

Goiás Previdência



**RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS – FUNDO PREVIDENCIÁRIO
JUNHO - 2023**

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	3
4	MOVIMENTAÇÕES E RENTABILIDADE – CONSOLIDADO JUNHO 2023	5
5	RENTABILIDADE E RISCO DOS ATIVOS – JUNHO 2023	6
6	RENDIMENTOS – CONSOLIDADO JUNHO 2023	7
7	MOVIMENTAÇÕES – JUNHO 2023	7



1 INTRODUÇÃO

Com foco nos interesses do segurado e total transparência, a Goiás Previdência apresenta o relatório de investimentos referente ao mês de junho de 2023, 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

No cenário externo, a principal incerteza quanto à economia dos Estados Unidos diz respeito à elevação do montante da dívida. O acordo recentemente aprovado no Senado americano prevê a suspensão do teto da dívida até o início de 2025. Na China, o país descreve uma trajetória de recuperação desde o fim das restrições sanitárias em dezembro de 2022. O crescimento do PIB chinês no primeiro trimestre do corrente ano em relação ao mesmo período do ano passado foi de 4,5%. Na Zona do Euro, a inflação permanece elevada mesmo que o aumento dos preços tenha desacelerado e a taxa de desemprego atingiu o valor de 6,5% em abril de 2023.

No Brasil, o desempenho do produto doméstico brasileiro tem surpreendido positivamente e, em virtude disso, teve suas taxas de crescimento revistas mês a mês pelo mercado ao longo do ano. O país elevou sua participação nos mercados internacionais de *commodities*, mais especificamente de soja e petróleo — a cotação dos produtos primários, ainda que em queda, estão em patamar superior ao nível verificado antes da pandemia. No que se refere a demanda interna, esta é influenciada por duas forças opostas. Ao mesmo momento em que os efeitos da política monetária contracionista devam repelir o consumo, a política fiscal expansionista se incumbe do incentivo a esse componente da economia real.

Ao analisar os indicadores econômicos, pode-se observar que o IPCA mensal foi de -0,08% e o mesmo índice foi de 2,87% para o acumulado anual. Em síntese, os preços seguem trajetória de desinflação pela diminuição da cotação das commodities aliada à valorização do real e à manutenção da taxa de juros básica elevada.

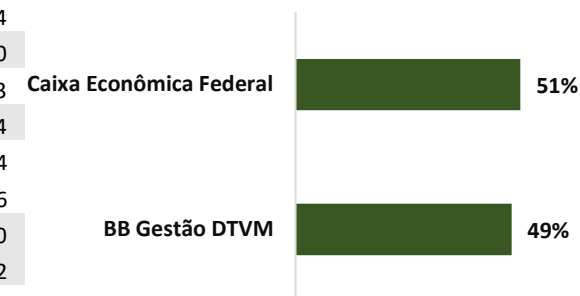
O dólar comercial (PTAX) desvalorizou 5,43% em relação ao real no mês de junho, fechando a R\$4,8186. No apurado semestral, a desvalorização é ainda maior e chega a 7,638%. O índice Ibovespa operou em alta de 9% no apurado mensal, aos 118.087 pontos e, no primeiro semestre, acumulou valorização de 7,61%.



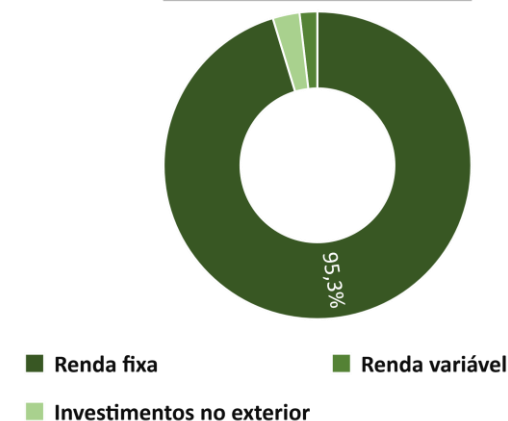
2 DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA

	CNPJ	%	JUNHO	%	MAIO
FUNDOS DE RENDA FIXA		95,3%	182.838.201,24	95,2%	173.013.635,54
BB PREV RF IRF-M1 TP	11.328.882/0001-35	3,8%	7.373.321,03	4,0%	7.288.873,64
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	03.543.447/0001-03	3,8%	7.350.818,24	4,0%	7.275.810,90
BB PREV RF IDKA 2 TP	13.322.205/0001-35	3,8%	7.301.171,11	4,0%	7.227.486,73
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC	13.077.415/0001-05	1,5%	2.806.587,35	1,5%	2.778.874,34
BB PREV RF PERFIL FIC FI	13.077.418/0001-49	25,8%	49.522.273,13	26,9%	48.987.073,74
BB PREV RF TP VÉRTICE 2027	46.134.096/0001-81	5,7%	10.871.524,77	5,9%	10.769.286,46
BB PREV RF TP VÉRTICE 2030	46.134.117/0001-69	2,0%	3.836.650,02	2,1%	3.754.744,40
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	10.740.670/0001-06	22,1%	42.361.696,19	18,7%	34.064.329,92
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP	14.386.926/0001-71	4,4%	8.401.850,85	4,6%	8.315.102,16
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI RF LP	11.060.913/0001-10	2,7%	5.225.582,36	2,8%	5.172.228,14
CAIXA BRASIL FI RF REF DI LP	03.737.206/0001-97	3,7%	7.148.667,18	3,9%	7.069.811,38
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF	14.508.643/0001-55	1,6%	3.004.037,32	1,6%	2.974.644,10
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RF LP	35.536.532/0001-22	0,9%	1.683.882,37	0,9%	1.655.968,04
CAIXA BRASIL TP FI RF LP	05.164.356/0001-84	0,4%	707.315,41	0,4%	699.424,98
CAIXA ALIANÇA TP FI RF	05.164.358/0001-73	13,2%	25.242.823,90	13,7%	24.979.976,61
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL		1,9%	3.617.179,11	1,8%	3.329.131,30
BB AÇÕES GOVERNANÇA	10.418.335/0001-88	0,2%	412.794,30	0,2%	379.136,76
BB AÇÕES AGRO	40.054.357/0001-77	0,5%	992.518,74	0,5%	937.641,24
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	09.005.805/0001-00	0,0%	75.845,67	0,0%	70.622,07
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	30.068.169/0001-44	0,8%	1.575.451,32	0,8%	1.435.174,28
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTI LP	14.120.520/0001-42	0,0%	84.180,77	0,0%	83.164,25
CAIXA FIA ELETROBRAS	45.443.475/0001-90	0,2%	476.388,30	0,2%	423.392,70
FUNDOS DE INVESTIMENTO DO EXTERIOR		2,8%	5.389.426,39	2,9%	5.361.085,35
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF IE FIA	28.578.897/0001-54	0,7%	1400157,478	0,8%	1.449.513,98
BB AÇÕES EUROPEIAS BDR I	38.236.242/0001-51	1,1%	2.062.902,75	1,1%	1.994.180,22
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	1,0%	1.926.366,17	1,1%	1.917.391,15
CONTAS CORRENTES		0,1%	136.018,86	0,1%	125.900,24
BANCO DO BRASIL		0,0%	-	0,0%	-
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	N/A	0,1%	136.018,86	0,1%	125.900,24
TOTAL DA CARTEIRA		100,0%	191.980.825,60	100,0%	181.829.752,43

POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



POR SEGMENTO





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 TP	11.328.882/0001-35	D+0	0,1% a 0,3%	Art. 7º, I, b	100%	3,84%
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	03.543.447/0001-03	D+1	0,20%	Art. 7º, I, b	100%	3,83%
BB PREV RF IDKA 2 TP	13.322.205/0001-35	D+1	0,20%	Art. 7º, I, b	100%	3,81%
BB PREV RF TP VÉRTICE 2027	46.134.096/0001-81	D+0	0,20%	Art. 7º, I, b	100%	5,67%
BB PREV RF TP VÉRTICE 2030	46.134.117/0001-69	D+0	0,20%	Art. 7º, I, b	100%	2,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	10.740.670/0001-06	D+0	0,20%	Art. 7º, I, b	100%	22,08%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP	14.386.926/0001-71	D+0	0,20%	Art. 7º, I, b	100%	4,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI RF LP	11.060.913/0001-10	D+0	0,20%	Art. 7º, I, b	100%	2,72%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF	14.508.643/0001-55	D+0	1,50%	Art. 7º, I, b	100%	1,57%
CAIXA BRASIL TP FI RF LP	05.164.356/0001-84	D+0	0,20%	Art. 7º, I, b	100%	0,37%
CAIXA ALIANÇA TP FI RF	05.164.358/0001-73	D+0	0,20%	Art. 7º, I, b	100%	13,16%
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC	13.077.415/0001-05	D+0	1,00%	Art. 7º, III, a	60%	1,46%
BB PREV RF PERFIL FIC FI	13.077.418/0001-49	D+0	0,2% a 0,3%	Art. 7º, III, a	60%	25,81%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI LP	03.737.206/0001-97	D+0	0,20%	Art. 7º, III, a	60%	3,73%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RF LP	35.536.532/0001-22	D+1	0,40%	Art. 7º, III, a	60%	0,88%
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL						
CAIXA JUROS E MOEDAS	14.120.520/0001-42	D+0	0,70%	Art. 10º, I	10%	0,04%
BB AÇÕES GOVERNANÇA	10.418.335/0001-88	D+3	1,00%	Art. 8º, I	30%	0,22%
BB AÇÕES AGRO	40.054.357/0001-77	D+2	1,00%	Art. 8º, I	30%	0,52%
CAIXA AÇÕES LIVRE	30.068.169/0001-44	D+15	2,00%	Art. 8º, I	30%	0,82%
CAIXA FIA ELETROBRAS	45.443.475/0001-90	D+3	0,45%	Art. 8º, I	30%	0,25%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	09.005.805/0001-00	D+3	1% a 2%	Art. 8º, II	30%	0,04%
FUNDOS DE INVESTIMENTO DO EXTERIOR						
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF IE FIA	28.578.897/0001-54	D+6	0% a 0,10%	Art. 9º, II	10%	0,73%
BB AÇÕES EUROPEIAS BDR I	38.236.242/0001-51	D+2	0,85%	Art. 9º, III	10%	1,08%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	D+3	0,70%	Art. 9º, III	10%	1,00%



4 MOVIMENTAÇÕES E RENTABILIDADE – CONSOLIDADO JUNHO 2023

ATIVOS	CNPJ	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	RENDIMENTO	SALDO ATUAL	RENT./MÊS	RENT. ACUMULADA/ANO
FUNDOS DE RENDA FIXA					1.922.981,47	182.838.201,24		
BB PREV RF IRF-M1 TP	11.328.882/0001-35	7.288.873,64			84.447,39	7.373.321,03	1,16%	6,49%
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	03.543.447/0001-03	7.275.810,90			75.007,34	7.350.818,24	1,03%	6,99%
BB PREV RF IDKA 2 TP	13.322.205/0001-35	7.227.486,73			73.684,38	7.301.171,11	1,02%	6,56%
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC	13.077.415/0001-05	2.778.874,34			27.713,02	2.806.587,35	1,00%	5,98%
BB PREV RF PERFIL FIC FI	13.077.418/0001-49	48.987.073,74			535.199,39	49.522.273,13	1,09%	6,44%
BB PREV RF TP VÉRTICE 2027	46.134.096/0001-81	10.769.286,46			102.238,31	10.871.524,77	0,95%	9,20%
BB PREV RF TP VÉRTICE 2030	46.134.117/0001-69	3.754.744,40			81.905,62	3.836.650,02	2,18%	11,77%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	10.740.670/0001-06	34.064.329,92	7.901.584,25		395.782,05	42.361.696,19	1,16%	6,59%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP	14.386.926/0001-71	8.315.102,16			86.748,69	8.401.850,85	1,04%	6,60%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI RF LP	11.060.913/0001-10	5.172.228,14			53.354,22	5.225.582,36	1,03%	7,00%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI LP	03.737.206/0001-97	7.069.811,38			78.855,80	7.148.667,18	1,12%	6,42%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF	14.508.643/0001-55	2.974.644,10			29.393,22	3.004.037,32	0,99%	5,64%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RF LP	35.536.532/0001-22	1.655.968,04			27.914,33	1.683.882,37	1,69%	7,76%
CAIXA BRASIL TP FI RF LP	05.164.356/0001-84	699.424,98			7.890,43	707.315,41	1,13%	6,55%
CAIXA ALIANÇA TP FI RF	05.164.358/0001-73	24.979.976,61			262.847,29	25.242.823,90	1,05%	6,38%
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL		3.329.131,30			288.047,81	3.617.179,11		
BB AÇÕES GOVERNANÇA	10.418.335/0001-88	379.136,76			33.657,54	412.794,30	8,88%	6,51%
BB AÇÕES AGRO	40.054.357/0001-77	937.641,24			54.877,50	992.518,74	5,85%	0,53%
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	09.005.805/0001-00	70.622,07			5.223,60	75.845,67	7,40%	2,75%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	30.068.169/0001-44	1.435.174,28			140.277,04	1.575.451,32	9,77%	13,72%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTI LP	14.120.520/0001-42	83.164,25			1.016,52	84.180,77	1,22%	6,56%
CAIXA FIA ELETROBRAS	45.443.475/0001-90	423.392,70			52.995,60	476.388,30	12,52%	-5,21%
FUNDOS DE INVESTIMENTO DO EXTERIOR		5.361.085,35			28.341,04	5.389.426,39		
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF IE FIA	28.578.897/0001-54	1.449.513,98			- 49.356,50	1.400.157,48	-3,41%	-2,81%
BB AÇÕES EUROPEIAS BDR I	38.236.242/0001-51	1.994.180,22			68.722,53	2.062.902,75	3,45%	13,75%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	1.917.391,15			8.975,01	1.926.366,17	0,47%	14,53%



