

Goiás Previdência



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS – FUNDO PREVIDENCIÁRIO
AGOSTO - 2022
Goiás Previdência

Goiânia - GO



Sumário

1	INTRODUÇÃO.....	2
1.1	Comentários do mês	2
2	DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA	3
3	RESGATE, CUSTO DAS APLICAÇÕES E ENQUADRAMENTO LEGAL	4
4	MOVIMENTAÇÕES E RENTABILIDADE – CONSOLIDADO AGOSTO 2022.....	5
5	RENTABILIDADE E RISCO DOS ATIVOS – AGOSTO 2022.....	6
6	MOVIMENTAÇÕES – AGOSTO 2022	7



1 INTRODUÇÃO

Com foco nos interesses do segurado e total transparência, a Goiás Previdência apresenta o relatório de investimentos referente ao mês de agosto de 2022, refletindo todas as decisões do Comitê de Investimentos, com intuito de garantir a sustentabilidade e segurança das aplicações. Neste relatório é possível observar a distribuição dos investimentos realizados, a demonstração dos custos envolvendo essas aplicações, assim como a rentabilidade obtida e as movimentações do mês.

1.1 Comentários do mês

O mês finalizou positivo para o mercado brasileiro, com o Ibovespa fechando agosto aos 109.522 pontos, acumulando alta de 6,16% no período. O dólar comercial encerrou o mês em R\$ 5,20, com alta de 0,53% em relação ao mês anterior. A taxa Selic é de 13,75% ao ano e o IPCA acumulado se encontra em 8,73%.

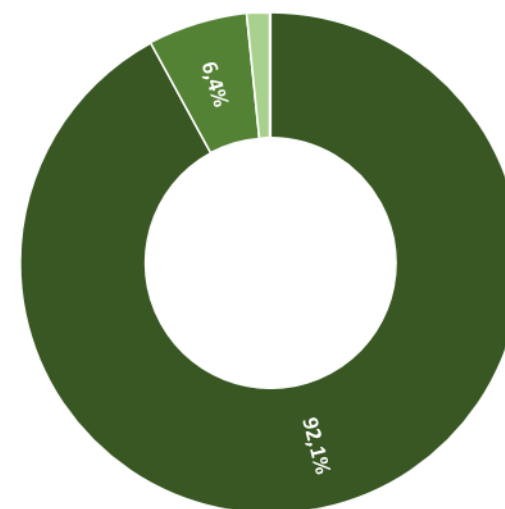
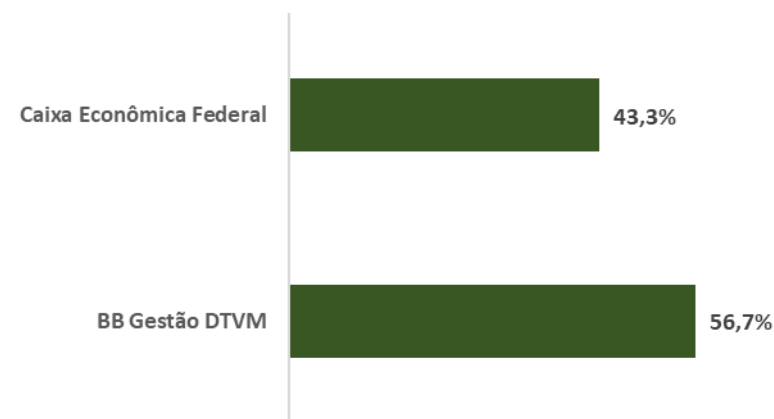
No mercado internacional as perspectivas econômicas dos Estados Unidos e da Europa movimentaram o mercado no mês de agosto. Enquanto os dados de atividade econômica seguem dando sinais de melhora e a inflação cai nos Estados Unidos, a Europa continua apresentando um cenário, ao menos temporário, de estagflação. Além disso, as expectativas em relação ao crescimento global continuam diminuindo, principalmente pela queda da perspectiva de avanço da economia chinesa em 2022 e das pressões trazidas pelo modelo econômico suportado por investimentos em infraestrutura e no mercado imobiliário. No Brasil, o mercado demonstra animação com a queda na taxa de desemprego e com o resultado econômico registrado no segundo trimestre, porém, ainda há uma preocupação devido as eleições presidenciais e seus riscos políticos.



