

IPSGA

(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 IPSGA.

CARTEIRA PREVIDENCIÁRIO_DEZ/2023

ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 34.669.301,93	29.25%	D+0	7, I "b"
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	R\$ 20.402.631,34	17.22%	D+0	7, I "b"
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	R\$ 6.863.417,48	5.79%	D+1	7, I "b"
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	R\$ 12.045.158,72	10.16%	D+3	7, I "b"
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 8.242.890,83	6.96%	D+1	7, I "b"
BB PERFIL FIC RF REF DI...	R\$ 13.430.286,49	11.33%	D+0	7, III "a"
CATÂNIA FI RF LP	R\$ 0,00	0.00%	D+30	7, III "a"
BB AÇÕES ENERGIA FI AÇÕES	R\$ 1.843.190,03	1.56%	D+3	8, I
BB FATORIAL FIC AÇÕES	R\$ 1.211.986,86	1.02%	D+3	8, I
BB QUANTITATIVO FI...	R\$ 6.324.730,27	5.34%	3	8, I
BB MACRO FIC...	R\$ 2.305.848,74	1.95%	D+1	10, I
BB MULTIMERCADO LP...	R\$ 4.247.094,00	3.58%	D+1	10, I
FONTAINE VILLE URBANISMO...	R\$ 6.817.554,73	5.75%	-	10, II
AUSTRO MULTISSETORIAL FIP...	R\$ 106.714,73	0.09%	-	10, II
Total investimentos	R\$ 118.510.806,15	100.00%		
Disponibilidade	R\$ 0,00	-		
Total patrimônio	R\$ 118.510.806,15	100.00%		

CARTEIRA FINANCEIRO_DEZ/2023

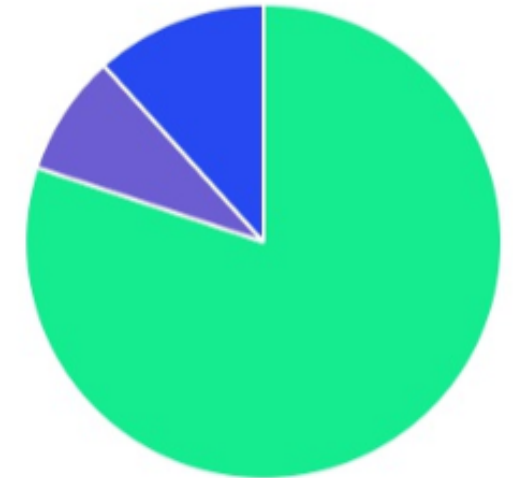
ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	R\$ 9.230.456,75	30.92%	D+1	7, I "b"
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 3.101.265,30	10.39%	D+0	7, I "b"
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 4.673.020,07	15.65%	D+1	7, I "b"
BB PERFIL FIC RF REF DI...	R\$ 6.029.047,55	20.19%	D+0	7, III "a"
BB AÇÕES ENERGIA FI AÇÕES	R\$ 1.178.432,97	3.95%	D+3	8, I
BB FATORIAL FIC AÇÕES	R\$ 774.876,84	2.60%	D+3	8, I
BB QUANTITATIVO FI...	R\$ 964.015,33	3.23%	3	8, I
BB MACRO FIC...	R\$ 1.474.231,15	4.94%	D+1	10, I
BB MULTIMERCADO LP...	R\$ 2.431.232,99	8.14%	D+1	10, I
Total investimentos	R\$ 29.856.578,95	100.00%		
Disponibilidade	R\$ 16.639,10	-		
Total patrimônio	R\$ 29.873.218,05	100.00%		

CARTEIRA CONSOLIDADA_DEZ/2023






ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	R\$ 16.093.874,23	10.81%	D+1	7, I "b"
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	R\$ 37.770.567,23	25.37%	D+0	7, I "b"
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	R\$ 12.045.158,72	8.09%	D+3	7, I "b"
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	R\$ 20.402.631,34	13.70%	D+0	7, I "b"
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 12.915.910,90	8.67%	D+1	7, I "b"
BB PERFIL FIC RF REF DI...	R\$ 19.980.681,32	13.42%	D+0	7, III "a"
CATÂNIA FI RF LP	R\$ 0,00	0.00%	D+30	7, III "a"
BB AÇÕES ENERGIA FI AÇÕES	R\$ 3.021.623,00	2.03%	D+3	8, I
BB FATORIAL FIC AÇÕES	R\$ 1.986.863,70	1.33%	D+3	8, I
BB QUANTITATIVO FI...	R\$ 7.288.745,60	4.90%	3	8, I
BB MACRO FIC...	R\$ 3.780.079,89	2.54%	D+1	10, I
BB MULTIMERCADO LP...	R\$ 6.678.326,99	4.49%	D+1	10, I
FONTAINE VILLE URBANISMO...	R\$ 6.817.554,73	4.58%	-	10, II
AUSTRO MULTISSETORIAL FIP...	R\$ 106.714,73	0.07%	-	10, II
Total investimentos	R\$ 148.888.732,38	100.00%		
Disponibilidade	R\$ 16.639,10	-		
Total patrimônio	R\$ 148.905.371,48	100.00%		

