

INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICÍPIO DE CARAGUATATUBA/SP

CARAGUAPREV

AVALIAÇÃO FINANCEIRA

4º TRIMESTRE DE 2021

SUMÁRIO

1.	INTRODUÇÃO	3
2.	CENÁRIO MACROECONÔMICO	5
3.	BOLETIM FOCUS	7
4.	CARTEIRA DE INVESTIMENTOS	8
4.1	ESTUDO ALM	8
5.	RENTABILIDADE DO PLANO PREVIDENCIÁRIO	13
6.	RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS	14
7.	PERSPECTIVAS	17
8.	GERENCIAMENTO DE RISCOS - INDICADORES DE DESEMPENHO E RISCO	18
9.	TABELA DE LIQUIDEZ	20
10.	MOVIMENTAÇÕES DO TRIMESTRE	20
11.	EXECUÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS	31
12.	RELAÇÃO DE GESTORES DOS RECURSOS	33
13.	RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV. DEZEMBRO 2021	34
14.	PRÓ GESTÃO – NÍVEL 1	35
15.	CONCLUSÃO	36

RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

4º TRIMESTRE DE 2021

Parâmetros:

- *Resolução 3.922/10 do CMN e alterações – Legislação Vigente;*
- *Política Anual de Investimentos - elaborada pelo CARAGUAPREV;*
- *Diversificação, Segurança, Liquidez e Transparência;*
- *Diluição dos riscos de perda e do retorno nos Investimentos;*
- *Aumento da rentabilidade da carteira de forma inteligente;*
- *Expectativas do Mercado.*

1. INTRODUÇÃO

O CaraguaPrev no trimestre avaliado vem implementando ações que demonstram transparência nos processos decisórios dos investimentos financeiros e divulgação das informações aos seus segurados.

O Instituto com sua estrutura administrativa composta pelo Conselho Deliberativo, Conselho Fiscal e Diretoria Executiva que executa as deliberações tomadas pelos Conselhos. Na área de investimentos atuam os membros do Comitê de Investimentos que analisam as aplicações financeiras e levam a matéria para deliberação conclusiva pelo Conselho Deliberativo. Nas reuniões mensais são deliberadas e avaliadas as questões: previdenciárias, fiscais, financeiras e administrativas, visando a implantação de boas práticas de gestão e governança, com o intuito de que o CaraguaPrev desenvolva uma boa gestão previdenciária e administrativa e efetue os investimentos conforme as normas vigentes e de maneira eficaz, levando em conta sua finalidade essencial, que é assegurar os direitos aos participantes beneficiários segurados do sistema, que é o pagamento dos benefícios previdenciários.

O Relatório Mensal de Investimentos do CaraguaPrev tem o intuito de informar à sociedade os dados quantitativos e qualitativos da carteira de investimentos do Plano Previdenciário, detalhando os

ativos financeiros que o compõe, inclusive quanto aos indicadores de desempenho e gerenciamento de riscos.

Participantes da Gestão do CaraguaPrev no mês avaliado:

Conselho Deliberativo:

- Marcus da Costa Nunes Gomes (Presidente do Conselho Deliberativo);
- Rosemeire Maria de Jesus (Certificação profissional CPA-10);
- Ivone Cardoso Vicente Alfredo
- Gilceli de Oliveira Ubiña;
- Ivy Monteiro Malerba;
- Marcia Denise Gusmão Coelho;
- Roberta Alice Zimbres Franzolin;
- Ronaldo Cheberle;

Conselho Fiscal:

- Cristiano Paulo Silva (Presidente do Conselho Fiscal)
- Adriana Zambotto (Certificação profissional CPA-10);
- Márcia Regina Paiva Silva Rossi;
- Priscila Sousa Giorgeti Vieira (Certificação profissional CPA-10);

Comitê de Investimentos:

- Luana Moussalli Forcioni Guedes (Presidente do Comitê de Investimentos e Certificação Profissional CPA-10);
- Pedro Ivo de Sousa Tau (Certificação profissional CPA-10);
- Adriana Zambotto (Certificação profissional CPA-10)
- Rosemeire Maria de Jesus (Certificação profissional CPA-10);
- Ivone Cardoso Vicente Alfredo;

Diretoria Executiva:

- Pedro Ivo de Sousa tau (Presidente do CaraguaPrev);
- Luana Moussalli Forcioni Guedes (Diretora Financeira); e
- Rose Ellen de Oliveira Faria (Diretora de Benefícios)

O Demonstrativo das Aplicações e Investimentos dos Recursos - DAIR enviado ao Ministério da Previdência Social, disponível para consulta pública no site <http://cadprev.previdencia.gov.br>, contém todas as informações sobre as aplicações financeiras nas Instituições Financeiras, obedecendo

a Resolução n.º 3.922/10 e alterações do Conselho Monetário Nacional e a Política Anual de Investimentos do CaraguaPrev.

2. CENÁRIO MACROECONÔMICO

OUTUBRO

GERAL: Em outubro foi observada a continuidade da queda nos casos e mortes da COVID-19. Além disso, a vacinação seguiu avançando e já alcançou 73% da população com ao menos uma dose e mais de 55% com duas doses.

BRASIL: O avanço inflacionário, o elevado nível de desemprego formal, ainda acima de 14 milhões de trabalhadores, dúvidas fiscais e acirramento de tensões políticas foram determinantes para mais um mês de má performance nos mercados locais. Sobre dúvidas fiscais e acirramento de tensões políticas, até o momento não há sinais claros de que possa haver melhora no curto prazo, em especial em ano pré-eleitoral. Também recai sobre o Brasil os desdobramentos que podem ser trazidos pela CPI da Covid-19; o orçamento de 2022, que embora o Projeto de Lei Orçamentária Anual já tenha sido enviada, há diversas questões que podem vir a ser alteradas, como os precatórios, bolsa família e o fundo eleitoral. A necessidade de discussão e aprovação de importantes e consistentes reformas, tais como a reforma tributária e a administrativa. O fato é que se esses eventos não evoluírem, de forma minimamente positiva, poderão em alguma medida penalizar a intensidade e o ritmo do crescimento do brasileiro, com já vem acontecendo nas revisões semanais do relatório FOCUS do BCB.

COPOM: SELIC em 7,75 % a.a. Próximo COPOM: 07/08 de dezembro.

GLOBAL: Em outubro, a evolução da pandemia continuou sendo amplamente monitorada, tendo como destaque negativo o aumento no número de casos na Europa (especialmente no Reino Unido e na Rússia). No campo econômico, no último relatório de Perspectivas divulgado pelo FMI, a previsão de crescimento global para 2021 foi revisada para baixo chegando a 5,9% (A/A). A autoridade reconheceu que o ritmo de recuperação da atividade perdeu força diante da persistência pandêmica e das rupturas na cadeia global de suprimentos. Considerando ainda riscos inflacionários globais e um menor crescimento na China, o PIB Global ainda tende a apresentar bom crescimento em 2021, face aos estímulos e maior abertura dos mercados nas principais economias do mundo. Assim, o mercado internacional continua apresentando um

cenário relativamente mais favorável e menos desafiador que o mercado local, em especial o americano.

NOVEMBRO

GERAL: Na África do Sul e sobre a pandemia, o final de novembro trouxe a descoberta de uma nova cepa do Coronavírus, a Ômicron, sendo classificada pela OMS como “variante de preocupação”, por conta do alto número de mutações e elevado potencial de contágio. Essa descoberta trouxe grande volatilidade aos mercados, devido à maior possibilidade de fechamento de economias, em especial no leste europeu e na Alemanha, já previamente e ainda hoje bem castigados pela variante Delta, provocando queda nos mercados de renda variável pelo mundo afora.

