

PREVIGUABA

Instituto de Previdência dos Servidores
Públicos do Município de Iguaba Grande

ATA Nº 532 DE 14 DE FEVEREIRO DE 2024

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Aos quatorze dias do mês de fevereiro de 2024, às dezenove horas e quinze minutos na sala do Gabinete da Presidência - do PREVIGUABA, 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 de Investimentos Rosana Aparecida, os membros Rogério Maia, Victor Medeiros, Flávia Canelas e Vanessa Ferreira. Recebemos da Empresa de Consultoria Mais Valia, a análise do primeiro mês do ano começou amargo para a maioria das carteiras de investimentos. Após um bom retorno no ano de 2023, o retorno do primeiro mês do ano de 2024, dificilmente superará a meta. Os ativos ligados a renda fixa, fecharam com sinais mistos, com o CDI e Títulos Públicos levados ao vencimento com resultados positivos e os fundos atrelados a inflação com desempenho negativo. Já na renda variável o desempenho foi em sentido único, todos os ativos fecharam em forte baixa com maiores incertezas no mercado. Já os ativos no exterior fecharam no positivo principalmente pelo desempenho do dólar frente ao real no mês de janeiro e as valorizações históricas de alta dos principais índices do mercado acionário americano. Sobre nossa carteira de investimentos 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 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 2024. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2024 ainda não foram atingidos diante das oportunidades que o mercado ofereceu como boas alternativas. 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 os objetivos da política de investimentos, e de rentabilidade e liquidez pretendidos. 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. As gestoras e administradoras dos fundos de investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização, estão presentes na lista exaustiva da SPREV, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos. No segmento de renda fixa, os ativos fecharam com sinais mistos, com o CDI e Títulos Públicos levados ao vencimento com resultados positivos e os fundos atrelados a inflação com

desempenho negativo. Já na renda variável o desempenho não foi satisfatório devido as incertezas em relação ao novo ano no mercado. Já os ativos no exterior fecharam no positivo principalmente pelo desempenho do dólar frente ao real no mês de janeiro e as valorizações históricas de alta dos principais índices do mercado acionário americano. 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 2024, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos. O Comitê de Investimentos do PREVIGUABA IGUABA GRANDE - RJ analisou o relatório de investimentos referente ao mês Janeiro/2024, atestando os dados relativos à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos. O Conselho Fiscal do PREVIGUABA IGUABA GRANDE - RJ analisou, conferiu e aprovou o relatório de investimentos, referente ao mês Janeiro/2024 bem como o parecer do Comitê de Investimentos, que tratam do acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do PREVIGUABA IGUABA GRANDE - RJ e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos. 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, 14 de fevereiro de 2024.

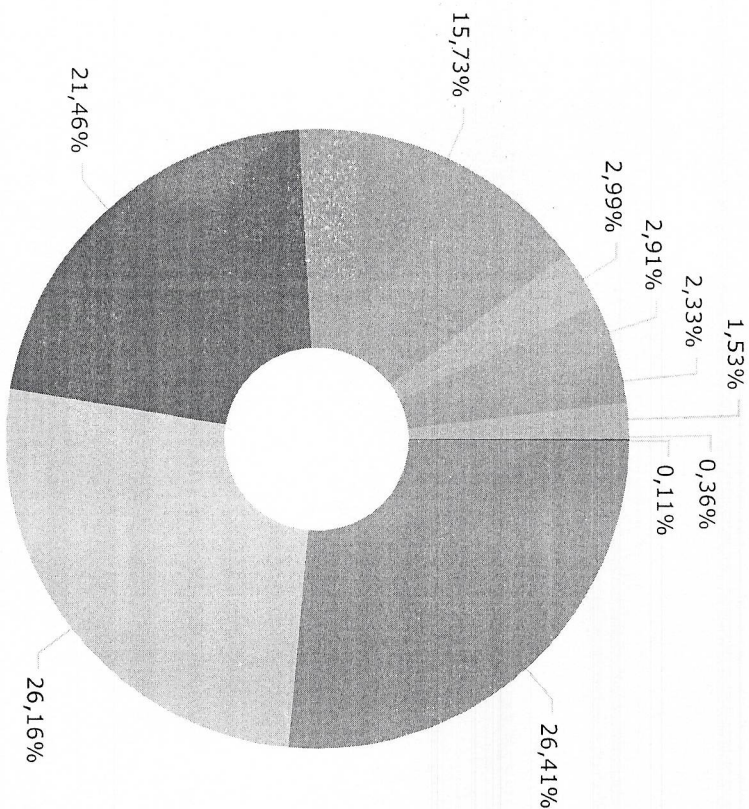
Rosana Aparecida Rodrigues Alves – Presidente do Comitê de Investimento.

