

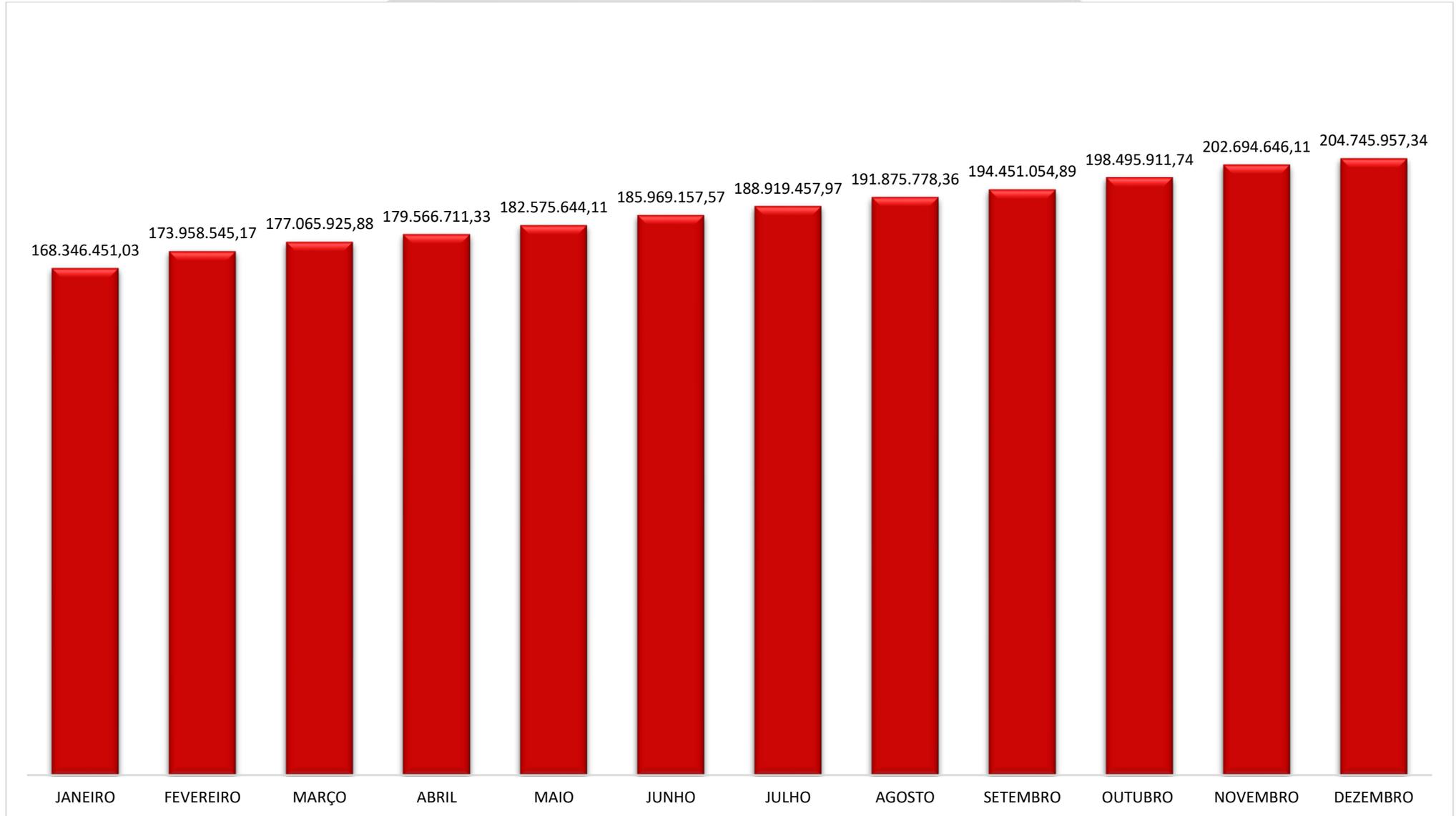
RELATÓRIO ANUAL DE AVALIAÇÃO E ACOMPANHAMENTO DOS INVESTIMENTOS DO INSTITUTO EM 2023.**SABARAPREV – SABARÁ / MG.****Período:** Janeiro a Dezembro de 2023.