BRASIL: O avanço inflacionário, o elevado nível de desemprego formal, ainda acima de 14 milhões de trabalhadores, dúvidas fiscais e acirramento de tensões políticas foram determinantes para mais um mês de má performance nos mercados locais. Sobre dúvidas fiscais e acirramento de tensões políticas, até o momento não há sinais claros de que possa haver melhora no curto prazo, em especial em ano pré-eleitoral. Também recai sobre o Brasil os desdobramentos que podem ser trazidos pela CPI da Covid-19; o orçamento de 2022, que embora o Projeto de Lei Orçamentária Anual já tenha sido enviada, há diversas questões que podem vir a ser alteradas, como os precatórios, bolsa família e o fundo eleitoral. A necessidade de discussão e aprovação de importantes e consistentes reformas, tais como a reforma tributária e a administrativa. Agregando o risco internacional, a tensão com a dinâmica inflacionária e dúvidas fiscais mais acentuadas, além do constante ruído político entre os três poderes, novembro acabou sendo positivo para renda fixa e negativo para renda variável, nesse último mercado, mais ou menos em linha com a queda observada no mercado internacional.

COPOM: SELIC em 9,25 % a.a.

GLOBAL: Adicionando o evento Ômicron, e um menor potencial de crescimento na China, previamente e de forma relevante os mercados continuavam observando uma aceleração inflacionária global, com atenção concentrada nos próximos movimentos do Fed, especialmente após o anúncio de redução do “tapering”, e, uma sinalização mais segura sobre quando se daria uma elevação de taxa de juros no mercado americano. Considerando ainda riscos inflacionários globais e um menor crescimento na China, o PIB Global ainda tende a

apresentar bom crescimento em 2021, face aos estímulos e maior abertura dos mercados nas principais economias do mundo. Assim, o mercado internacional continua apresentando um cenário relativamente mais favorável e menos desafiador que o mercado local, em especial o americano.

DEZEMBRO

GERAL: Ainda que menos letal ou com menor potencial de gravidade, em especial para o público já vacinado, o forte avanço da variante Ômicron vem contribuindo com o aumento de incertezas e de volatilidade nos mercados.

BRASIL: Ainda que agregando o risco internacional, a atenção com a dinâmica inflacionária e dúvidas fiscais mais acentuadas em ano pré-eleitoral, além do constante ruído político entre os três poderes, dezembro acabou sendo positivo para renda fixa e para renda variável, mais ou menos em linha com o mercado internacional.

COPOM: SELIC em 9,25 % a.a.

GLOBAL: Adicionando o evento Ômicron, e um menor potencial de crescimento global, se comparado ao início de 2021, em dezembro vimos diversos bancos centrais se mobilizarem para o combate direto à inflação, continuando ainda a ter como foco os próximos passos do Fed.

3. BOLETIM FOCUS

Expectativas de Mercado													31 de dezembro de 2021											
▲ Aumento ▼ Diminuição = Estabilidade																								
Mediana - Agregado	2021						2022						2023						2024					
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	Há 4 semanas	Há 1 semana	Comp. Hoje semanal *	Resp. **	
IPCA (variação %)	10,18	10,02	10,01	▼ (4)	133	9,96	29	5,02	5,03	5,03	= (2)	132	4,97	28	3,50	3,38	3,41	▲ (1)	116	3,10	3,00	3,00	= (2)	94
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	4,71	4,51	4,50	▼ (12)	91	4,46	21	0,51	0,42	0,36	▼ (2)	89	0,28	20	1,95	1,80	1,80	= (1)	74	2,10	2,00	2,00	= (3)	61
Câmbio (R\$/US\$)	5,56	5,63	-					5,55	5,60	5,60	= (1)	108	5,61	26	5,40	5,40	5,40	= (4)	83	5,30	5,30	5,30	= (5)	73
Selic (% a.a.)	9,25	-	-					11,25	11,50	11,50	= (3)	117	11,50	25	8,00	8,00	8,00	= (4)	103	7,00	7,00	7,00	= (8)	86
IGP-M (variação %)	17,47	17,47	-					5,40	5,49	5,49	= (1)	82	5,38	15	4,00	4,00	4,00	= (37)	70	4,00	4,00	4,00	= (10)	59
IPCA Administrados (variação %)	17,03	17,17	17,17	= (1)	63	17,08	12	4,29	4,60	4,61	▲ (5)	59	4,54	11	3,90	3,95	3,97	▲ (1)	47	3,50	3,50	3,50	= (36)	38
Conta corrente (US\$ bilhões)	-14,50	-20,00	-20,00	= (1)	23	-27,33	6	-19,00	-21,25	-21,59	▼ (1)	22	-26,90	6	-24,50	-27,50	-27,50	= (1)	15	-35,00	-40,00	-40,00	= (1)	11
Balança comercial (US\$ bilhões)	60,30	59,15	59,15	= (1)	22	59,00	5	63,00	55,00	55,00	= (1)	21	55,00	5	56,50	51,00	51,00	= (2)	14	56,00	52,00	52,00	= (3)	8
Investimento direto no país (US\$ bilhões)	50,00	52,00	52,00	= (1)	22	52,00	7	56,80	58,00	58,05	▲ (2)	22	60,00	7	70,00	70,00	70,00	= (2)	17	76,50	77,00	77,00	= (2)	12
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	59,50	58,90	58,75	▼ (1)	22	57,00	5	63,20	63,00	63,00	= (3)	21	61,42	5	65,35	65,20	65,20	= (2)	19	68,20	68,41	68,43	▲ (2)	14
Resultado primário (% do PIB)	-0,60	-0,60	-0,13	▲ (1)	25	0,10	6	-1,20	-1,10	-1,05	▲ (1)	24	-0,85	6	-0,80	-0,70	-0,70	= (3)	21	-0,40	-0,38	-0,38	= (1)	16
Resultado nominal (% do PIB)	-5,75	-5,60	-5,60	= (2)	21	-5,70	3	-6,80	-7,40	-7,40	= (1)	20	-8,00	3	-6,50	-6,50	-6,50	= (4)	17	-5,45	-5,45	-5,45	= (2)	12

* comportamento dos indicadores desde o FOCUS-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias *** respondentes nos últimos 5 dias úteis

2021

2022

2023

2024

* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias *** respondentes nos últimos 5 dias úteis