Vanessa da Silva Ferreira dos Santos – Secretária.

Flávia Canelas - Membro Comitê de Investiemntos.

Victor Medeiros Mendes da Silva – Membro Comitê de Investimento.

Rogério Maia Vieira – Membro Comitê de Investimento.



ITAU UNIBANCO S.A.	19.254.870,93
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	19.072.438,67
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	15.643.216,08
BANCO BRADESCO S.A.	11.469.696,20
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.183.173,27
RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VAL...	2.120.323,20
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	1.700.228,12
S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA...	1.117.627,44
PLANNER CORRETORA DE VALORES S...	264.697,21
FINAXIS CORRETORA DE TÍTULOS E...	82.213,97

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	73.693.056,65	1.567.328,09	336.192,17	74.347.798,04	-576.394,53	-576.394,53	-0,77% ▼	-0,77%	0,99%	0,99%	-77,78%	1,88%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

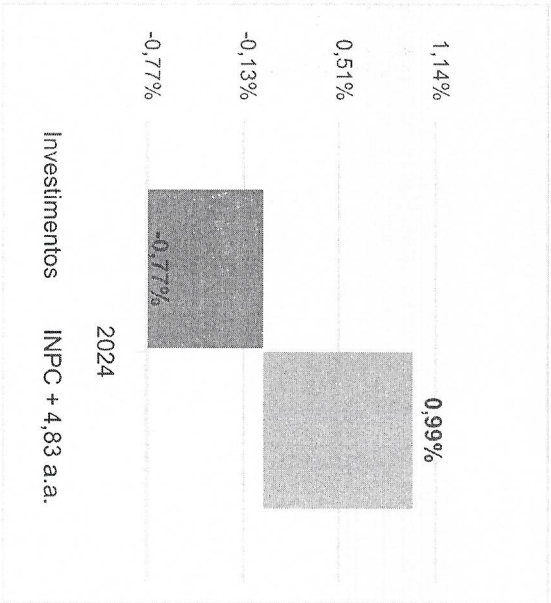
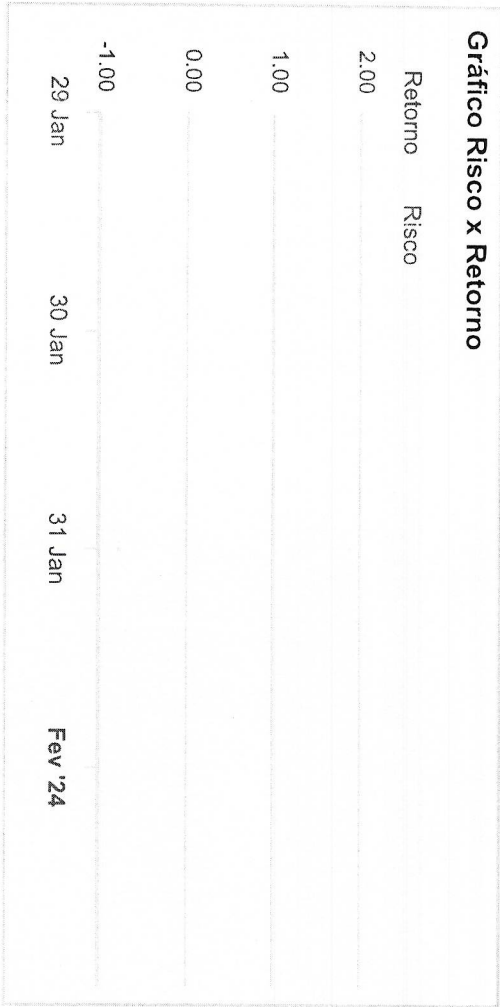
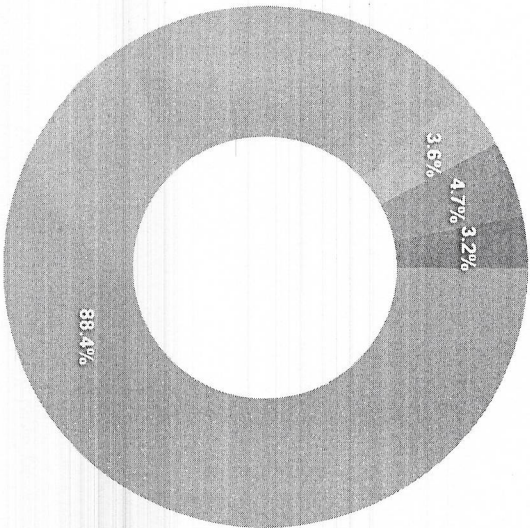