Assunto	Página
1. Panorama geral consolidado de evolução, resgates, aplicações e rentabilidade dos investimentos em 2023.	2
2. Evolução das RESERVAS do instituto em 2023 (saldo no final de cada mês).	3
3. RENTABILIDADE, mensal em reais de janeiro a Dezembro de 2023.	4
4. Comparativo Meta atuarial X Rendimento da carteira, mês a mês em 2023.	5
5. Divisão dos recursos investidos por estratégia de investimentos, Janeiro e Dezembro de 2023.	6
6. Posição da carteira de investimentos em relação a normativa CMN nº 4.963 e atualizações / JANEIRO 2023.	7
7. Posição da carteira de investimentos em relação a normativa CMN nº 4.963 e atualizações / DEZEMBRO 2023.	9
8. Divisão dos recursos investidos por instituições financeiras JANEIRO – DEZEMBRO 2023.	10

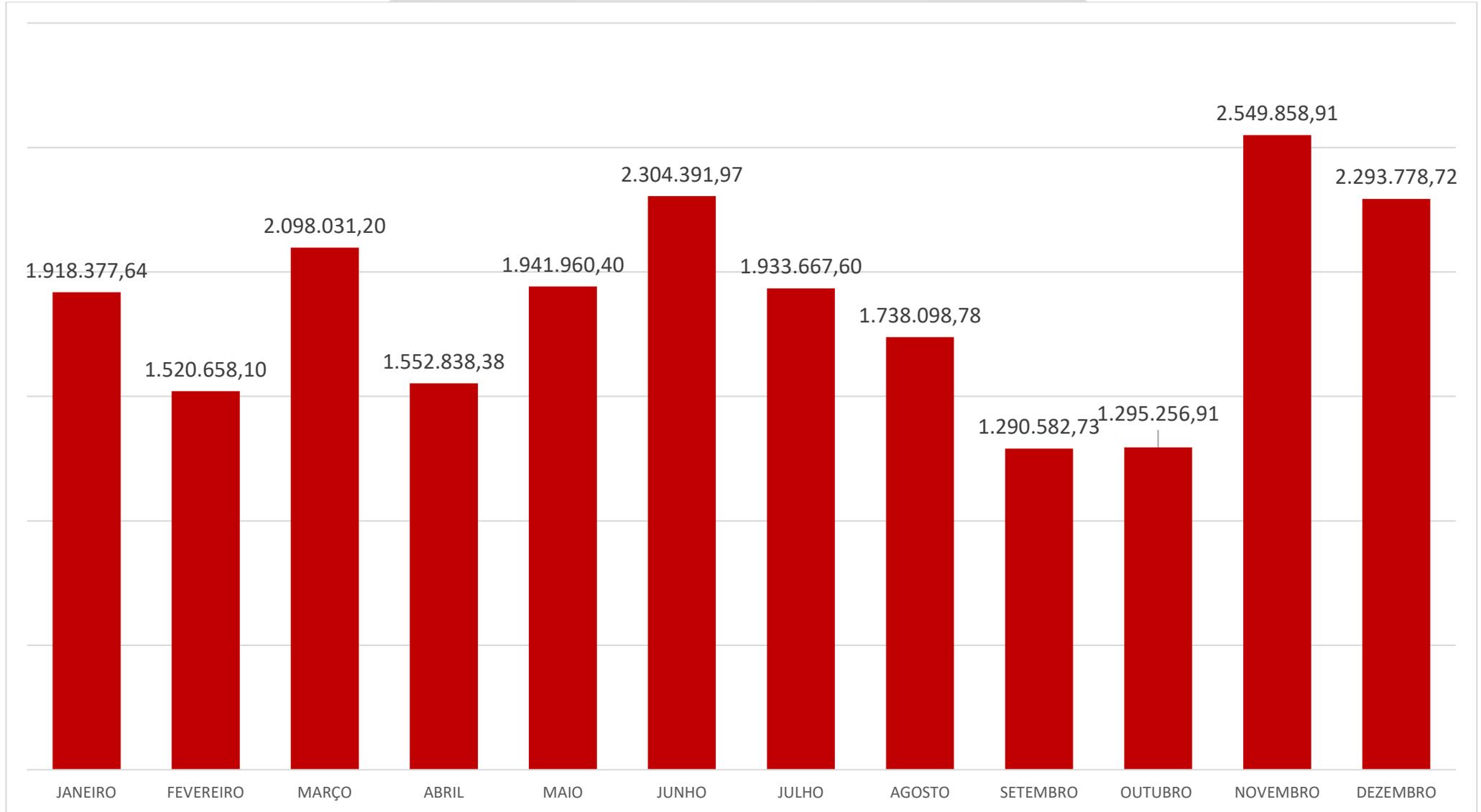
1. Panorama geral consolidado de evolução, resgates, aplicações e rentabilidade dos investimentos em 2023.

