

Goiás Previdência



**RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS – FUNDO PREVIDENCIÁRIO
CONSOLIDADO - 2022**

Goiás Previdência

Goiânia - GO



Sumário

| | | |
|------------|---|-----------|
| 1 | INTRODUÇÃO..... | 2 |
| 1.1 | Comentários do ano de 2022..... | 2 |
| 2 | DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA | 3 |
| 3 | RESGATE, CUSTO DAS APLICAÇÕES E ENQUADRAMENTO LEGAL – POSICIONADO EM DEZEMBRO 2022 | 4 |
| 4 | MOVIMENTAÇÕES – CONSOLIDADO 2022..... | 5 |
| 5 | RENDIMENTOS – 2022 | 7 |
| 6 | RENTABILIDADE E RISCO DOS ATIVOS – POSICIONADO EM DEZEMBRO DE 2022 .. | 8 |
| 7 | RENTABILIDADE DA CARTEIRA – 2022..... | 9 |
| 8 | CONSIDERAÇÕES FINAIS | 10 |



1 INTRODUÇÃO

Com foco nos interesses do segurado e total transparência, a Goiás Previdência apresenta o relatório de investimentos consolidado do ano de 2022 do Fundo Previdenciário, refletindo todas as decisões do Comitê de Investimentos, com intuito de garantir a sustentabilidade e a 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 ano de 2022

Com a ampliação da vacinação contra a Covid-19, a atividade econômica mundial foi retomada rapidamente. Assim, um aumento da demanda foi registrado, enquanto a oferta não acompanhou o fato na mesma proporção. Consequentemente houve um aumento da inflação, ainda impulsionado fortemente pela guerra na Ucrânia. A inflação que em 2021 foi considerada como transitória, em 2022 não foi vista da mesma forma e influenciou fortemente os resultados dos mercados mundiais, assim como levou os bancos centrais globais a um aperto em suas políticas monetárias.

Já no Brasil, apesar das oscilações durante o ano, 2022 finalizou positivo. Os resultados do país foram influenciados pelos reflexos da guerra na Ucrânia, pelos altos níveis de inflação em grande parte dos países e, já no segundo semestre, pela incerteza política relativa as eleições presidenciais. No último pregão do ano o Ibovespa fechou aos 109.734 pontos, com queda de 2,45% em dezembro e alta acumulada de 4,69% em 2022. O dólar comercial encerrou o último mês do ano em R\$ 5,21, com alta de aproximadamente 1,51% em relação ao mês anterior e queda acumulada de 6,5% no ano. A taxa Selic é de 13,75% ao ano e o IPCA se encontra em 5,79%.

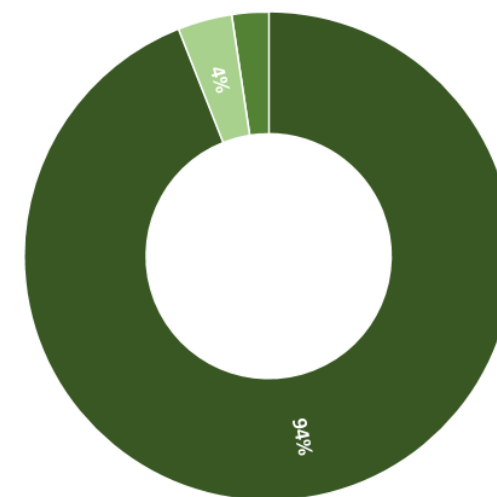
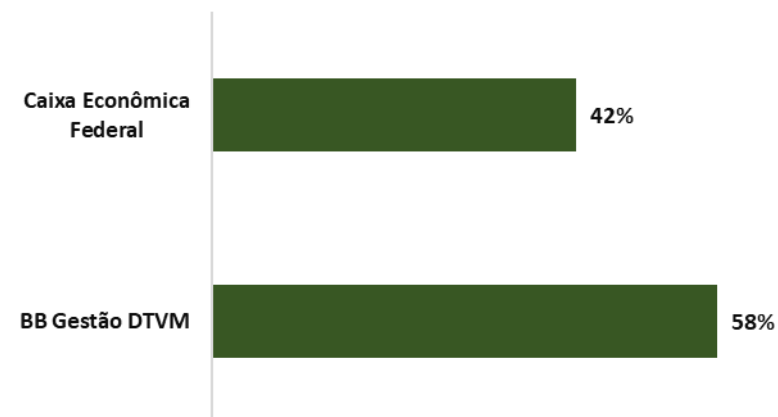
No que diz respeito aos investimentos do Fundo Previdenciário da GOIASPREV, a maioria dos fundos de renda fixa finalizaram o ano com rendimentos positivos, com exceção do BB PREV RF TP VÉRTICE 2030 (46.134.117/0001-69), que finalizou o período com rendimentos negativos. Já os fundos de renda variável não tiveram desempenho dentro do esperado, sendo que, dos seis fundos com capital investido, dois apresentaram rendimentos negativos: BB AÇÕES AGRO (40.054.357/0001-77) e BB AÇÕES RETORNO TOTAL (09.005.805/0001-00). Em relação aos investimentos que se enquadram como investimentos no exterior, os rendimentos foram negativos para os três fundos investidos.