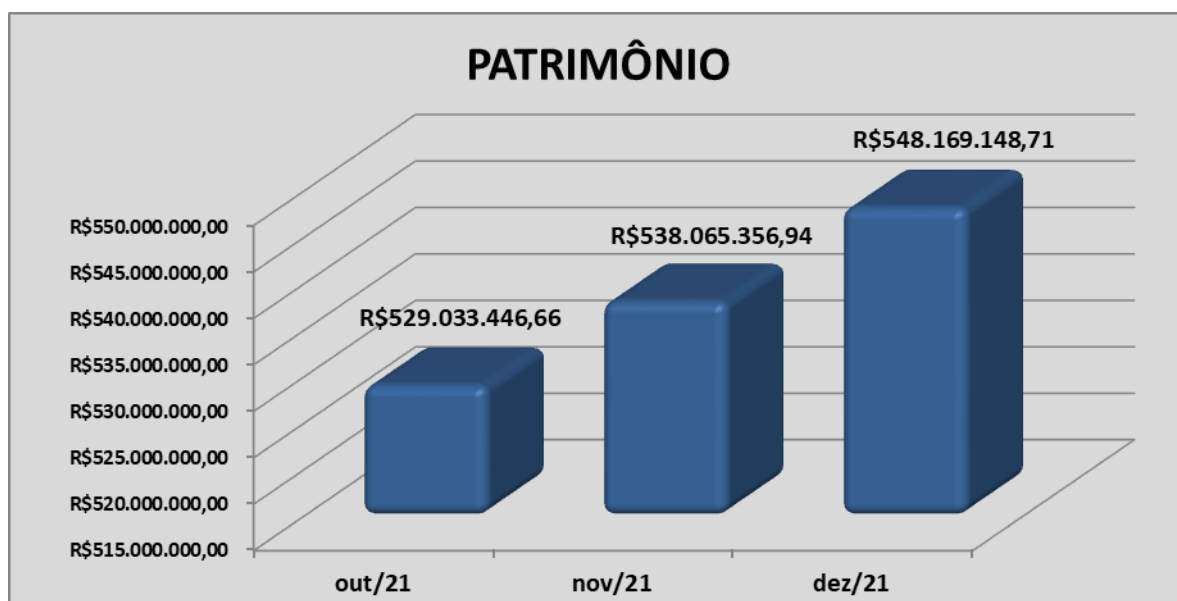
— 2021 — 2022 — 2023 — 2024

Relatório Focus de 31.12.2021. Fonte: <https://www.bcb.gov.br/publicacoes/focus>

4. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

A carteira de investimentos do CaraguaPrev é composta por ativos que estão vinculados ao seu respectivo Plano Previdenciário (PPREV), também compõe a carteira de investimentos os recursos oriundos da taxa de administração, que são utilizados na manutenção dos serviços e pagamento de pessoal da autarquia. O Plano Previdenciário possui meta atuarial estabelecida, sendo este um fundo previdenciário em regime de capitalização dos recursos, este relatório dará enfoque aos ativos a ele vinculados.

Evolução Patrimonial da Carteira de Investimentos (R\$ mil)

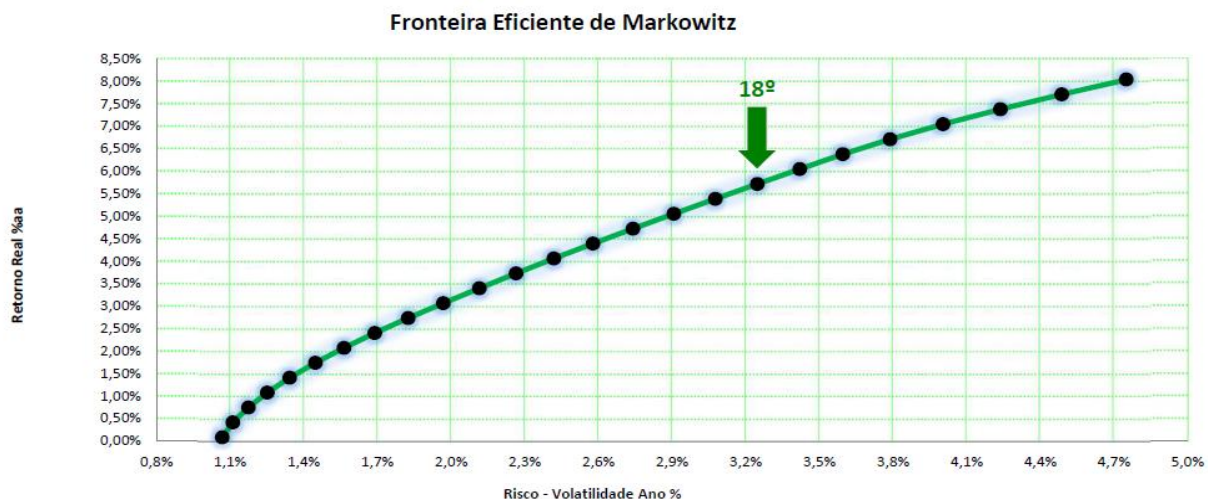


ANO	PATRIMÔNIO
out/21	R\$ 529.033.446,66
nov/21	R\$ 538.065.356,94
dez/21	R\$ 548.169.148,71

4.1 ESTUDO ALM

O estudo de Asset Liability Management (ALM) realizado na data de 31/10/2021, onde foram estudados os patamares de riscos x retorno (fronteira eficiente Markowitz). O estudo ALM trouxe como diagnostico na renda fixa: Aumentar A Alocação Em IMA-B, ARTIGO 7º, I, A ou B, num total de R\$19.909.677,14 (3,72%); aumentar a alocação em fundos atrelados a SELIC/CDI, num total de R\$ 29.761.641,48 (5,56%); no total, aumentar a alocação em renda fixa num total de R\$49.671.318,62 (9,27%); e na Renda Variável: diminuir a alocação em fundos de ações de gestão passiva do artigo 8º, I, A, num total de R\$ 24.160.881,65 (4,51%); diminuir a alocação em fundos de ações de gestão ativa do artigo 8º, II, A, num total de R\$ 57.537.786,77 (10,74%); * aumentar a aplicação em fundos multimercados atrelados à S&P500, do artigo 8º, III, num total de R\$ 19.172.335,49 (3,58%); no total, diminuir a alocação em renda variável num total de R\$62.526.332,92 (11,67%); rever os limites da alocação objetivo, mínimos e máximos da atual política anual de investimentos.

FRONTEIRA EFICIENTE DE MARKOWITZ (Taxa Real PI = 5,46%)



CARTEIRAS DA FRONTEIRA EFICIENTE DE MARKOWITZ



N	Retorno a.a.	Risco a.a.	SELIC	IRF-M	IMA-B	S&P500	MSCI AC	IBOV	SMLL
14	4,38%	2,58%	25,07%	0,00%	54,93%	10,00%	10,00%	0,00%	0,00%
15	4,72%	2,74%	20,65%	0,00%	58,96%	10,00%	10,00%	0,00%	0,39%
16	5,05%	2,91%	16,32%	0,00%	62,86%	10,00%	10,00%	0,00%	0,82%
17	5,38%	3,08%	11,98%	0,00%	66,76%	10,00%	10,00%	0,00%	1,26%
18	5,71%	3,25%	7,65%	0,00%	70,66%	10,00%	10,00%	0,00%	1,69%
19	6,04%	3,42%	3,31%	0,00%	74,56%	10,00%	10,00%	0,00%	2,13%
20	6,37%	3,60%	0,00%	0,00%	76,86%	10,00%	10,00%	0,00%	3,14%
21	6,70%	3,79%	0,00%	0,00%	73,98%	10,00%	10,00%	0,00%	6,02%
22	7,04%	4,00%	0,00%	0,00%	71,10%	10,00%	10,00%	0,00%	8,90%
23	7,37%	4,24%	0,00%	0,00%	68,21%	10,00%	10,00%	0,00%	11,79%
24	7,70%	4,49%	0,00%	0,00%	65,33%	10,00%	10,00%	0,00%	14,67%
25	8,03%	4,75%	0,00%	0,00%	62,45%	10,00%	10,00%	0,00%	17,55%