ANO: 2023	RESERVA COMEÇO DE MÊS	APLICAÇÕES	RESGATES	RENTAB. R\$	SALDO FINAL DO MÊS	RENTAB. %	META ATUARIAL	ATINGIDO DA META		
JANEIRO	167.201.906,34	14.346.629,20	15.015.359,66	1.918.377,64	168.346.451,03	1,15	0,97	118,56		
FEVEREIRO	168.346.451,03	5.007.969,73	911.433,71	1.520.658,10	173.958.545,17	0,90	1,34	67,16		
MARÇO	173.958.545,17	4.791.077,38	3.781.750,66	2.098.031,20	177.065.925,88	1,21	1,16	104,31		
ACUMULADO 1º TRIMESTRE				5.537.066,94		3,26	3,47	93,95		
ABRIL	177.065.925,88	6.886.449,07	6.080.871,61	1.552.838,38	179.566.711,33	0,88	1,05	83,81		
MAIO	179.566.711,33	7.797.339,32	6.751.914,75	1.941.960,40	182.575.644,11	1,08	0,67	161,19		
JUNHO	182.575.644,11	12.463.028,12	11.340.229,76	2.304.391,97	185.969.157,57	1,26	0,36	350,00		
ACUMULADO 2º TRIMESTRE				5.799.190,75		3,22	2,08	154,81		
JULHO	185.969.157,57	2.176.584,87	1.190.945,33	1.933.667,60	188.919.457,97	1,04	0,66	157,58		
AGOSTO	188.919.457,97	19.151.285,78	17.970.510,11	1.738.098,78	191.875.778,36	0,92	0,67	137,31		
SETEMBRO	191.875.778,36	3.462.285,68	2.177.603,68	1.290.582,73	194.451.054,89	0,67	0,7	95,71		
ACUMULADO 3º TRIMESTRE				4.962.349,11		2,63	2,03	129,56		
OUTUBRO	194.451.054,89	13.405.083,65	10.578.408,33	1.295.256,91	198.495.911,74	0,67	0,68	98,53		
NOVEMBRO	198.495.911,74	9.617.361,45	7.794.295,76	2.549.858,91	202.694.646,11	1,28	0,73	175,34		
DEZEMBRO	202.694.646,11	5.394.008,18	5.636.475,67	2.293.778,72	204.745.957,34	1,13	1,00	113,00		
ACUMULADO 4º TRIMESTRE				6.138.894,54		3,08	2,41	127,80		
ACUMULADO ANO CUMPRIMENTO META ATUARIAL						22.437.501,34		12,19	9,99	122,02%

