



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE PELOTAS

RELATÓRIO MENSAL INVESTIMENTOS

Em julho, o desempenho do setor de renda fixa voltou a reforçar a menor percepção de risco por parte do investidor, com todos os indicadores IMA encerrando o período no campo positivo. Todavia, diferentemente do observado nos últimos meses, as carteiras vinculadas aos ativos de menor prazo foram aquelas que perfizeram os maiores retornos mensais. O IRF-M1, que reflete o desempenho dos títulos pré-fixados com vencimento não superior a um ano, variou 1,07%, seguido do IMA-S, que representa a carteira das LFTs remuneradas pela variação diária da Selic, cujo ganho foi de 1,06% no período. Já o IMA-B5, correspondente a carteira das NTN-Bs com prazo não superior a 5 anos, valorizou 0,97%. Por sua vez, os títulos de maior prazo também mantiveram trajetória positiva em julho e, apesar de terem registrado rendimentos inferiores aos de prazos mais curtos, seguiram liderando o ranking das rentabilidades anuais e no agregado dos últimos 12 meses. O IMA-B5+, que representa as NTN-Bs acima de 5 anos, variou 0,73% no mês, acumulando ganhos de 15,74% no ano e de 19,37% em 12 meses. De maneira análoga, o IRF-M1+, que corresponde ao desempenho dos títulos pré-fixados com vencimento superior a um ano, registrou respectivos ganhos de 0,82% no mês, 12,33% no ano e de 18,36% no acumulado dos últimos 12 meses. No geral, os resultados de julho indicam uma menor inclinação da curva de juros futuros na comparação com os meses anteriores, cujo início do ciclo de queda da Selic já havia sido precificado pelo mercado. Por outro lado, a manutenção dos elevados juros de curtíssimo prazo seguiu garantindo bons retornos aos títulos de menor duration, justificando a prevalência destes frente às alternativas com maiores prazos de vencimento. Por fim, na esteira do bom desempenho aferido pelo conjunto dos indicadores IMA, o IMA-Geral, que sinaliza a rentabilidade dos títulos marcados a mercado com um todo, variou 0,98% em julho, contabilizando um retorno anual de 9,7% nos primeiros sete meses de 2023.

No mês de julho o de 2023 o Prevpel alcançou um Patrimônio Líquido de R\$ 500.075.905,63 no Plano Previdenciário, R\$ 495.958.439,46 Plano Financeiro e R\$ 816.446,87 na Taxa de Administração o valor de R\$ 3.301.019,30. OS rendimentos obtidos no mês, total de R\$ 4.852.813,48, rentabilidade atingida de 0,98%, sendo que a acumulada ficou 7,87% acima da meta (IPCA + 5,05%). Mantendo os aportes em Renda Fixa, benchmark IMABs, IMAB-5 e IRF-M.

Pelotas, 23 de agosto de 2023

Composição da Carteira de Investimentos e gráficos em anexo

MARIA GENESSI
GARCIA:45021899015

Assinado de forma digital por MARIA
GENESSI GARCIA:45021899015
Dados: 2023.08.23 11:39:24 -03'00'

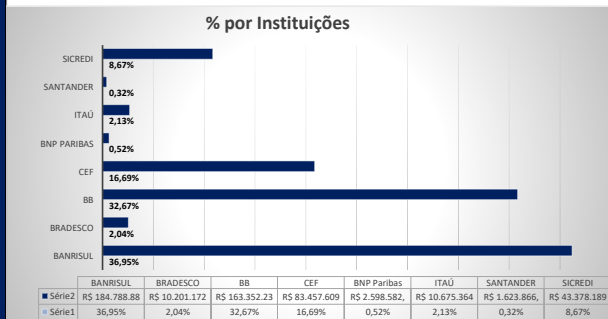
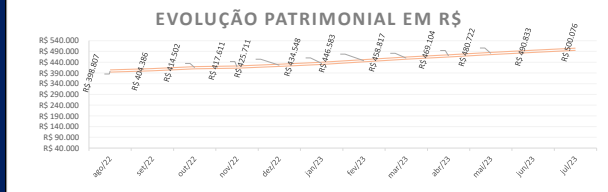
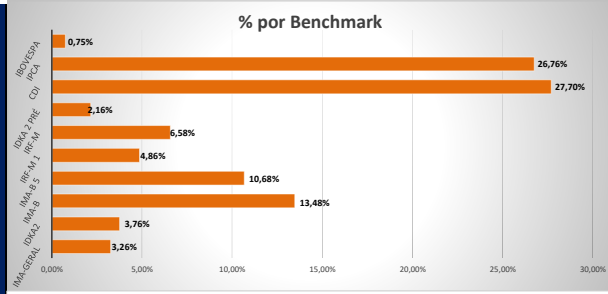


