não podendo ser reproduzida ou distribuída por este a qualquer pessoa ou instituição sem a expressa autorização da SMI Consultoria de Investimentos. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. **Para demais informações, por favor, ligue para (48) 3027 5200.**

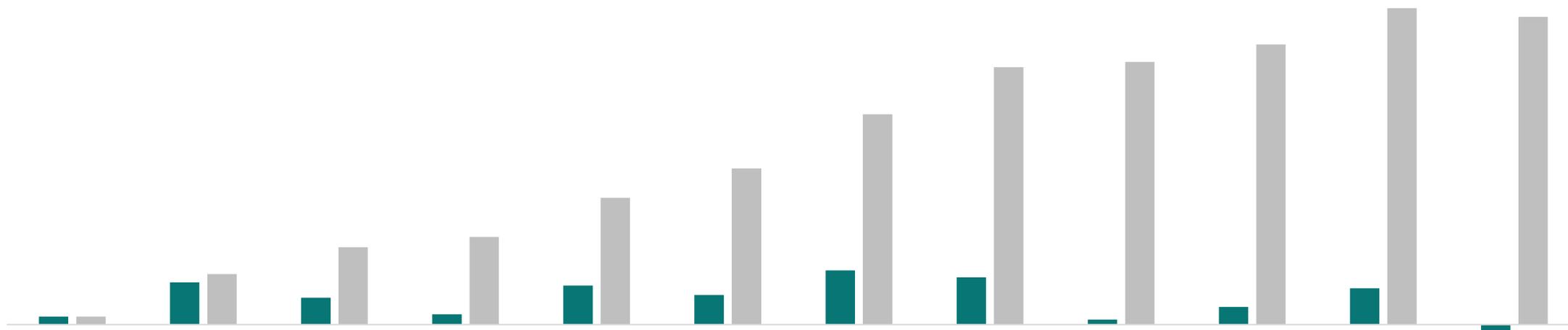
Alocação por Benchmark



DISCLAIMER

Esta apresentação foi elaborada pela SMI Consultoria de Investimentos, para uso exclusivo dos seus clientes, não podendo ser reproduzida ou distribuída por este a qualquer pessoa ou instituição sem a expressa autorização da SMI Consultoria de Investimentos. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Para demais informações, por favor, ligue para (48) 3027 5200.

Retorno Financeiro Acumulado e PL



	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maió	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
■ Retorno Mensal	7.773.455,83	40.576.250,19	25.825.982,90	9.913.354,16	37.384.415,85	28.373.412,00	51.883.441,16	45.275.780,46	4.879.650,76	16.918.606,95	34.704.791,06	-8.342.801,61
■ Retorno Acumulado	7.773.455,83	48.349.706,02	74.175.688,92	84.089.043,08	121.473.458,93	149.846.870,93	201.730.312,09	247.006.092,55	251.885.743,31	268.804.350,26	303.509.141,32	295.166.339,71

O patrimônio líquido do IPREVILLE fechou o ano de 2024 em **R\$ 4.037.414.643,80.**



DISCLAIMER

Esta apresentação foi elaborada pela SMI Consultoria de Investimentos, para uso exclusivo dos seus clientes, não podendo ser reproduzida ou distribuída por este a qualquer pessoa ou instituição sem a expressa autorização da SMI Consultoria de Investimentos. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Para demais informações, por favor, ligue para (48) 3027 5200.