2 DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA

| | CNPJ | % | DEZEMBRO/22 | % | DEZEMBRO/21 |
|---|--------------------|---------------|-----------------------|---------------|----------------------|
| FUNDOS DE RENDA FIXA | | 94,0% | 131.146.963,34 | 84,9% | 52.420.000,19 |
| BB PREV RF IRF-M1 TP | 11.328.882/0001-35 | 4,9% | 6.826.060,40 | 8,6% | 5.277.394,00 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 03.543.447/0001-03 | 4,9% | 6.870.594,40 | 8,8% | 5.438.092,85 |
| BB PREV RF IDKA 2 TP | 13.322.205/0001-35 | 4,9% | 6.851.562,60 | 8,8% | 5.431.443,86 |
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC | 13.077.415/0001-05 | 1,9% | 2.648.234,20 | 3,8% | 2.373.544,65 |
| BB PREV RF PERFIL FIC FI | 13.077.418/0001-49 | 5,4% | 7.567.146,53 | 10,9% | 6.721.158,22 |
| BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 | 27,7% | 38.639.512,14 | 0,0% | - |
| BB PREV RF TP VÉRTICE 2027 | 46.134.096/0001-81 | 2,5% | 3.458.714,70 | 0,0% | - |
| BB PREV RF TP VÉRTICE 2030 | 46.134.117/0001-69 | 2,5% | 3.530.358,87 | 0,0% | - |
| BB RF ALOC RET TOTAL | 35.292.588/0001-89 | 0,0% | - | 0,0% | - |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RF CRED PRIV | 21.918.896/0001-62 | 0,0% | - | 0,0% | - |
| CAIXA BRASIL 2023 TP FI RF | 44.683.378/0001-02 | 16,4% | 22.921.532,93 | 0,0% | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF | 10.740.670/0001-06 | 4,7% | 6.588.547,36 | 8,9% | 5.514.773,56 |
| CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP | 14.508.605/0001-00 | 0,0% | - | 0,0% | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP | 14.386.926/0001-71 | 5,7% | 7.881.828,34 | 10,3% | 6.361.402,38 |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI RF LP | 11.060.913/0001-10 | 3,5% | 4.883.553,39 | 5,9% | 3.614.103,30 |
| CAIXA BRASIL FI RF REF DI LP | 03.737.206/0001-97 | 4,8% | 6.717.229,22 | 9,7% | 5.961.848,85 |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF | 14.508.643/0001-55 | 2,0% | 2.843.725,01 | 4,1% | 2.544.534,56 |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RF LP | 35.536.532/0001-22 | 1,1% | 1.562.574,81 | 2,3% | 1.410.597,78 |
| CAIXA BRASIL TP FI RF LP | 05.164.356/0001-84 | 0,5% | 663.851,57 | 1,0% | 590.481,16 |
| CAIXA ALIANÇA TP FI RF | 05.164.358/0001-73 | 0,5% | 691.936,87 | 1,0% | 590.274,00 |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 | 0,0% | - | 1,0% | 590.351,01 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF | 23.215.097/0001-55 | 0,0% | - | - | - |
| FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL | | 2,4% | 3.415.607,26 | 4,7% | 2.885.003,20 |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA | 10.418.335/0001-88 | 0,3% | 387.557,67 | 0,6% | 378.379,45 |
| BB AÇÕES AGRO | 40.054.357/0001-77 | 0,7% | 987.257,30 | 1,6% | 1.002.887,23 |
| BB AÇÕES RETORNO TOTAL | 09.005.805/0001-00 | 0,1% | 73.816,31 | 0,1% | 82.151,09 |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE | 30.068.169/0001-44 | 1,0% | 1.385.390,15 | 2,2% | 1.351.953,86 |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTI LP | 14.120.520/0001-42 | 0,1% | 78.996,36 | 0,1% | 69.631,57 |
| CAIXA FIA ELETROBRAS | 45.443.475/0001-90 | 0,4% | 502.589,47 | 0,0% | - |
| FUNDOS DE INVESTIMENTO DO EXTERIOR | | 3,5% | 4.936.248,07 | 10,4% | 6.414.878,37 |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF IE FIA | 28.578.897/0001-54 | 1,0% | 1.440.705,99 | 3,3% | 2.035.605,60 |
| BB AÇÕES EUROPEIAS BDR I | 38.236.242/0001-51 | 1,4% | 1.813.566,69 | 3,3% | 2.025.581,42 |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 17.502.937/0001-68 | 1,4% | 1.681.975,39 | 3,8% | 2.353.691,36 |
| CONTAS CORRENTES | | 0,0% | - | 0,0% | - |
| BANCO DO BRASIL | | 0,0% | - | 0,0% | - |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL | | 0,0% | - | 0,0% | - |
| TOTAL DA CARTEIRA | | 100,0% | 139.498.818,68 | 100,0% | 61.719.881,76 |

POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



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



3 RESGATE, CUSTO DAS APLICAÇÕES E ENQUADRAMENTO LEGAL – POSICIONADO EM DEZEMBRO 2022

| 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% | 4,89% |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 03.543.447/0001-03 | D+1 | 0,20% | Art. 7º, I, b | 100% | 4,93% |
| BB PREV RF IDKA 2 TP | 13.322.205/0001-35 | D+1 | 0,20% | Art. 7º, I, b | 100% | 4,91% |
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC | 13.077.415/0001-05 | D+0 | 1,00% | Art. 7º, III, a | 60% | 1,90% |
| BB PREV RF PERFIL FIC FI | 13.077.418/0001-49 | D+0 | 0,2% a 0,3% | Art. 7º, III, a | 60% | 5,42% |
| BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 | D+0 | 0,15% | Art. 7º, I, b | 100% | 27,70% |
| BB PREV RF TP VÉRTICE 2027 | 46.134.096/0001-81 | D+0 | 0,20% | Art. 7º, I, b | 100% | 2,48% |
| BB PREV RF TP VÉRTICE 2030 | 46.134.117/0001-69 | D+0 | 0,20% | Art. 7º, I, b | 100% | 2,53% |
| BB RF ALOC RET TOTAL | 35.292.588/0001-89 | D+3 | 0,3% a 0,5% | Art. 7º, III, a | 60% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RF CRÉDITO PRIVADO | 21.918.896/0001-62 | D+0 | 0,20% | Art. 7º, V, b | 5% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL 2023 TP FI RF | 44.683.378/0001-02 | D+0 | 0,20% | Art. 7º, I, b | 100% | 16,43% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF | 10.740.670/0001-06 | D+0 | 0,20% | Art. 7º, I, b | 100% | 4,72% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP | 14.508.605/0001-00 | D+0 | 0,20% | Art. 7º, I, b | 100% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP | 14.386.926/0001-71 | D+0 | 0,20% | Art. 7º, I, b | 100% | 5,65% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI RF LP | 11.060.913/0001-10 | D+0 | 0,20% | Art. 7º, I, b | 100% | 3,50% |
| CAIXA BRASIL FI RF REF DI LP | 03.737.206/0001-97 | D+0 | 0,20% | Art. 7º, III, a | 60% | 4,82% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF | 14.508.643/0001-55 | D+0 | 1,50% | Art. 7º, I, b | 100% | 2,04% |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RF LP | 35.536.532/0001-22 | D+1 | 0,40% | Art. 7º, III, a | 60% | 1,12% |
| CAIXA BRASIL TP FI RF LP | 05.164.356/0001-84 | D+0 | 0,20% | Art. 7º, I, b | 100% | 0,48% |
| CAIXA ALIANÇA TP FI RF | 05.164.358/0001-73 | D+0 | 0,20% | Art. 7º, I, b | 100% | 0,50% |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 | D+0 | 0,20% | Art. 7º, III, a | 60% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF | 23.215.097/0001-55 | D+0 | 0,40% | Art. 7º, I, b | 100% | 0,00% |
| FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL | | | | | | |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA | 10.418.335/0001-88 | D+3 | 1,00% | Art. 8º, I | 30% | 0,28% |
| BB AÇÕES AGRO | 40.054.357/0001-77 | D+2 | 1,00% | Art. 8º, I | 30% | 0,71% |
| BB AÇÕES RETORNO TOTAL | 09.005.805/0001-00 | D+3 | 1% a 2% | Art. 8º, II | 30% | 0,05% |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE | 30.068.169/0001-44 | D+15 | 2,00% | Art. 8º, I | 30% | 0,99% |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTI LP | 14.120.520/0001-42 | D+0 | 0,70% | Art. 10º, I | 10% | 0,06% |
| CAIXA FIA ELETROBRAS | 45.443.475/0001-90 | D+3 | 0,45% | Art. 8º, I | 30% | 0,36% |
| 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% | 1,03% |
| BB AÇÕES EUROPEIAS BDR I | 38.236.242/0001-51 | D+2 | 0,85% | Art. 9º, III | 10% | 1,30% |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 17.502.937/0001-68 | D+3 | 0,70% | Art. 9º, III | 10% | 1,21% |



