

PREVIGUABA

Instituto de Previdência dos Servidores
Públicos do Município de Iguaba Grande

ATA Nº 485 DE 31 DE MARÇO DE 2023

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

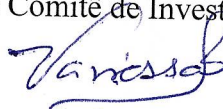
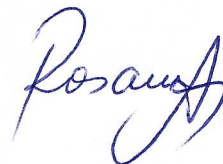
Aos trinta e um dias do mês de março de 2023, às onze horas na sala do Gabinete da Presidência - do PREVIGUABA, situado na situado na Rua Altieres Mello dos Santos, 20 – Cidade Nova – Iguaba Grande/RJ, reuniu-se o Comitê de Investimentos, com a presença da Presidente do Comitê Rosana Aparecida, os membros Rogerio Maia, Victor Medeiros e Vanessa Ferreira. As perspectivas de crescimento de importantes economias no mundo melhoraram no primeiro trimestre de 2023, em relação ao que se esperava no fim do ano passado. Uma nova fonte de atenção, porém, surgiu com a quebra de bancos regionais nos Estados Unidos, seguida de dificuldades em bancos europeus. No entanto, o problema tem sido contornado e não impediu os bancos centrais de Estados Unidos e Europa de continuar aumentando suas taxas básicas de juros. No Brasil, desde o último trimestre do ano passado, o comportamento dos indicadores setoriais indica desaceleração bastante disseminada da atividade econômica, e este quadro se manteve nos primeiros meses de 2023. O mercado de trabalho vem mostrando sinais de arrefecimento, caracterizado por leve aceleração da taxa de desocupação, refletindo a perda de dinamismo da população ocupada. Em contrapartida, o aumento dos rendimentos médios tem possibilitado o crescimento da massa salarial. Os dados mais recentes mostram que o processo de desinflação da economia brasileira vem se consolidando nos últimos meses, embora tanto os índices de preços ao consumidor quanto as médias dos núcleos de inflação ainda se encontrem em patamares relativamente elevados. No front fiscal, após as contas públicas fecharem 2022 com números bastante positivos, a expectativa para o ano corrente é de redução do resultado primário do setor público consolidado. Esperamos que, no primeiro trimestre de 2023, o PIB brasileiro avance 1,2% na comparação, com ajuste sazonal, com o último trimestre de 2022, e tenha alta de 2,7% sobre o primeiro trimestre do ano passado. Para o acumulado em 2023, o cenário considera que a economia se recupera progressivamente ao longo do ano, registrando crescimento de 1,4%. Apontamos, ainda, para uma expansão do PIB de 2,0% em 2024. As projeções do Grupo de Conjuntura do Ipea para o IPCA indicam que a inflação acumulada em 2023 deve manter-se no nível atual, encerrando o ano em 5,6%. Nota-se, entretanto, que, na comparação com a estimativa anterior (4,9%), divulgada em dezembro de 2022, houve revisão para cima, decorrente do desempenho menos favorável dos preços administrados e dos serviços. De modo similar, a projeção para o INPC para 2023 também foi revista, passando de 4,6% para 5,5%. 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, 31 de março 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 e 1º trimestre de 2023

