

PREVIGUABA

Instituto de Previdência dos Servidores
Públicos do Município de Iguaba Grande

ATA N° 487 DE 28 DE ABRIL DE 2023

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Aos vinte e oito dias do mês de abril de 2023, às onze horas na sala do Gabinete da Presidência - do PREVIGUABA, situado na situado na Rua Altieres Mello dos Santos, 20 – Cidade Nova – Iguaba Grande/RJ, reuniu-se o Comitê de Investimentos, com a presença da Presidente do Comitê Rosana Aparecida, os membros Rogerio Maia, Victor Medeiros e Vanessa Ferreira. Recebemos da Empresa de Consultoria Mais Valia o relatório mensal que com uma menor volatilidade, o mês de abril, propiciou retorno positivo à maioria das carteiras de investimentos. O segmento de renda fixa apresentou mais um mês de bons resultados, principalmente pelo fechamento da curva de juros, beneficiando os fundos atrelados as estratégias IMAs. Já na renda variável, após dois meses fechando no vermelho, os principais índices locais, voltaram a apresentar resultado positivo. Já os fundos no exterior, apresentaram resultados ruins, com perspectivas piores com relação à economia global. Apesar de menores em relação aos meses anteriores, os dados inflacionários ainda seguem em foco indicando manutenção de uma política monetária mais restritiva. Principalmente com dúvidas sobre o crescimento econômico local e global em 2023. Neste sentido, é de suma importância a manutenção de uma carteira diversificada. Como dissemos, o fechamento da curva de juros, nos meses de março e abril, garantiu bons resultados em fundos atrelados aos índices IMAs. Mas, mesmo em níveis atuais, os títulos públicos ainda seguem com taxas superiores a grande maioria das metas atuariais, principalmente nos vértices mais longos. Apesar de apresentarem riscos superiores, as letras financeiras seguem com remuneração competitiva, podendo também compor as carteiras de investimentos. Em relação a nossa Carteira de Investimentos, no final do período, a carteira apresentou números de fechamento que evidenciam que suas posições estão em conformidade com os limites definidos nos artigos da Resolução 4.963/2021. A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos ainda não terem sido alcançados (estratégias alvo), fica demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria Política de Investimentos definida para o ano de 2023. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2023 ainda não foram integralmente atingidos. Rentabilidade e Risco (por ativo) As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, demonstra a qualidade e consistência de seus resultados. Distribuição por Benchmarks a carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e em conformidade, com

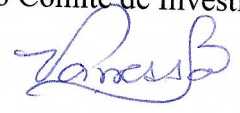
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO Município DE IGUABA GRANDE

R. Altieres Mello dos Santos, 20 Cidade Nova- Iguaba Grande. RJ. CEP 28960 000 .Tel.: 22 2624 1334

diretoria.financeiro@previguaba.rj.gov.br

os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos. Distribuição por Classificação ANBIMA os fundos de investimentos presentes na carteira seguem as características de estratégias e fatores de riscos definidas pela ANBIMA. Esse agrupamento facilita a comparação de performance entre os diferentes fundos, assim como auxilia o processo de decisão de investimento. Distribuição por Gestoras e Administradoras. As gestoras e administradoras dos fundos de investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização do Mercado de Capitais, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos. Retorno da Carteira de Investimentos com uma menor volatilidade o segmento de renda fixa apresentou mais um mês de bons resultados, principalmente pelo fechamento da curva de juros, beneficiando os fundos atrelados as estratégias IMAs. Já na renda variável, os fundos vinculados aos principais índices locais continuaram a apresentar resultados positivos, diferente dos fundos no exterior, que não performaram bem, devido as perspectivas piores com relação a economia global. Retorno dos Fundos de Investimentos os fundos de investimento presentes na carteira são regulados, e estão em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Além de estarem adequados à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2023, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos. Nada mais havendo a tratar eu Vanessa da Silva Ferreira dos Santos, lavrei e assino a presente Ata juntamente com os demais presentes que assim quiseram assinar, Iguaba Grande/RJ, 28 de abril de 2023.

Rosana Aparecida Rodrigues Alves – Presidente do Comitê de Investimento. 

Vanessa da Silva Ferreira dos Santos – Secretária 

Victor Medeiros Mendes da Silva – Membro Comitê de Investimento. 

Rogério Maia Vieira – Membro Comitê de Investimento. 