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE PELOTAS - PREVPEL

| Composição da Carteira | jul/23 | | |
|---|---------------------------|--------------|-------------------------|
| | R\$ | % | Rentabilidade mês |
| PLANO PREVIDENCIÁRIO | | | |
| BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | R\$ 24.327.482,72 | 4,86% | R\$ 254.082,53 |
| BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA | R\$ 12.897.435,39 | 2,58% | R\$ 144.202,40 |
| BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP | R\$ 15.493.363,43 | 3,10% | R\$ 136.961,34 |
| BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP | R\$ 12.640.129,44 | 2,53% | R\$ 76.303,70 |
| BANRISUL RPPS II FI RENDA FIXA | R\$ 13.783.554,18 | 2,76% | R\$ 111.748,80 |
| BANRISUL FOCO IMA-B FI RENDA FIXA LP | R\$ 12.329.132,59 | 2,47% | R\$ 93.441,59 |
| BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP | R\$ 56.756.938,78 | 11,35% | R\$ 589.885,75 |
| BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA | R\$ 32.443.383,87 | 6,49% | R\$ 338.642,69 |
| ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11) | R\$ 2.598.582,60 | 0,52% | R\$ 93.067,35 |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | R\$ 12.740.368,34 | 2,55% | R\$ 123.601,40 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | R\$ 4.091.318,82 | 0,82% | R\$ 42.814,97 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | R\$ 861.886,29 | 0,17% | R\$ 8.986,59 |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | R\$ 22.954.254,26 | 4,59% | R\$ 182.560,87 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | R\$ 1.044.159,85 | 0,21% | R\$ 4.159,85 |
| BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP | R\$ 12.702.179,52 | 2,54% | R\$ 174.712,91 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VERTICE 2032 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | R\$ 5.195.830,02 | 1,04% | R\$ 18.292,97 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VERTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | R\$ 5.091.417,32 | 1,02% | R\$ 53.693,21 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | R\$ 23.364.755,70 | 4,67% | R\$ 244.457,01 |
| BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP | R\$ 7.782.789,83 | 1,56% | R\$ 78.082,14 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VERTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | R\$ 27.085.959,66 | 5,42% | R\$ 220.009,67 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | R\$ 799.777,61 | 0,16% | R\$ 8.338,26 |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | R\$ 11.272.510,45 | 2,25% | R\$ 118.735,54 |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | R\$ 28.364.827,04 | 5,67% | R\$ 256.516,18 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | R\$ 5.638.301,78 | 1,13% | R\$ 43.853,90 |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | R\$ 4.562.870,55 | 0,91% | R\$ 53.359,82 |
| SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | R\$ 523.360,88 | 0,10% | R\$ 5.437,84 |
| ITAU IPCA SANTANDER (22/08/2024) | R\$ 548.405,92 | 0,11% | R\$ 2.790,74 |
| ITAU IPCA SANTANDER (19/11/2024) | R\$ 548.405,92 | 0,11% | R\$ 2.594,28 |
| ITAU IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | R\$ 1.015.860,68 | 0,20% | R\$ 9.160,47 |
| ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP | R\$ 4.909.453,11 | 0,98% | R\$ 47.975,80 |
| ITAU INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP | R\$ 4.750.050,23 | 0,95% | R\$ 50.182,03 |
| SICREDI IMA-B 5 FIC RENDA FIXA REFERENCIADO LP | R\$ 2.028.943,78 | 0,41% | R\$ 16.009,81 |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP | R\$ 20.263.698,71 | 4,05% | R\$ 190.133,50 |
| SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA | R\$ 21.085.547,26 | 4,22% | R\$ 220.971,55 |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | R\$ 8.532.781,59 | 1,72% | R\$ 68.223,52 |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | R\$ 5.899.129,59 | 1,18% | R\$ 59.204,86 |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP | R\$ 3.733.053,64 | 0,75% | R\$ 36.681,67 |
| CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP | R\$ 10.777.326,16 | 2,16% | R\$ 92.388,38 |
| CAIXA BRASIL 2032 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | R\$ 5.199.464,75 | 1,04% | R\$ 18.357,97 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | R\$ 2.886.231,05 | 0,58% | R\$ 25.547,17 |
| CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | R\$ 6.101.893,92 | 1,22% | R\$ 63.102,61 |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP | R\$ 1.166.779,07 | 0,23% | R\$ 48.814,70 |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | R\$ 23.006.022,39 | 4,60% | R\$ 216.860,32 |
| CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | R\$ 8.517.497,91 | 1,70% | R\$ 57.654,32 |
| CAIXA BRASIL 2024 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | R\$ 10.577.429,10 | 2,12% | R\$ 110.337,33 |
| TOTAL PLANO PREVIDENCIÁRIO | R\$ 495.958.439,46 | 99% | R\$ 4.813.050,31 |
| PLANO FINANCEIRO | | | |
| BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP | R\$ 816.446,87 | 0,16% | R\$ 8.340,43 |
| TOTAL PLANO FINANCEIRO | R\$ 816.446,87 | 0,16% | R\$ 8.340,43 |
| TAXA ADMINISTRATIVA | | | |
| BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP | R\$ 3.301.019,30 | 0,66% | R\$ 31.422,74 |
| TOTAL TAXA ADMINISTRATIVA | R\$ 3.301.019,30 | 0,66% | R\$ 31.422,74 |
| TOTAL | R\$ 500.075.905,63 | 100% | R\$ 4.852.813,48 |