Março

Análise dos Investimentos

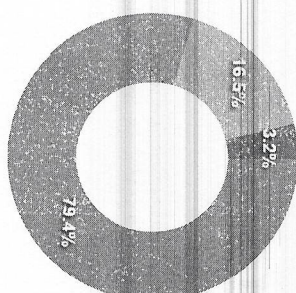
De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.703.425,22	7,57%	5.074.930,034,52	0,09%	7º I b	Investimentos
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.718.671,32	20,47%	8.067.452,652,34	0,16%	7º I b	\$ 62.133.273,82
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3.136.040,73	5,05%	148.557,375,44	2,11%	7º I b	Disponibilidades Financeiras
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.908.521,68	7,90%	2.028.549,843,89	0,24%	7º I b	\$ 4.763.683,29
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1.061.572,24	1,71%	167.996,353,33	0,63%	7º I b	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.114.248,47	5,01%	3.847.917,325,94	0,08%	7º III a	Total Carteira
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.305.895,72	16,59%	7.612.606,824,57	0,14%	7º III a	\$ 66.896.957,11
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	9.317.768,90	15,00%	270.098,060,28	3,45%	7º III a	Governança (Pró Gestão)
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	96.224,22	0,15%	34.281,200,44	0,28%	7º Va	\$
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	97.959,74	0,16%	215.135,718,36	0,05%	8º I	
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	305.144,89	0,49%	244.265,939,23	0,12%	8º I	
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1.419.431,89	2,28%	31.419,171,24	4,52%	8º I	
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	6.913.812,98	11,13%	286.509,098,08	2,41%	8º I	
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	1.538.380,15	2,48%	271.266,935,39	0,57%	8º I	
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	515.088,23	0,83%	108.496,503,35	0,47%	10º II	
HAZ FII - ATCR11	1.684.997,74	2,71%	0,00		11º	
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	296.089,70	0,48%	0,00		11º	

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	39,70%	26.528.231,19 60,30%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	34,03%	22.737.913,09 25,97%
7º V a - FIDC Cota Sênior	5,00%	0,14%	96.224,22 4,86%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	15,38%	10.274.729,65 14,62%
10º II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	0,77%	515.088,23 4,23%
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	2,96%	1.981.087,44 2,04%

