

PREVSOL

(INVESTIMENTOS_2023)

LEMA 

APRESENTAÇÃO

Este relatório atende ao parágrafo terceiro do art. 101 da Portaria MTP nº 1.467 de 2022:

§ 3º No início de cada exercício, a unidade gestora deverá apresentar aos conselhos deliberativo e fiscal o relatório de acompanhamento da execução da política de investimentos relativo ao ano anterior.

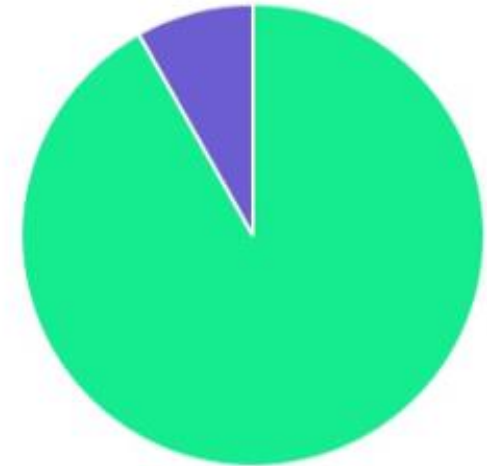
Os dados aqui apresentados foram extraídos do Uno, sistema de gestão de investimentos utilizado pelo PREVSOL.

CARTEIRA CONSOLIDADA_DEZ/2023

ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	R\$ 6.889.462,36	14.91%	D+1	7, I "b"
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 11.533.510,04	24.96%	D+0	7, I "b"
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	R\$ 6.133.906,23	13.28%	D+3	7, I "b"
BNB RPPS IMA-B FI RF	R\$ 2.937.652,25	6.36%	D+1	7, I "b"
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	R\$ 614.995,44	1.33%	D+360	7, I "b"
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 3.182.751,91	6.89%	D+1	7, I "b"
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 1.553.169,86	3.36%	D+0	7, III "a"
BB PERFIL FIC RF REF DI...	R\$ 8.085.914,48	17.50%	D+0	7, III "a"
BNB PLUS FIC RF LP	R\$ 1.481.631,25	3.21%	D+1	7, III "a"
BB MULTIMERCADO LP...	R\$ 3.787.461,87	8.20%	D+1	10, I
Total investimentos	R\$ 46.200.455,69	100.00%		
Disponibilidade	R\$ 5.810,91	-		
Total patrimônio	R\$ 46.206.266,60	100.00%		

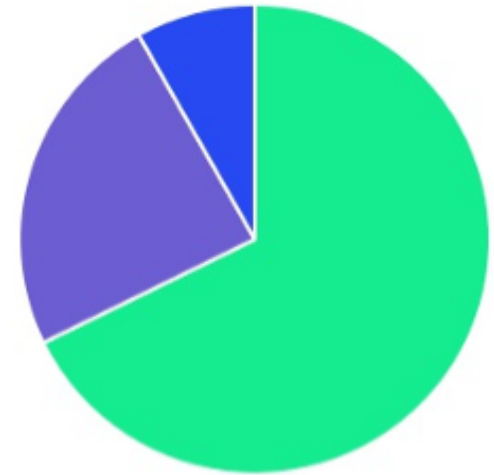
DISTRIBUIÇÃO_CLASSE

CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	91,80%	R\$ 42.412.993,82	
Estruturados	8,20%	R\$ 3.787.461,87	
Total	100,00%	R\$ 46.200.455,69	





DISTRIBUIÇÃO_ENQUADRAMENTO

ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	67,73%	R\$ 31.292.278,23	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	24,07%	R\$ 11.120.715,59	
Artigo 10º, Inciso I	8,20%	R\$ 3.787.461,87	
Total	100,00%	R\$ 46.200.455,69	





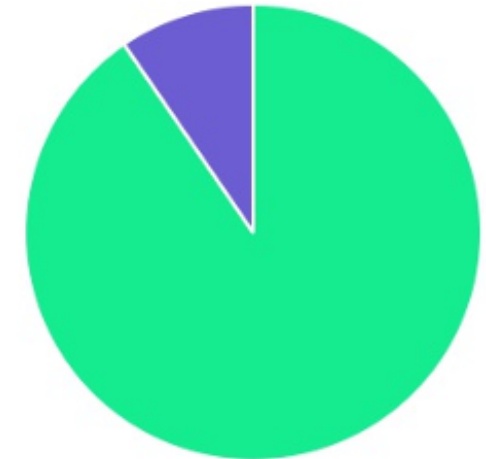
DISTRIBUIÇÃO_GESTOR

GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	90,43%	R\$ 41.781.172,19	
BANCO DO NORDESTE	9,57%	R\$ 4.419.283,50	
Total	100,00%	R\$ 46.200.455,69	