DISTRIBUIÇÃO_CLASSE

CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	80,07%	R\$ 119.208.823,74	
Estruturados	11,67%	R\$ 17.382.676,34	
Renda Variável	8,26%	R\$ 12.297.232,30	
Total	100,00%	R\$ 148.888.732,38	







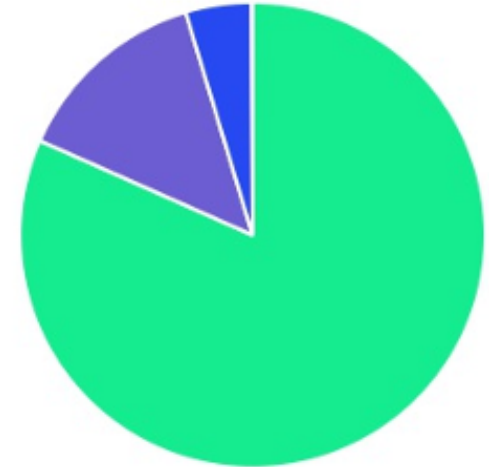
DISTRIBUIÇÃO_ENQUADRAMENTO

ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR LEG.	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	66,65%	R\$ 99.228.142,42	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	13,42%	R\$ 19.980.681,32	
Artigo 8º, Inciso I	8,26%	R\$ 12.297.232,30	
Artigo 10, Inciso I	7,02%	R\$ 10.458.406,88	
Artigo 10, Inciso II	4,65%	R\$ 6.924.269,46	
Total	100,00%	R\$ 148.888.732,38	







DISTRIBUIÇÃO_GESTOR

GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	81,65%	R\$ 121.561.831,58	
CAIXA DISTRIBUIDORA	13,70%	R\$ 20.402.631,34	
ARENA CAPITAL	4,58%	R\$ 6.817.554,73	
RENDA ASSET	0,07%	R\$ 106.714,73	
Total	100,00%	R\$ 148.888.732,38	



DISTRIBUIÇÃO_ADMINISTRADOR

ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	81,65%	R\$ 121.561.831,58	
CAIXA ECONOMICA	13,70%	R\$ 20.402.631,34	
MDL TRUST	4,58%	R\$ 6.817.554,73	
BFL ADMINISTRADORA	0,07%	R\$ 106.714,73	
Total	100,00%	R\$ 148.888.732,38	



DISTRIBUIÇÃO_BENCHMARK

BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IRF-M 1	25,37%	R\$ 37.770.567,23	
CDI	25,02%	R\$ 37.256.642,93	
IMA Geral ex-C	21,79%	R\$ 32.447.790,06	
IMA-B 5	10,81%	R\$ 16.093.874,23	
IRF-M	8,67%	R\$ 12.915.910,90	
IBOVESPA	6,23%	R\$ 9.275.609,30	
IEE	2,03%	R\$ 3.021.623,00	
IPCA	0,07%	R\$ 106.714,73	
Total	100,00%	R\$ 148.888.732,38	



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%	5,00%	10,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	R\$ 99.228.142,42	66,65%	30,00%	50,00%	80,00%
FI Renda Fixa - Art. 7º, III, “a”	R\$ 19.980.681,32	13,42%	0,00%	20,00%	50,00%
Ativos Bancários – Art. 7º, IV	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%
FI Renda Fixa “Crédito Privado” – Art. 7º, V, “b”	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%
FI Ações – Art. 8º, I	R\$ 2.297.232,30	8,26%	0,00%	5,00%	20,00%
FI Ações – BDR Nível I – Art. 9º, III	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%
FI Multimercado – aberto – Art. 10, I	R\$ 10.458.406,88	7,02%	0,00%	5,00%	10,00%
FI em Participações – Art. 10, II	R\$ 6.924.269,46	4,65%	0,00%	5,00%	5,00%
Total Geral	R\$ 148.888.732,38	100,00%	30,00%	100,00%	

