
REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE
ARRAIAS / TO

RELATÓRIO TRIMESTRAL
DE
INVESTIMENTOS

2º TRIMESTRE
2023

11 de julho de 2023

(63)3602-1493 / (63)3602-2504 - economico@selfassessoria.com.br

Av. Castelo Branco - 1555 2º Andar, Centro - Cep: 77600-000 - Paraíso do Tocantins-TO

SUMÁRIO EXECUTIVO

O Sumário Executivo apresenta as principais informações do Relatório Mensal de Investimentos de 2023 do ARRAIAS-PREV.

Índice Inflacionário: IPCA – Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo

Taxa de Juros (anual): 4,73% a.a.

Taxa de Juros (mensal): 0,39%

Meta Atuarial (Taxa de Juros + Índice): 4,73% a.a. + IPCA a.a.

Previsão da Meta Atuarial (Taxa de Juros + Índice): 10,16%

Data Focal: 30/06/2023

MENSAL											
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN					
RENTABILIDADE DA CARTEIRA	1,26%	0,79%	1,18%	0,77%	1,27%	1,62%					
TAXA DE JUROS	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%					
VARIAÇÃO IPCA	0,53%	0,84%	0,71%	0,61%	0,23%	-0,08%					
META ATUARIAL	0,92%	1,23%	1,10%	1,00%	0,62%	0,31%					
CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%					

ACUMULADO											
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN					
RENTABILIDADE DA CARTEIRA	1,26%	2,06%	3,27%	4,07%	5,38%	7,09%					
TAXA DE JUROS	0,39%	0,77%	1,16%	1,55%	1,94%	2,34%					
VARIAÇÃO IPCA	0,53%	1,37%	2,09%	2,72%	2,95%	2,87%					
META ATUARIAL	0,92%	2,15%	3,27%	4,30%	4,94%	5,26%					
CDI	1,12%	2,05%	3,24%	4,19%	5,36%	6,49%					

SUMÁRIO (ÍNDICE)

1 – INTRODUÇÃO	4
2 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA, POLÍTICA DE INVESTIMENTOS, ENQUADRAMENTO: RESOLUÇÃO CMN 4.963/2021	5
2.1 - Movimentação da Carteira	5
2.2 - PAI - Limite de Segmento	6
2.3 - Enquadramento sobre Segmentos e Fundos de Investimento	7
2.3.1 - Disponibilidade Financeira e Total por Segmento	10
3 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTO	11
4 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RENDA FIXA	15
5 – RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	21
5.1 - Melhor Desempenho Trimestral dos Investimentos	23
5.2 - Pior Desempenho Trimestral dos Investimentos	24
6 – RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO	25
6.1 - Rentabilidade Mensal da Carteira de Investimentos	25
6.2 - Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos	26
6.3 - Análise da Carteira de Investimento	28
7 – CONCLUSÃO	29
7.1 - Rentabilidade da Carteira Trimestral	29
7.2 - Meta Atuarial	30
7.3 - Riscos	30
7.3.1 - Risco de Mercado	30
7.3.2 - Risco de Crédito	32
7.3.2.1 - Fundo de Investimento	32
7.3.2.2 - Instituição Financeira	33
7.3.3 - Risco de Liquidez	33
7.4 - Aderência ao PAI	34
7.4.1 - Perfil de Risco (Mercado)	34
7.4.2 - Risco de Crédito	35
7.4.3 - Risco de Liquidez	35
7.4.3.1 - Obrigações Previdenciárias - Curto Prazo	35
7.4.3.2 - Obrigações Previdenciárias - Médio e Longo Prazo	36

1 - INTRODUÇÃO

Atendendo a necessidade do Instituto Previdenciário quanto a Política anual de Investimentos e a Meta Atuarial, enviamos o Relatório Trimestral dos investimentos, referente ao 2º TRIMESTRE, sobre o desempenho das rentabilidades e os riscos das aplicações financeiras do ARRAIAS-PREV.

Este relatório vem atender o **Art. 136º da Portaria MTP 1.467/2022**, que exige a elaboração de **Relatórios Trimestrais**, para acompanhamento dos riscos e desempenho das aplicações financeiras.

Art. 136. A unidade gestora deverá elaborar, no mínimo, trimestralmente, relatórios detalhados sobre a rentabilidade, os riscos das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do regime e a aderência à política de investimentos, que deverão ser submetidos para avaliação e adoção de providências pelos órgãos responsáveis, conforme atribuições estabelecidas na forma do § 2º do art. 86.

2.1-MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2023 - ARRAIAS-PREV

Nº	MESES	SALDO INICIAL	APORTES (Aplicação)	RESGATES	VARIÇÃO PU - TÍTULOS PÚBLICOS	RENTABILIDADE			SALDO FINAL
						Positiva (a)	Negativa (b)	Consolidado c = (a) - (b)	
1	JANEIRO	8.313.769,01	411.014,56	(449.028,81)	-	105.501,41	(1.155,33)	104.346,08	8.380.100,84
2	FEVEREIRO	8.380.100,84	32.750,64	(140.358,30)	-	85.487,06	(20.116,86)	65.370,20	8.337.863,38
3	MARÇO	8.337.923,85	267.472,44	(290.050,37)	-	118.314,72	(20.018,96)	98.295,76	8.413.641,68
4	ABRIL	8.413.641,68	-	(32.300,00)	-	71.318,31	(6.522,77)	64.795,54	8.446.137,22
5	MAIO	8.446.137,22	322.037,58	(137.060,00)	-	107.003,07	(59,87)	106.943,20	8.738.058,00
6	JUNHO	8.738.058,00	-	(21.890,00)	-	140.972,46	-	140.972,46	8.857.140,46
7	JULHO	8.857.140,46	-	-	-	-	-	-	8.857.140,46
8	AGOSTO	8.857.140,46	-	-	-	-	-	-	8.857.140,46
9	SETEMBRO	8.857.140,46	-	-	-	-	-	-	8.857.140,46
10	OUTUBRO	8.857.140,46	-	-	-	-	-	-	8.857.140,46
11	NOVEMBRO	8.857.140,46	-	-	-	-	-	-	8.857.140,46
12	DEZEMBRO	8.857.140,46	-	-	-	-	-	-	8.857.140,46
13	ANO	8.313.769,01	1.033.275,22	(1.070.687,48)	-	628.597,03	(47.873,79)	580.723,24	8.857.140,46

*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

2.2-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2023 - LIMITE DE SEGMENTO - ARRAIAS-PREV