4 MOVIMENTAÇÕES – CONSOLIDADO 2022

| DATA | VALOR | MOVIMENTO | ATIVOS | CNPJ |
|------------|--------------|-----------|---------------------------------------|--------------------|
| 31/01/2022 | 839.671,19 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP | 14.386.926/0001-71 |
| 31/01/2022 | 839.671,19 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI RF LP | 11.060.913/0001-10 |
| 31/01/2022 | 839.671,19 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF | 10.740.670/0001-06 |
| 10/02/2022 | 839.671,18 | APLICAÇÃO | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 03.543.447/0001-03 |
| 10/02/2022 | 839.671,18 | APLICAÇÃO | BB PREV RF IRF-M1 TP | 11.328.882/0001-35 |
| 10/02/2022 | 839.671,18 | APLICAÇÃO | BB PREV RF IDKA 2 TP | 13.322.205/0001-35 |
| 11/03/2022 | 2.255.990,27 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL 2023 TP FI RF | 44.683.378/0001-02 |
| 24/03/2022 | 2.250.000,00 | APLICAÇÃO | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC | 13.077.415/0001-05 |
| 25/03/2022 | 2.250.909,29 | RESGATE | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC | 13.077.415/0001-05 |
| 25/03/2022 | 2.250.909,29 | APLICAÇÃO | BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 |
| 01/04/2022 | 3.680.264,75 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL 2023 TP FI RF | 44.683.378/0001-02 |
| 04/04/2022 | 3.680.264,75 | APLICAÇÃO | BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 |
| 07/04/2022 | 113.112,08 | APLICAÇÃO | BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 |
| 28/04/2022 | 317.928,50 | APLICAÇÃO | BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 |
| 29/04/2022 | 4.726.518,58 | APLICAÇÃO | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC | 13.077.415/0001-05 |
| 02/05/2022 | 4.728.443,53 | APLICAÇÃO | BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 |
| 02/05/2022 | 4.728.443,53 | RESGATE | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC | 13.077.415/0001-05 |
| 16/05/2022 | 315.507,04 | RESGATE | BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 |
| 18/05/2022 | 204.630,68 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 |
| 19/05/2022 | 204.630,68 | RESGATE | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 |
| 19/05/2022 | 204.630,68 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL 2023 TP FI RF | 44.683.378/0001-02 |
| 20/05/2022 | 316.948,27 | APLICAÇÃO | BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 |
| 31/05/2022 | 4.924.053,58 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 |
| 01/06/2022 | 4.924.053,58 | RESGATE | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 |
| 01/06/2022 | 5.097.760,86 | APLICAÇÃO | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC | 13.077.415/0001-05 |
| 02/06/2022 | 5.097.760,86 | RESGATE | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC | 13.077.415/0001-05 |
| 02/06/2022 | 5.097.760,86 | APLICAÇÃO | BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 |
| 08/06/2022 | 500.000,00 | RESGATE | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF | 10.740.670/0001-06 |
| 09/06/2022 | 500.000,00 | APLICAÇÃO | CAIXA FIA ELETROBRAS | 45.443.475/0001-90 |
| 01/07/2022 | 5.017.511,52 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 |
| 08/07/2022 | 5.017.511,52 | RESGATE | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 |



MOVIMENTAÇÕES – CONSOLIDADO 2022

| DATA | VALOR | MOVIMENTO | ATIVOS | CNPJ |
|------------|---------------|-----------|---------------------------------------|--------------------|
| 08/07/2022 | 5.017.511,52 | APLICAÇÃO | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC | 13.077.415/0001-05 |
| 11/07/2022 | 5.017.511,52 | RESGATE | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC | 13.077.415/0001-05 |
| 11/07/2022 | 5.017.511,52 | APLICAÇÃO | BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 |
| 29/07/2022 | 5.608.056,23 | APLICAÇÃO | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC | 13.077.415/0001-05 |
| 01/08/2022 | 5.608.056,23 | APLICAÇÃO | BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 |
| 01/08/2022 | 5.608.056,23 | RESGATE | BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC | 13.077.415/0001-05 |
| 30/08/2022 | 5.561.289,98 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 |
| 09/09/2022 | 5.561.289,98 | APLICAÇÃO | BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 |
| 09/09/2022 | 5.561.289,98 | RESGATE | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 |
| 14/09/2022 | 40.000,00 | RESGATE | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 |
| 23/09/2022 | 29.179,86 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF | 10.740.670/0001-06 |
| 23/09/2022 | 29.179,86 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF | 14.508.643/0001-55 |
| 23/09/2022 | 29.179,86 | APLICAÇÃO | CAIXA ALIANÇA TP FI RF | 05.164.358/0001-73 |
| 23/09/2022 | 29.179,86 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP | 14.386.926/0001-71 |
| 30/09/2022 | 5.682.180,88 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 |
| 17/10/2022 | 5.682.180,88 | RESGATE | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 |
| 18/10/2022 | 5.682.180,88 | APLICAÇÃO | BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 |
| 01/11/2022 | 5.874.302,47 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 |
| 03/11/2022 | 5.874.302,47 | RESGATE | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 |
| 04/11/2022 | 2.937.151,23 | APLICAÇÃO | BB PREV RF TP VÉRTICE 2027 | 46.134.096/0001-81 |
| 04/11/2022 | 2.937.151,23 | APLICAÇÃO | BB PREV RF TP VÉRTICE 2030 | 46.134.117/0001-69 |
| 16/11/2022 | 1.124.251,73 | RESGATE | BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 |
| 16/11/2022 | 81.811,82 | RESGATE | BB PREV RF TP VÉRTICE 2027 | 46.134.096/0001-81 |
| 23/11/2022 | 190.598,96 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL 2023 TP FI RF | 44.683.378/0001-02 |
| 24/11/2022 | 603.031,78 | APLICAÇÃO | BB PREV RF TP VÉRTICE 2027 | 46.134.096/0001-81 |
| 24/11/2022 | 603.031,78 | APLICAÇÃO | BB PREV RF TP VÉRTICE 2030 | 46.134.117/0001-69 |
| 01/12/2022 | 6.135.542,84 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL 2023 TP FI RF | 44.683.378/0001-02 |
| 22/12/2022 | 9.602.415,61 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 |
| 23/12/2022 | 10.299.815,37 | RESGATE | CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 |
| 23/12/2022 | 9.779.570,64 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL 2023 TP FI RF | 44.683.378/0001-02 |
| 26/12/2022 | 520.244,79 | APLICAÇÃO | CAIXA BRASIL 2023 TP FI RF | 44.683.378/0001-02 |