2023

Relatório Mensal

Abril

Análise dos Investimentos

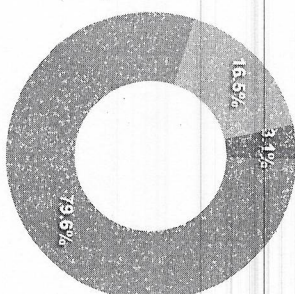
De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.4, item 3.2.6 Nível 1, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei	
BB ÁGIL FIC RENDA FIXA SIMPLES	229.848,73	0,36%	16.165.094.327,87	0,00%	7º I b	Investimentos
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.744.486,75	7,44%	5.073.029.012,42	0,09%	7º I b	\$ 63.810.785,28
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.831.261,41	20,11%	8.356.195.901,98	0,15%	7º I b	Disponibilidades Financeiras
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3.230.337,30	5,06%	160.380.050,03	2,01%	7º I b	\$ 5.186.188,83
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.968.696,64	7,79%	1.969.463.967,87	0,25%	7º I b	Total Carteira
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1.079.459,87	1,69%	171.555.881,20	0,63%	7º I b	\$ 68.996.974,11
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.711.124,10	5,82%	4.036.788.225,11	0,09%	7º III a	Governança (Pró Gestão)
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.398.283,34	16,30%	7.884.712.793,21	0,13%	7º III a	\$ 27
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	9.500.126,30	14,89%	270.704.363,69	3,51%	7º V a	
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	95.842,56	0,15%	34.145.228,14	0,28%	8º I	
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	101.559,62	0,16%	220.872.179,79	0,05%	8º I	
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	311.682,29	0,49%	248.081.731,30	0,13%	8º I	
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1.493.003,80	2,34%	32.911.752,14	4,54%	8º I	
SCMMA BRASIL FI AÇÕES	7.082.128,04	11,10%	292.548.773,75	2,42%	8º I	
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	1.547.070,96	2,42%	259.095.014,27	0,60%	8º I	
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	514.777,85	0,81%	108.431.126,16	0,47%	10º II	
HAZ FII - ATCR11	1.685.629,60	2,64%	0,00		11º	
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	285.466,12	0,45%	0,00		11º	

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	39,25%	27.084.090,70 60,75%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	34,22%	23.609.533,74 25,78%
7º V a - FIDC Cota Sênior	5,00%	0,14%	95.842,56 4,86%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	15,27%	10.535.444,71 14,73%
10º II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	0,75%	514.777,85 4,25%
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	2,86%	1.971.095,72 2,14%