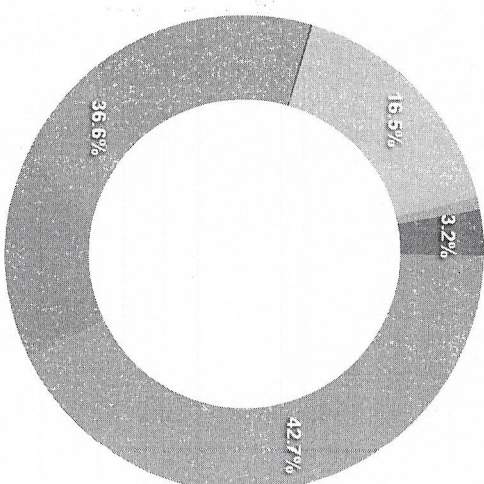
Governança (Pró Gestão)
Não possui

Segmentos



Renda Fixa
Renda Variável
Estruturados
Fundo Imobiliário

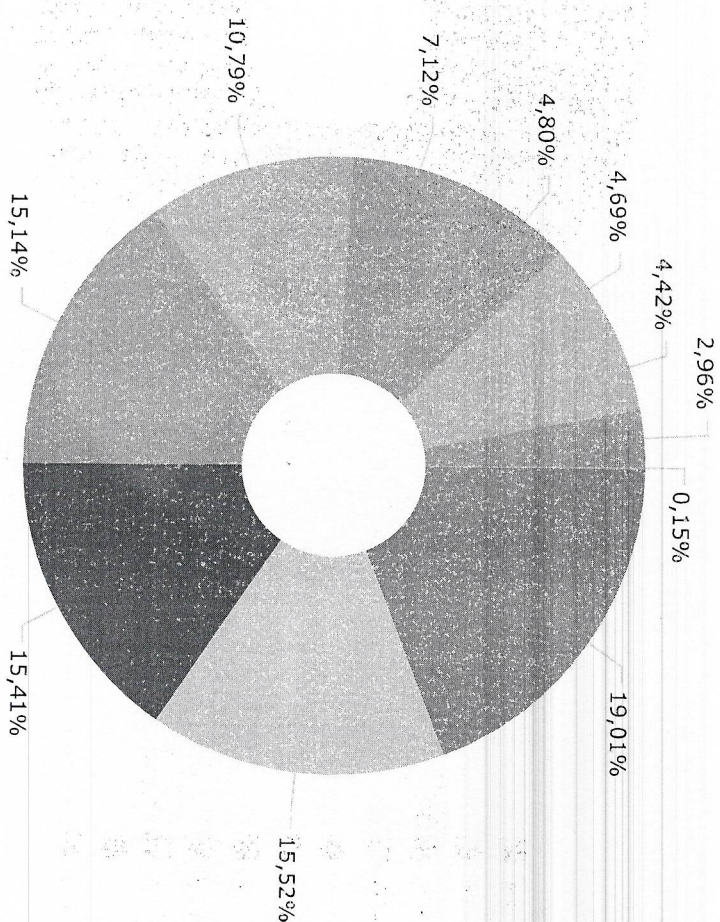
Artigos



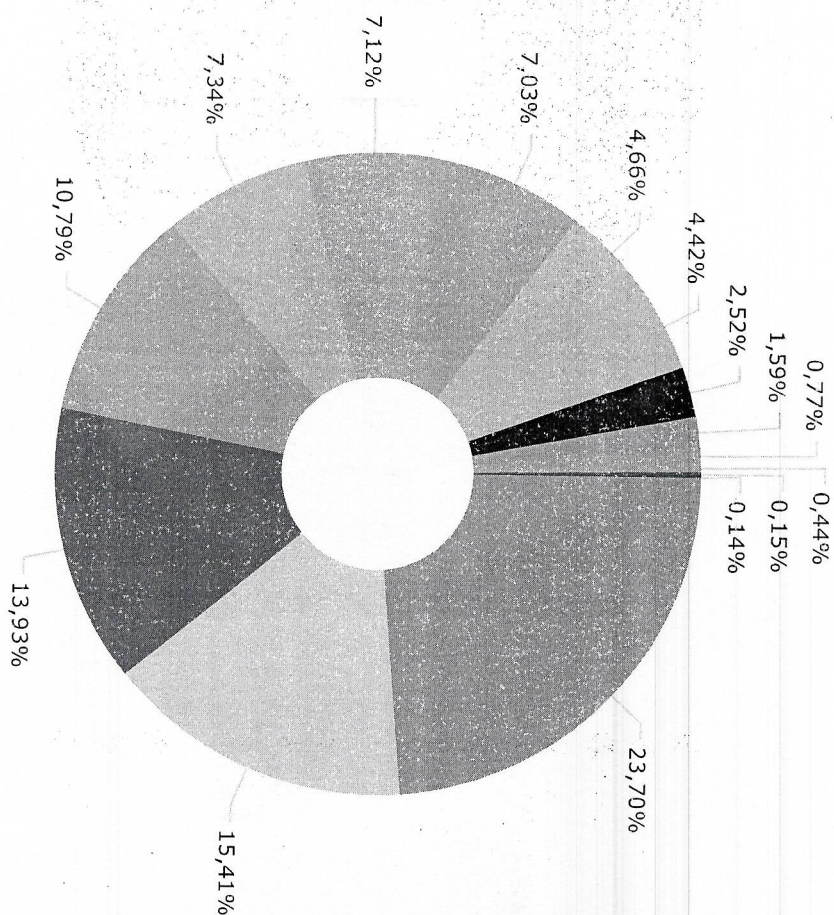
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	2,00%	100,00%	66.818.892,67	8º I - Fundos de Ações	15,38%	0,00%	25,00%	30,00%	9.770.938,15
7º I b - FI 100% Títulos TN	39,70%	0,00%	29,00%	100,00%	40.290.661,48	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	20.045.667,80
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	66.818.892,67	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.681.889,27
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.340.944,63	9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.681.889,27
7º III a - FI Referenciados RF	34,03%	0,00%	22,00%	60,00%	17.353.422,51	9º III - Ações - BDR Nível I	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	6.681.889,27
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	40.091.335,60	10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	6.681.889,27
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	13.363.778,53	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,77%	0,00%	1,00%	5,00%	2.825.856,40
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,14%	0,00%	1,00%	5,00%	3.244.720,41	10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.340.944,63
7º V b - Fundos de RF - Crédito...	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	3.340.944,63	11º - Fundos Imobiliários	2,96%	0,00%	4,00%	5,00%	1.359.857,19
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	3.340.944,63	12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.340.944,63