5 RENTABILIDADE E RISCO DOS ATIVOS – JUNHO 2023

ATIVOS	CNPJ	BENCH	RENTABILIDADE/MÊS	RENT. ACUMULADA/ANO	VAR (95%) / MÊS*
FUNDOS DE RENDA FIXA					
BB PREV RF IRF-M1 TP	11.328.882/0001-35	IRF-M1	1,16%	6,49%	-
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	03.543.447/0001-03	IMA-B5	1,03%	6,99%	-
BB PREV RF IDKA 2 TP	13.322.205/0001-35	IDKA IPCA 2A	1,02%	6,56%	2,29%
BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC	13.077.415/0001-05	SELIC	1,00%	5,98%	-
BB PREV RF PERFIL FIC FI	13.077.418/0001-49	CDI	1,09%	6,44%	-
BB PREV RF TP VÉRTICE 2027	46.134.096/0001-81	IPCA + 5% a.a.	0,95%	9,20%	2,06%
BB PREV RF TP VÉRTICE 2030	46.134.117/0001-69	IPCA + 5% a.a.	2,18%	11,77%	2,43%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	10.740.670/0001-06	IRF-M1	1,16%	6,59%	0,07%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP	14.386.926/0001-71	IDKA IPCA 2A	1,04%	6,60%	1,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI RF LP	11.060.913/0001-10	IMA-B5	1,03%	7,00%	0,74%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI LP	03.737.206/0001-97	CDI	1,12%	6,42%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF	14.508.643/0001-55	-	0,99%	5,64%	0,00%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RF LP	35.536.532/0001-22	IPCA	1,69%	7,76%	0,37%
CAIXA BRASIL TP FI RF LP	05.164.356/0001-84	CDI	1,13%	6,55%	0,07%
CAIXA ALIANÇA TP FI RF	05.164.358/0001-73	-	1,05%	6,38%	0,00%
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL					
BB AÇÕES GOVERNANÇA	10.418.335/0001-88	ETF - AÇÕES	8,88%	6,51%	7,92%
BB AÇÕES AGRO	40.054.357/0001-77	-	5,85%	0,53%	-
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	09.005.805/0001-00	IBOVESPA	7,40%	2,75%	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE	30.068.169/0001-44	-	9,77%	13,72%	9,42%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTI LP	14.120.520/0001-42	CDI	1,22%	6,56%	0,21%
CAIXA FIA ELETROBRAS	45.443.475/0001-90	ELET3	12,52%	-5,21%	14,22%
FUNDOS DE INVESTIMENTO DO EXTERIOR					
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF IE FIA	28.578.897/0001-54	MSCI ACWI	-3,41%	-2,81%	-
BB AÇÕES EUROPEIAS BDR I	38.236.242/0001-51	-	3,45%	13,75%	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	-	0,47%	14,53%	4,81%