5 RENDIMENTOS – 2022

| ATIVOS | CNPJ | JANEIRO | FEVEREIRO | MARÇO | ABRIL | MAIO | JUNHO | JULHO | AGOSTO | SETEMBRO | OUTUBRO | NOVEMBRO | DEZEMBRO | TOTAL |
|---|--------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|-------------|--------------|--------------|-------------|--------------|-------------|---------------------|
| FUNDOS DE RENDA FIXA | | | | | | | | | | | | | | |
| BB PREV RF IRF-M1 TP | 11.328.882/0001-35 | 32.405,92 | 42.760,40 | 53.698,35 | 43.700,78 | 57.964,85 | 58.278,02 | 66.757,74 | 77.947,96 | 71.127,48 | 65.145,06 | 61.129,17 | 78.079,49 | 708.995,22 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 03.543.447/0001-03 | 4.177,15 | 62.787,65 | 163.611,03 | 99.413,72 | 50.872,22 | 21.153,75 | - 201,15 | 408,42 | 26.766,97 | 126.752,55 | - 25.124,13 | 62.212,19 | 592.830,37 |
| BB PREV RF IDKA 2 TP | 13.322.205/0001-35 | 523,13 | 68.826,89 | 166.130,49 | 96.550,39 | 51.174,22 | 17.707,55 | - 14.738,05 | - 2.966,49 | 35.236,79 | 124.040,06 | - 44.526,52 | 82.489,10 | 580.447,56 |
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC | 13.077.415/0001-05 | 15.480,50 | 16.190,34 | 20.940,71 | 17.639,35 | 25.184,15 | 25.230,54 | 25.939,78 | 29.777,24 | 25.324,69 | 24.445,60 | 24.278,67 | 27.092,22 | 277.523,79 |
| BB PREV RF PERFIL FIC FI | 13.077.418/0001-49 | 52.650,72 | 54.076,52 | 65.791,68 | 53.916,70 | 74.073,63 | 72.036,09 | 73.505,94 | 84.809,99 | 79.239,14 | 76.179,26 | 75.716,82 | 83.991,83 | 845.988,31 |
| BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 | - | - | - 7.005,00 | 127.253,89 | 55.865,98 | 37.040,04 | 37.184,83 | - 37.048,60 | 42.219,81 | 799.097,70 | 284.752,21 | 365.504,17 | 1.704.865,03 |
| BB PREV RF TP VÉRTICE 2027 | 46.134.096/0001-81 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - 10.708,02 | 11.051,54 | 343,52 |
| BB PREV RF TP VÉRTICE 2030 | 46.134.117/0001-69 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - 6.880,31 | - 2.943,85 | - 9.824,16 |
| BB RF ALOC RET TOTAL | 35.292.588/0001-89 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RF CRED PRIV | 21.918.896/0001-62 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA BRASIL 2023 TP FI RF | 44.683.378/0001-02 | - | - | 28.995,40 | 125.208,34 | - 167.544,98 | 19.915,10 | 4.583,59 | - 8.737,47 | 5.096,86 | 137.525,60 | - 144.668,94 | 154.319,38 | 154.692,89 |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF | 10.740.670/0001-06 | 33.584,85 | 46.300,19 | 55.707,39 | 46.955,57 | 60.668,88 | 56.764,17 | 63.492,81 | 75.279,33 | 68.535,65 | 62.949,84 | 59.482,06 | 75.201,43 | 704.922,16 |
| CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP | 14.508.605/0001-00 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP | 14.386.926/0001-71 | 1.196,76 | 82.556,06 | 191.333,52 | 104.701,89 | 64.678,10 | 17.151,82 | - 22.409,88 | - 8.308,99 | 38.990,27 | 140.915,48 | - 55.302,06 | 96.071,78 | 651.574,77 |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI RF LP | 11.060.913/0001-10 | 3.266,35 | 46.840,13 | 116.485,55 | 70.959,60 | 35.871,81 | 15.768,95 | 981,01 | 2.258,18 | 20.273,13 | 89.389,98 | - 16.933,74 | 44.617,65 | 429.778,61 |