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54		
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,08	2,99	2,99	6,03	12,15	18,06	0,01	0,03
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,43	-0,55	-0,55	10,67	-55,33	-57,76	0,09	0,19
IBOVESPA - BENCHMARK	-2,91	-7,16	-7,16	-7,44	-15,10	-12,65		
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	-4,35	-8,45	-8,45	-12,67	-17,99	-20,67	8,65	18,22
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	-4,91	-11,02	-11,02	-12,44	-19,61	-21,23	8,96	18,87
IBX - BENCHMARK	-3,07	-7,27	-7,27	-7,64	-16,05	-13,70		
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	-7,17	-8,08	-8,08	-14,06	-26,70	-29,79	13,91	29,29
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-3,62	-6,36	-6,36	-35,51	-40,61	-45,07	13,67	28,79
IDIV - BENCHMARK	-2,02	-4,08	-4,08	-1,06	-6,43	4,48		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,06	-4,28	-4,28	-1,50	-7,17	2,17	6,94	14,61
IMA-B - BENCHMARK	2,66	3,98	3,98	4,22	7,51	12,36		
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	2,12	3,72	3,72	3,94	8,13	7,52	1,28	2,70
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2,79	3,96	3,96	3,46	5,77	11,27	1,88	3,95
IMA-B 5 - BENCHMARK	1,52	4,38	4,38	7,03	10,38	20,01		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,50	4,32	4,32	6,89	10,27	19,62	0,89	1,86
IMA-B 5+ - BENCHMARK	3,73	3,61	3,61	1,83	5,03	5,39		
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3,70	3,54	3,54	1,72	4,78	4,87	2,42	5,10
IPCA - BENCHMARK	0,71	2,09	2,09	3,76	4,65	16,48		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,21	3,25	3,25	5,55	11,71	14,38	0,19	0,39

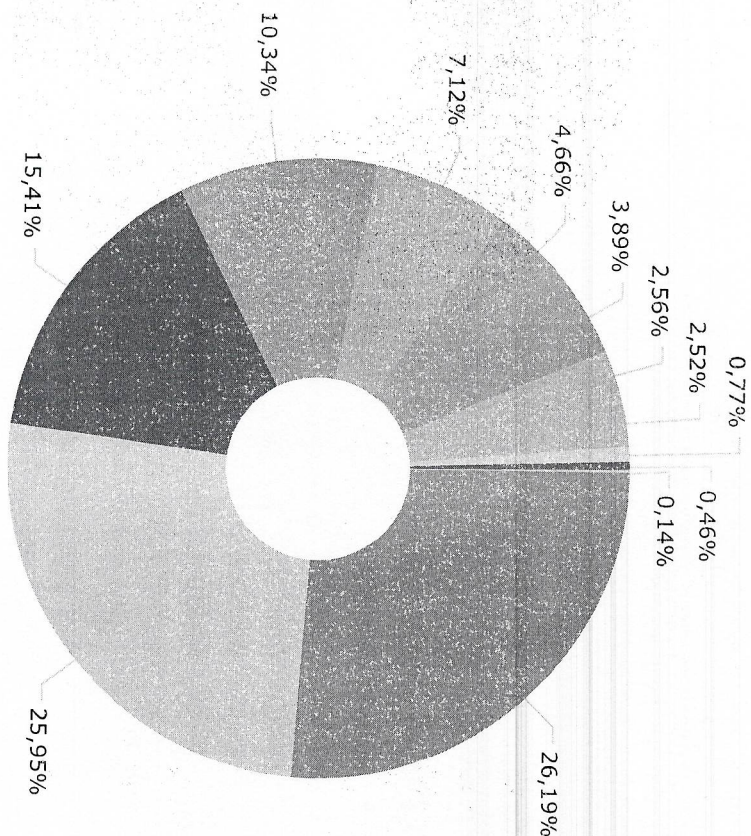
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,43	4,12	4,12	3,57	9,39	16,97	1,62	3,42
LSH FIP MULTISTRATÉGIA	-0,06	-0,18	-0,18	-0,37	-0,89	-1,69		
SELLC - BENCHMARK								
	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,17	3,21	3,21	6,65	13,70	21,72	0,03	0,06
FIX - BENCHMARK								
	-1,69	-3,70	-3,70	-7,68	-0,68	-3,01		
HAZ FIL - ATCR11								
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FIL - VLJS11								