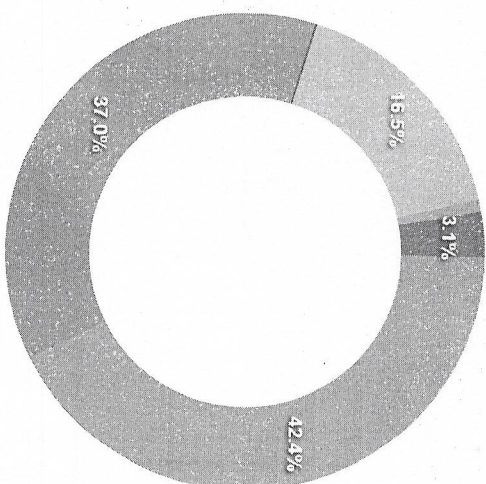
Governança (Pró Gestão)
☒ Não possui

Segmentos



Renda Fixa
Renda Variável
Estruturados
Fundo Imobiliário

Artigos

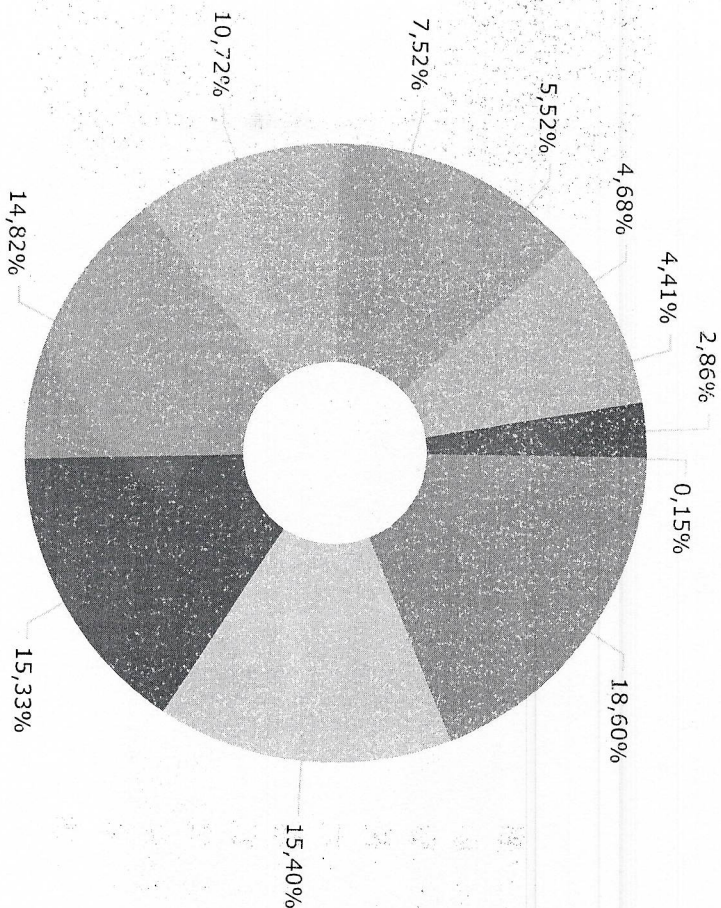


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	2,00%	100,00%	68.996.974,11	8º I - Fundos de Ações	15,27%	0,00%	25,00%	30,00%	10.163.647,52
7º I b - FI 100% Títulos TN	39,25%	0,00%	29,00%	100,00%	41.912.883,41	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	20.699.052,23
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	68.996.974,11	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.899.697,41
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.449.848,71	9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.899.697,41
7º III a - FI Referenciados RF	34,22%	0,00%	22,00%	60,00%	17.788.650,73	9º III - Ações - BDR Nível I	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	6.899.697,41
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	41.398.184,47	10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	6.899.697,41
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	13.799.394,82	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,75%	0,00%	1,00%	5,00%	2.935.070,86
7º V a - FIDC Cola Sênior	0,14%	0,00%	1,00%	5,00%	3.354.006,15	10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.449.848,71
7º V b - Fundos de RF - Crédito...	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	3.449.848,71	11º - Fundos Imobiliários	2,86%	0,00%	4,00%	5,00%	1.478.752,99
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	3.449.848,71	12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.449.848,71

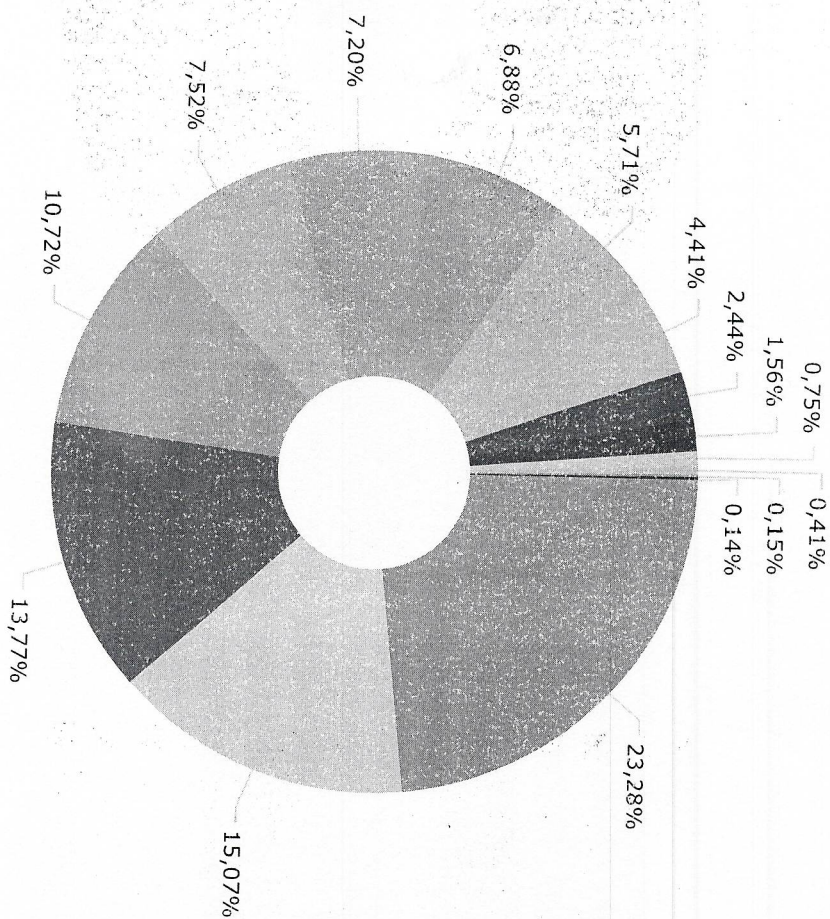
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK								
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,92	4,20	3,04	6,44	13,37	21,40		
PREMIUM FIDC SENIOR 1	0,83	3,85	2,79	5,90	12,26	18,91	0,00	0,01
	-0,40	-0,94	-0,60	10,70	-55,39	-57,89	0,49	1,03
IBOVESPA - BENCHMARK								
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	2,50	-4,93	-7,93	-10,00	-3,19	-12,16		
SOMMA BRASIL FIC AÇÕES	2,14	-6,49	-10,14	-15,69	-6,95	-21,60	9,08	19,13
	2,43	-8,85	-12,11	-14,20	-10,23	-21,78	8,85	18,64
IBX - BENCHMARK								
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	1,93	-5,48	-8,69	-10,82	-4,80	-14,46		
QUELUZ VALOR FIC AÇÕES	0,56	-7,56	-14,67	-22,60	-20,35	-35,37	14,29	30,11
	5,18	-1,51	-3,76	-9,03	-30,93	-43,74	12,00	25,27
IDIV - BENCHMARK								
CAIXA DIVIDENDOS FIC AÇÕES	3,89	-0,36	-5,90	-1,19	2,52	6,38		
	3,67	-0,76	-6,10	-1,66	1,37	4,32	7,84	16,51
IMA-B - BENCHMARK								
SULAMÉRICA INFLATIE FIC RENDA FIXA LP	2,02	6,08	6,08	5,03	8,78	13,88		
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,69	5,47	5,27	4,31	8,56	8,34	1,29	2,72
	1,96	6,00	6,07	4,18	7,05	12,53	2,01	4,23
IMA-B 5 - BENCHMARK								
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	0,90	5,33	3,67	5,96	9,67	20,04		
	0,89	5,25	3,82	5,85	9,56	19,64	0,60	1,27
IMA-B 5+ - BENCHMARK								
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3,03	6,75	8,11	4,24	8,12	8,09		
	3,01	6,66	8,04	4,12	7,87	7,57	2,76	5,80
IPCA - BENCHMARK								
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,61	2,72	2,18	3,78	4,18	16,82		
	0,87	4,15	3,08	5,43	11,67	14,62	0,20	0,42