| CAIXA BRASIL FI RF REF DI LP | 03.737.206/0001-97 | 46.915,94 | 49.216,09 | 56.191,21 | 48.920,38 | 66.344,47 | 66.070,10 | 63.388,88 | 75.494,75 | 71.109,38 | 67.149,29 | 68.230,01 | 76.349,88 | 755.380,37 |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF | 14.508.643/0001-55 | 15.474,15 | 16.233,52 | 20.249,02 | 18.561,39 | 23.223,66 | 23.097,97 | 24.056,35 | 27.387,11 | 25.413,31 | 24.522,35 | 24.657,32 | 27.134,43 | 270.010,59 |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RF LP | 35.536.532/0001-22 | 11.440,17 | 13.141,10 | 11.695,62 | 13.751,49 | 18.492,43 | 1.266,29 | 9.192,92 | 23.383,59 | 19.396,53 | 14.751,29 | - 3.034,98 | 18.500,58 | 151.977,03 |
| CAIXA BRASIL TP FI RF LP | 05.164.356/0001-84 | 4.688,82 | 5.220,09 | 5.289,40 | 4.523,65 | 6.551,91 | 6.312,12 | 6.368,30 | 7.391,02 | 6.960,26 | 6.521,77 | 6.357,73 | 7.185,33 | 73.370,41 |
| CAIXA ALIANÇA TP FI RF | 05.164.358/0001-73 | 4.204,41 | 4.348,61 | 5.406,13 | 4.934,72 | 6.154,11 | 6.115,83 | 6.312,00 | 7.196,08 | 6.753,77 | 6.723,00 | 6.789,24 | 7.545,14 | 72.483,04 |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 | 4.998,66 | 5.193,07 | 5.559,34 | 4.761,87 | 6.776,99 | 8.628,80 | 18.877,38 | 10.615,41 | 24.930,00 | 35.617,04 | 10.222,86 | 10.867,22 | 147.048,65 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF | 23.215.097/0001-55 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL | | | | | | | | | | | | | | |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA | 10.418.335/0001-88 | 25.337,04 | 3.237,36 | 24.808,07 | - 43.346,27 | 11.369,29 | - 47.121,70 | 15.577,38 | 24.217,50 | - 515,81 | 22.075,05 | - 16.021,31 | - 10.438,38 | 9.178,22 |
| BB AÇÕES AGRO | 40.054.357/0001-77 | 2.912,54 | - 5.046,10 | 77.059,03 | - 40.336,38 | 32.225,99 | - 143.283,07 | 30.410,08 | 66.530,34 | - 34.699,87 | 81.369,01 | - 56.113,49 | - 26.658,00 | - 15.629,93 |
| BB AÇÕES RETORNO TOTAL | 09.005.805/0001-00 | 918,49 | - 2.117,58 | 4.460,86 | - 6.667,92 | 2.301,03 | - 9.592,54 | 3.091,99 | 6.536,92 | - 2.319,13 | 4.858,92 | - 7.630,99 | - 2.174,82 | - 8.334,78 |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE | 30.068.169/0001-44 | 18.968,29 | - 5.234,47 | 91.134,12 | - 43.975,77 | 43.364,48 | - 153.257,42 | 54.244,87 | 86.473,54 | - 46.415,60 | 80.685,48 | - 57.332,33 | - 35.218,88 | 33.436,29 |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTI LP | 14.120.520/0001-42 | 717,40 | 778,00 | 749,44 | 689,71 | 739,45 | 835,19 | 636,95 | 1.080,90 | 908,06 | 746,20 | 574,49 | 908,99 | 9.364,79 |
| CAIXA FIA ELETROBRAS | 45.443.475/0001-90 | - | - | - | - | - | 52.387,34 | - 4.837,41 | 3.356,48 | - 37.609,24 | 81.316,21 | - 27.789,41 | - 64.234,51 | 2.589,47 |
| FUNDOS DE INVESTIMENTO DO EXTERIOR | | | | | | | | | | | | | | |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF IE FIA | 28.578.897/0001-54 | - 173.860,87 | - 93.297,69 | - 118.581,19 | - 64.190,32 | - 63.465,09 | 20.120,08 | 33.277,73 | - 24.123,89 | - 81.135,82 | - 33.280,67 | 36.479,90 | - 32.841,77 | - 594.899,61 |
| BB AÇÕES EUROPEIAS BDR I | 38.236.242/0001-51 | - 48.012,20 | - 77.145,36 | - 5.377,13 | - 84.273,48 | 46.672,74 | - 188.704,79 | 89.921,84 | - 114.386,10 | - 135.696,49 | 121.026,31 | 202.590,62 | - 18.630,68 | - 212.014,73 |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 17.502.937/0001-68 | - 229.391,63 | - 151.182,66 | - 81.130,49 | - 129.027,06 | - 78.222,36 | 13.940,75 | 133.805,68 | - 71.673,57 | - 135.996,40 | 27.670,89 | 114.176,14 | - 84.685,26 | - 671.715,96 |