CARAGUAPREV 30/09/2021: R\$ 535.646.813,44



ALOCÇÃO MARKOWITZ		
BENCHMARKS	% ALOCAÇÃO	R\$
SELIC/CDI	7,65%	40.955.960,51
IMA-B	70,66%	378.502.234,86
IBOVESPA	0,00%	-
SMLL	1,69%	9.059.255,38
S&P500	10,00%	53.564.681,34
MSCI AC	10,00%	53.564.681,34
TOTAL	100,00%	535.646.813,44

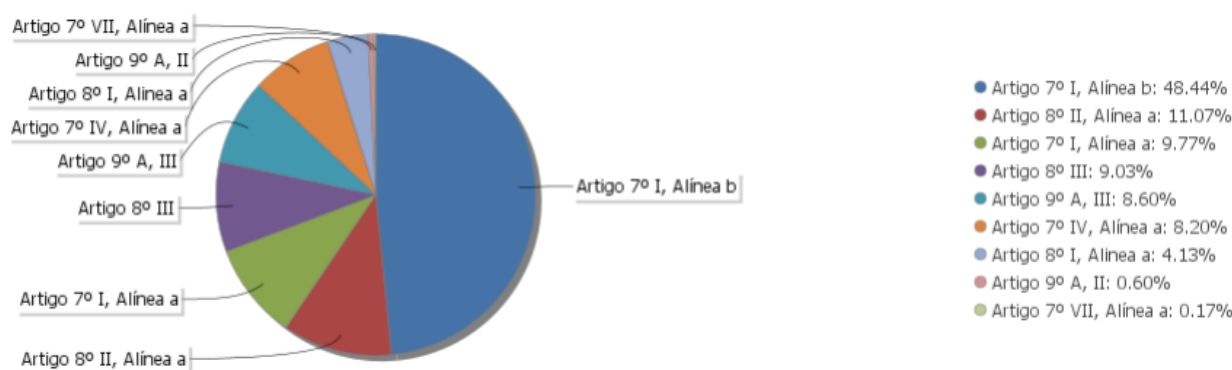
Registre-se que em novembro de 2021, em consonância ao estudo ALM, foram adequadas as aplicações em fundos de investimento S&P 500 e BDR I, conforme aprovação do Conselho Deliberativo na Ata n.º 294, em 17 de novembro de 2021. Com relação as demais indicações registre-se que em 2021 se iniciou o processo de redução a exposição em fundos atrelados a IRFM, IRFM-1 e IRFM-1+ e de diminuir a carteira de fundos de investimento em títulos públicos pós-fixados mais longos (IMA B 5+), passando para fundos compostos por títulos públicos pós-fixados mais curtos,

como o IMA B 5 (títulos públicos com até 5 anos de vencimento) e futura compra direta de Títulos Públicos Federais.

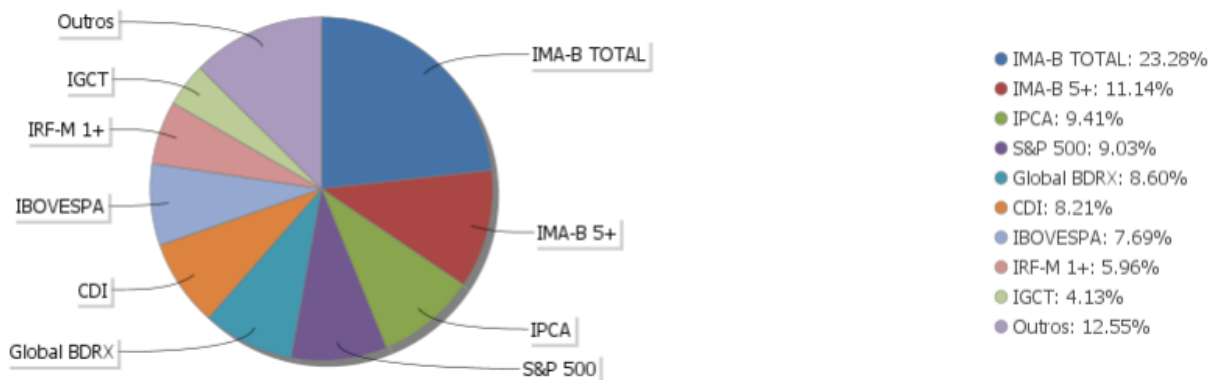
Registre-se que em dezembro de 2021, em consonância ao estudo ALM, conforme aprovação do Comitê de Investimentos na Ata n.º 127, de 23 de setembro de 2021 e do Conselho Deliberativo na Ata n.º 292, de 23 de setembro de 2021 e ratificada na Ata n.º 294, de 17/11/2021 a aplicação em Títulos do Tesouro Direto, de forma gradual, até a porcentagem máxima da atual Política de Investimentos do Instituto, que é de 10% (dez por cento), em 2021, que deverão ser contabilizados pelo valor da curva, saindo assim de um investimento com alta volatilidade para um com rentabilidade positiva fixa, desde que a taxa indicativa esteja equivalente a meta atuarial do Instituto, que é de 5,46%a.a.. Assim foi realizada a compra de 10.000 (dez mil títulos NTN-B), no dia 21 de dezembro de 2021, para o vencimento de 15/05/2023, a taxa de 5,90% e a compra de 4.000 (quatro mil títulos NTN-B), no dia 22 de dezembro de 2021, para o vencimento de 15/08/2022, a taxa de 6,09%, sendo essas taxas superiores a meta atuarial do Instituto.

Apesar de ter sido realizada algumas movimentação para adequar ao momento econômico do país, diante do cenário negativo do acumulado dos fundos de investimento da carteira do CaraguaPrev, não foi possível uma completa aderência aos indicadores, pois o registro contábil dos ganhos e perdas havidos com investimentos no mercado enquanto não houver o resgate, será registrado no plano patrimonial, como Variação Patrimonial, ativa e passiva, e, só quando houver o efetivo resgate da aplicação é que o registro será feito no plano orçamentário. Assim, conforme os atuais fundos de investimento forem performando positivamente, iniciaremos de forma gradual a adequação em consonância a ALM, evitando o registro contábil negativo.

4.2 Alocação por Artigo – Resolução CMN n.º 3.922/10.



4.2 Alocação por Estratégia



4.3 Conceitos de Classes de Ativos, conforme Resolução do Conselho Monetário Nacional n.º 3.922/2010 e alterações.

- 4.3.1 Artigo 7º I, Alínea b: Fundos de Investimento 100% Títulos Públicos: Cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa, conforme regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM), constituídos sob a forma de condomínio aberto, que apliquem seus recursos exclusivamente em títulos definidos na alínea "a", ou compromissadas lastreadas nesses títulos, e cuja política de investimento assuma o compromisso de buscar o retorno de índice de renda fixa não atrelado à taxa de juros de um dia, cuja carteira teórica seja composta exclusivamente por títulos públicos (fundos de renda fixa).
- 4.3.2 Fundos de Investimento de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a") cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa constituídos sob a forma de condomínio aberto, conforme regulamentação estabelecida pela CVM (fundos de renda fixa);
- 4.3.3 Artigo 7º VII, Alínea a - cotas de classe sênior de fundos de investimento em direitos creditórios (FDIC). O Fundo de Investimento em Direitos Creditórios - FIDC é um veículo de securitização de recebíveis e um tipo de fundo de investimento caracterizado pela aquisição de direitos creditórios. Ele é geralmente definido como uma "comunhão de recursos", por configurar-se juridicamente como um condomínio, no qual os investidores são detentores de cotas.
- 4.3.4 Artigo 8º I, Alínea a - cotas de fundos de investimento classificados como ações, constituídos sob a forma de condomínio aberto cuja política de investimento assegure que o seu patrimônio líquido esteja investido em ativos que acompanham índices de renda variável, divulgados por bolsa de valores no Brasil, compostos por, no mínimo, cinquenta ações, correspondentes bônus ou recibos de subscrição e de

certificados de depósitos de tais ações, conforme regulamentação estabelecida pela CVM (fundos de renda variável).