DISTRIBUIÇÃO_ADMINISTRADOR

ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	90,43%	R\$ 41.781.172,19	
S3 CACEIS	9,57%	R\$ 4.419.283,50	
Total	100,00%	R\$ 46.200.455,69	





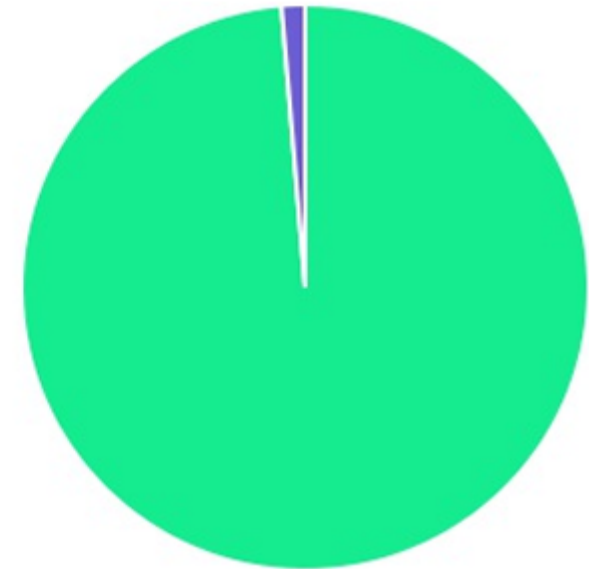
DISTRIBUIÇÃO_BENCHMARK

BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CDI	32,27%	R\$ 14.908.177,46	
IRF-M 1	24,96%	R\$ 11.533.510,04	
IMA-B 5	14,91%	R\$ 6.889.462,36	
IMA Geral ex-C	13,28%	R\$ 6.133.906,23	
IRF-M	6,89%	R\$ 3.182.751,91	
IMA-B	6,36%	R\$ 2.937.652,25	
IPCA	1,33%	R\$ 614.995,44	
Total	100,00%	R\$ 46.200.455,69	



DISTRIBUIÇÃO_LIQUIDEZ

LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	98,67%	R\$ 45.585.460,25	
181 a 365 dias	1,33%	R\$ 614.995,44	
Total	100,00%	R\$ 46.200.455,69	



ENQUADRAMENTOS

Tipo de Ativo	Carteira Atual (R\$)	Carteira Atual (%)	Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)
Títulos Tesouro Nacional – SELIC - Art. 7º, I, “a”.	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	8,00%	100,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - Art. 7º, I, “b”	R\$ 28.221.923,06	63,91%	0,00%	60,00%	100,00%
FI Renda Fixa - Art. 7º, III, “a”	R\$ 12.314.096,26	27,88%	0,00%	20,00%	60,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III, “b”	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%
FI Ações – Art. 8º, I	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	5,00%	30,00%
FI Ações – BDR Nível 1 – Art. 9º, III	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%
FI Multimercado – aberto – Art. 10º, I	R\$ 3.626.065,17	8,21%	0,00%	7,00%	10,00%
Empréstimos Consignados – Art. 12º	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%
Total Geral	R\$ 44.162.084,49	100,00%	0,00%	100,00%	