Nº	Segmentos da Resolução CMN 4.963/2021	Dispositivo Legal Resolução CMN 4.963/2021	Limites do PAI			Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
			Mínimo	Estratégia Alvo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
RENDA FIXA								
1	Títulos Públicos Federal	Art. 7, I, a (100%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
2	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas	Art. 7, I, b (100%)	0,0%	62,4%	82,0%	70,3%	6.349.930,65	-
3	F.I. Índice de Renda Fixa 100% T.P.F. e/ou Operação	Art. 7, I, c (100%)	0,0%	0,0%	82,0%	0,0%	-	-
4	Operações Compromissadas	Art. 7, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
5	F.I. de Renda Fixa	Art. 7, III, a (60%)	0,0%	20,9%	50,0%	12,0%	1.080.053,35	-
6	F.I. de Índice de Renda Fixa	Art. 7, III, b (60%)	0,0%	0,0%	50,0%	0,0%	-	-
7	Ativos Financeiros de Renda Fixa de I.F.	Art. 7, IV (20%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
8	FIDC - Classe Sênior	Art. 7, V, a (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
9	F.I. Renda Fixa de 'Crédito Privado'	Art. 7, V, b (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
10	F.I. em 85% de Debêntures	Art. 7, V, c (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
11	TOTAL - RENDA FIXA					82,2%	7.429.984,00	
RENDA VARIÁVEL								
12	F.I. Ações	Art. 8, I (30%)	0,0%	6,7%	17,0%	6,2%	564.553,69	-
13	F.I. Ações em Índices de Renda Variável	Art. 8, II (30%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
14	TOTAL - RENDA VARIÁVEL	Art. 8º (30%)				6,2%	564.553,69	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS								
15	F.I. e F.I.C FI Multimercados	Art. 10, I (10%)	0,0%	4,7%	10,0%	4,4%	401.778,09	-
16	F.I. em Participações	Art. 10, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
17	F.I. Ações - Mercado de Acesso	Art. 10, III (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
18	TOTAL - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	Art. 10 (15%)				4,4%	401.778,09	
FUNDOS IMOBILIÁRIOS								
19	F.I. Imobiliário	Art. 11 (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
20	TOTAL - FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Art. 11 (5%)				0,0%	-	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR								
21	FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa	Art. 9º, I (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
22	FIC - Aberto - Investimento no Exterior	Art. 9º, II (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
23	Fundos de Ações - BDR Nível I	Art. 9º, III (10%)	0,0%	5,2%	10,0%	5,1%	460.824,68	-
24	TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Art. 9º (10%)				5,1%	460.824,68	
EMPRÉSTIMO CONSIGNADO								
25	Empréstimo Consignado	Art. 12 (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
26	TOTAL - EMPRÉSTIMO CONSIGNADO	Art. 12 (5%)				0,0%	-	
27	DESENQUADRADO	-		100,0%		0,0%	-	-
28	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-				2,0%	179.284,19	
29	PATRIMÔNIO TOTAL					100,0%	9.036.424,65	

2.3-ENQUADRAMENTO SOBRE SEGMENTOS E FUNDOS DE INVESTIMENTOS

RENDA FIXA

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
1	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	246.133,85	2,72%	SIM	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	70,27%	SIM
2	13.327.340/0001-73	BB PREVIDENCIARIO RF IMA - B 5 + TP FI	271.195,78	3,00%	SIM			
3	07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	375.879,60	4,16%	SIM			
4	44.345.590/0001-60	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	672.113,94	7,44%	SIM			
5	35.292.588/0001-89	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	879.088,03	9,73%	SIM			
6	14.964.240/0001-10	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TP FI	513.109,91	5,68%	SIM			
7	03.543.447/0001-03	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	1.243.739,91	13,76%	SIM			
8	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	1.244.153,12	13,77%	SIM			
9	11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	904.516,51	10,01%	SIM			
10	13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.080.053,35	11,95%	SIM	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	12,0%	SIM
(1) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA			7.429.984,00	82,22%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JUNHO

RENDA VARIÁVEL

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
11	36.178.569/0001-99	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	100.750,34	1,11%	SIM			
12	40.054.357/0001-77	BB AÇÕES AGRO FIC FI	268.270,55	2,97%	SIM	F.I. Ações, Art. 8, I (30%)	6,2%	SIM
13	05.100.213/0001-09	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	195.532,80	2,16%	SIM			
14	06.015.368/0001-00	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	401.778,09	4,45%	SIM	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	4,4%	SIM
(2) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL			966.331,78	10,69%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JUNHO

INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
15	22.632.237/0001-28	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	460.824,68	5,10%	SIM	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)	5,1%	SIM
(3) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			460.824,68	5,10%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JUNHO

2.3.1-DISPONIBILIDADE FINANCEIRA E TOTAL POR SEGMENTO

Nº	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		
16	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	179.284,19	1,98%
(4)	TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)	179.284,19	1,98%

TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS		
(1) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	7.429.984,00	82,22%
(2) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL	966.331,78	10,69%
(3) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	460.824,68	5,10%
(4) TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)	179.284,19	1,98%
PATRIMÔNIO LÍQUIDO TOTAL (1 + 2 + 3 + 4)	9.036.424,65	100,00%

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JUNHO

3-RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS

1

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI
CNPJ	13.077.418/0001-49	11.328.882/0001-35	13.322.205/0001-35	03.543.447/0001-03
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa
ÍNDICE	CDI	IRF-M 1	IDKA IPCA 2A	IMA - B 5
PÚBLICO ALVO	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
ADMINISTRADOR	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
GESTOR	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
CUSTODIANTE	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.
CNPJ	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
CNPJ	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
AUDITORIA	PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA	PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA	PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA	PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA
DATA DE INÍCIO	28/04/2011	08/12/2009	28/04/2011	17/12/1999
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,10% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
APLICAÇÃO INICIAL	1000	1000	10000	1000
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01	0,01	0	0,01
RESGATE MÍNIMO	0,01	0,01	0,00	0,01
SALDO MÍNIMO	0,01	0,01	0	0,01
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	2 - Baixo	2 - Baixo	3 - Médio	3 - Médio
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

2

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TP FI	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI
CNPJ	14.964.240/0001-10	35.292.588/0001-89	44.345.590/0001-60	07.111.384/0001-69
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa
ÍNDICE	IMA-GERAL-EX-C	IPCA	IPCA + 5,00% a.a.	IRF-M
PÚBLICO ALVO	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
ADMINISTRADOR	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
GESTOR	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
CUSTODIANTE	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.
CNPJ	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
CNPJ	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
AUDITORIA	PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	DELOITTE TOUCHE TOHMATSU AUDITORES INDEPENDENTES LTDA	PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA
DATA DE INÍCIO	20/04/2012	16/03/2020	24/01/2022	08/12/2004
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,30% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não Possui	Não Possui	Não Possui	Não Possui
APLICAÇÃO INICIAL	1000	10000	100000	10000
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0	1000	100000	0,01
RESGATE MÍNIMO	0,00	1.000,00	100.000,00	0,01
SALDO MÍNIMO	0	1000	100000	0,01
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Até dia 15/08/2024	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	3 - Médio	3 - Médio	3 - Médio	3 - Médio
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

12

(63)3602-1493 / (63)3602-2504 - economico@selfassessoria.com.br

Av. Castelo Branco - 1555 2º Andar, Centro - Cep: 77600-000 - Paraíso do Tocantins-TO