2 DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA

	CNPJ	%	AGOSTO	%	JULHO
FUNDOS DE RENDA FIXA		92,1%	99.676.398,05	91,7%	93.750.220,55
BB PREV RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	6,0%	6.550.579,20	6,3%	6.472.631,24
BB PREV IMA-B 5	03.543.447/0001-03	6,2%	6.679.986,82	6,5%	6.679.578,40
BB PREV RF IDKA 2	13.322.205/0001-35	6,1%	6.654.323,17	6,5%	6.657.289,66
BB PREV RF FLUXO	13.077.415/0001-05	2,4%	2.547.093,02	7,9%	8.125.372,02
BB PREV RF PERFIL	13.077.418/0001-49	6,7%	7.252.019,48	7,0%	7.167.209,50
BB PREVI TP IPCA (VÉRTICE)	15.486.093/0001-83	25,0%	27.028.719,13	21,0%	21.457.711,50
CAIXA 2023 TP RF (VÉRTICE)	44.683.378/0001-02	5,7%	6.143.305,68	6,0%	6.152.043,15
CAIXA IRF-M 1 TP	10.740.670/0001-06	5,8%	6.293.197,92	6,1%	6.217.918,59
CAIXA IRF-M TP LP	14.508.605/0001-00	0,0%	-	0,0%	-
CAIXA IDKA IPCA 2A LP	14.386.926/0001-71	7,0%	7.631.972,87	7,5%	7.640.281,86
CAIXA IMA-B5 TP LP	11.060.913/0001-10	4,4%	4.746.206,08	4,6%	4.743.947,90
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	03.737.206/0001-97	5,9%	6.434.390,66	6,2%	6.358.895,91
CAIXA RF DISPONIBILIDADES	14.508.643/0001-55	2,5%	2.712.817,73	2,6%	2.685.430,62
CAIXA RF ATIVA	35.536.532/0001-22	1,4%	1.512.961,40	1,5%	1.489.577,80
CAIXA RF TP LP	05.164.356/0001-84	0,6%	636.826,48	0,6%	629.435,46
CAIXA FI ALIANÇA	05.164.358/0001-73	0,6%	634.945,89	0,6%	627.749,82
CAIXA MATRIZ FI	23.215.008/0001-70	5,7%	6.217.052,51	0,6%	645.147,12
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL		6,4%	6.972.423,58	6,8%	6.965.067,60
BB AÇÕES GOVERNANÇA	10.418.335/0001-88	0,4%	392.458,12	0,4%	368.240,62
BB AÇÕES AGRO	40.054.357/0001-77	0,9%	1.023.359,65	0,9%	956.829,31
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	09.005.805/0001-00	0,1%	81.082,33	0,1%	74.545,41
BB BOLSAS EUROPEIAS	38.236.242/0001-51	1,5%	1.644.276,93	1,7%	1.758.663,03
CAIXA AÇÕES LIVRE	30.068.169/0001-44	1,3%	1.443.671,48	1,3%	1.357.197,95
CAIXA JUROS E MOEDAS	14.120.520/0001-42	0,1%	75.858,62	0,1%	74.777,72
CAIXA INSTITUCIONAL BDR	17.502.937/0001-68	1,6%	1.760.810,03	1,8%	1.832.483,59
CAIXA FIA ELETROBRAS	45.443.475/0001-90	0,5%	550.906,41	0,5%	542.329,96
FUNDOS DE INVESTIMENTO DO EXTERIOR		1,4%	1.551.484,35	1,5%	1.575.608,24
BB ETF INVESTIM EXTERIOR	28.578.897/0001-54	1,4%	1.551.484,35	1,5%	1.575.608,24
CONTAS CORRENTES		0,1%	76.719,30	0,0%	-
BANCO DO BRASIL		0,0%	-	0,0%	-
CAIXA ECONOMICA FEDERAL		0,1%	76.719,30	0,0%	-
TOTAL DA CARTEIRA		100,0%	108.277.025,28	100,0%	102.290.896,39

POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



■ Renda fixa ■ Renda variável ■ Investimentos no exterior ■ Conta corrente



3 RESGATE, CUSTO DAS APLICAÇÕES E ENQUADRAMENTO LEGAL

ATIVOS	CNPJ	RESGATE	TAXA ADM	ENQUADRAMENTO LEGAL	LIMITE DO ENQUADRAMENTO LEGAL	DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ENQUADRAMENTO LEGAL
FUNDOS DE RENDA FIXA						
BB PREV RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	D+0	0,30%	Art. 7º, I, b	100%	6,05%
BB PREV IMA-B 5	03.543.447/0001-03	D+1	0,20%	Art. 7º, I, b	100%	6,17%
BB PREV RF IDKA 2	13.322.205/0001-35	D+1	0,20%	Art. 7º, I, b	100%	6,15%
BB PREV RF FLUXO	13.077.415/0001-05	D+0	1,00%	Art. 7º, IV, a	40%	2,35%
BB PREV RF PERFIL	13.077.418/0001-49	D+0	0,30%	Art. 7º, IV, a	40%	6,70%
BB PREVI TP IPCA (VÉRTICE)	15.486.093/0001-83	D+0	0,15%	Art. 7º, I, b	100%	24,98%
CAIXA 2023 TP RF (VÉRTICE)	44.683.378/0001-02	D+0	2,00%	Art. 7º, I, b	100%	5,68%
CAIXA IRF-M 1 TP	10.740.670/0001-06	D+0	0,20%	Art. 7º, I, b	100%	5,82%
CAIXA IRF-M TP LP	14.508.605/0001-00	D+0	0,20%	Art. 7º, I, b	100%	0,00%
CAIXA IDKA IPCA 2A LP	14.386.926/0001-71	D+0	0,20%	Art. 7º, I, b	100%	7,05%
CAIXA IMA-B5 TP LP	11.060.913/0001-10	D+0	0,20%	Art. 7º, I, b	100%	4,39%
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	03.737.206/0001-97	D+0	0,20%	Art. 7º, IV, a	40%	5,95%
CAIXA RF DISPONIBILIDADES	14.508.643/0001-55	D+0	1,50%	Art. 7º, IV, a	40%	2,51%
CAIXA RF ATIVA	35.536.532/0001-22	D+1	0,40%	Art. 7º, IV, a	40%	1,40%
CAIXA RF TP LP	05.164.356/0001-84	D+0	0,20%	Art. 7º, IV, a	40%	0,59%
CAIXA FI ALIANÇA	05.164.358/0001-73	D+0	0,20%	Art. 7º, IV, a	40%	0,59%
CAIXA MATRIZ FI	23.215.008/0001-70	D+0	0,20%	Art. 7º, IV, a	40%	5,75%
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL						
BB AÇÕES GOVERNANÇA	10.418.335/0001-88	D+3	1,00%	Art. 8º, I, a	30%	0,36%
BB AÇÕES AGRO	40.054.357/0001-77	D+0	1,00%	Art. 8º, II, a	20%	0,95%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	09.005.805/0001-00	D+3	1% a 2%	Art. 8º, II, a	20%	0,07%
BB BOLSAS EUROPEIAS	38.236.242/0001-51	D+0	0,85%	Art. 8º, III	10%	1,52%
CAIXA AÇÕES LIVRE	30.068.169/0001-44	D+15	2,00%	Art. 8º, II, a	20%	1,33%
CAIXA JUROS E MOEDAS	14.120.520/0001-42	D+0	0,70%	Art. 8º, III	10%	0,07%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR	17.502.937/0001-68	D+3	0,70%	Art. 9º-A, III	10%	1,63%
CAIXA FIA ELETROBRAS	45.443.475/0001-90	D+1	0,45%	Art. 8º, I, a	30%	0,51%
FUNDOS DE INVESTIMENTO DO EXTERIOR						
BB ETF INVESTIM EXTERIOR	28.578.897/0001-54	D+6	0% a 0,10%	Art. 9º-A, III	10%	1,43%