MOVIMENTAÇÕES_2023

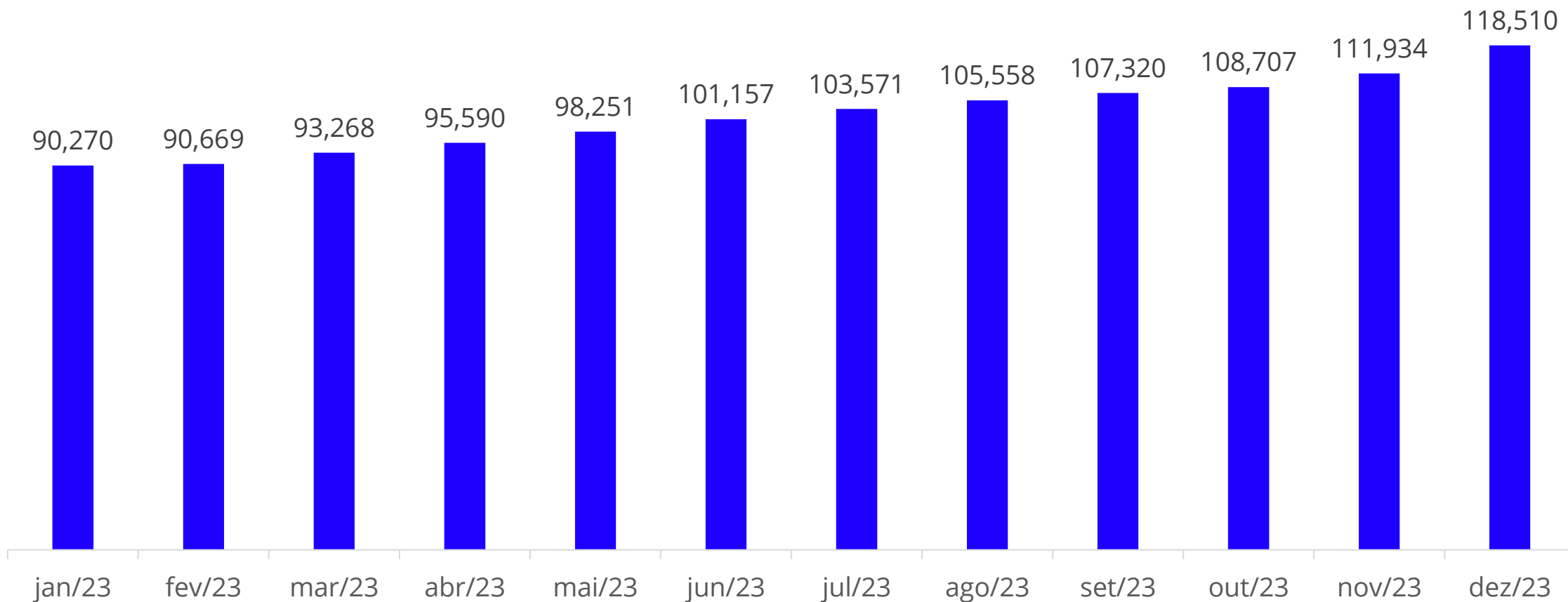
PERÍODO	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO FINAL
JANEIRO	R\$ 1.916.304,89	R\$ 461.808,89	R\$ 118.160.721,85
FEVEREIRO	R\$ 151.701,40	R\$ 742.744,93	R\$ 118.815.854,00
MARÇO	R\$ 2.437.270,17	R\$ 612.657,07	R\$ 121.806.019,59
ABRIL	R\$ 2.072.687,91	R\$ 651.039,29	R\$ 123.670.022,03
MAIO	R\$ 2.560.119,28	R\$ 653.847,71	R\$ 126.755.197,68
JUNHO	R\$ 1.776.782,99	R\$ 676.966,86	R\$ 130.120.268,31
JULHO	R\$ 1.914.736,83	R\$ 930.525,00	R\$ 132.500.985,99
AGOSTO	R\$ 2.238.416,00	R\$ 775.807,18	R\$ 134.806.537,81
SETEMBRO	R\$ 2.053.859,76	R\$ 721.552,45	R\$ 136.047.597,95
OUTUBRO	R\$ 2.422.325,46	R\$ 687.254,45	R\$ 137.299.613,88
NOVEMBRO	R\$ 41.428.425,47	R\$ 40.488.539,32	R\$ 141.447.793,12
DEZEMBRO	R\$ 6.353.203,01	R\$ 388.295,04	R\$ 148.905.371,48