Rentabilidade da Carteira e Meta Atuarial

RENTABILIDADE DA CARTEIRA, INDICADORES E META ATUARIAL (INPC + 5,09% A.A.)							
MÊS	CARTEIRA	META	CDI	IMA-G	% META	% CDI	% IMA-G
Janeiro	0,20	0,99	0,97	0,47	21	21	44
Fevereiro	1,07	1,23	0,80	0,64	87	133	167
Março	0,67	0,61	0,83	0,52	111	81	129
Abril	0,25	0,79	0,89	(0,22)	32	29	-116
Maiο	0,97	0,88	0,83	0,95	111	116	103
Junho	0,72	0,67	0,79	0,05	109	92	1.539
Julho	1,32	0,68	0,91	1,36	196	146	97
Agosto	1,14	0,27	0,87	0,79	415	131	143
Setembro	0,12	0,90	0,83	0,34	13	14	36
Outubro	0,42	1,03	0,93	0,38	40	45	109
Novembro	0,86	0,75	0,79	0,32	116	109	270
Dezembro	(0,20)	0,90	0,93	(0,59)	-23	-22	34
TOTAL	7,81	10,10	10,87	5,10	77	72	153



DISCLAIMER

Esta apresentação foi elaborada pela SMI Consultoria de Investimentos, para uso exclusivo dos seus clientes, não podendo ser reproduzida ou distribuída por este a qualquer pessoa ou instituição sem a expressa autorização da SMI Consultoria de Investimentos. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Para demais informações, por favor, ligue para (48) 3027 5200.

Gestão de Risco

MEDIDAS DE RISCO E DESEMPENHO DA CARTEIRA (%)

	MEDIDA	12 MESES
Janeiro/2024	Volatilidade Anualizada	2,1441
	VaR (95%)	3,5275
Dezembro/2024	Volatilidade Anualizada	1,7368
	VaR (95%)	2,8573

Na Gestão de Risco da Política de Investimentos de 2024 do IPREVILLE, ficaram estabelecidos os limites máximos de Volatilidade Anualizada e VaR, de 6,0% e 9,0% respectivamente.

Enquadramento em Relação à Resolução 4.963/2021 e a PI 2024

POR SEGMENTO						
ENQUADRAMENTO	SALDO EM R\$	% CARTEIRA	% LIMITE RESOLUÇÃO		% LIMITE PI 2024	
7, I	2.630.605.664,27	65,59	100,0	✓	100,0	✓
7, I, a	2.162.352.640,29	53,91	100,0	✓	100,0	✓
7, I, b	468.253.023,98	11,68	100,0	✓	100,0	✓
7, I, c	-	0,00	100,0	✓	100,0	✓
7, II	-	0,00	5,0	✓	5,0	✓
7, III	722.119.009,90	18,00	75,0	✓	75,0	✓
7, III, a	722.119.009,90	18,00	75,0	✓	75,0	✓
7, III, b	-	0,00	75,0	✓	75,0	✓
7, IV	-	0,00	20,0	✓	20,0	✓
7, V	42.691.538,28	1,06	30,0	✓	30,0	✓
7, V, a	2.293.454,09	0,06	15,0	✓	15,0	✓
7, V, b	40.398.084,19	1,01	15,0	✓	15,0	✓
7, V, c	-	0,00	15,0	✓	15,0	✓
ART. 7	3.395.416.212,45	84,66	100,0	✓	100,0	✓
8, I	262.995.559,94	6,56	45,0	✓	45,0	✓
8, II	-	0,00	45,0	✓	45,0	✓
ART. 8	262.995.559,94	6,56	45,0	✓	45,0	✓

POR SEGMENTO						
ENQUADRAMENTO	SALDO EM R\$	% CARTEIRA	% LIMITE RESOLUÇÃO		% LIMITE PI 2024	
9, I	-	0,00	10,0	✓	10,0	✓
9, II	110.053.225,10	2,74	10,0	✓	10,0	✓
9, III	-	0,00	10,0	✓	10,0	✓
ART. 9	110.053.225,10	2,74	10,0	✓	10,0	✓
10, I	147.131.396,34	3,67	15,0	✓	15,0	✓
10, II	95.074.312,35	2,37	10,0	✓	10,0	✓
10, III	-	0,00	10,0	✓	10,0	✓
ART. 10	242.205.708,69	6,04	20,0	✓	20,0	✓
ART. 11	-	0,00	15,0	✓	15,0	✓
ART. 12	-	0,00	10,0	✓	10,0	✓
ART. 8, 10 E 11	505.201.268,63	12,60	50,0	✓	50,0	✓
PATRIMÔNIO INVESTIDO	4.010.670.706,18					

PRÓ GESTÃO

O IPREVILLE comprovou adoção de melhores práticas de gestão previdenciária à Secretaria de Previdência, ao NÍVEL III de aderência na forma por ela estabelecidos.