4 MOVIMENTAÇÕES E RENTABILIDADE – CONSOLIDADO AGOSTO 2022

ATIVOS	CNPJ	BENCH	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	RENDIMENTO	SALDO ATUAL	RENTABILIDADE /MÊS	RENT. ACUMULADA/ANO
FUNDOS DE RENDA FIXA									
BB PREV RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	IRF-M1	6.472.631,24	-	-	77.947,96	6.550.579,20	1,20%	7,22%
BB PREV IMA-B 5	03.543.447/0001-03	IMA-B5	6.679.578,40	-	-	207,27	6.679.986,82	0,01%	6,48%
BB PREV RF IDKA 2	13.322.205/0001-35	IDKA IPCA 2A	6.657.289,66	-	-	- 2.966,49	6.654.323,17	-0,04%	6,17%
BB PREV RF FLUXO	13.077.415/0001-05	CDI	8.125.372,02	-	5.608.056,23	29.777,24	2.547.093,02	1,08%	7,01%
BB PREV RF PERFIL	13.077.418/0001-49	CDI	7.167.209,50	-	-	84.809,99	7.252.019,48	1,18%	7,90%
BB PREVI TP IPCA (VÉRTICE)	15.486.093/0001-83	IPCA + 6% a.a.	21.457.711,50	5.608.056,23	-	- 37.048,60	27.028.719,13	-0,14%	7,06%
CAIXA 2023 TP RF (VÉRTICE)	44.683.378/0001-02	IPCA + 5% a.a.	6.152.043,15	-	-	- 8.737,47	6.143.305,68	-0,14%	6,39%
CAIXA IRF-M 1 TP	10.740.670/0001-06	IRF-M1	6.217.918,59	-	-	75.279,33	6.293.197,92	1,21%	7,22%
CAIXA IRF-M TP LP	14.508.605/0001-00	IRF-M	-	-	-	-	-	2,04%	5,40%
CAIXA IDKA IPCA 2A LP	14.386.926/0001-71	IDKA IPCA 2A	7.640.281,86	-	-	- 8.308,99	7.631.972,87	-0,11%	5,99%
CAIXA IMA-B5 TP LP	11.060.913/0001-10	IMA-B5	4.743.947,90	-	-	2.258,18	4.746.206,08	0,05%	6,58%
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	03.737.206/0001-97	CDI	6.358.895,91	-	-	75.494,75	6.434.390,66	1,19%	7,93%
CAIXA RF DISPONIBILIDADES	14.508.643/0001-55	-	2.685.430,62	-	-	27.387,11	2.712.817,73	1,02%	6,61%
CAIXA RF ATIVA	35.536.532/0001-22	IPCA	1.489.577,80	-	-	23.383,59	1.512.961,40	1,57%	7,26%
CAIXA RF TP LP	05.164.356/0001-84	CDI	629.435,46	-	-	7.391,02	636.826,48	1,17%	7,85%
CAIXA FI ALIANÇA	05.164.358/0001-73	-	627.749,82	-	-	7.196,08	634.945,89	1,15%	7,57%
CAIXA MATRIZ FI	23.215.008/0001-70	CDI	645.147,12	5.561.289,98	-	10.615,41	6.217.052,51	1,20%	8,05%
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL									
BB AÇÕES GOVERNANÇA	10.418.335/0001-88	IGC	368.240,62	-	-	24.217,50	392.458,12	6,58%	3,72%
BB AÇÕES AGRO	40.054.357/0001-77	-	956.829,31	-	-	66.530,34	1.023.359,65	6,95%	2,04%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	09.005.805/0001-00	IBOVESPA	74.545,41	-	-	6.536,92	81.082,33	8,77%	-1,30%
BB BOLSAS EUROPEIAS	38.236.242/0001-51	-	1.758.663,03	-	-	-114.386,10	1.644.276,93	-6,50%	-18,82%
CAIXA AÇÕES LIVRE	30.068.169/0001-44	IBOVESPA	1.357.197,95	-	-	86.473,54	1.443.671,48	6,37%	6,78%
CAIXA JUROS E MOEDAS	14.120.520/0001-42	CDI	74.777,72	-	-	1.080,90	75.858,62	1,45%	8,94%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR	17.502.937/0001-68	-	1.832.483,59	-	-	- 71.673,57	1.760.810,03	-3,92%	-25,19%
CAIXA FIA ELETROBRAS	45.443.475/0001-90	ELET3	542.329,96	-	-	3.356,48	550.906,41	0,61%	11,22%
FUNDOS DE INVESTIMENTO DO EXTERIOR									
BB ETF INVESTIM EXTERIOR	28.578.897/0001-54	MSCI ACWI	1.575.608,24	-	-	- 24.123,89	1.551.484,35	-1,53%	-23,78%