RENTABILIDADES_2023

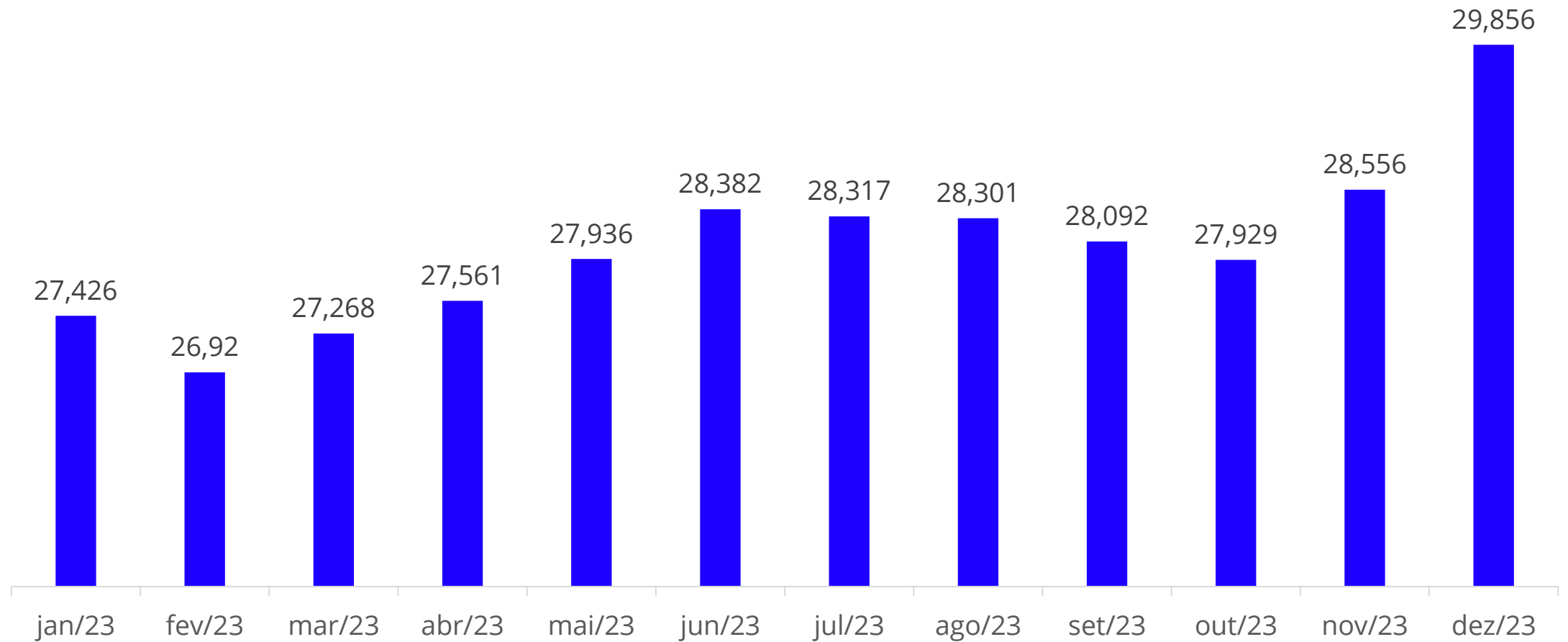
PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2023			IPCA + 4.86% a.a.			
Janeiro	R\$ 114.522.160,05	R\$ 118.160.721,85	0,93%	R\$ 1.720.144,65	1,50%	0,58p.p.
Fevereiro	R\$ 118.160.721,85	R\$ 118.815.854,00	1,24%	R\$ 484.518,77	0,41%	-0,83p.p.
Março	R\$ 118.815.854,00	R\$ 121.806.019,59	1,11%	R\$ 1.600.285,08	1,34%	0,23p.p.
Abril	R\$ 121.806.019,59	R\$ 123.670.022,03	1,01%	R\$ 1.211.298,42	0,99%	-0,02p.p.
Maio	R\$ 123.670.022,03	R\$ 126.755.197,68	0,63%	R\$ 1.179.950,88	0,95%	0,32p.p.
Junho	R\$ 126.755.197,68	R\$ 130.120.268,31	0,32%	R\$ 2.265.017,10	1,77%	1,45p.p.
Julho	R\$ 130.120.268,31	R\$ 132.500.985,99	0,52%	R\$ 1.362.616,12	1,04%	0,52p.p.
Agosto	R\$ 132.500.985,99	R\$ 134.806.537,81	0,63%	R\$ 534.996,04	0,40%	-0,22p.p.
Setembro	R\$ 134.806.537,81	R\$ 136.047.597,95	0,66%	R\$ 249.747,12	0,19%	-0,47p.p.
Outubro	R\$ 136.047.597,95	R\$ 137.299.613,88	0,64%	R\$ -484.781,11	-0,35%	-0,99p.p.
Novembro	R\$ 137.299.613,88	R\$ 141.447.793,12	0,68%	R\$ 2.843.386,87	2,07%	1,40p.p.
Dezembro	R\$ 141.447.793,12	R\$ 148.905.371,48	0,96%	R\$ 1.864.597,41	1,31%	0,35p.p.
Total	R\$ 141.447.793,12	R\$ 148.905.371,48	9,71%	R\$ 14.831.777,35	12,22%	2,51p.p.