3

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B 5 + TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	BB AÇÕES AGRO FIC FI
CNPJ	13.327.340/0001-73	07.442.078/0001-05	05.100.213/0001-09	40.054.357/0001-77
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Variável	Renda Variável
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Ações	Fundo de Ações
ÍNDICE	IMA-B5+	IMA-B	IBOVESPA	IBOVESPA
PÚBLICO ALVO	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
ADMINISTRADOR	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
GESTOR	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
CUSTODIANTE	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.
CNPJ	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
CNPJ	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
AUDITORIA	PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA	PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA	PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
DATA DE INÍCIO	28/04/2011	24/07/2005	22/07/2002	11/02/2021
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,20% a.a.	2,00% a.a.	1,00% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não Possui	Não Possui	Não Possui	20% IBOVESPA
APLICAÇÃO INICIAL	10000	10000	0,01	0,01
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01	0,01	0,01	0,01
RESGATE MÍNIMO	0,01	0,01	0,01	0,01
SALDO MÍNIMO	0,01	0,01	0,01	0,01
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	4 - Alto	4 - Alto	5 - Muito Alto	5 - Muito Alto
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

13

(63)3602-1493 / (63)3602-2504 - economico@selfassessoria.com.br

Av. Castelo Branco - 1555 2º Andar, Centro - Cep: 77600-000 - Paraíso do Tocantins-TO

4

INFORMAÇÕES	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	
CNPJ	36.178.569/0001-99	06.015.368/0001-00	22.632.237/0001-28	
SEGMENTO	Renda Variável	Investimentos Estruturados	Investimento no Exterior	
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Ações	Fundo Multimercado	Fundo de Ações	
ÍNDICE	S&P500	MULT	IBOVESPA	
PÚBLICO ALVO	Público Geral	Público Geral	Público Geral	
ADMINISTRADOR	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	
GESTOR	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	
CUSTODIANTE	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	
CNPJ	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	
CNPJ	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	
AUDITORIA	KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	PRICEWATERHOUSECOO PERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.	
DATA DE INÍCIO	04/05/2020	29/06/2006	29/12/2015	
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	1,00% a.a.	1,00% a.a.	1,00% a.a.	
TAXA DE PERFORMANCE	10% do S&P 500	20% CDI	Não Possui	
APLICAÇÃO INICIAL	0,01	0,01	0,01	
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01	0,01	0,01	
RESGATE MÍNIMO	0,01	0,01	0,01	
SALDO MÍNIMO	0,01	0,01	0,01	
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	
CRÉDITO DO RESGATE	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+4 (Quatro dias úteis após a solicitação)	
RISCO DE MERCADO*	5 - Muito Alto	3 - Médio	5 - Muito Alto	
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)	

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

14

(63)3602-1493 / (63)3602-2504 - economico@selfassessoria.com.br

Av. Castelo Branco - 1555 2º Andar, Centro - Cep: 77600-000 - Paraíso do Tocantins-TO

4.1 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - BANCO DO BRASIL

BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI						
1	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	1.212.731,87	-	-	10.841,74	1.223.573,61	0,894%
MAIO	1.223.573,61	-	-	7.475,25	1.231.048,86	0,611%
JUNHO	1.231.048,86	-	-	12.691,05	1.243.739,91	1,031%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI						
2	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	199.060,43	-	-	2.140,59	201.201,02	1,075%
MAIO	201.201,02	161.018,79	-	5.954,91	368.174,72	2,960%
JUNHO	368.174,72	-	-	7.704,88	375.879,60	2,093%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI						
3	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	229.791,67	-	-	4.601,01	234.392,68	2,002%
MAIO	234.392,68	-	-	6.038,02	240.430,70	2,576%
JUNHO	240.430,70	-	-	5.703,15	246.133,85	2,372%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI

4	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	776.722,68	-	-	6.435,05	783.157,73	0,828%
MAIO	783.157,73	-	112.000,00	8.576,83	679.734,56	1,278%
JUNHO	679.734,56	-	-	7.875,27	687.609,83	1,159%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B 5 + TP FI

5	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	92.815,08	-	-	2.783,81	95.598,89	2,999%
MAIO	95.598,89	161.018,79	-	5.897,24	262.514,92	6,169%
JUNHO	262.514,92	-	-	8.680,86	271.195,78	3,307%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI

6	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	1.218.573,09	-	-	8.253,89	1.226.826,98	0,677%
MAIO	1.226.826,98	-	-	4.769,98	1.231.596,96	0,389%
JUNHO	1.231.596,96	-	-	12.556,16	1.244.153,12	1,020%

BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI

7	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	1.046.938,05	-	-	9.286,33	1.056.224,38	0,887%
MAIO	1.056.224,38	-	-	12.156,56	1.068.380,94	1,151%
JUNHO	1.068.380,94	-	-	11.672,41	1.080.053,35	1,093%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TP FI

8	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	489.254,47	-	-	6.174,49	495.428,96	1,262%
MAIO	495.428,96	-	-	8.998,04	504.427,00	1,816%
JUNHO	504.427,00	-	-	8.682,91	513.109,91	1,721%

BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI

9	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	836.907,04	-	-	10.632,84	847.539,88	1,270%
MAIO	847.539,88	-	-	15.969,23	863.509,11	1,884%
JUNHO	863.509,11	-	-	15.578,92	879.088,03	1,804%

BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI						
10	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	662.575,46	-	-	3.397,76	665.973,22	0,513%
MAIO	665.973,22	-	-	59,87	665.913,35	-0,009%
JUNHO	665.913,35	-	-	6.200,59	672.113,94	0,931%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI						
11	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	288.385,38	-	32.300,00	2.292,47	258.377,85	0,895%
MAIO	258.377,85	-	25.060,00	2.800,78	236.118,63	1,200%
JUNHO	236.118,63	-	21.890,00	2.678,05	216.906,68	1,250%

4.2 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - RENDA VARIÁVEL

BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI							
12	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
ABRIL	185.338,22	-	-	2.607,28	182.730,94	-1,407%	
MAIO	182.730,94	-	-	2.673,55	185.404,49	1,463%	
JUNHO	185.404,49	-	-	10.128,31	195.532,80	5,463%	

BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI							
13	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
ABRIL	389.204,09	-	-	3.375,86	392.579,95	0,867%	
MAIO	392.579,95	-	-	4.470,35	397.050,30	1,139%	
JUNHO	397.050,30	-	-	4.727,79	401.778,09	1,191%	

BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I							
14	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
ABRIL	443.880,89	-	-	2.747,76	441.133,13	-0,619%	
MAIO	441.133,13	-	-	13.401,50	454.534,63	3,038%	
JUNHO	454.534,63	-	-	6.290,05	460.824,68	1,384%	

BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA

15	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	93.418,06	-	-	1.102,47	94.520,53	1,180%
MAIO	94.520,53	-	-	1.260,74	95.781,27	1,334%
JUNHO	95.781,27	-	-	4.969,07	100.750,34	5,188%

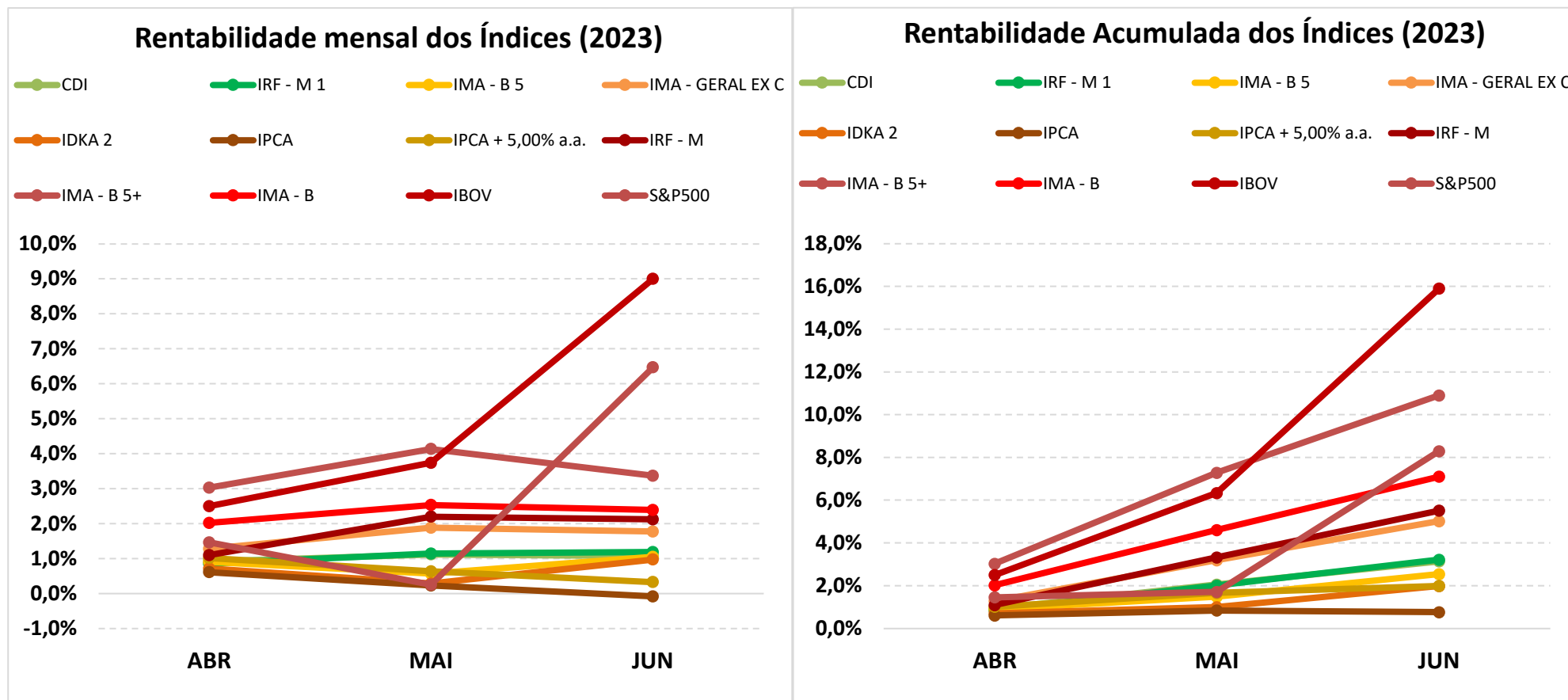
BB AÇÕES AGRO FIC FI

16	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
ABRIL	248.045,20	-	-	1.167,73	246.877,47	-0,471%
MAIO	246.877,47	-	-	6.560,09	253.437,56	2,657%
JUNHO	253.437,56	-	-	14.832,99	268.270,55	5,853%

5-TABELA DE RENTABILIDADE

INVESTIMENTOS	ABR	MAI	JUN	ACUMULADO
BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,89%	1,15%	1,09%	3,16%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	0,83%	1,12%	1,16%	3,14%
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	0,68%	0,39%	1,02%	2,10%
BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	0,89%	0,61%	1,03%	2,56%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TP FI	1,26%	1,82%	1,72%	4,88%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,27%	1,88%	1,80%	5,04%
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,51%	-0,01%	0,93%	1,44%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	1,08%	2,17%	2,09%	5,43%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA - B 5 + TP FI	3,00%	4,12%	3,31%	10,79%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	2,00%	2,58%	2,37%	7,11%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	-1,41%	1,46%	5,46%	5,50%
BB AÇÕES AGRO FIC FI	-0,47%	2,66%	5,85%	8,15%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	1,18%	1,33%	5,19%	7,85%
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	0,87%	1,14%	1,19%	3,23%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	-0,62%	3,04%	1,38%	3,82%
CDI	0,92%	1,12%	1,07%	3,14%
IRF - M 1	0,86%	1,14%	1,19%	3,22%
IMA - B 5	0,90%	0,57%	1,05%	2,55%
IMA - GERAL EX C	1,28%	1,88%	1,78%	5,02%
IDKA 2	0,71%	0,29%	0,97%	1,99%
IPCA	0,61%	0,23%	-0,08%	0,76%
IPCA + 5,00% a.a.	1,02%	0,64%	0,33%	1,99%
IRF - M	1,10%	2,20%	2,12%	5,52%
IMA - B 5+	3,03%	4,13%	3,37%	10,90%
IMA - B	2,02%	2,53%	2,39%	7,10%
IBOV	2,50%	3,74%	9,00%	15,90%
S&P500	1,46%	0,25%	6,47%	8,29%

GRÁFICO COMPARATIVO DE RENTABILIDADE DOS ÍNDICES



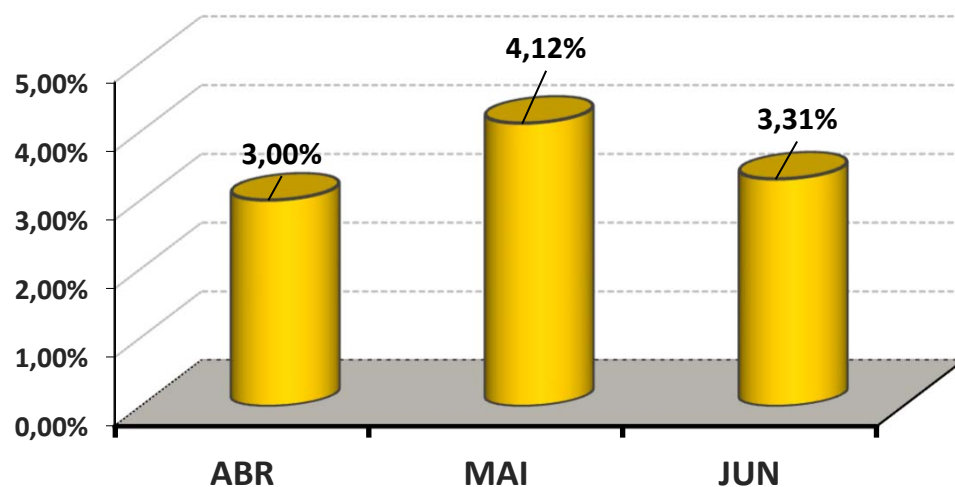
5.1-MELHOR DESEMPENHO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO MENSAL