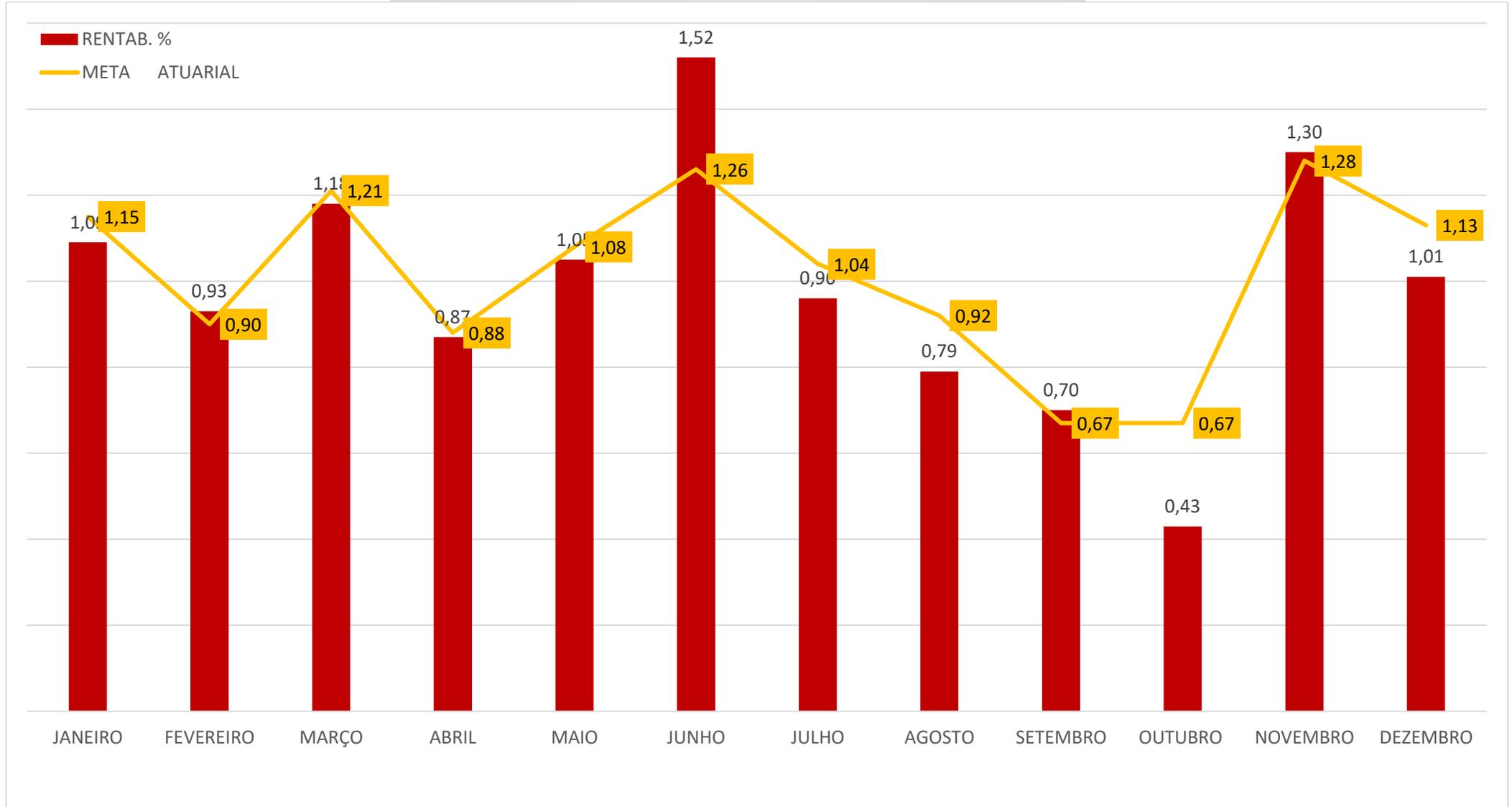
2. Evolução das RESERVAS do instituto em 2023 (saldo no final de cada mês).



3. RENTABILIDADE, mensal em reais de Janeiro a Dezembro de 2023.



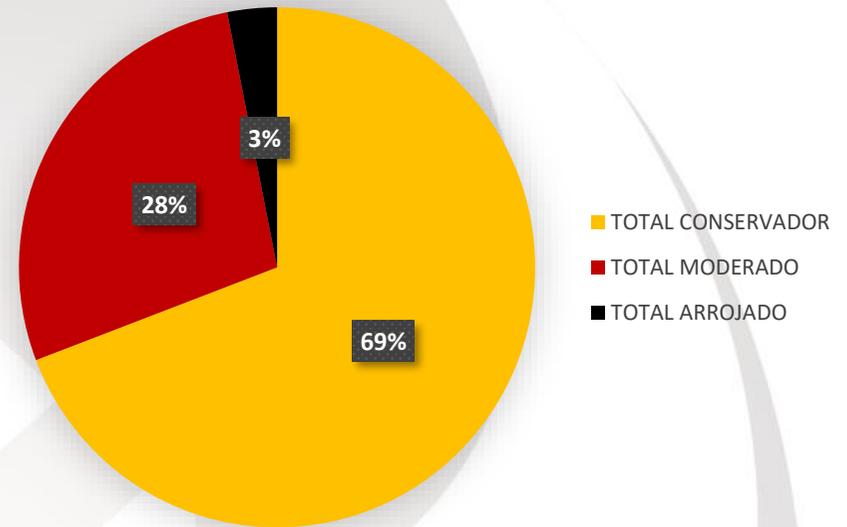
4. Comparativo Meta atuarial X Rendimento da carteira, mês a mês em 2023.