- 4.3.5 Artigo 8º II, Alínea a, cotas de fundos de investimento classificados como ações, constituídos sob a forma de condomínio aberto, conforme regulamentação estabelecida pela CVM (fundos de renda variável).
- 4.3.6 Artigo 8º III, até 10% (dez por cento) em cotas de Fundos de Investimento classificados como multimercado, constituídos sob a forma de condomínio aberto, cujos regulamentos determinem tratar-se de fundos sem alavancagem (fundos de renda variável). Os multimercados podem aplicar em diferentes mercados (renda fixa, câmbio e, ações, entre outros), além de usar derivativos para proteção da carteira. Eles preveem uma maior liberdade de gestão e buscam oferecer aos investidores um rendimento mais alto que em aplicações conservadoras.
- 4.3.7 Artigo 9º A, III, No segmento de investimentos no exterior, as aplicações dos recursos dos regimes próprios de previdência social subordinam-se ao limite de até 10% (dez por cento) no conjunto de: III - cotas dos fundos da classe “Ações – BDR Nível I”, nos termos da regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários. Fundos de Investimento no Exterior são fundos de investimento que possuem uma carteira com ativos financeiros internacionais. Ou seja, são fundos negociados no mercado local que investem em ações, títulos e demais ativos localizados em mercados estrangeiros. Por força da Resolução CMN nº 3.922/2010, nessa classe também estão contidos os fundos de investimentos BDRs.

5. RENTABILIDADE DO PLANO PREVIDENCIÁRIO

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,94	-1,45	0,38	1,02	1,49	0,37	-0,80	-0,98	-1,64	-1,55	1,37	1,32	-1,47
IPCA + 5,46%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,05
p.p. indexador	-1,61	-2,69	-1,04	0,29	0,21	-0,60	-2,23	-2,32	-3,25	-3,23	-0,00	0,10	-17,51
2020	0,26	-1,20	-8,82	2,26	2,04	2,60	3,94	-1,32	-1,68	-0,06	3,29	4,43	5,12
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,45	-1,86	-9,40	2,11	1,97	1,86	3,06	-2,04	-2,80	-1,40	1,94	2,58	-5,52
2019	1,51	0,37	0,41	0,94	1,99	2,58	1,16	0,11	1,85	2,11	-0,78	2,17	15,34
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	0,68	-0,53	-0,78	-0,12	1,35	2,13	0,44	-0,51	1,40	1,47	-1,75	0,52	4,75

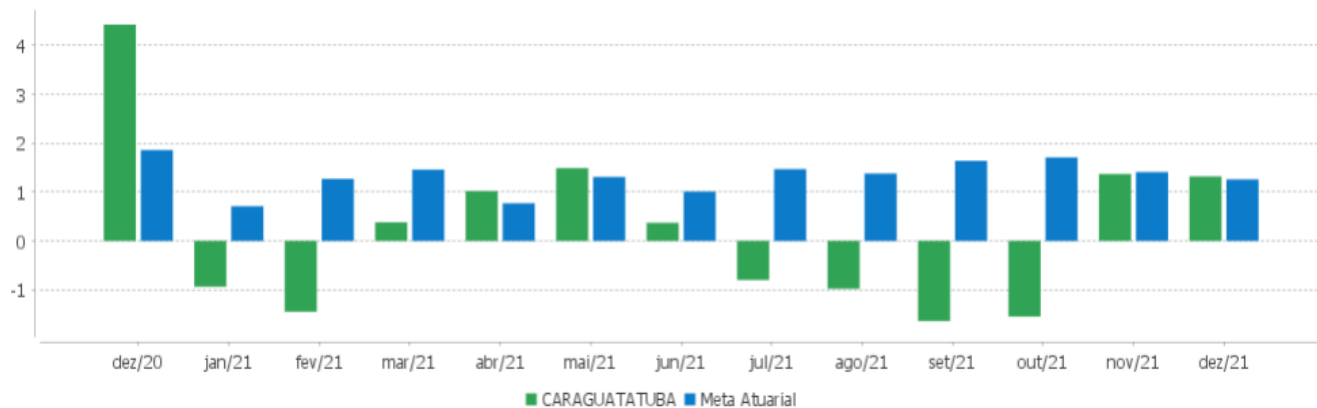
Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	16	44,44
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	55,56
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,43	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-8,82	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,12	4,34	-3,22	6,28
06 meses	-2,30	8,97	-11,27	6,17
12 meses	-1,47	16,05	-17,51	5,82
24 meses	3,58	28,40	-24,82	10,09
36 meses	19,47	42,00	-22,53	8,45
Desde 31/12/2018	19,47	42,00	-22,53	8,45

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



No trimestre a carteira de investimentos do plano previdenciário obteve rentabilidade de -1,12%. A linha intitulada “Meta Atuarial” informa a meta de rendimento positivo estabelecido para o plano previdenciário a partir da avaliação técnica atuarial anual, que hoje é de IPCA + 5,46%.

6. RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS

6.1 RENDA FIXA

RENTA FIXA 66,58%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,900000%)	4,14	0,39	0,39	38.112.344,74	6,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (6,090000%)	4,17	0,34	0,34	15.431.109,58	2,82
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,11	0,39	0,39	53.543.454,32	9,77

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	3,52	1,88	0,93	16.124.140,18	2,94	4.897.855.877,38	0,33
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,64	0,84	1,08	359.354,25	0,07	142.521.365,80	0,25
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,75	0,21	1,01	11.702.304,81	2,13	393.080.062,36	2,98
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,64	0,84	1,10	10.992.934,25	2,01	6.208.104.156,65	0,18
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,79	0,20	0,97	16.366.053,99	2,99	7.081.253.604,41	0,23
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,76	0,21	1,00	45.534.437,80	8,31	4.689.992.155,11	0,97
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	9,05	-0,33	0,01	21.782.065,96	3,97	1.022.290.416,95	2,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,77	0,77	1,98	4.529.481,21	0,83	1.144.893.205,94	0,40
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	9,05	-0,36	0,03	4.200.131,05	0,77	246.014.699,70	1,71
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,99	-0,34	-0,14	35.062.910,60	6,40	1.353.637.713,77	2,59
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,10	2,27	0,86	32.675.659,51	5,96	1.203.780.064,86	2,71
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	0,72	1,82	11.738.583,84	2,14	10.998.710.156,34	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,52	1,87	0,97	4.889.433,76	0,89	1.233.687.856,77	0,40
BB	BB	BB PREV RF VII	1,63	0,58	1,82	478.291,11	0,09	248.037.532,98	0,19
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	0,83	1,07	49.134.040,19	8,96	12.561.638.596,69	0,39
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,99	0,64	0,80	265.569.822,51	48,45		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,17	0,80	2,02	3.494.021,36	0,64	1.663.005.755,26	0,21
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,30	0,08	0,37	25.719.964,84	4,69	625.914.328,31	4,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,20	0,75	1,89	13.287.330,18	2,42	8.765.736.063,59	0,15
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	1,10	0,86	2,16	2.449.310,46	0,45	2.626.754.965,66	0,09
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,98	0,43	1,31	44.950.626,84	8,20		

Artigo 7º VII, Alínea a (Cota Sênior de FIDC)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	11,37	0,47	0,83	930.827,37	0,17	40.395.435,01	2,30
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a			11,37	0,47	0,83	930.827,37	0,17		
Renda Fixa			4,46	0,64	1,00	364.994.731,04	66,58		

Os investimentos em Renda Fixa que compõem a carteira do CaraguaPrev são compostos por Títulos Públicos Federais – art. 7º, I, alínea “a”, FUNDOS 100% TITULOS PUBLICOS - ART. 7º, I, alínea “b”, FUNDOS DE RENDA FIXA – ART. 7º, IV, alínea “a” e Cota Sênior de FIDC, ART. 7º, VII, alínea “a”, representam 66,58% da Carteira de Investimentos. (Resolução CMN n.º 3.922/10 e alterações)

No trimestre avaliado a rentabilidade dos fundos de Investimento em Renda Fixa foi de 1,00%, enquanto que no ano a performance desses fundos é de -1,41%.

