



LagesPrevi

Instituto de Previdência do Município de Lages

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

1º TRIMESTRE DE 2023



LagesPrevi

Instituto de Previdência do Município de Lages

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS – 1º TRIMESTRE DE 2023

Considerando o Programa de Certificação Institucional e Modernização da Gestão dos Regimes Próprios de Previdência Social da União, dos Estados, do Distrito Federal e dos Municípios, instituído pela Portaria MPS Portaria MPS nº 185/2015 e o Manual do Pró-Gestão RPPS em sua versão 3.4 com vigência a partir de 02 de janeiro de 2023.

Considerando o item 3.2 do Manual do Pró-Gestão que trata sobre a governança corporativa, diz respeito ao conjunto de processos, políticas e normas aplicados a uma organização com o objetivo de consolidar boas práticas de gestão e garantir a proteção dos interesses de todos aqueles que com ela se relacionam, interna e externamente, aumentando a confiança de seus investidores e apoiadores. Alguns princípios fundamentais ligados à governança corporativa são a transparência, equidade, prestação de contas (accountability) e responsabilidade.

Considerando as movimentações financeiras realizadas, que constam nos Relatórios de Gestão de Investimentos destas competências, elaborados pela SMI Consultoria de Investimentos, a gestora de recursos do Lagesprevi quer neste relatório fazer a prestação de contas do 1º Trimestre de 2023 para o Conselho Administrativo.

O Instituto encerrou o 1º Trimestre de 2023 com o total de R\$98.456.978,02 distribuídos em 26 Títulos Públicos na Curva – NTN-B, 19 Fundos de investimentos de renda fixa, 07 Fundos de investimentos de renda variável, 01 Fundo de investimento no exterior, 02 Fundos de investimentos multimercado; segregados entre Fundo Financeiro (R\$4.094.361,70) e Fundo Previdenciário (R\$94.362.616,32).

Com base nas informações apresentadas no fechamento do mês de março/2023, verifica-se que os percentuais de investimentos estão respeitando os limites estabelecidos na legislação vigente. Abaixo, segue o quadro extraído da Política de Investimentos 2023 com a estratégia definida e posição de alocação do mês.

LIMITE DE ALOCAÇÃO DE RECURSOS - NÍVEL II	RESOLUÇÃO 4963/21	LIMITE INFERIOR	ATUAL (%)	ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR
ARTIGO 7 SEGMENTO DE RENDA FIXA			94%	86%	
I, a - TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN	100,0%	0,0%	45,24%	60%	100,0%
I, b - FI 100% TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN	100,0%	0,0%	17,85%	9,5%	100,0%
I, c - ETF - 100% TÍTULOS PÚBLICOS DE EMISSÃO DO TN	100,0%	0,0%	0,00%	0,5%	100,0%
II - OPERAÇÕES COMPROMISSADAS	5,0%	0,0%	0,00%	0,0%	5,0%
III, a - FI RENDA FIXA - GERAL	70,0%	0,0%	29,81%	10,0%	70,0%
III, b - ETF - ÍNDICES DE RENDA FIXA - GERAL	70,0%	0,0%	0,00%	0,5%	70,0%
IV - ATIVOS DE RF DE EMISSÃO DE INST. BANCÁRIAS	20,0%	0,0%	0,00%	2,0%	20,0%



LagesPrevi

Instituto de Previdência do Município de Lages

V, a - FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS - COTA SÊNIOR	10,0%	0,0%	0,00%	0,5%	10,0%
V, b - FI RENDA FIXA "CRÉDITO PRIVADO"	10,0%	0,0%	0,68%	2,5%	10,0%
V, c - FI DEBÊNTURES DE INFRAESTRUTURA	10,0%	0,0%	0,00%	0,5%	10,0%
ARTIGO 8 - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL			4,6%	7,5%	
I - FI AÇÕES	40,0%	0,0%	3,44%	7,0%	40,0%
II - ETF - ÍNDICES DE AÇÕES	40,0%	0,0%	1,15%	0,5%	40,0%
ARTIGO 9 - SEGMENTO DE INVEST. NO EXTERIOR			0,4%	4,0%	
I - FUNDO DE RENDA FIXA - DÍVIDA EXTERNA	10,0%	0,0%	0,00%	0,0%	10,0%
II - FI - SUFIXO "INVESTIMENTO NO EXTERIOR"	10,0%	0,0%	0,00%	2,0%	10,0%
III - FI DE AÇÕES - BDR NÍVEL 1	10,0%	0,0%	0,39%	2,0%	10,0%
ARTIGO 10 - SEGMENTO DE INVEST. ESTRUTURADOS			1,4%	2,5%	
I - FI MULTIMERCADO - ABERTO	10,0%	0,0%	1,43%	2,0%	10,0%
II - FI EM PARTICIPAÇÕES	5,0%	0,0%	0,00%	0,5%	5,0%
III - FI "AÇÕES - MERCADO DE ACESSO"	5,0%	0,0%	0,00%	0,0%	5,0%
ARTIGO 11 - SEGMENTO DE FUNDOS IMOBILIÁRIOS			0,0%	0,0%	
FI IMOBILIÁRIOS	10,0%	0,0%	0,00%	0,0%	10,0%
ARTIGO 12 - SEGMENTO DE EMPRÉSTIMO CONSIGNADO			0,0%	0,0%	
EMPRÉSTIMO CONSIGNADO	10,0%	0,0%	0,00%	0,0%	10,0%
TOTAL			100,0%	100,0%	

Finalizamos o trimestre com rentabilidade de 3,14% da carteira, a meta esperada para esse período era de 3,09%, resultando, desta forma, em uma rentabilidade de 101% em comparativo com a meta.