5. Divisão dos recursos investidos por estratégia de investimentos Janeiro e Dezembro de 2023.

JANEIRO

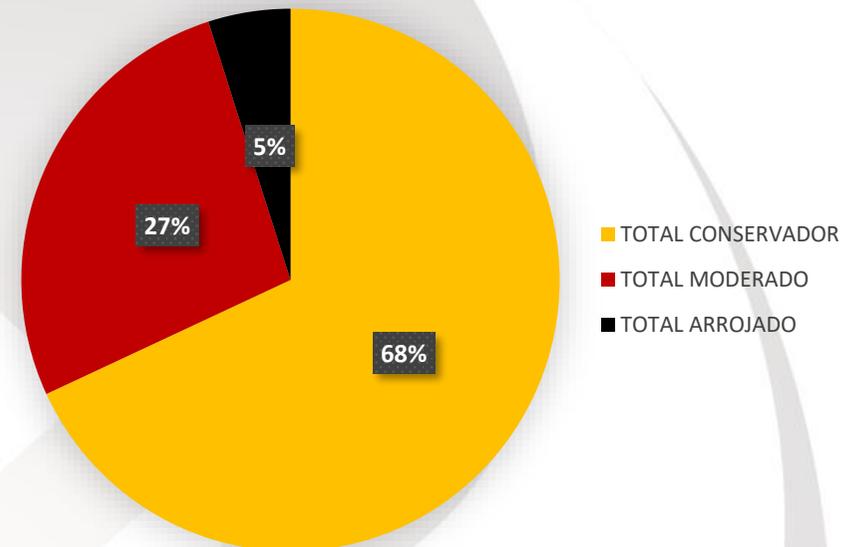
ESTRATÉGIA DE INVESTIMENTOS, 30 DE JANEIRO 2023.		
DI	29.278.227,55	17,39%
IRFM1	23.943.198,72	14,22%
RF (FLUXO, PERFIL, MAXI)	57.401.628,95	34,10%
TOTAL CONSERVADORES	110.623.055,22	65,71%
IDKA 2	13.662.417,21	8,12%
IMAB5	22.068.758,29	13,11%
RF (IPCA III, ALOC., ALOC. DINÂMICA, GESTÃO)	7.924.586,71	4,71%
IMOBILIARIO	634.000,00	0,38%
TOTAL MODERADOS	44.289.762,21	26,31%
MULTIMERCADO	2.862.870,29	1,70%
AÇÕES LIVRES	1.142.192,44	0,68%
AÇÕES ESTRANGEIRAS	439.051,05	0,26%
FIDC	515.817,97	0,31%
TOTAL ARROJADO	4.959.931,75	2,95%



DEZEMBRO

ESTRATÉGIA DE INVESTIMENTOS, 30 de dezembro 2023.

DI	47.102.211,76	23,01%
IRFM1	39.838.323,86	19,46%
RF (Fluxo, Retorno, Vértice, Curto, Perfil)	48.280.940,66	23,58%
Letra Financeira - Bradesco	2.124.262,75	1,04%
Título Público Federal	2.065.195,03	1,01%
TOTAL CONSERVADORES	139.410.934,06	68,09%
IDKA 2	14.133.638,89	6,90%
IMAB5	11.354.703,73	5,55%
RF (IPCA III, Alocação, Gestão, Global)	18.425.019,18	9,00%
IRF-M	5.362.941,01	2,62%
IMA-B	5.148.560,81	2,51%
IMOBILIARIO	801.000,00	0,39%
TOTAL MODERADOS	55.225.863,62	26,97%
IRF-M1+	2.103.348,92	1,03%
IMA-B5+	2.053.171,84	1,00%
MULTIMERCADO	3.768.186,01	1,84%
AÇÕES LIVRES	1.242.902,16	0,61%
AÇÕES ESTRANGEIRAS	498.429,57	0,24%
FIDC	443.121,16	0,22%
TOTAL ARROJADO	10.109.159,66	4,94%