MOVIMENTAÇÕES_2023

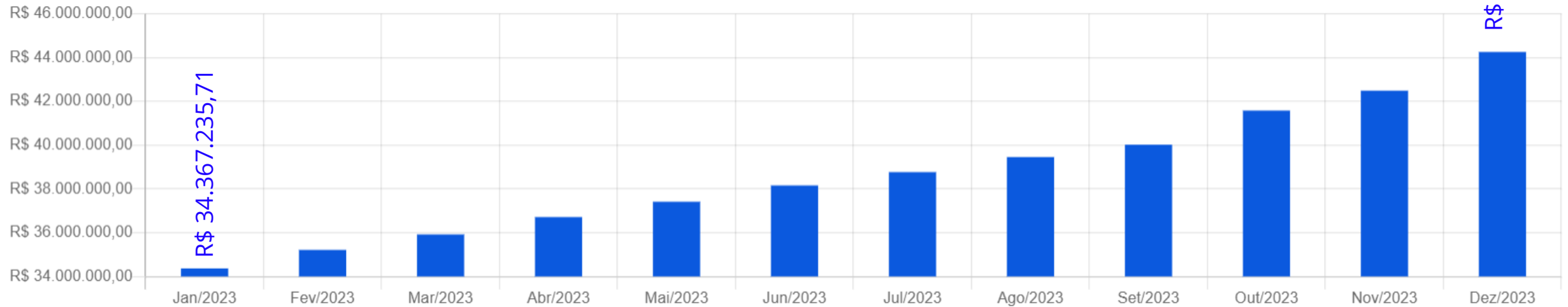
PERÍODO	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO FINAL
JANEIRO	R\$ 363.272,74	R\$ 11.798,22	R\$ 34.367.235,71
FEVEREIRO	R\$ 644.027,34	R\$ 257.221,43	R\$ 35.214.530,30
MARÇO	R\$ 23.000,00	R\$ 30.714,79	R\$ 35.920.253,47
ABRIL	R\$ 951.558,77	R\$ 155.665,70	R\$ 36.713.935,84
MAIO	R\$ 538.367,70	R\$ 253.327,10	R\$ 37.414.841,53
JUNHO	R\$ 1.827.921,62	R\$ 1.520.161,70	R\$ 38.158.578,23
JULHO	R\$ 338.580,00	R\$ 59.004,43	R\$ 38.768.552,12
AGOSTO	R\$ 668.571,20	R\$ 270.680,31	R\$ 39.455.381,11
SETEMBRO	R\$ 270.680,43	R\$ 55.778,48	R\$ 40.021.065,59
OUTUBRO	R\$ 1.486.916,52	R\$ 30.697,31	R\$ 41.580.076,07
NOVEMBRO	R\$ 4.741.500,00	R\$ 4.273.477,52	R\$ 42.488.875,98
DEZEMBRO	R\$ 3.700.691,61	R\$ 2.514.767,52	R\$ 44.256.989,95

RENTABILIDADES_2023

2023	IPCA + 4.74% a.a.					
Janeiro	R\$ 33.639.448,94	R\$ 34.367.235,71	0,92%	R\$ 388.172,70	1,15%	0,24p.p.
Fevereiro	R\$ 34.367.235,71	R\$ 35.214.530,30	1,23%	R\$ 389.722,33	1,13%	-0,09p.p.
Março	R\$ 35.214.530,30	R\$ 35.920.253,47	1,10%	R\$ 469.239,13	1,34%	0,24p.p.
Abril	R\$ 35.920.253,47	R\$ 36.713.935,84	1,00%	R\$ 312.754,49	0,87%	-0,13p.p.
Maio	R\$ 36.713.935,84	R\$ 37.414.841,53	0,62%	R\$ 338.934,49	0,92%	0,30p.p.
Junho	R\$ 37.414.841,53	R\$ 38.158.578,23	0,31%	R\$ 434.385,61	1,16%	0,85p.p.
Julho	R\$ 38.158.578,23	R\$ 38.768.552,12	0,51%	R\$ 377.954,81	0,99%	0,48p.p.
Agosto	R\$ 38.768.552,12	R\$ 39.455.381,11	0,62%	R\$ 315.269,41	0,81%	0,20p.p.
Setembro	R\$ 39.455.381,11	R\$ 40.021.065,59	0,65%	R\$ 186.832,34	0,47%	-0,17p.p.
Outubro	R\$ 40.021.065,59	R\$ 41.580.076,07	0,63%	R\$ 144.859,70	0,36%	-0,27p.p.
Novembro	R\$ 41.580.076,07	R\$ 42.488.875,98	0,67%	R\$ 567.293,17	1,38%	0,71p.p.
Dezembro	R\$ 42.488.875,98	R\$ 44.256.989,95	0,95%	R\$ 487.284,50	1,14%	0,19p.p.
Total	R\$ 42.488.875,98	R\$ 44.256.989,95	9,58%	R\$ 4.412.702,66	12,36%	2,78p.p.

A rentabilidade de R\$ 4.412.702,66 corresponde a 9,97% do Patrimônio Líquido (PL) do PREVSOL.

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL_2023



CONCLUSÃO

O PREVSOL encerrou 2023 superando a meta atuarial em 2,78 p.p.

Os investimentos permaneceram aderentes aos limites impostos pela Política de Investimentos e pela Resolução CMN nº 4.963/2021.

A composição da carteira de investimentos da PREVSOL respeita o seu perfil de risco considerado como conservador.

Os processos decisórios das aplicações dos recursos são sempre avaliados e aprovados pelo Comitê de Investimentos com o apoio da LEMA.

A análise dos riscos e a avaliação e acompanhamento do retorno dos investimentos foi realizada mensalmente através de relatórios específicos gerados pelo Uno e monitorados conjuntamente pelo Comitê de Investimentos e pela LEMA.

PREVSOL

(INVESTIMENTOS_2023)

LEMA 