De Títulos Públicos fechamos o trimestre com R\$44.332.404,15, observe o quadro a seguir:

RELATÓRIO RESUMIDO TÍTULOS PÚBLICOS								
NTN-B	2024	2030	2035	2040	2045	2050	2055	Total
Quantidade	94	365	879	2186	2635	2714	1944	10817
Valor Atual	R\$ 385.442,78	R\$ 1.541.924,27	R\$ 3.688.922,29	R\$ 8.941.280,82	R\$ 10.861.047,72	R\$ 10.997.506,43	R\$ 7.916.279,84	R\$ 44.332.404,15
% do Patrimônio	0,41%	1,63%	3,91%	9,48%	11,51%	11,65%	8,39%	46,98%
Estudo ALM 2022	0%	0%	0%	10,98%	5,25%	24,63%	23,35%	64,21%
Dif. Patrimônio-ALM	0,41%	1,63%	3,91%	-1,50%	6,26%	-12,98%	-14,96%	-17,23%
Patrimônio F. Previd.	R\$ 94.362.616,32							

Lages

13/04/2023

Com relação ao BOVA11 tivemos 5 movimentações neste trimestre, sendo 2 vendas em janeiro, 2 compras em fevereiro e 1 em março. As vendas tiveram um lucro líquido de R\$16.347,47. O valor que temos comprado é de R\$1.179.000,41.

O retorno da carteira consolidado por ativos no ano de 2023, conforme o Relatório de Gestão de Investimentos da SMI, está com o rendimento acumulado de R\$2.937.348,11.

[Handwritten signatures and initials in blue ink]



LagesPrevi

Instituto de Previdência do Município de Lages



RETORNO DA CARTEIRA POR ATIVO

ATIVOS	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	2023
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA							
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 04/08/2022 Tx 6.1630)	459.414,04	387.099,32	649.416,43				1.495.929,79
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 06/05/2022 Tx 5.6540)	25.063,49	20.503,43	31.875,19				77.442,11
NTN-B 15/05/2035 (Compra em 02/06/2022 Tx 5.8050)	17.424,65	14.241,77	22.269,48				53.935,90
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 03/02/2023 Tx 6.4380)	17.911,62	14.641,87	22.855,81				55.409,30
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 04/08/2022 Tx 6.2250)	25.196,65	20.611,11	32.024,12				33.445,83
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 17/05/2022 Tx 5.7200)	490,11	400,58	625,91				77.831,88
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 17/11/2022 Tx 6.0612)	24.386,08	19.943,71	31.042,09				1.516,60
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 22/07/2022 Tx 6.2950)	26.206,81	21.440,28	33.285,83				75.371,88
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 27/09/2022 Tx 5.8360)	15.349,60	12.549,61	19.581,24				80.932,92
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 02/06/2022 Tx 5.8400)	17.943,65	14.671,10	22.889,50				47.480,45
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 07/03/2023 Tx 6.5130)	-	-	23.879,83				55.504,25
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 17/11/2022 Tx 6.0551)	24.378,33	19.033,74	31.032,14				23.879,83
NTN-B 15/05/2055 (Compra em 22/07/2022 Tx 6.3070)	26.239,33	21.465,79	33.326,64				75.344,21
NTN-B 15/08/2024 (Compra em 17/08/2022 Tx 6.2610)	4.667,11	3.765,68	5.759,16				81.031,76
NTN-B 15/08/2030 (Compra em 06/05/2022 Tx 5.5510)	17.778,01	14.331,98	22.109,39				14.191,95
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 04/08/2022 Tx 6.1850)	25.089,58	20.544,01	30.967,61				54.219,38
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 18/11/2022 Tx 6.1010)	24.425,16	18.589,07	30.183,29				76.601,20
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 22/07/2022 Tx 6.2800)	26.174,60	20.803,36	32.269,62				73.197,52
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 26/05/2022 Tx 5.7810)	15.503,83	13.056,11	19.236,32				79.247,58
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 27/09/2022 Tx 5.7810)	15.701,32	13.222,42	19.481,38				47.796,26
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 02/06/2022 Tx 5.8250)	17.940,66	15.839,46	22.248,05				48.405,12
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 04/08/2022 Tx 6.2450)	25.189,39	18.881,48	31.066,92				56.028,17
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 17/11/2022 Tx 6.0551)	24.347,48	19.701,80	30.099,68				75.137,79
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 22/07/2022 Tx 6.3050)	26.212,14	19.686,05	32.299,56				74.148,96
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 24/02/2023 Tx 6.3510)	-	2.243,85	27.816,65				78.197,75
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 27/09/2022 Tx 5.8410)	15.794,44	14.193,77	19.582,48				30.060,50
FUNDOS DE RENDA FIXA	440.981,70	469.650,92	675.085,12				1.585.717,74
Barrisul Soberano	5.444,12	7.717,45	723,28				13.884,85
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	52.833,79	40.496,55	57.161,32				150.491,66
BB Previdenciário Títulos Públicos 2027	1.607,79	2.327,18	2.977,19				6.912,16
BB Previdenciário Títulos Públicos XXI	67.550,68	65.966,83	61.928,51				195.446,02
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B	182,40	19.179,96	42.441,50				61.803,86