28/04/2023

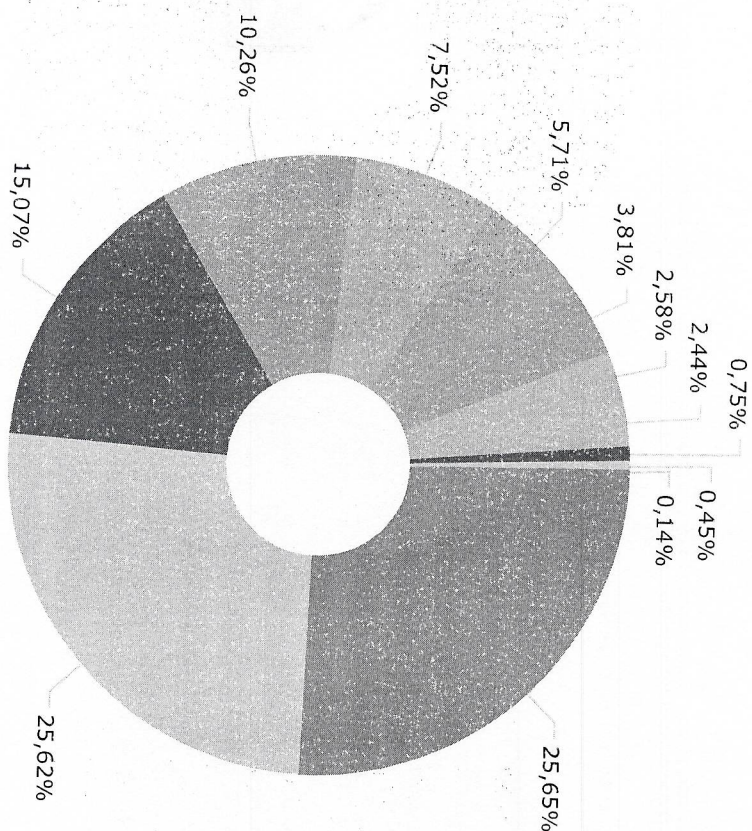
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var - Mês	Volatilidade - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,23	5,40	4,87	3,93	9,88	18,27	1,42	2,98
LSH FIP MULTISTRATÉGIA	-0,06	-0,24	-0,18	-0,37	-0,89	-1,69		
SELIC - BENCHMARK								
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,92	4,20	3,04	6,44	13,37	21,40		
BB ÁGIL FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,90	4,13	2,97	6,46	13,74	22,51	0,02	-0,04
	0,76	3,53	2,56	5,41	11,20		0,00	0,01
IFIX - BENCHMARK								
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLSJ11	3,52	-0,31	1,31	-4,45	1,61	-0,10		
HAZ FII - ATCR11								