5 RENTABILIDADE E RISCO DOS ATIVOS – AGOSTO 2022

ATIVOS	CNPJ	BENCH	RENTABILIDADE/MÊS	RENT. ACUMULADA/ANO	VAR (95%) / MÊS*
FUNDOS DE RENDA FIXA					
BB PREV RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	IRF-M1	1,20%	7,22%	-
BB PREV IMA-B 5	03.543.447/0001-03	IMA-B5	0,01%	6,48%	-
BB PREV RF IDKA 2	13.322.205/0001-35	IDKA IPCA 2A	-0,04%	6,17%	0,01%
BB PREV RF FLUXO	13.077.415/0001-05	CDI	1,08%	7,01%	-
BB PREV RF PERFIL	13.077.418/0001-49	CDI	1,18%	7,90%	-
BB PREVI TP IPCA (VÉRTICE)	15.486.093/0001-83	IPCA + 6% a.a.	-0,14%	7,06%	0,56%
CAIXA 2023 TP RF (VÉRTICE)	44.683.378/0001-02	IPCA + 5% a.a.	-0,14%	6,39%	0,68%
CAIXA IRF-M 1 TP	10.740.670/0001-06	IRF-M1	1,21%	7,22%	0,24%
CAIXA IRF-M TP LP	14.508.605/0001-00	IRF-M	2,04%	5,40%	2,04%
CAIXA IDKA IPCA 2A LP	14.386.926/0001-71	IDKA IPCA 2A	-0,11%	5,99%	1,73%
CAIXA IMA-B5 TP LP	11.060.913/0001-10	IMA-B5	0,05%	6,58%	1,63%
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	03.737.206/0001-97	CDI	1,19%	7,93%	0,03%
CAIXA RF DISPONIBILIDADES	14.508.643/0001-55	-	1,02%	6,61%	0,00%
CAIXA RF ATIVA	35.536.532/0001-22	IPCA	1,57%	7,26%	1,20%
CAIXA RF TP LP	05.164.356/0001-84	CDI	1,17%	7,85%	0,04%
CAIXA FI ALIANÇA	05.164.358/0001-73	-	1,15%	7,57%	0,00%
CAIXA MATRIZ FI	23.215.008/0001-70	CDI	1,20%	8,05%	0,02%
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL					
BB AÇÕES GOVERNANÇA	10.418.335/0001-88	IGC	6,58%	3,72%	10,38%
BB AÇÕES AGRO	40.054.357/0001-77	-	6,95%	2,04%	-
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	09.005.805/0001-00	IBOVESPA	8,77%	-1,30%	-
BB BOLSAS EUROPEIAS	38.236.242/0001-51	-	-6,50%	-18,82%	-
CAIXA AÇÕES LIVRE	30.068.169/0001-44	IBOVESPA	6,37%	6,78%	11,83%
CAIXA JUROS E MOEDAS	14.120.520/0001-42	CDI	1,45%	8,94%	0,16%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR	17.502.937/0001-68	-	-3,92%	-25,19%	6,25%
CAIXA FIA ELETROBRAS	45.443.475/0001-90	ELET3	0,61%	11,22%	7,02%
FUNDOS DE INVESTIMENTO DO EXTERIOR					
BB ETF INVESTIM EXTERIOR	28.578.897/0001-54	MSCI ACWI	-1,53%	-23,78%	-

* VAR (Valor de risco) como percentual do PL calculado para 21 dias úteis e 95% de confiança e Sintetiza a maior perda esperada para a Carteira no intervalo de um dia.

Dados retirados da Central de Sistemas da Comissão de Valores Mobiliários.



6 MOVIMENTAÇÕES – AGOSTO 2022

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVOS	CNPJ
01/08/2022	5.608.056,23	APLICAÇÃO	BB PREVI TP IPCA (VÉRTICE)	15.486.093/0001-83
01/08/2022	5.608.056,23	RESGATE	BB PREV RF FLUXO	13.077.415/0001-05
30/08/2022	5.561.289,98	APLICAÇÃO	CAIXA MATRIZ FI	23.215.008/0001-70



ESTADO DE GOIÁS
GOIÁS PREVIDÊNCIA - GOIASPREV
COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Processo: 202211129011199

Nome: GOIÁS PREVIDÊNCIA - GOIASPREV

Assunto: Parecer Comitê de Investimentos - 8/2022

PARECER GOIASPREV/CI-19523 Nº 8/2022

Em consonância com as boas práticas de gestão previdenciária no que diz respeito às Aplicações dos Recursos, o Comitê de Investimentos da Goiás Previdência – GOIASPREV promove o presente parecer.