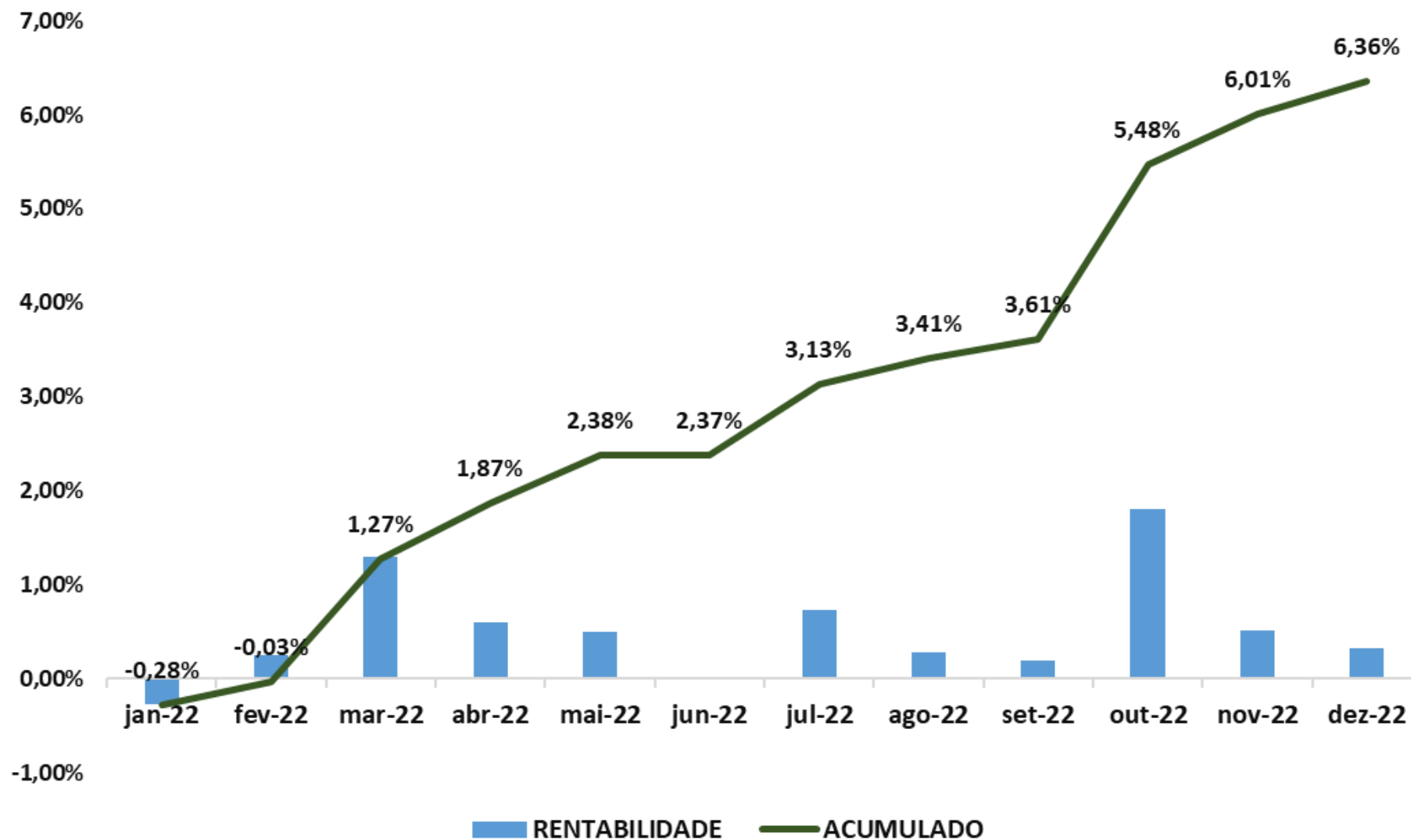
6 RENTABILIDADE E RISCO DOS ATIVOS – POSICIONADO EM DEZEMBRO DE 2022

| 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% | 11,73% | - |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 03.543.447/0001-03 | IMA-B5 | 0,91% | 9,51% | - |
| BB PREV RF IDKA 2 TP | 13.322.205/0001-35 | IDKA IPCA 2A | 1,22% | 9,32% | 2,79% |
| BB PREV FLUXO RF SIMPLES FIC | 13.077.415/0001-05 | SELIC | 1,03% | 11,26% | - |
| BB PREV RF PERFIL FIC FI | 13.077.418/0001-49 | CDI | 1,01% | 12,59% | - |
| BB PREV TP IPCA | 15.486.093/0001-83 | IPCA + 6% a.a. | 0,96% | 11,41% | 2,27% |
| BB PREV RF TP VÉRTICE 2027 | 46.134.096/0001-81 | IPCA + 5% a.a. | 0,32% | 1,03% | 2,72% |
| BB PREV RF TP VÉRTICE 2030 | 46.134.117/0001-69 | IPCA + 5% a.a. | -0,08% | 0,43% | 2,71% |
| BB RF ALOC RET TOTAL | 35.292.588/0001-89 | IPCA + 6% a.a. | 0,77% | 9,30% | - |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RF CRÉDITO PRIVADO | 21.918.896/0001-62 | IPCA + 6% a.a. | 0,93% | 10,36% | 1,28% |
| CAIXA BRASIL 2023 TP FI RF | 44.683.378/0001-02 | IPCA + 5% a.a. | 0,95% | 10,51% | 0,74% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF | 10.740.670/0001-06 | IRF-M1 | 1,15% | 11,74% | 0,07% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF LP | 14.508.605/0001-00 | IRF-M | 1,44% | 8,72% | 1,80% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP | 14.386.926/0001-71 | IDKA IPCA 2A | 1,23% | 9,04% | 1,56% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI RF LP | 11.060.913/0001-10 | IMA-B5 | 0,92% | 9,67% | 1,31% |
| CAIXA BRASIL FI RF REF DI LP | 03.737.206/0001-97 | CDI | 1,15% | 12,67% | 0,02% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RF | 14.508.643/0001-55 | - | 0,96% | 10,58% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RF LP | 35.536.532/0001-22 | IPCA | 1,20% | 10,77% | 0,57% |
| CAIXA BRASIL TP FI RF LP | 05.164.356/0001-84 | CDI | 1,09% | 12,43% | 0,03% |
| CAIXA ALIANÇA TP FI RF | 05.164.358/0001-73 | - | 1,10% | 12,11% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF | 23.215.008/0001-70 | CDI | 1,13% | 12,76% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF | 23.215.097/0001-55 | - | 1,14% | 10,70% | 0,36% |
| FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL | | | | | |
| BB AÇÕES GOVERNANÇA | 10.418.335/0001-88 | ETF - AÇÕES | -2,62% | 2,43% | 8,79% |
| BB AÇÕES AGRO | 40.054.357/0001-77 | - | -2,63% | -1,56% | - |
| BB AÇÕES RETORNO TOTAL | 09.005.805/0001-00 | IBOVESPA | -2,86% | -10,15% | - |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE | 30.068.169/0001-44 | - | -2,48% | 2,47% | 6,85% |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTI LP | 14.120.520/0001-42 | CDI | 1,16% | 13,45% | 0,08% |
| CAIXA FIA ELETROBRAS | 45.443.475/0001-90 | ELET3 | -11,33% | 1,47% | 11,08% |
| FUNDOS DE INVESTIMENTO DO EXTERIOR | | | | | |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF IE FIA | 28.578.897/0001-54 | MSCI ACWI | -2,23% | -29,22% | 0,00% |
| BB AÇÕES EUROPEIAS BDR I | 38.236.242/0001-51 | - | -1,02% | -10,47% | - |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 17.502.937/0001-68 | - | -4,79% | -28,54% | 10,49% |