6.2 FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL.

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,64	3,44	-6,39	22.617.348,87	4,13	994.621.415,62	2,27
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			20,64	3,44	-6,39	22.617.348,87	4,13		

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRDESCO F I A SELECTION	21,47	2,00	-8,61	4.950.175,70	0,90	535.410.218,31	0,92
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	19,41	1,63	-5,04	1.351.577,93	0,25	681.956.137,29	0,20
BRAM	BEM	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	22,59	3,89	-12,01	6.062.240,71	1,11	1.419.483.989,90	0,43
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,34	1,88	-8,98	13.982.271,75	2,55	723.867.535,77	1,93
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR RPPS	20,64	0,06	-6,16	6.763.424,74	1,23	668.180.768,94	1,01
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,72	-0,32	-3,49	12.425.705,45	2,27	924.501.793,20	1,34
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,92	0,97	-7,99	5.787.099,75	1,06	2.631.453.374,95	0,22
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	27,04	-1,60	-15,03	9.335.972,60	1,70	297.006.334,02	3,14
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,74	0,78	-8,92	60.658.468,63	11,07		

Os Fundos de renda variável que compõem a carteira do CaraguaPrev são compostos por FUNDOS DE AÇÕES REFERENCIADOS - ART. 8º, I, alínea “a” e FUNDOS DE AÇÕES – ART. 8º, II, alínea “a”, representam 15,20% da Carteira de Investimentos. (Resolução CMN n.º 3.922/10 e alterações).

No trimestre avaliado a rentabilidade do FUNDO DE AÇÕES REFERENCIADO foi de -6,39%, enquanto que no ano sua performance é de -11,53%. Com relação a rentabilidade do mês dos FUNDOS DE AÇÕES foi de -8,92% e no ano de 2021 de -15,39%.

6.3 FUNDOS ESTRUTURADOS

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilib. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	13,41	5,54	13,02	49.476.009,96	9,03	2.374.573.482,34	2,08
Sub-total Artigo 8º III			13,41	5,54	13,02	49.476.009,96	9,03		

O Fundo Multimercado - ART. 8º, III, que compõem a carteira do CaraguaPrev representa 9,03% da Carteira de Investimentos. (Resolução CMN n.º 3.922/10 e alterações)

No trimestre avaliado a rentabilidade do FUNDO MULTIMERCADO foi de 13,02%, enquanto que no ano sua performance é de 32,74%.

6.4 FUNDOS DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,20%

Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilib. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,28	0,89	6,63	1.599.430,07	0,29	2.180.881.081,62	0,07
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	14,05	5,61	11,28	1.669.255,25	0,30	900.729.355,99	0,19
Sub-total Artigo 9º A, II			13,60	3,24	8,96	3.268.685,32	0,60		

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilib. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,57	1,70	11,81	47.153.904,89	8,60	3.890.658.229,39	1,21
Sub-total Artigo 9º A, III			17,57	1,70	11,81	47.153.904,89	8,60		
Investimentos no Exterior			17,45	1,80	11,60	50.422.590,21	9,20		

Os Fundos de Investimento no Exterior - ART. 9º, A, II, que compõem a carteira do CaraguaPrev representam 0,60% da Carteira de Investimentos. *(Resolução CMN n.º 3.922/10 e alterações)*.

O Fundo de Investimento no Exterior - ART. 9º, A, III, que compõem a carteira do CaraguaPrev representa 8,60% da Carteira de Investimentos. *(Resolução CMN n.º 3.922/10 e alterações)*

No trimestre avaliado a rentabilidade do fundo de Investimento no Exterior foi de 11,60%, enquanto que no ano sua performance é de 30,26%.

7. PERSPECTIVAS

Renda Fixa: O cenário segue desafiador com os investidores monitorando (i) inflação nos EUA e no Brasil; (ii) andamento do tapering nos EUA e debates quanto ao início da alta de juros e da redução do balanço do FED; (iii) andamento do processo de vacinação e das novas variantes do COVID-19 pelo globo, em especial frente à variante Ômicron; (iv) ambiente político e seus impactos na política fiscal do país; (v) desdobramentos da implementação da política chinesa definida para o ano, visando estabilização do crescimento; (vi) gargalos de oferta nas cadeias de suprimentos globais. Nossa visão prospectiva continua de baixa alocação em risco de mercado, haja vista a baixa visibilidade e alta volatilidade esperada para 2022 com a eleição, assim como o processo de normalização acelerado nos EUA.

Renda Variável: Em que pese uma expectativa de volatilidade no mercado de ações em 2022, vemos uma assimetria favorável à alocação em bolsa, dado seu nível de preço vs os resultados das empresas. Mesmo em um ano de eleições, acreditamos que em um cenário no qual os principais candidatos já são conhecidos, os pontos de preocupação parecem já estar no preço, o que abre espaço para surpresas positivas, ainda que em se tratando de Brasil momentos de ruídos políticos possam sempre existir. Cabe destacar que o mercado de renda variável caminha à frente da economia real, o que significa que caso haja diminuição na percepção de riscos, a tendência é que haja uma alta na bolsa bem antes de isso se materializar na economia real.

Renda Variável Exterior: Em dezembro, a pandemia voltou ao centro das atenções com a rápida disseminação da variante Ômicron pelo globo ao longo do mês. Em especial na Europa, essa

variante pegou o continente em um momento em que o continente já adotava medidas de distanciamento social devido a um maior número de infecções. Consequentemente, as medidas foram intensificadas, com inclusive a imposição de nova rodada de lockdowns em determinados países e regiões, enquanto nos EUA, o recrudescimento da situação sanitária foi sentido mais nas últimas semanas do mês. Não obstante, o desempenho dos ativos foi de recuperação das perdas provocadas pela descoberta da nova cepa no final de novembro, na medida em que investidores ponderavam a menor letalidade da Omicron em contraste à maior taxa de infecção.

Quanto à decisão de outros BCs, na zona do euro, a presidente do BCE, Christine Lagarde, afirmou que a instituição planeja reduzir as compras mensalmente até eventualmente encerrar o programa emergencial de compras de título da pandemia (PEPP) em março de 2022, mas irá continuar realizando compras durante os três primeiros trimestres do ano através do seu programa de compras tradicional (APP) de forma a suavizar a transição para os mercados. Enquanto isso, no Reino Unido, o BoE foi o único BC que de fato surpreendeu, ao elevar os juros de 0,15% para 0,25% em votação quase unânime, mesmo com os riscos de impacto negativo da Ômicron sobre a economia. Finalmente, a única autoridade monetária com postura mais dovish entrando em 2022 é o Banco Central chinês (PBoC), que anunciava medidas de apoio à economia, frente aos riscos de desaceleração da atividade econômica no país.