A rentabilidade de R\$ 14.831.777,35 é equivalente a 9,96% do Patrimônio Líquido (PL) do IPSGA.

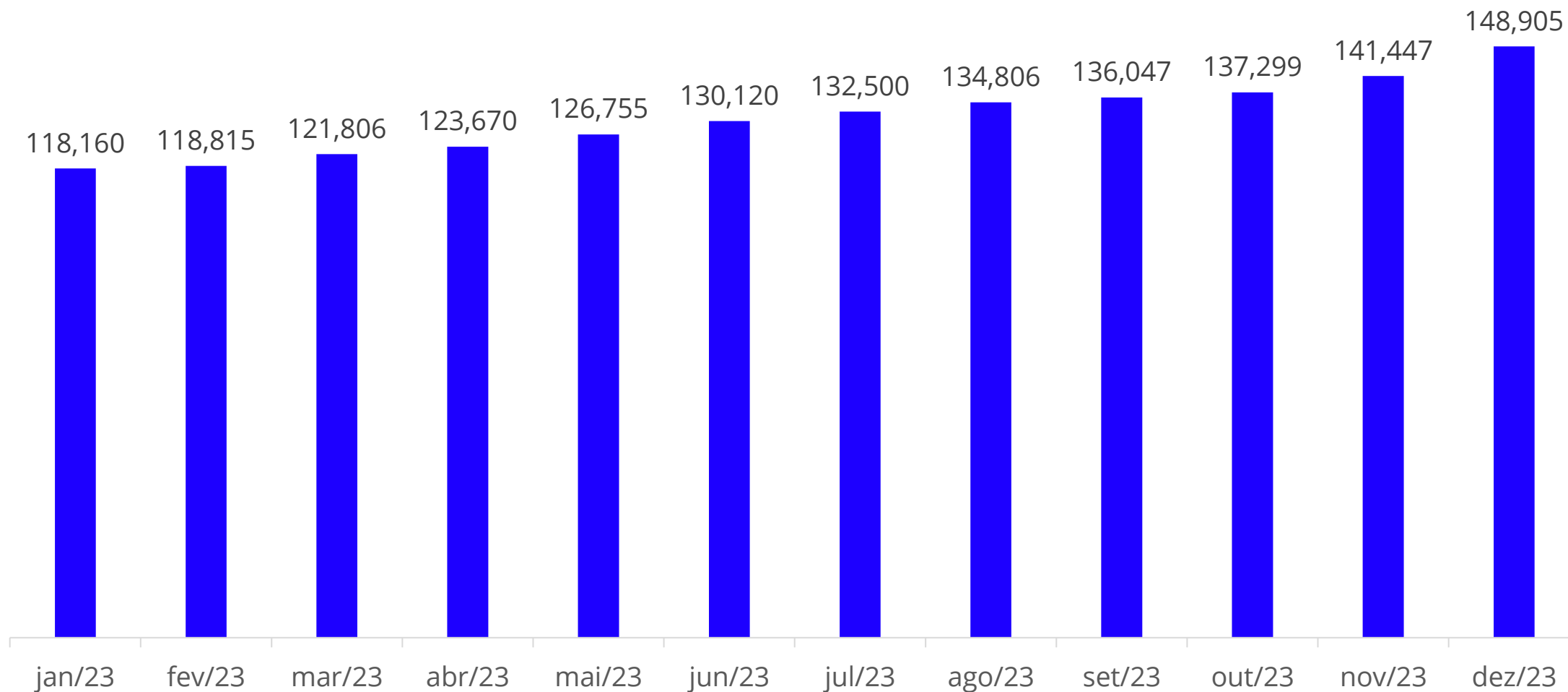
EVOLUÇÃO PATRIMONIAL PREVIDENCIÁRIO_2023



EVOLUÇÃO PATRIMONIAL FINANCEIRO_2023



EVOLUÇÃO PATRIMONIAL CONSOLIDADO_2023



CONCLUSÃO

O IPSGA encerrou 2023 superando a meta atuarial em 2,51 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 do IPSGA 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.

IPSGA

(INVESTIMENTOS_2023)

LEMA 