Foram utilizados para a emissão deste parecer o Relatório de Investimentos do Fundo Previdenciário, do mês de Agosto/2022, qual descreve análise exploratória da carteira de investimentos, enquadramento conforme Resolução CMN nº 4.963/2021, binômio de rentabilidade-risco dos fundos de investimentos, e breve análise do atual cenário econômico e político referente ao mês de Agosto/2022 e outros documentos complementares disponibilizados à GOIASPREV.

O panorama do mês de agosto, conforme comentários do relatório de investimentos, finalizou positivo para o mercado brasileiro, com o Ibovespa fechando agosto aos 109.522 pontos, acumulando alta de 6,16% no período. O dólar comercial encerrou o mês em R\$ 5,20, com alta de 0,53% em relação ao mês anterior. A taxa Selic é de 13,75% ao ano e o IPCA acumulado se encontra em 8,73%. No mercado internacional as perspectivas econômicas dos Estados Unidos e da Europa movimentaram o mercado no mês de agosto. Enquanto os dados de atividade econômica seguem dando sinais de melhora e a inflação cai nos Estados Unidos, a Europa continua apresentando um cenário, ao menos temporário, de estagflação.

Além disso, as expectativas em relação ao crescimento global continuam diminuindo, principalmente pela queda da perspectiva de avanço da economia chinesa em 2022 e das pressões trazidas pelo modelo econômico suportado por investimentos em infraestrutura e no mercado imobiliário. No Brasil, o mercado demonstra animação com a queda na taxa de desemprego e com o resultado econômico registrado no segundo trimestre, porém, ainda há uma preocupação devido as eleições presidenciais e seus riscos políticos.

O valor de cota do Fundo Previdenciário iniciou a competência agosto com uma cota de abertura de R\$ 1,068852 e uma cota de fechamento de R\$ 1,071802, repercutindo numa rentabilidade de 0,276003%, superior à meta atuarial de 0,046740% qual considera a inflação de agosto e anualização da taxa de juros parâmetro do Fundo Previdenciário do exercício 2022.

Para além do exposto, os investimentos estão em conformidade com a Política de Investimentos de 2022, portanto, encaminhe-se este parecer FAVORÁVEL dos membros do Comitê de Investimentos para aprovação do Conselho Fiscal da

GOIASPREV.

COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO (A) GOIÁS PREVIDÊNCIA -
GOIASPREV, ao(s) 25 dia(s) do mês de novembro de 2022.



Documento assinado eletronicamente por **MARCOS MEDEIROS DA SILVA, Gerente**, em 25/11/2022, às 21:06, conforme art. 2º, § 2º, III, "b", da Lei 17.039/2010 e art. 3ºB, I, do Decreto nº 8.808/2016.



Documento assinado eletronicamente por **YURI MARTI SANTANA SANTOS, Diretor (a)**, em 28/11/2022, às 07:37, conforme art. 2º, § 2º, III, "b", da Lei 17.039/2010 e art. 3ºB, I, do Decreto nº 8.808/2016.



Documento assinado eletronicamente por **ADRIANA JESUS SILVA BATISTA, Assessor (a)**, em 29/11/2022, às 10:30, conforme art. 2º, § 2º, III, "b", da Lei 17.039/2010 e art. 3ºB, I, do Decreto nº 8.808/2016.



Documento assinado eletronicamente por **GILVAN CANDIDO DA SILVA, Presidente**, em 29/11/2022, às 12:38, conforme art. 2º, § 2º, III, "b", da Lei 17.039/2010 e art. 3ºB, I, do Decreto nº 8.808/2016.



A autenticidade do documento pode ser conferida no site

[http://sei.go.gov.br/sei/controlador_externo.php?](http://sei.go.gov.br/sei/controlador_externo.php?acao=documento_conferir&id_orgao_acesso_externo=1)

[acao=documento_conferir&id_orgao_acesso_externo=1](http://sei.go.gov.br/sei/controlador_externo.php?acao=documento_conferir&id_orgao_acesso_externo=1) informando o código verificador **000035761323** e o código CRC **0CFD97B8**.

COMITÊ DE INVESTIMENTOS
AVENIDA PRIMEIRA RADIAL Nº 586, 5º ANDAR - Bairro SETOR PEDRO LUDOVICO -
GOIANIA - GO - CEP 74820-300 - (62)3201-7800.



Referência: Processo nº 202211129011199



SEI 000035761323