FUNDO DE INVESTIMENTO	ABR	MAI	JUN
BB PREVIDENCIARIO RF IMA - B 5 + TP FI	3,00%	4,12%	3,31%

Comportamento MENSAL no Trimestre

■ BB PREVIDENCIARIO RF IMA - B 5 + TP FI

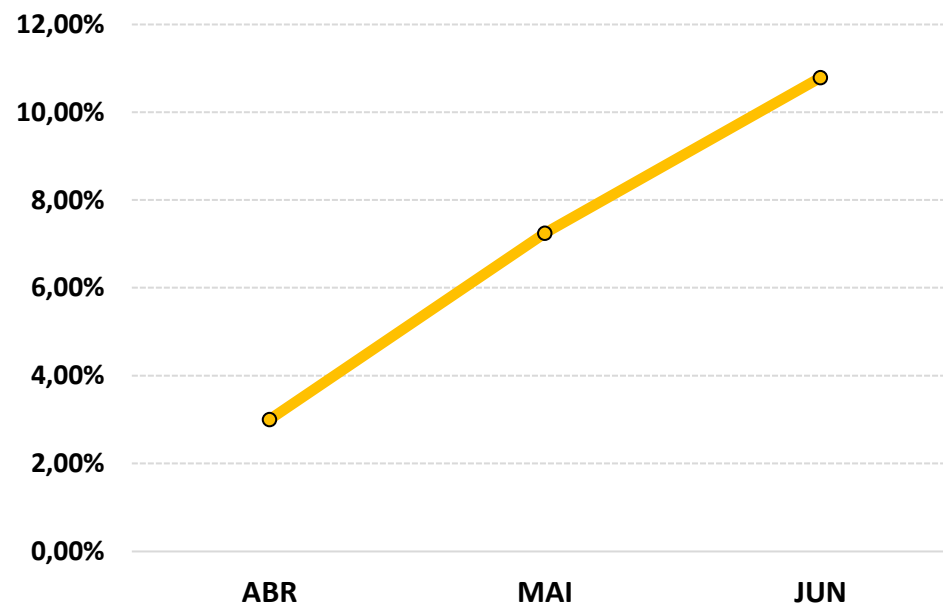


COMPORTAMENTO ACUMULADO

FUNDO DE INVESTIMENTO	ABR	MAI	JUN
BB PREVIDENCIARIO RF IMA - B 5 + TP FI	3,00%	7,24%	10,79%

Comportamento ACUMULADO no Trimestre

● BB PREVIDENCIARIO RF IMA - B 5 + TP FI

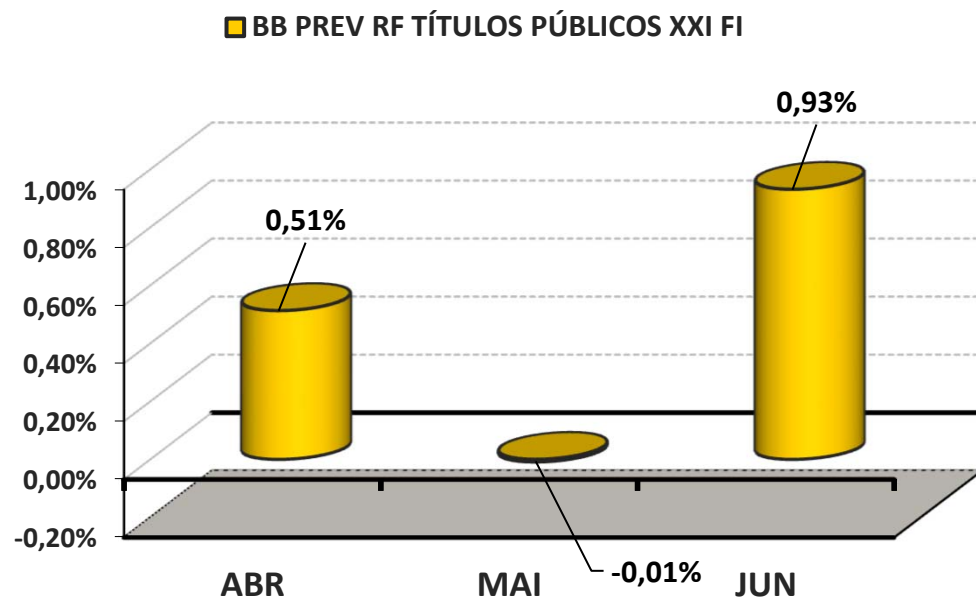


5.2-PIOR DESEMPENHO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

COMPORTAMENTO MENSAL

FUNDO DE INVESTIMENTO	ABR	MAI	JUN
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,51%	-0,01%	0,93%

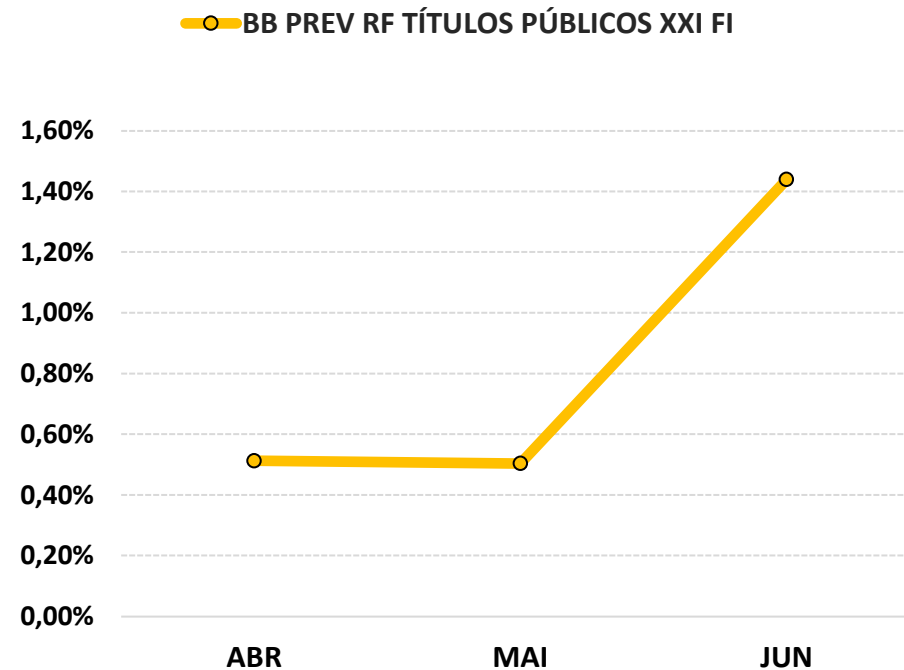
Comportamento MENSAL no Trimestre



COMPORTAMENTO ACUMULADO

FUNDO DE INVESTIMENTO	ABR	MAI	JUN
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,51%	0,50%	1,44%