PARECER SOBRE ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA

- ✓ Enquadrada em relação à Resolução CMN 4.963/2021.
- ✓ Enquadrada em relação à Política de Investimento vigente.

Carteira de Investimentos 2024

GESTÃO PRÓPRIA
IPREVILLE – JOINVILLE

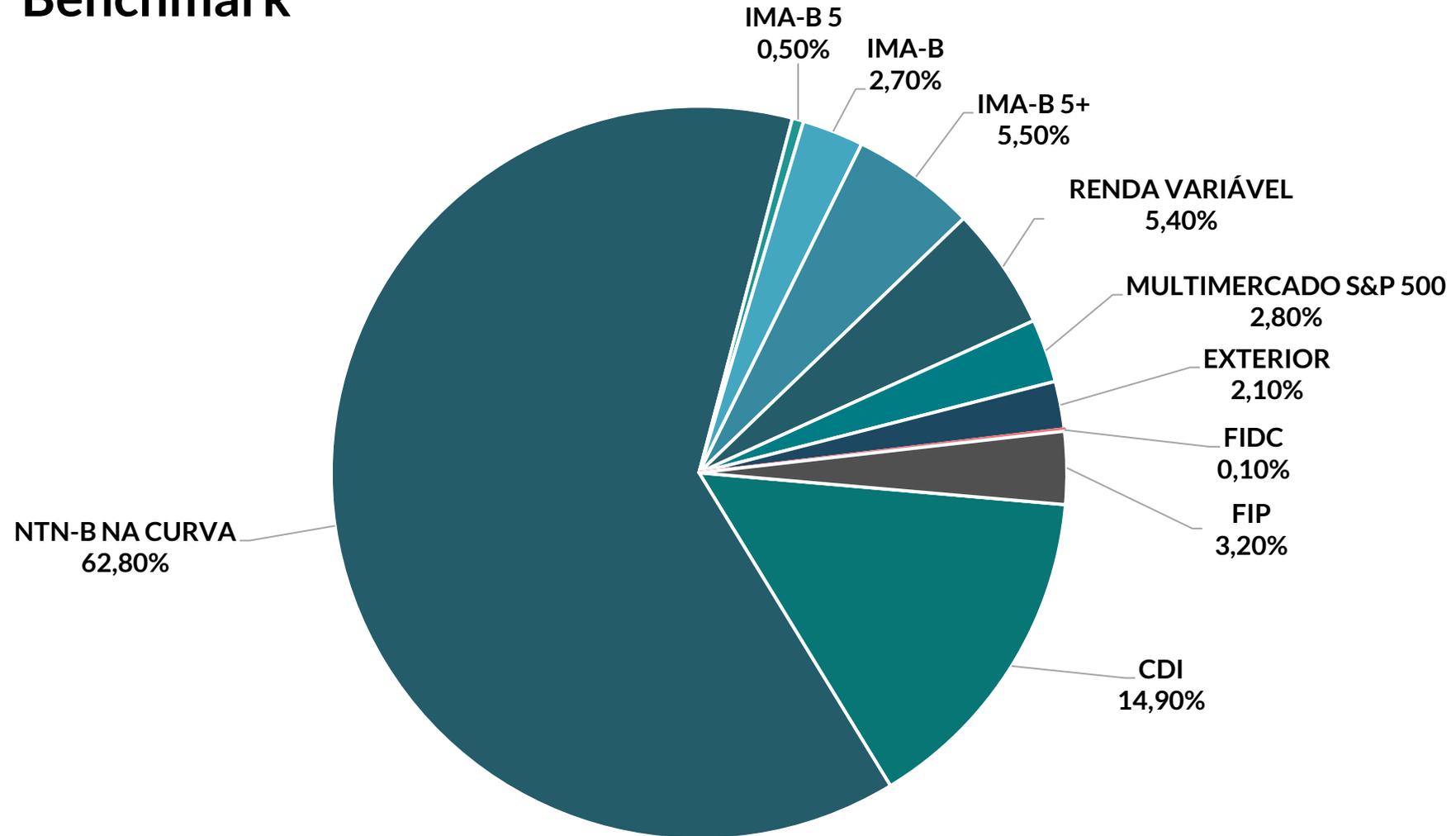
Eduardo Barão | eduardo@smiconsult.com.br