LagesPrevi

Instituto de Previdência do Município de Lages



RETORNO DA CARTEIRA POR ATIVO

ATIVOS	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	2023
FUNDOS DE RENDA FIXA							
Bradesco Títulos Públicos (IRF-M 1)	440.981,70	469.650,92	675.085,12				1.585.717,74
Caixa Brasil Crédito Privado IPCA XVI	5.550,41	5.005,05	6.264,91				16.820,37
Caixa Brasil Matriz Renda Fixa	8.608,50	8.936,70	9.751,50				27.296,70
Caixa Brasil Referenciado	41.027,08	30.436,57	54.946,96				126.410,61
Caixa Brasil Títulos Públicos	120.040,71	87.180,54	107.648,19				314.869,44
Caixa Brasil Títulos Públicos 2023	30.790,85	25.927,31	32.010,95				88.729,11
Caixa Brasil Títulos Públicos 2024 IV	24.098,59	14.898,10	19.461,89				58.458,58
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	22.641,18	22.124,46	20.746,51				65.512,15
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	4.799,68	22.201,89	46.490,03				73.491,60
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	(1.136,17)	43.470,08	92.748,94				135.082,85
Caixa FIC Novo Brasil Referenciado IMA-B	37.030,07	29.894,32	38.743,76				105.668,15
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	(1.840,04)	24.796,05	55.185,30				78.141,31
Itaú FIC Institucional Optimus Renda Fixa	5.303,68	4.493,79	7.211,24				17.008,71
Safra FIC Soberano Regime Próprio Referenciado RF	11.960,34	10.896,84	13.848,99				36.706,17
	4.488,04	3.701,25	4.794,15				12.983,44
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	163.032,25	(318.711,76)	(168.104,05)				(323.783,56)
BB FIC FIA Valor	39.025,56	(86.043,64)	(21.184,96)				(68.203,04)
Bradesco FIA Selection	36.786,81	(48.073,72)	(23.866,19)				(35.153,10)
Caixa FIC FIA Multifigestor	45.874,76	(93.781,70)	(42.082,97)				(89.989,91)
Guernard FIC FIA Valor Institucional	(4.593,67)	(18.214,14)	(4.951,86)				(27.759,67)
Ishares Fundo de Índice Ibovespa BOVA11 Méd.	20.080,88	(20.984,95)	(33.606,57)				(34.510,64)
Itaú FIC FIA Dunamis	12.998,18	(37.447,19)	(20.163,82)				(44.612,83)
Tarpon FIC FIA GT Institucional I	12.859,73	(14.166,42)	(22.247,68)				(23.554,37)
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	7.005,13	1.161,31	3.790,12				11.956,56
BB FIC FIA ESG BDR Nivel I	7.005,13	1.161,31	3.790,12				11.956,56
FUNDOS MULTIMERCADO	116.870,71	19.530,66	31.126,21				167.527,58
Caixa Bolsa Americana Multimercado	107.358,02	13.605,14	20.515,51				141.478,67
Itaú FIC Juros e Mordas Institucional Mult.	9.512,69	5.925,52	10.610,70				26.048,91
TOTAL	1.187.303,83	558.730,45	1.191.313,83				2.937.348,11



LagesPrevi

Instituto de Previdência do Município de Lages

O valor das despesas administrativas deste trimestre foi de R\$229.721,66, sendo R\$155.598,66 do mês de janeiro (incluso o pagamento do carro no valor de R\$123.900,00), R\$32.019,97 do mês de fevereiro, e R\$42.103,03 do mês de março. Quanto ao valor recebido de taxa de administração nesse período foi de R\$171.219,18. Para maiores detalhes podem acessar no site do Lagesprevi, no menu Administrativo/Financeiro, APR – Autorização de Aplicação e Resgates, onde constam as movimentações de investimentos e despesas pagas nesses períodos.

Lages, 13 de abril de 2023.

Rosemeri Solek Martins
Diretora Financeira

Ciente:

Amilton Werlich	Claudia Regina Porto Velho
Cleino Arruda de Souza	Josué Hebel Pires
Odila Maria Waldrich	Silvio Fernando Córdova Duarte
Sônia de Fátima Souza	Vera Marcia Aparecida Correa