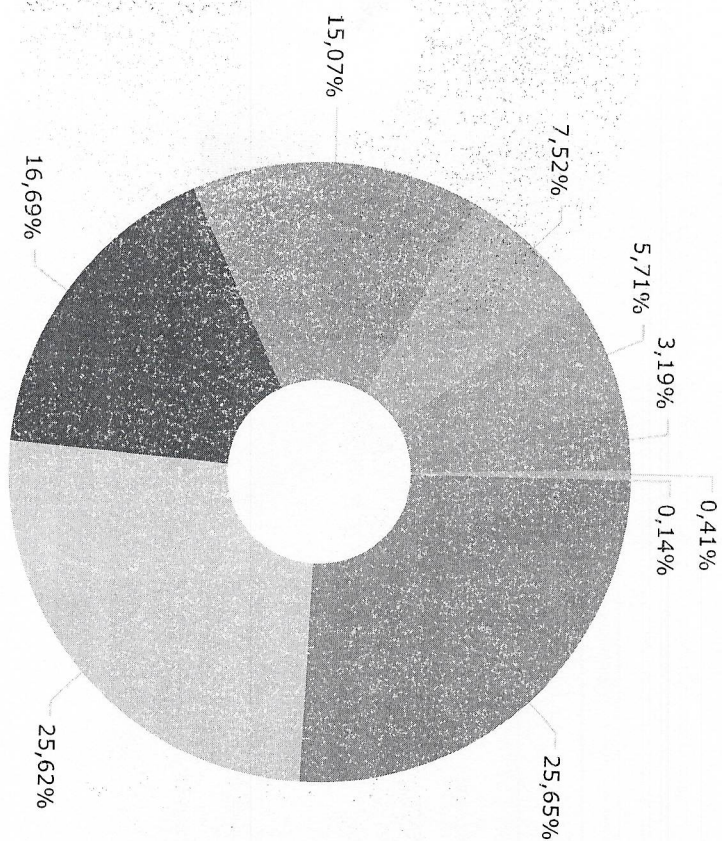
IMA-B 5	12.831.261,41
Selic	10.628.132,07
IMA-B	10.579.586,17
IPCA	10.227.961,24
Ibovespa	7.393.810,33
Disponibilidades Financeiras	5.186.188,83
CDI	3.806.966,66
IMA-B 5+	3.230.337,30
IBX	3.040.074,76
IFIX	1.971.095,72
IDIV	101.559,62



Renda Fixa Indexados	16.061.598,71
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	10.398.283,34
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	9.500.126,30
Ações Índice Ativo	7.393.810,33
Disponibilidades Financeiras	5.186.188,83
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	4.968.696,64
Renda Fixa Duração Livre Soberano	4.744.486,75
Renda Fixa Simples	3.940.972,83
Ações Livre	3.040.074,76
FII Desenvolvimento para Venda Gestão Ativa	1.685.629,60
Renda Fixa Duração Alta Soberano	1.079.459,87
Fundos de Participações	514.777,85
FII Renda Gestão Ativa	285.466,12
Ações Dividendos	101.559,62
FIDC Outros	95.842,56



ITAU UNIBANCO S.A.	17.699.160,24
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	17.677.307,78
BRAM - BRADESCO ASSET MANEGEME...	10.398.283,34
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.	7.082.128,04
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	5.186.188,83
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	3.940.972,83
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GEST...	2.626.530,83
QLZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCE...	1.778.469,92
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA.	1.685.629,60
RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VAL...	514.777,85
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE...	311.682,29
PETRA CAPITAL GESTÃO DE INVEST...	95.842,56



ITAU UNIBANCO S.A.	17.699.160,24
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	17.677.307,78
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	11.513.344,96
BANCO BRADESCO S.A.	10.398.283,34
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	5.186.188,83
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	3.940.972,83
RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VAL...	2.200.407,45
PLANNER CORRETORA DE VALORES S...	285.466,12
FINAXIS CORRETORA DE TÍTULOS E...	95.842,56