* 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.



7 RENTABILIDADE DA CARTEIRA – 2022





8 CONSIDERAÇÕES FINAIS

Operacionalizado na competência de novembro de 2020, o Fundo Previdenciário acumulou R\$ 139.498.818,68 (cento e trinta e nove milhões, quatrocentos e noventa e oito mil, oitocentos e dezoito reais e sessenta e oito centavos) até 31 de dezembro de 2022, compostos pelas contribuições normais e dos respectivos rendimentos financeiros obtidos no período.

A rentabilidade ocorrida ao longo do exercício de 2022, de 6,36%, foi superior a rentabilidade alcançada no ano de 2021, de 2,71%. O Fundo Previdenciário do RPPS/GO, desde o início de sua vigência, ainda não atingiu a meta de investimento estabelecida pelo Comitê de Investimentos da GOIASPREV, sendo o resultado aferido em 2022 inferior a meta de 10,80% estabelecida na Política de Investimentos de 2022.

A análise das aplicações é imprescindível para buscar o bom desempenho dos investimentos e possibilitar tomadas de decisões mais assertivas, com o intuito de diminuir o risco e obter melhor retorno.

Goiás
Previdência



ESTADO DE GOIÁS
GOIÁS PREVIDÊNCIA - GOIASPREV
COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Processo: 202211129011199

Nome: GOIÁS PREVIDÊNCIA - GOIASPREV

Assunto: Parecer do Comitê de Investimentos - Exercício 2022

PARECER GOIASPREV/CI-19523 Nº 3/2023

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 dezembro/2022, o 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 dezembro/2022 e outros documentos complementares disponibilizados à GOIASPREV.

Com a ampliação da vacinação contra a Covid-19, a atividade econômica mundial foi retomada rapidamente. Assim, um aumento da demanda foi registrado, enquanto a oferta não acompanhou o fato na mesma proporção. Consequentemente houve um aumento da inflação, ainda impulsionado fortemente pela guerra na Ucrânia. A inflação que em 2021 foi considerada como transitória, em 2022 não foi vista da mesma forma e influenciou fortemente os resultados dos mercados mundiais, assim como levou os bancos centrais globais a um aperto em suas políticas monetárias.

Já no Brasil, apesar das oscilações durante o ano, 2022 finalizou positivo. Os resultados do país foram influenciados pelos reflexos da guerra na Ucrânia, pelos altos níveis de inflação em grande parte dos países e, já no segundo semestre, pela incerteza política relativa as eleições presidenciais. No último pregão do ano o Ibovespa fechou aos 109.734 pontos, com queda de 2,45% em dezembro e alta acumulada de 4,69% em 2022. O dólar comercial encerrou o último mês do ano em R\$ 5,21, com queda de aproximadamente 1,51% em relação ao mês anterior e queda acumulada de 6,5% no ano. A taxa Selic é de 13,75% ao ano e o IPCA se encontra em 5,79%.

No que diz respeito aos investimentos do Fundo Previdenciário da GOIASPREV, a maioria dos fundos de renda fixa finalizaram o ano com rendimentos positivos, com exceção do BB PREV RF TP VÉRTICE 2030 (46.134.117/0001-69), que finalizou o período com rendimentos negativos. Já os fundos de renda variável não tiveram desempenho dentro do esperado, sendo que, dos seis fundos com capital investido, dois apresentaram rendimentos negativos: BB AÇÕES AGRO (40.054.357/0001-77) e BB AÇÕES RETORNO TOTAL (09.005.805/0001-00). Em relação aos investimentos que se enquadram como investimentos no exterior, os rendimentos foram expressivamente negativos para os três fundos investidos.

O valor de cota do Fundo Previdenciário iniciou o exercício de 2022 o com uma cota de abertura de R\$ 1,036453 e uma cota de fechamento de R\$ 1,102387, repercutindo numa rentabilidade anual de 6,36%, inferior à meta atuarial de 10,80% qual considera a inflação desta do exercício de 5,79% da taxa de juros parâmetro do Fundo Previdenciário do exercício 2022 fixada em 5,01%.

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) 26 dia(s) do mês de março de 2023.



Documento assinado eletronicamente por **MARCOS MEDEIROS DA SILVA, Gerente**, em 27/03/2023, às 16:20, 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 27/03/2023, às 16:34, 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 28/03/2023, às 11:47, 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 **46106705** e o código CRC **0660F1F4**.

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 46106705