Quanto ao fiscal, em janeiro o mercado deve continuar com as negociações em torno do pacote de investimentos sociais trilionário (Build Back Better) do governo norte-americano com membros do Senado, após um membro da base aliada de Biden se declarar contra o projeto, que deverá ter votação apertada (os senadores estão divididos entre 50 democratas e 50 republicanos). Outro risco relacionado à economia americana será a persistência da inflação, que se não mostrar sinais mais fortes de desaceleração nos próximos resultados pode sustentar expectativas de mais uma aceleração do tapering.

8. GERENCIAMENTO DE RISCOS - INDICADORES DE DESEMPENHO E RISCO

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$):

14.864.721,04

Value-At-Risk:

2,71%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	3,10	1,98	0,88	-0,06	0,57	364.994.731,04	66,58
Artigo 8º	17,80	8,00	1,75	0,13	3,01	132.751.827,46	24,22
Artigo 9º	18,56	7,99	0,09	0,06	1,80	50.422.590,21	9,20
CARAGUATATUBA	5,60	2,71	2,71	0,10	1,32	548.169.148,71	100,00

Conforme demonstrado acima representa a volatilidade da carteira para uma média móvel dos últimos 21 dias.

8.1 Índice de Sharpe

O Índice de Sharpe é um indicador que leva em consideração a relação entre duas variáveis de grande importância nos investimentos: Risco e Retorno. Esse índice mostra a eficiência do gestor de um fundo de investimento, por exemplo, ao apresentar o quanto de risco a mais ele precisa se expor para obter mais rendimento. Ao ser necessário assumir mais risco para alcançar um mesmo rendimento de um investimento menos arriscado, admite-se que a eficiência nesse caso está comprometida.

8.2 VaR

O VaR, ou Value at Risk, é um indicador de risco que estima a perda potencial máxima de um investimento para um período de tempo, com um determinado intervalo de confiança. Ou seja, através de um cálculo estatístico, o VaR mostra a exposição ao risco financeiro que um ou mais ativos possuem em determinado dia, semana ou mês.

8.3 Volatilidade

A volatilidade é uma medida estática que mede o risco de um ativo, de acordo com a intensidade e frequência de sua oscilação de preço em um determinado período. Por meio dela, é possível entender o histórico de um ativo, qual a probabilidade de ele subir ou cair, de acordo com o período

preestabelecido, e qual será a estimativa de oscilação do seu preço no futuro. Se o preço de um ativo for muito volátil, por exemplo, é sinal de que sua cotação, em relação às flutuações do mercado, oscila muito, tornando sua compra arriscada, mas, por outro lado, proporciona maior possibilidade de lucro no curtíssimo prazo.

9. TABELA DE LIQUIDEZ

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	468.240.345,97	85,42	468.240.345,97	85,42
de 31 a 365 dias	41.816.458,00	7,63	510.056.803,97	93,05
acima de 365 dias	38.112.344,74	6,95	548.169.148,71	100,00

Liquidez, em contabilidade, corresponde à velocidade e facilidade com a qual um ativo pode ser convertido em caixa. Por exemplo: ouro é um ativo relativamente líquido, pois pode ser rapidamente vendido; uma instalação fabril não o é. Na realidade, a liquidez possui duas dimensões: facilidade de conversão versus perda de valor. Qualquer ativo pode ser convertido em caixa rapidamente, desde que se reduza suficientemente o preço.

A tabela de liquidez mostra a relação entre o percentual da carteira e o seu respectivo nível de liquidez. Neste caso, 85,42% da carteira de investimentos do CaraguaPrev possui liquidez de até 30 dias, ou seja, a maior parte dos ativos financeiros podem ser resgatados e monetizados dentro desse período de tempo.

10. MOVIMENTAÇÕES DO TRIMESTRE

N.º	Data	Origem	Destino	Valor	Motivo
167	01/10/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - RESTITUIÇÃO CORRESPONDENTE A BENEFÍCIO PREVIDENCIÁRIO DE PENSIONISTA DO CARAGUAPREV	Fundo Itaú Institucional Renda Fixa IRF-M1 – CNPJ 08.703.063/0001-16	R\$ 400,00	APLICAÇÃO
168	07/10/2021	Banco do Brasil, ag. 1741-8, conta corrente 37299-4 - REPASSE DO APOORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DO CARAGUAPREV REFERENTE AO MÊS DE OUTUBRO DE 2021	Fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP- CNPJ n.º 11.328.882/0001-35	R\$ 2.207,61	APLICAÇÃO

169	07/10/2021	Caixa Econômica Federal, agência 0797, conta corrente 9999-0 - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - CNPJ 03.737.206/0001-97	PAGAMENTO DE DESPESAS ADMINISTRATIVAS	R\$ 47.000,00	RESGATE
170	08/10/2021	Banco do Brasil, ag. 1741-8, conta corrente 9999-6 - REPASSE DAS COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS – COMPREV, REFERENTE AO MÊS DE AGOSTO DE 2021	fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP - CNPJ n.º 11.328.882/0001-35	R\$ 163.293,06	APLICAÇÃO
171	08/10/2021	Banco Itaú, Agência 0248 da conta corrente n.º 04042-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA PREFEITURA MUNICIPAL REFERENTE AO MÊS DE SETEMBRO DE 2021	Fundo Itaú Institucional Renda Fixa IRF-M1 – CNPJ 08.703.063/0001-16	R\$ 292.829,51	APLICAÇÃO
172	11/10/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI – CNPJ 16.718.302/0001-30 - RESGATE TOTAL PARA CISÃO DO FUNDO ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FICFI	Banco Itaú, Agência 0248 da conta corrente n.º 04042-0 - CISÃO DO FUNDO ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FICFI e entrada para o FUNDO ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC FI – CNPJ 42.318.981/0001-60	R\$ 10.986.961,31	RESGATE
173	11/10/2021	Banco Itaú, Agência 0248 da conta corrente n.º 04042-0 - CISÃO DO FUNDO ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FICFI CNPJ - 16.718.302/0001-30	FUNDO ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC FI – CNPJ 42.318.981/0001-60	R\$ 10.986.961,31	APLICAÇÃO
174	13/10/2021	Banco do Brasil, ag. 1741-8, conta corrente 37299-4 - REPASSE DO APORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DA FUNDACC REFERENTE AO MÊS DE OUTUBRO DE 2021	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP- CNPJ n.º 11.328.882/0001-35	R\$ 2.314,51	APLICAÇÃO
175	13/10/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA B - CNPJ 10.474.513/0001-98	BANCO ITAÚ S.A, AGÊNCIA 0248-0, C/C 04042-0 - PARA APLICAÇÃO NO FUNDO DE INVESTIMENTO ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO S&P500 BRL FIC FI - CNPJ 26.269.692/0001-61	R\$ 5.000.000,00	RESGATE
176	14/10/2021	BANCO ITAÚ S.A, AGÊNCIA 0248-0, C/C 04042-0 - RESGATE FUNDO DE INVESTIMENTO ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA B - CNPJ 10.474.513/0001-98	APLICAÇÃO NO FUNDO DE INVESTIMENTO ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO S&P500 BRL FIC FI - CNPJ 26.269.692/0001-61	R\$ 5.000.000,00	APLICAÇÃO
177	14/10/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA FUNDACC – REFERENTE AO MÊS DE SETEMBRO DO ANO DE 2021	FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI CNPJ n.º 00.832.435/0001-00	R\$ 24.084,20	APLICAÇÃO