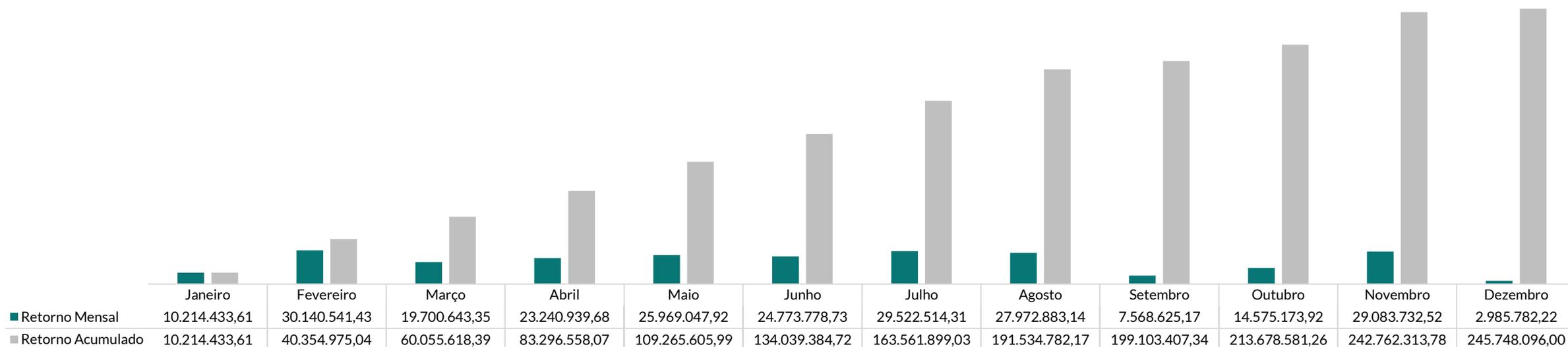
DISCLAIMER

Esta apresentação foi elaborada pela SMI Consultoria de Investimentos, para uso exclusivo dos seus clientes, não podendo ser reproduzida ou distribuída por este a qualquer pessoa ou instituição sem a expressa autorização da SMI Consultoria de Investimentos. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. **Para demais informações, por favor, ligue para (48) 3027 5200.**

Alocação por Benchmark



Retorno Financeiro Acumulado e PL



O patrimônio líquido do IPREVILLE fechou o ano de 2024 em **R\$ 2.954.537.654,02.**



DISCLAIMER

Esta apresentação foi elaborada pela SMI Consultoria de Investimentos, para uso exclusivo dos seus clientes, não podendo ser reproduzida ou distribuída por este a qualquer pessoa ou instituição sem a expressa autorização da SMI Consultoria de Investimentos. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Para demais informações, por favor, ligue para (48) 3027 5200.