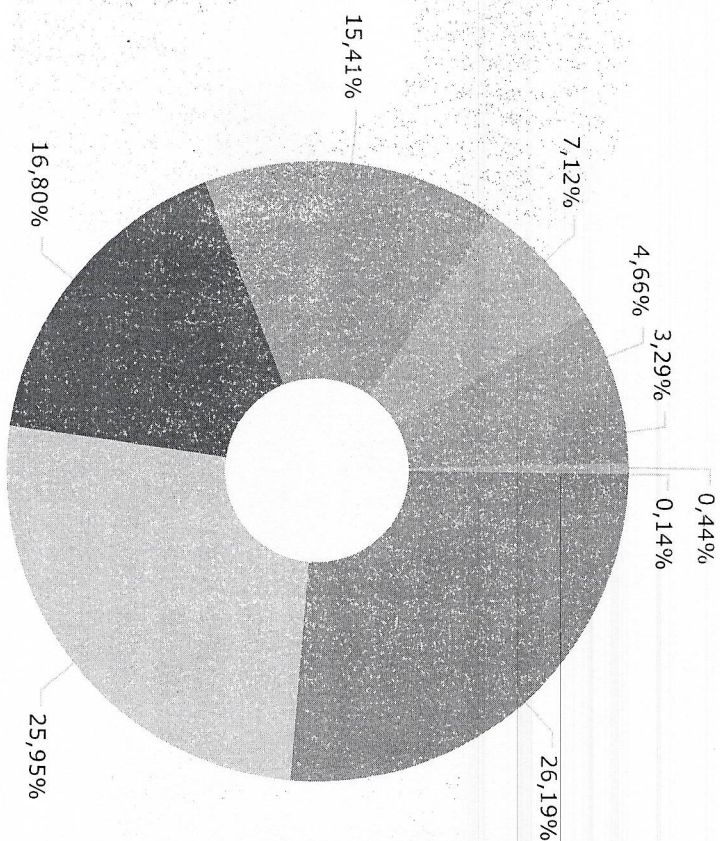
IMA-B 5	12.718.671,32
IMA-B	10.379.341,14
Selic	10.305.895,72
IPCA	10.127.035,13
Ibovespa	7.218.957,87
Disponibilidades Financeiras	4.763.683,29
CDI	3.210.472,69
IMA-B 5 +	3.136.040,73
IBX	2.957.812,04
IFIX	1.981.087,44
IDIV	97.959,74



Renda Fixa Indexados	15.854.712,05
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	10.305.895,72
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	9.317.768,90
Ações Índice Ativo	7.218.957,87
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	4.908.521,68
Disponibilidades Financeiras	4.763.683,29
Renda Fixa Duração Livre Soberano	4.703.425,22
Renda Fixa Simples	3.114.248,47
Ações Livre	2.957.812,04
FII Desenvolvimento para Venda Gestão Ativa	1.684.997,74
Renda Fixa Duração Alta Soberano	1.061.572,24
Fundos de Participações	515.088,23
FII Renda Gestão Ativa	296.089,70
Ações Dividendos	97.959,74
FIDC Outros	96.224,22



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	17.520.056,28
ITAU UNIBANCO S.A.	17.362.331,31
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEN...	10.305.895,72
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.	6.913.812,98
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	4.763.683,29
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	3.114.248,47
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GEST...	2.599.952,39
QI2 GESTÃO DE RECURSOS FINANCE...	1.715.521,59
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA.	1.684.997,74
RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VAL...	515.088,23
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE...	305.144,89
PETRA CAPITAL GESTÃO DE INVEST...	96.224,22



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	17.520.056,28
ITAU UNIBANCO S.A.	17.362.331,31
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	11.238.342,15
BANCO BRADESCO S.A.	10.305.895,72
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	4.763.683,29
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	3.114.248,47
RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VAL...	2.200.085,97
PLANNER CORRETORA DE VALORES S...	296.089,70
FINAXIS CORRETORA DE TÍTULOS E...	96.224,22