Comportamento ACUMULADO no Trimestre



6-RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

6.1-RENTABILIDADE MENSAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2023 - ARRAIAS-PREV

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN						
RENTABILIDADE MENSAL DA CARTEIRA	1,26%	0,79%	1,18%	0,77%	1,27%	1,62%						
CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%						
IBOVESPA	3,37%	-7,49%	-2,91%	2,50%	3,74%	9,00%						
META ATUARIAL	0,92%	1,23%	1,10%	1,00%	0,62%	0,31%						

A RENTABILIDADE DA CARTEIRA DO ARRAIAS-PREV NO MÊS DE JUNHO FOI DE:

R\$ **140.972,46**

A META ATUARIAL NO MÊS DE JUNHO FOI DE:

R\$ **26.727,19**

6.2-RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2023 - ARRAIAS-PREV

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN						
RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA	1,26%	2,06%	3,27%	4,07%	5,38%	7,09%						
CDI	1,12%	2,05%	3,24%	4,19%	5,36%	6,49%						
IBOVESPA	3,37%	-4,37%	-7,16%	-4,83%	-1,27%	7,61%						
META ATUARIAL	0,92%	2,15%	3,27%	4,30%	4,94%	5,26%						

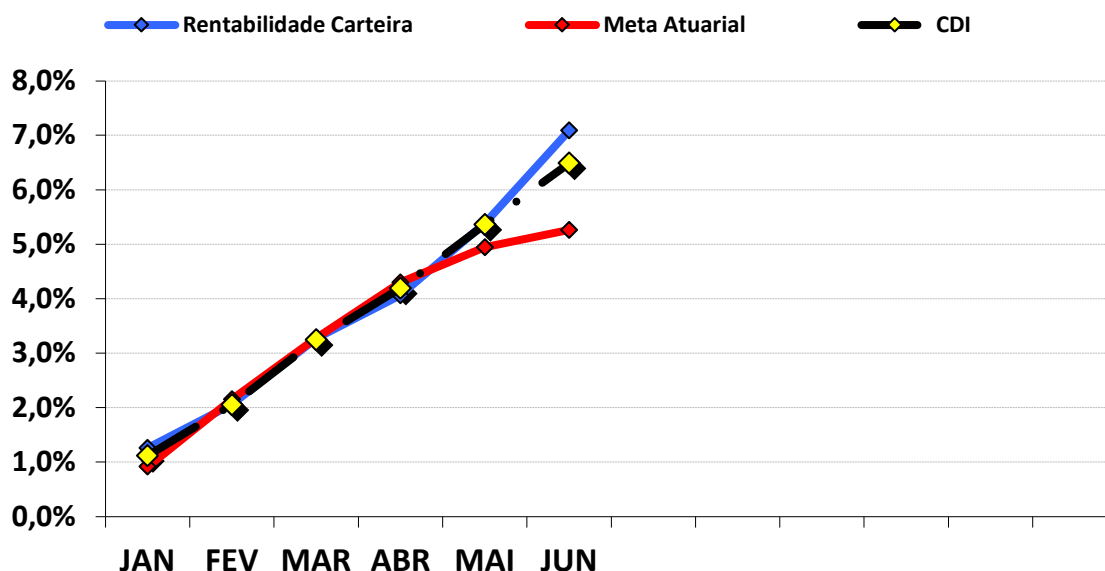
RENTABILIDADE ACUMULADA DO ARRAIAS-PREV: R\$ 580.723,24

META ATUARIAL ACUMULADA: R\$ 432.779,08

GANHO SOBRE A META ATUARIAL R\$ 147.944,16

GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL

RENTABILIDADE DA CARTEIRA (Acumulada) 2023



RENTABILIDADE e ÍNDICES ACUMULADOS

	Rentabilidade Carteira	Meta Atuarial	CDI
JAN	1,26%	0,92%	1,12%
FEV	2,06%	2,15%	2,05%
MAR	3,27%	3,27%	3,24%
ABR	4,07%	4,30%	4,19%
MAI	5,38%	4,94%	5,36%
JUN	7,09%	5,26%	6,49%

6.3-ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - 2º TRIMESTRE - 2023

	ABR	MAI	JUN
MENSAL	0,77%	1,27%	1,62%
CDI	0,92%	1,12%	1,07%
IBOVESPA	2,50%	3,74%	9,00%
META ATUARIAL	1,00%	0,62%	0,31%

	ABR	MAI	JUN
ACUMULADO DO TRIMESTRE	0,77%	2,05%	3,70%
CDI	0,92%	2,05%	3,14%
IBOVESPA	2,50%	6,33%	15,90%
META ATUARIAL	1,00%	1,62%	1,93%

RENTABILIDADE ACUMULADA DO TRIMESTRE DO ARRAIAS-PREV:

R\$ 312.711,20

META ATUARIAL ACUMULADA DO TRIMESTRE:

R\$ 162.533,54

GANHO SOBRE A META ATUARIAL

R\$ 150.177,66

7-CONCLUSÃO

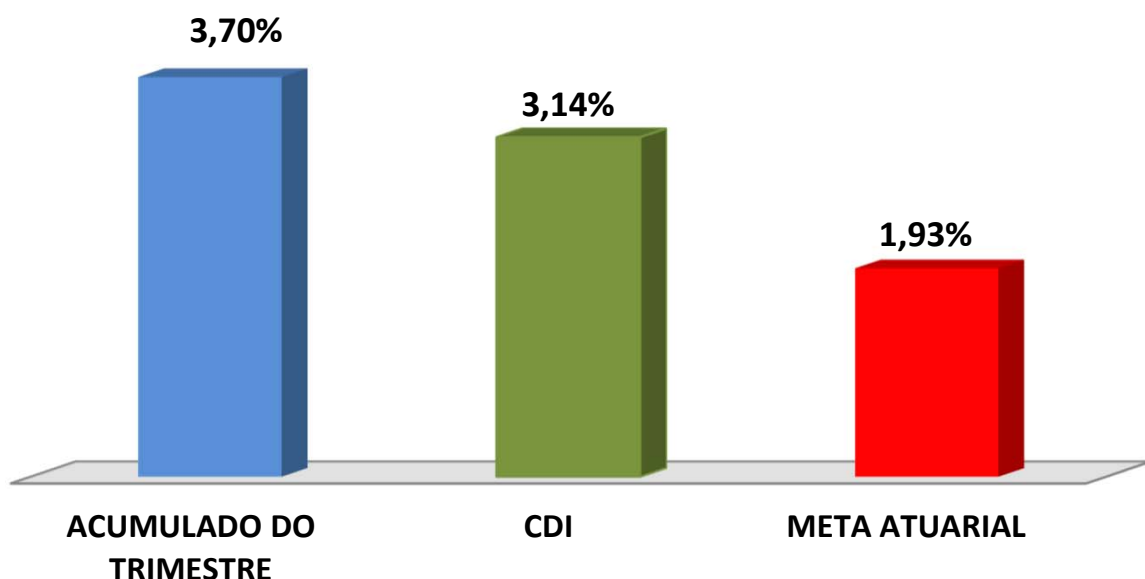
Atendendo o Art. 136º da Portaria MTP 1.467/2022, detalhado na página 3 deste relatório, segue abaixo uma análise da Carteira de Investimento ARRAIAS-PREV, no 2º Trimestre/2023, analisando rentabilidade, risco das operações e aderência ao PAI/2023.