6. Posição da carteira de investimentos JANEIRO 2023.

	VALORES EM 31.12.2023	% CADA FUNDO NO TOTAL
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL		
FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	10.280.781,51	6,11%
FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	22.068.758,29	13,11%
FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	2.675.027,71	1,59%
FI BRASIL DI LP	29.278.227,55	17,39%
FI BRASIL MATRIZ	8.232.445,45	4,89%
FII CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	634.000,00	0,38%
BANCO DO BRASIL		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	13.662.417,21	8,12%
BB TR IPCA	5.249.559,00	3,12%
BB PREVID. TP IPCA III	140.450,05	0,08%
BB PREVID. IRF-M1	7.766.864,95	4,61%
BB PREVID. RF PERFIL	23.507.153,12	13,96%
BB PREVID. RF FLUXO 16365-1	575.339,40	0,34%
BB PREVID. RF FLUXO 13365-5	1.505.831,34	0,89%
BB RF CP AUTOMATICO	51.801,26	0,03%
BB PREV. RF RETORNO TOTAL	6.493.152,97	3,857%
BB MULT. JUROS E MOEDAS	2.862.870,29	1,70%
BRADESCO		
BRADESCO REFERENC. DI PREMIUM	15.328.466,30	9,11%
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER	2.173.019,61	1,29%
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER	87.183,05	0,05%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NIVEL I	439.051,05	0,26%
ITAU		
ITAU INSTIT. GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC	5.333.153,29	3,17%
ITAU INST. RF REF. DI FI	5.061.430,48	3,01%
ITAU AÇÕES DUNAMIS	1.142.192,44	0,68%
FINAXIS		
FIDC PREMIUM SR	515.817,97	0,31%
SANTANDER		
REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM	3.281.456,74	1,95%

**ENQUADRAMENTO NA POLÍTICA DE INVESTIMENTO
RESOLUÇÃO CMN Nº 4.963/2021.**

Art. 7º, Inciso I, Alínea "b". LIMITE: 100%	
61.843.858,72	TOTAL
36,74%	% DA CARTEIRA

Art. 7º, Inciso III, Alínea "a". LIMITE: 60%	
97.627.203,82	TOTAL
57,99%	% DA CARTEIRA

Art. 7º, Inciso V, Alínea "a". LIMITE: 5%	
2.862.870,29	TOTAL
1,70%	

Art. 8º, Inciso I. LIMITE: 30%	
1.142.192,44	TOTAL
0,68%	% DA CARTEIRA

Art. 10º, inciso I. LIMITE: 10%	
2.862.870,29	TOTAL
1,70%	% DA CARTEIRA

Art. 11º. LIMITE 5%	
634.000,00	TOTAL
0,38%	% DA CARTEIRA

7. Posição da carteira de investimentos DEZEMBRO 2023.

	VALORES EM 31.12.2023	% CADA FUNDO NO TOTAL
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL		
FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	11.354.703,73	5,55%
FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	24.961.859,08	12,19%
FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	6.647.459,39	3,25%
FI BRASIL IRF-M	5.362.941,01	2,62%
FI BRASIL IRF-M1+	2.103.348,92	1,03%
FI BRASIL DI LP	28.699.724,40	14,02%
FII CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	801.000,00	0,39%
BANCO DO BRASIL		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	10.916.009,54	5,33%
BB PREVID. TP IPCA III	145.278,02	0,07%
BB PREVID. IRF-M1	12.833.594,29	6,27%
BB PREV IMA-B	5.148.560,81	2,51%
BB PREV IMA B 5+	2.053.171,84	2,51%
BB PREVID. RF PERFIL	18.735.498,95	9,15%
BB PREVID. RF PERFIL 16.365- 1	5.683.907,26	2,78%
BB PREVID. RF FLUXO 16.365-1	662.165,49	0,32%
BB PREVID. RF FLUXO 13.365-5	2.251.446,19	1,10%
BB PREV. VERTICE 2024	5.773.489,27	2,82%
BB PREV. RF RETORNO TOTAL	13.842.138,57	6,76%
BB MULT. JUROS E MOEDAS	3.768.186,01	1,84%
BRADESCO		
BB IDK PRÉ 2	3.217.629,35	1,57%
BRADESCO REFERENC. DI PREMIUM	14.721.899,43	7,19%
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER	1.062.578,40	0,52%
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER	269.716,53	0,13%
LETRA FINANCEIRA	2.124.262,75	1,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NIVEL I	498.429,57	0,24%

ENQUADRAMENTO NA POLÍTICA DE INVESTIMENTO
RESOLUÇÃO CMN Nº 4.963/2021.