MOVIMENTAÇÃO DO MÊS:

| Fundo de Investimento | CNPJ | Data | Valor |
|---|--------------------|------------|---------------------------|
| BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA | 21.007.180/0001-03 | 07/07/2023 | -R\$ 310.000,00 |
| BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA | 21.007.180/0001-03 | 12/07/2023 | -R\$ 10.000.000,00 |
| BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP | 16.844.885/0001-45 | 26/07/2023 | R\$ 232.231,10 |
| BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP | 16.844.885/0001-45 | 28/07/2023 | R\$ 236.257,77 |
| BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP | 16.844.885/0001-45 | 12/07/2023 | R\$ 7.000.000,00 |
| BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP | 16.844.885/0001-45 | 19/07/2023 | R\$ 645.000,00 |
| BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP | 21.743.480/0001-50 | 11/07/2023 | R\$ 60.000,00 |
| BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP | 04.828.795/0001-81 | 12/07/2023 | R\$ 3.000.000,00 |
| ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11) | 10.406.511/0001-61 | 21/07/2023 | -R\$ 232.231,10 |
| ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11) | 10.406.511/0001-61 | 25/07/2023 | -R\$ 236.257,77 |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 03.543.447/0001-03 | 12/07/2023 | R\$ 5.000.000,00 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 35.292.588/0001-89 | 19/07/2023 | R\$ 1.040.000,00 |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 07.442.078/0001-05 | 12/07/2023 | R\$ 5.000.000,00 |
| BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP | 44.345.473/0001-23 | 12/07/2023 | R\$ 10.000.000,00 |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 14.386.926/0001-71 | 11/07/2023 | -R\$ 2.000.000,00 |
| CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP | 45.163.710/0001-70 | 11/07/2023 | R\$ 2.000.000,00 |
| CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP | 45.163.710/0001-70 | 19/07/2023 | R\$ 1.000.000,00 |
| SICREDI IMA-B 5 FIC RENDA FIXA REFERENCIADO LP | 41.283.495/0001-90 | 19/07/2023 | R\$ 1.000.000,00 |
| ITAU IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 05.073.656/0001-58 | 19/07/2023 | R\$ 500.000,00 |
| BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP | 04.828.795/0001-81 | 06/07/2023 | R\$ 300.000,00 |
| BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP | 04.828.795/0001-81 | 07/07/2023 | R\$ 200.000,00 |
| BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP | 04.828.795/0001-81 | 11/07/2023 | R\$ 44.000,00 |
| BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP | 04.828.795/0001-81 | 04/07/2023 | -R\$ 104.000,00 |
| BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP | 04.828.795/0001-81 | 19/07/2023 | -R\$ 390.000,00 |
| BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP | 11.311.874/0001-86 | 04/07/2023 | R\$ 200.000,00 |
| BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP | 11.311.874/0001-86 | 06/07/2023 | R\$ 105.000,00 |
| BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP | 11.311.874/0001-86 | 19/07/2023 | R\$ 240.000,00 |
| BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP | 11.311.874/0001-86 | 03/07/2023 | -R\$ 10.000,00 |
| Total Aplicações | | | R\$ 27.602.488,87 |
| Total Resgates | | | -R\$ 23.412.488,87 |



| Mês | Rendimento do mês (R\$) | Rendimentos do mês (%) | Rentabilidade Acumulada (%) | Meta Atuarial Acumulada IPCA +5,05% |
|--------------|--------------------------|------------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| Janeiro | R\$ 5.284.880,75 | 1,23% | 1,23% | 0,94% |
| Fevereiro | R\$ 4.973.823,53 | 1,13% | 2,37% | 2,21% |
| Março | R\$ 5.843.032,08 | 1,29% | 3,69% | 3,36% |
| Abril | R\$ 3.901.674,19 | 0,84% | 4,56% | 4,42% |
| Maio | R\$ 4.207.674,00 | 0,88% | 5,48% | 5,09% |
| Junho | R\$ 6.154.984,06 | 1,27% | 6,82% | 5,44% |
| Julho | R\$ 4.852.813,48 | 0,98% | 7,87% | 6,00% |
| Agosto | | | | |
| Setembro | | | | |
| Outubro | | | | |
| Novembro | | | | |
| Dezembro | | | | |
| TOTAL | R\$ 35.718.882,09 | | | |