7.1.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA TRIMESTRAL

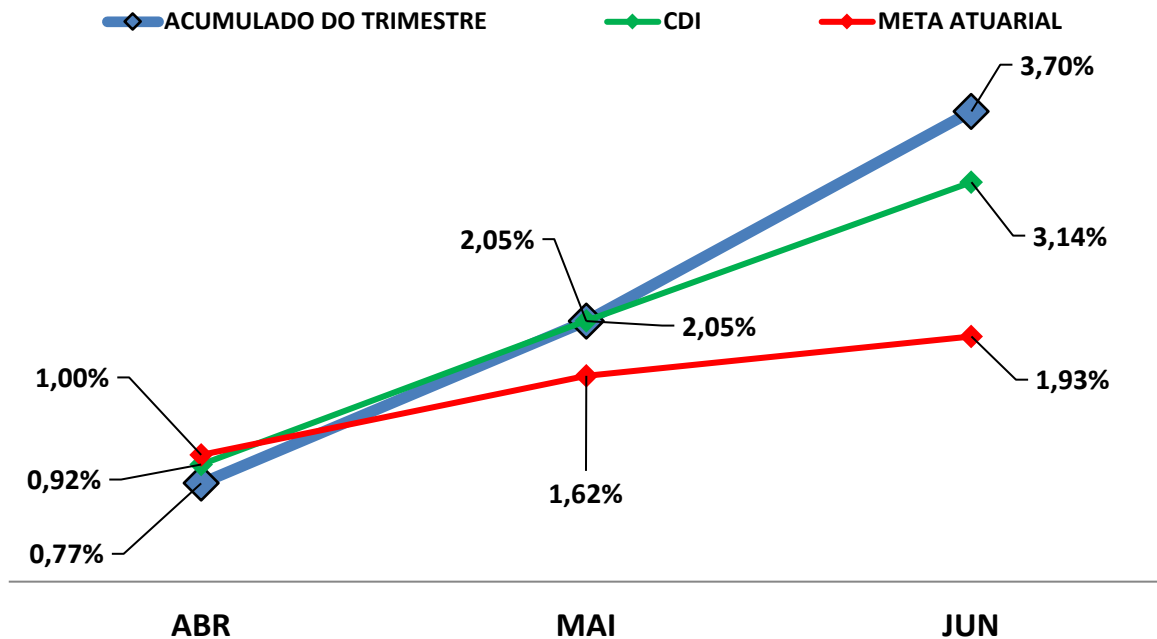
A Carteira de Investimentos do ARRAIAS-PREV, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada no trimestre de 3,70% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado no trimestre de 3,14% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou no período, uma rentabilidade de 117,74% sobre o índice de referência do mercado.

GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL

Rentabilidade Acumulada no Trimestre



Rentabilidade Acumulada no Trimestre



7.2-META ATUARIAL

Enquanto a rentabilidade acumulada no trimestre do ARRAIAS-PREV é de 3,70% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de 1,93%, representando 191,82% sobre a Meta Atuarial.

7.3-RISCOS

7.3.1-RISCO DE MERCADO

É o risco de oscilações de preços dos ativos conforme o cenário macroeconômico. Este risco é voltado para a volatilidade dos papéis, sobretudo de Renda Fixa (Títulos Públicos e fundos atrelados à inflação) e Renda Variável (ações, dólar e etc..)."

Conforme a tabela abaixo, o ARRAIAS-PREV aplica em alguns Fundos de Investimentos sensíveis às oscilações de mercado, conforme a classificação de Risco de Mercado, disponibilizado nas Lâminas de Informações Essenciais dos Fundos de Investimentos.

Nº	FUNDOS DE INVESTIMENTO	RISCO DE MERCADO*
1	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2 - Baixo
2	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	2 - Baixo
3	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	3 - Médio
4	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	3 - Médio
5	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TP FI	3 - Médio
6	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	3 - Médio
7	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	3 - Médio
8	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	3 - Médio
9	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B 5 + TP FI	4 - Alto
10	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	4 - Alto
11	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	5 - Muito Alto
12	BB AÇÕES AGRO FIC FI	5 - Muito Alto
13	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	5 - Muito Alto
14	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	3 - Médio
15	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	5 - Muito Alto

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

7.3.2-RISCO DE CRÉDITO

É a possibilidade do devedor não honrar seus compromissos. Nesse caso, investimentos que possuem risco de insolvência financeira são obrigados à se submeter a classificação de risco por Agências de Rating.

7.3.2.1-FUNDO DE INVESTIMENTO

A maioria dos Fundos de Investimentos em Renda Fixa e Renda Variável que o ARRAIAS-PREV aplica, não necessitam de Análise de Rating. Entretanto, alguns fundos de Renda Variável possuem certa concentração de papéis privados em sua carteira de investimento que, por possuir risco de insolvência financeira são obrigados à se submeter a classificação de risco por Agências de Rating. Abaixo segue a Classificação de Rating destes Fundos de Investimentos.

Nº	FUNDO DE INVESTIMENTO	CLASSIFICAÇÃO DE RATING	
		AGÊNCIA	RATING
1	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Não Disponibilizado pela Instituição	-
2	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	Não Disponibilizado pela Instituição	-
3	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	Moodys América Latina	MQ1
4	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	Moodys América Latina	MQ1
5	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TP FI	Moodys América Latina	MQ1
6	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	Não Disponibilizado pela Instituição	-
7	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	Não Disponibilizado pela Instituição	-
8	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	Não Disponibilizado pela Instituição	-
9	BB PREVIDENCIARIO RF IMA - B 5 + TP FI	Não Disponibilizado pela Instituição	-
10	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	Não Disponibilizado pela Instituição	-
11	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	Não Disponibilizado pela Instituição	-
12	BB AÇÕES AGRO FIC FI	Não Disponibilizado pela Instituição	-
13	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	Não Disponibilizado pela Instituição	-
14	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	Não Disponibilizado pela Instituição	-
15	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Não Disponibilizado pela Instituição	-

Nº	FUNDO DE INVESTIMENTO	CLASSIFICAÇÃO DE RATING	
		AGÊNCIA	RATING
15	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Não Disponibilizado pela Instituição	-

7.3.2.2-*INSTITUIÇÃO FINANCEIRA*

Todos os envolvidos na gestão do Fundo de Investimento, incluindo as Instituições Financeiras, o Administrador, o Gestor e o Distribuidor necessitam de Análise de Rating. Abaixo segue a Classificação de Rating dos envolvidos na gestão e distribuição dos Fundos de Investimentos.