Art. 7º, Inciso I, Alínea "b". LIMITE: 100%	
86.787.426,47	TOTAL
42,39%	% DA CARTEIRA
Art. 7º, Inciso I, Alínea "a". LIMITE: 100%	
2.065.195,03	TOTAL
1,01%	% DA CARTEIRA
Art. 7º, Inciso III, Alínea "a". LIMITE: 60%	
107.015.434,19	TOTAL
52,27%	% DA CARTEIRA
Art. 7º, inciso IV. LIMITE: 20%	
2.124.262,75	TOTAL
1,04%	% DA CARTEIRA
Art. 7º, Inciso V, Alínea "b". LIMITE: 5%	
3.768.186,01	TOTAL
1,84%	% DA CARTEIRA
Art. 8º, Inciso I. LIMITE: 30%	
1.242.902,16	TOTAL
0,61%	% DA CARTEIRA

continuação		
ITAÚ		
ITAU INSTITUC. ALOC. DINÂMICA RF FIC FI	5.948.286,38	2,91%
ITAU INSTIT. GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC	5.683.995,39	2,78%
ITAU AÇÕES DUNAMIS	1.242.902,16	0,61%
FINAXIS		
FIDC PREMIUM SR	443.121,16	0,22%
SANTANDER		
REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM	3.680.587,93	1,80%
SICREDI		
FI INSTITUCIONAL RF IRF-M1	2.042.870,49	1,00%
TITULOS PÚBLICOS FEDERAIS		
NTN - B (Cupom 6% vcto)	2.065.195,03	1,01%

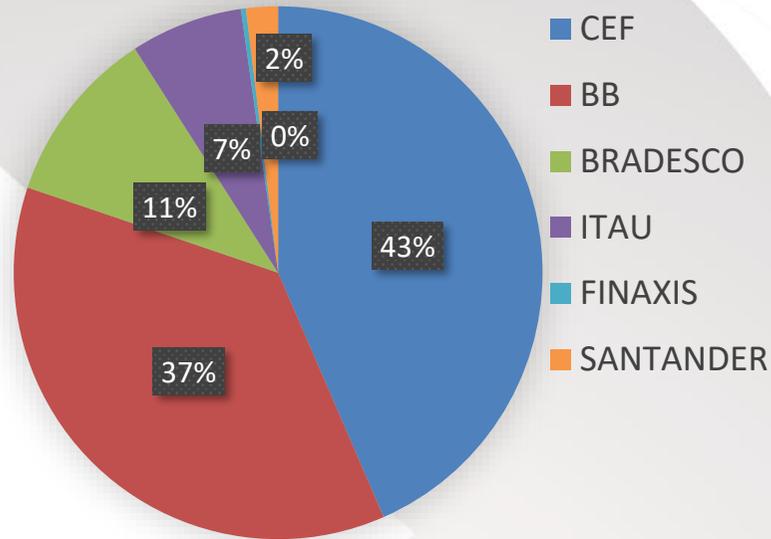
Art. 9º, inciso III. LIMITE: 5%	
498.429,57	TOTAL
0,24%	% DA CARTEIRA

Art. 10º, inciso I. LIMITE: 10%	
443.121,16	TOTAL
0,22%	% DA CARTEIRA

Art. 11º. LIMITE 5%	
801.000,00	TOTAL
0,39%	% DA CARTEIRA

8. Divisão dos recursos investidos por instituições financeiras, JANEIRO – DEZEMBRO 2023.

PARTICIPAÇÃO POR INSTITUIÇÃO JANEIRO	
CEF	73.169.240,51
BB	61.815.439,59
BRADESCO	18.027.720,01
ITAU	11.536.776,21
FINAXIS	515.817,97
SANTANDER	3.281.456,74



PARTICIPAÇÃO POR INSTITUIÇÃO DEZEMBRO	
CEF	79.931.036,53
BB	81.813.446,24
BRADESCO	21.894.516,03
ITAU	12.875.183,93
SANTANDER	3.680.587,93
TITULOS PÚBLICOS	2.065.195,03
FINAXIS	443.121,16
SICREDI	2.042.870,49