Rentabilidade da Carteira e Meta Atuarial

RENTABILIDADE DA CARTEIRA, INDICADORES E META ATUARIAL (INPC + 5,09% A.A.)							
MÊS	CARTEIRA	META	CDI	IMA-G	% META	% CDI	% IMA-G
Janeiro	0,40	0,99	0,97	0,47	41	42	86
Fevereiro	1,18	1,23	0,80	0,64	96	147	184
Março	0,76	0,61	0,83	0,52	126	91	146
Abril	0,89	0,79	0,89	(0,22)	113	100	-404
Mai	0,99	0,88	0,83	0,95	113	118	104
Junho	0,93	0,67	0,79	0,05	139	118	1.972
Julho	1,10	0,68	0,91	1,36	163	121	81
Agosto	1,03	0,27	0,87	0,79	375	118	130
Setembro	0,27	0,90	0,83	0,34	30	32	78
Outubro	0,52	1,03	0,93	0,38	50	56	136
Novembro	1,02	0,75	0,79	0,32	137	129	319
Dezembro	0,10	0,90	0,93	(0,59)	11	11	-17
TOTAL	9,56	10,10	10,87	5,10	95	88	188

Rentabilidade da Carteira por Segmento e Meta Atuarial

Período	Meta	CARTEIRA	RF	TP Curva	MM	FIDC	RV	FIP	FII	IE
31/01/2024	0,99	0,40	-0,17	1,05	1,68	0,73	-4,21	-0,05	0,00	3,99
29/02/2024	1,23	1,18	0,64	1,02	5,69	0,99	0,82	2,33	0,00	6,41
28/03/2024	0,61	0,76	0,32	1,02	3,41	0,33	-0,47	-0,34	0,00	2,99
30/04/2024	0,79	0,89	-0,51	0,71	-3,81	0,33	-2,31	31,93	0,00	-0,40
31/05/2024	0,88	0,99	1,09	0,89	5,07	0,60	-0,33	-0,14	0,00	2,24
28/06/2024	0,67	0,93	-0,30	0,85	3,93	0,70	4,63	0,02	0,00	9,85
31/07/2024	0,68	1,10	1,73	0,79	1,38	-0,73	2,06	0,02	0,00	0,27
30/08/2024	0,27	1,03	0,88	0,72	2,48	3,12	4,05	0,03	0,00	4,33
30/09/2024	0,90	0,27	0,04	0,68	2,34	0,33	-1,76	-2,30	0,00	0,01
31/10/2024	1,03	0,52	0,01	1,05	-0,34	-3,85	0,98	-6,17	0,00	5,45
29/11/2024	0,75	1,01	0,43	0,86	6,02	0,52	0,80	-0,21	0,00	9,07
31/12/2024	0,90	0,10	-0,97	1,02	-1,84	0,22	-1,37	-4,59	0,00	0,48
Acumulado	10,10	9,56	3,20	11,20	28,72	3,20	2,56	17,29	0,00	54,11

Gestão de Risco

MEDIDAS DE RISCO E DESEMPENHO DA CARTEIRA (%)

	MEDIDA	12 MESES
Janeiro/2024	Volatilidade Anualizada	1,9189
	VaR (95%)	3,1573
Dezembro/2024	Volatilidade Anualizada	1,5136
	VaR (95%)	2,4902

Na Gestão de Risco da Política de Investimentos de 2024 do IPREVILLE, ficaram estabelecidos os limites máximos de Volatilidade Anualizada e VaR, de 6,0% e 9,0% respectivamente.

Equipe | SMI Consultoria

Arthur Silva, CEA
arthur@smiconsult.com.br

Eduardo Barão, CPA
eduardo@smiconsult.com.br

Ernesto Meyer
ernesto@smiconsult.com.br

Igor Almeida, MSc
igor@smiconsult.com.br

Rafael Demeneghi, CEA, CGA, CFP
rafael@smiconsult.com.br



DISCLAIMER

Esta apresentação foi elaborada pela SMI Consultoria de Investimentos, para uso exclusivo dos seus clientes, não podendo ser reproduzida ou distribuída por este a qualquer pessoa ou instituição sem a expressa autorização da SMI Consultoria de Investimentos. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. **Para demais informações, por favor, ligue para (48) 3027 5200.**