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 31/01/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	67.670.095,94	88,42
Até D+180	2.771.154,77	3,62
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	3.622.486,22	4,73
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	2.467.234,38	3,22



RENDIA FIXA		Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - Var
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO		9.152,81	1.567.328,09	151.619,93	1.431.943,24	7.082,27	0,45% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		265.323,68	0,00	0,00	268.284,88	2.961,20	1,12% ▲	0,33%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO		67.458,00	0,00	67.723,53	0,00	265,53	0,39% ▲	0,01%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI		11.346.396,32	0,00	0,00	11.469.696,20	123.299,88	1,09% ▲	0,07%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA		5.174.392,34	0,00	0,00	5.208.288,38	33.896,04	0,66% ▲	0,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		13.650.140,53	0,00	0,00	13.740.761,83	90.621,30	0,66% ▲	0,55%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA		1.033.243,45	0,00	0,00	1.044.704,09	11.460,64	1,11% ▲	0,33%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA		3.603.622,34	0,00	0,00	3.550.243,40	-53.378,94	-1,48% ▼	2,03%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA		12.507.400,07	0,00	0,00	12.437.595,89	-69.804,18	-0,56% ▼	1,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA		2.211.809,92	0,00	0,00	2.222.327,55	10.517,63	0,48% ▲	0,65%
LF BRADESCO 20/10/2025 IPCA + 6,22%		2.546.802,34	0,00	0,00	2.574.328,94	27.526,60	1,08% ▲	-
LF BRADESCO 21/07/2025 IPCA + 5,68%		1.037.371,14	0,00	0,00	1.048.157,28	10.786,14	1,04% ▲	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1		82.832,96	0,00	0,00	82.213,97	-618,99	-0,75% ▼	0,31%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP		1.159.944,94	0,00	0,00	1.156.539,65	-3.405,29	-0,29% ▼	1,21%
		54.695.890,84	1.567.328,09	219.343,46	56.235.085,30	191.209,83	0,34%	0,73%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	127.913,24	0,00	0,00	123.388,46	-4.524,78	-3,54% ▼	4,60%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	1.154.646,86	0,00	0,00	1.117.627,44	-37.019,42	-3,21% ▼	7,14%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.084.971,69	0,00	0,00	1.047.774,41	-37.197,28	-3,43% ▼	6,30%
FINACAP MAURITSTAD FIAÇÕES	533.266,77	0,00	0,00	504.535,18	-28.731,59	-5,39% ▼	6,58%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	392.503,43	0,00	0,00	378.480,23	-14.023,20	-3,57% ▼	6,83%
PLURAL DIVIDENDOS FIAÇÕES	529.177,92	0,00	0,00	513.595,76	-15.582,16	-2,94% ▼	5,07%
QLZ MOS FIAÇÕES	2.072.190,77	0,00	0,00	1.997.931,77	-74.259,00	-3,58% ▼	8,57%
SOMMA BRASIL FIAÇÕES	8.794.020,90	0,00	0,00	8.390.831,75	-403.189,15	-4,58% ▼	5,41%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	1.805.780,44	0,00	0,00	1.653.527,33	-152.253,11	-8,43% ▼	7,54%
-	16.494.472,02	0,00	0,00	15.727.692,33	-766.779,69	-4,65%	6,27%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - Var
LSH FIP MULTISTRATÉGIA	512.129,52	0,00	0,00	511.787,09	-342,43	-0,07% ▼	-
-	512.129,52	0,00	0,00	511.787,09	-342,43	-0,07%	0,00%