Nº	INSTITUIÇÃO FINANCEIRA / ADMINISTRADOR / GESTOR / DISTRIBUIDOR	CLASSIFICAÇÃO DE RATING	
		AGÊNCIA	RATING
1	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	Fitch Ratings	AA

7.3.3-*RISCO DE LIQUIDEZ*

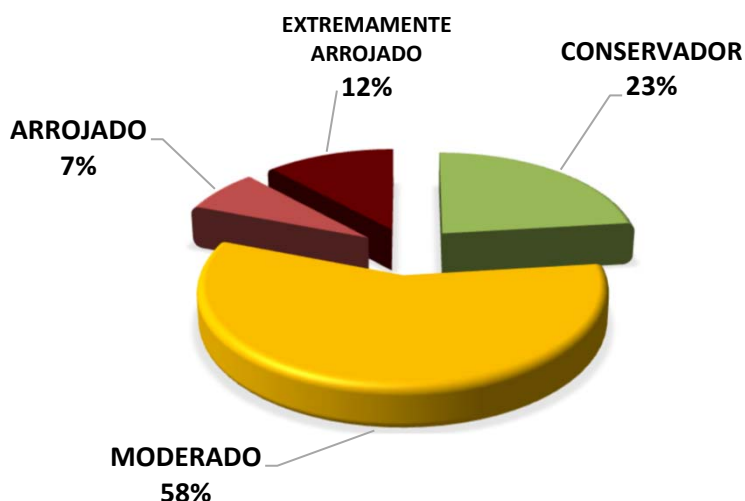
É o risco de o investidor não conseguir dar liquidez ao ativo financeiro (vender) ou conseguir liquidez abaixo do preço de mercado ou abaixo do preço de aquisição (compra).

O ARRAIAS-PREV possui Fundos de Investimento Aberto com Carência. Nesse caso, só poderá resgatar as cotas, após o termino do prazo de carência. Investimentos que possuem prazo para resgate, necessitam estar aderentes as obrigações financeiras do investidor.

7.4-ADERÊNCIA AO PAI

7.4.1-PERFIL DE RISCO (MERCADO)

PERFIL DOS INVESTIMENTOS



PERFIL 5

MODERADO

Descrição do Perfil de Investidor

Objetivo do perfil

Perfil que tem o objetivo de equilibrar os ganhos com a segurança da carteira de Investimentos. É mais familiarizado com investimentos de RENDA FIXA, equilibrando as aplicações em ativos com rentabilidades baixas, mas positiva e ativos que podem oscilar (inclusive fechando o mês negativo), mas que apresentam ganhos maiores em períodos mais longos.

Comportamento da carteira

A carteira com perfil MODERADO, busca investimentos que apresentam rentabilidades mensais positivas e investimentos que podem oferecer ganhos mais vultuosos no médio e longo prazo. Esse tipo de perfil tem dificuldade para conseguir cumprir a Meta Atuarial, principalmente em períodos de inflação em alta.

Classificação de Perfil de Investidor - Metodologia Atuarial Consultoria

CONSERVADOR	1	EXTREMAMENTE CONSERVADOR
	2	CONSERVADOR
	3	CONSERVADOR COM TENDÊNCIA MODERADA
MODERADO	4	MODERADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	5	MODERADO
	6	MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA
ARROJADO	7	ARROJADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	8	ARROJADO COM TENDÊNCIA MODERADA
	9	ARROJADO
	10	EXTREMAMENTE ARROJADO

O atual perfil de risco do ARRAIAS-PREV (PERFIL 5 - MODERADO), se encontra aderente ao Perfil de Risco proposto na Política Anual de Investimentos/2023.

7.4.2-RISCO DE CRÉDITO

A Política Anual de Investimentos/2023 do ARRAIAS-PREV, determina que fundos de investimentos e Instituições Financeiras que necessitem de Análise de Rating, só receberão recursos do ARRAIAS-PREV, caso sejam classificados, no mínimo, como BAIXO RISCO DE CRÉDITO (BBB).

As Análises de Ratings encontradas dos Fundos de Investimentos, assim como das Instituições Financeiras, dos Administradores, dos Gestores e dos Distribuidores dos fundos, se encontram aderentes à Política Anual de Investimentos/2023 do ARRAIAS-PREV.

7.4.3-RISCO DE LIQUIDEZ

7.4.3.1-OBRIGAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS - CURTO PRAZO

Para resguardar o ARRAIAS-PREV e minimizar o risco de liquidez no Curto Prazo foi definido na Política de Investimentos/2023, uma Separação de Recursos Financeiros, no intuito de formalizar uma Provisão de Caixa.

Na Política Anual de Investimentos/2023 do ARRAIAS-PREV foi definido um valor de Provisão de Caixa de R\$ 1.233.813,26 Milhões de reais. Atualmente, a necessidade de Provisão de Caixa do ARRAIAS-PREV é de R\$ 664.360,99 e o Saldo financeiro da Provisão de Caixa do ARRAIAS-PREV está em R\$ 1.767.663,18 Milhões de reais.

As Obrigações Previdenciárias no Curto Prazo, ou seja, a necessidade financeira do ARRAIAS-PREV estão aderentes a Política Anual de Investimentos/2023 e a sua capacidade financeira no Curto Prazo.

7.4.3.2-OBRIGAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS - MÉDIO e LONGO PRAZO

O ARRAIAS-PREV não possui Fundos de Investimento Aberto com Carência e Fundos de Investimentos de Condomínio Fechados na sua carteira de investimento, possuindo liquidez à qualquer momento de seus recursos financeiros.

De acordo com o Estudo de Duration do Fluxo de Caixa do Plano Previdenciário, informado na Política Anual de Investimentos/2023, o RPPS irá começar a consumir os seus recursos, à partir do ano de 2031.

As Obrigações Previdenciárias a Médio e Longo Prazo do ARRAIAS-PREV estão aderentes a Política Anual de Investimentos/2023 e a sua capacidade e necessidade financeira a Médio e Longo prazo.

As análises efetuadas seguem as disposições estabelecidas na **Resolução CMN 4.963/2021**, tendo presente as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação as obrigações previdenciárias e transparência.

É o Relatório.



Igor França Garcia

Atuário MIBA/RJ 1.659

Certificação de Especialista em Investimento - CEA

Consultor de Investimentos credenciado pela CVM