* 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 RENDIMENTOS – CONSOLIDADO JUNHO 2023

RENDIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	
BB Gestão DTVM	1.093.320,12
Caixa Econômica Federal	1.146.050,20
TOTAL	2.239.370,32

7 MOVIMENTAÇÕES – JUNHO 2023

DATA	VALOR	MOVIMENTO	ATIVOS	CNPJ
02/06/2023	125.900,24	APLICAÇÃO	CAIXA BRASIL IRF-M1	10.740.670/0001-06
30/06/2023	7.775.684,01	APLICAÇÃO	CAIXA BRASIL IRF-M1	10.740.670/0001-06



Referência: Processo nº 202311129003078

Interessado: Goiás Previdência - GOIASPREV

**Assunto: Parecer do Comitê de Investimentos
junho/2023.**

PARECER GOIASPREV/CI-19523 Nº 9/2023

1. 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.
2. Para a emissão deste parecer, foi utilizado o Relatório de Investimentos do Fundo Previdenciário do mês de junho/2023. Este descreve a análise exploratória da carteira de investimentos, o enquadramento conforme Resolução CMN nº 4.963/2021, o binômio de rentabilidade-risco dos fundos de investimentos e uma breve análise do atual cenário econômico e político no mês de junho/2023, além de documentos complementares.
3. O índice Ibovespa encerrou o mês em 118.087 pontos. Em relação ao mês anterior (108.335), apresentou alta de 9,00%. No acumulado do ano (de 109.735 em 31/12/22 para 118.087 em 30/06/23), a alta foi de 7,61%. Nos últimos 12 meses (de 98.542 em 30/06/22 para

118.087 em 30/06/23), o índice subiu 19,81%.

4. Já o dólar comercial fechou o mês de junho/23 em R\$ 4,82, desvalorização de 5,43% em relação ao mês anterior (R\$ 5,09). No acumulado do ano (de R\$ 5,22 em 30/12/22 para R\$ 4,82 em 30/06/23), apresentou desvalorização de 7,64%. Nos últimos 12 meses (de R\$ 5,24 em 30/06/22 para R\$ 4,82 em 30/06/23), a desvalorização foi de 8,00%.
5. A meta Selic, fixada na última reunião do COPOM, se manteve em 13,75% ao ano. A taxa SELIC do mês foi de 1,07%. No acumulado, a taxa SELIC atingiu 6,49% (13,63% ao ano).
6. O IPCA foi de -0,08% no mês, com acumulado de 2,87% no ano e 3,16% nos últimos 12 meses.
7. O **Fundo Previdenciário** iniciou a competência junho/2023 com uma **cota de abertura de R\$ 1,168874** e uma **cota de fechamento de R\$ 1,183200**. A **rentabilidade** foi de **1,23%**, ante à **meta atuarial** de 0,32%, a qual considera a inflação desta competência e a taxa de juros parâmetro do Fundo Previdenciário.
8. No período (jan-jun/2023), **os investimentos apresentaram rentabilidade agregada de 7,33% (15,46% anualizado)**. Considerando a **meta atuarial, no mesmo período, de 5,31% (11,09% anualizado)**, o rendimento do Fundo Previdenciário **superou a meta em 4,37 pontos percentuais com variação positiva de 39,40%**.
9. Por fim, consideram-se, os investimentos do Fundo Previdenciário, posicionados em 30/06/2023, em conformidade com a Política de Investimentos para o exercício de 2023.
10. Encaminhe-se o presente parecer **FAVORÁVEL**, deste Comitê de Investimentos, à Diretoria Executiva, para apreciação e posterior submissão ao Conselho Fiscal da GOIASPREV, para fins da aprovação, caso

este entenda pela conformidade do relatório objeto do parecer.



Documento assinado eletronicamente por **MARCOS MEDEIROS DA SILVA, Gerente**, em 12/07/2023, às 15:22, 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 **NELSON HIDEAKI FUJIMOTO, Diretor**, em 12/07/2023, às 15:45, 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 **RICARDO MENDES, Assessor (a)**, em 12/07/2023, às 17:01, 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?acao=documento_conferir&id_orgao_acesso_externo=1 informando o código verificador **49483309** e o código CRC **5F5CC93F**.

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
202311129003078



SEI 49483309