178	20/10/2021	Banco do Brasil, ag. 1741-8, conta corrente 37299-4, - REPASSE DO APORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DA CÂMARA MUNICIPAL REFERENTE AO MÊS DE OUTUBRO DE 2021.	fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP- CNPJ n.º 11.328.882/0001-35	R\$ 12.309,62	APLICAÇÃO
179	20/10/2021	Banco do Brasil, ag. 1741-8, conta corrente 37299-4 - REPASSE DO APORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DA PREFEITURA MUNICIPAL REF. AO MÊS DE OUTUBRO DE 2021	fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP- CNPJ n.º 11.328.882/0001-35	R\$ 316.501,58	APLICAÇÃO
180	20/10/2021	Banco Itaú, Agência 0248 da conta corrente n.º 04042-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA PREFEITURA MUNICIPAL REF. AO MÊS DE SETEMBRO DE 2021	Fundo Itaú Institucional Renda Fixa IRF-M1 – CNPJ 08.703.063/0001-16	R\$ 3.679.546,00	APLICAÇÃO
181	25/10/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA CÂMARA – REFERENTE AO MÊS DE OUTUBRO DO ANO DE 2021	FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI CNPJ n.º 00.832.435/0001-00	R\$ 112.571,49	APLICAÇÃO
182	27/10/2021	Caixa Econômica Federal, agência 0797, conta corrente 9999-0 - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - CNPJ 03.737.206/0001-97	PAGAMENTO DE DESPESAS ADMINISTRATIVAS	R\$ 144.111,54	APLICAÇÃO
183	27/10/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M1 - CNPJ n.º 08.703.063/0001-16	PAGAMENTO DE DESPESAS PREVIDENCIÁRIAS	R\$ 2.649.150,74	RESGATE
184	27/10/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DO CARAGUAPREV PATRONAL REFERENTE AO MÊS DE OUTUBRO DO ANO DE 2021	FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI CNPJ n.º 00.832.435/0001-00	R\$ 13.737,00	APLICAÇÃO
185	28/10/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - RESTITUIÇÃO CORRESPONDENTE A BENEFÍCIO PREVIDENCIÁRIO DE APOSENTADA DO CARAGUAPREV	FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI CNPJ n.º 00.832.435/0001-00	R\$ 800,00	APLICAÇÃO
186	28/10/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA PREFEITURA MUNICIPAL E CÂMARA MUNICIPAL – APOSENTADOS E PENSIONISTAS REFERENTE AO MÊS DE OUTUBRO DE 2021	FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI CNPJ n.º 00.832.435/0001-00	R\$ 2.404,36	APLICAÇÃO
187	04/11/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M1 - CNPJ n.º 08.703.063/0001-16	PAGAMENTO DE DESPESAS PREVIDENCIÁRIAS	R\$ 8.935,09	RESGATE

188	05/11/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M1 - CNPJ n.º 08.703.063/0001-16	PAGAMENTO DE DESPESAS PREVIDENCIÁRIAS	R\$ 1.207,53	RESGATE
189	09/11/2021	Banco do Brasil, ag. 1741-8, conta corrente 9999-6 - REPASSE DAS COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS – COMPREV, REFERENTE AO MÊS DE SETEMBRO DE 2021	fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP - CNPJ n.º 11.328.882/0001-35	R\$ 218.124,83	APLICAÇÃO
190	10/11/2021	Banco do Brasil, ag. 1741-8, conta corrente 37299-4 - REPASSE DO APORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DO CARAGUAPREV REFERENTE AO MÊS DE NOVEMBRO DE 2021	Fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP- CNPJ n.º 11.328.882/0001-35	R\$ 2.207,61	APLICAÇÃO
191	10/11/2021	Banco do Brasil, ag. 1741-8, conta corrente 37299-4 - REPASSE DO APORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DA FUNDACC REFERENTE AO MÊS DE NOVEMBRO DE 2021	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP- CNPJ n.º 11.328.882/0001-35	R\$ 2.314,51	APLICAÇÃO
192	10/11/2021	Caixa Econômica Federal, agência 0797, conta corrente 9999-0 - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - CNPJ 03.737.206/0001-97	PAGAMENTO DE DESPESAS ADMINISTRATIVAS	R\$ 57.000,00	RESGATE
193	18/11/2021	Resgate no Fundo de investimento ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA – CNPJ 21.838.150/0001-49, para aplicação no FUNDO DE INVESTIMENTO ITAÚ PRIVATE MULTIM S&P 500 - CNPJ 26.269.692/0001-61 E FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I - CNPJ 17.502.937/0001-68	Banco Itaú, Agência 0248 da conta corrente n.º 04042-0 - Resgate fundo Itaú Alocação Dinâmica CNPJ 21.838.150/0001-49, para aplicação no FUNDO DE INVESTIMENTO ITAÚ PRIVATE MULTIM S&P 500 - CNPJ 26.269.692/0001-61 E FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I - CNPJ 17.502.937/0001-68	R\$ 10.000.000,00	RESGATE
194	19/11/2021	Banco do Brasil, ag. 1741-8, conta corrente 37299-4 - REPASSE DO APORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DA PREFEITURA MUNICIPAL REFERENTE AO MÊS DE NOVEMBRO DE 2021	fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP- CNPJ n.º 11.328.882/0001-35	R\$ 316.501,58	APLICAÇÃO
195	19/11/2021	Banco Itaú, Agência 0248 da conta corrente n.º 04042-0 - Resgate no Fundo de investimento ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA – CNPJ 21.838.150/0001-49, para aplicação no FUNDO DE INVESTIMENTO ITAÚ PRIVATE MULTIM S&P 500 - CNPJ 26.269.692/0001-61	FUNDO DE INVESTIMENTO ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO S&P500 BRL FIC FI - CNPJ 26.269.692/0001-61	R\$ 5.000.000,00	APLICAÇÃO

196	19/11/2021	Caixa Econômica Federal, Agência 0797, Conta Corrente 1000-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA PREFEITURA MUNICIPAL REFERENTE AO MÊS DE OUTUBRO DE 2021	Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP- CNPJ 03.737.206/0001-97	R\$ 3.689.825,18	APLICAÇÃO
197	22/11/2021	Banco do Brasil, ag. 1741-8, conta corrente 37299-4. - REPASSE DO APORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DA CÂMARA MUNICIPAL REFERENTE AO MÊS DE NOVEMBRO DE 2021.	fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP- CNPJ n.º 11.328.882/0001-35	R\$ 12.309,62	APLICAÇÃO
198	22/11/2021	Caixa Econômica Federal, Agência 0797, Conta Corrente 1000-0 - Resgate no Fundo de investimento ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA – CNPJ 21.838.150/0001-49 para aplicação no FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I - CNPJ 17.502.937/0001-68	FUNDO DE INVESTIMENTO FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I – CNPJ 17.502.937/0001-68	R\$ 5.000.000,00	APLICAÇÃO
199	22/11/2021	Caixa Econômica Federal, Agência 0797, Conta Corrente 1000-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA PREFEITURA MUNICIPAL REFERENTE AO MÊS DE OUTUBRO DE 2021	Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP- CNPJ 03.737.206/0001-97	R\$ 293.664,59	APLICAÇÃO
200	23/11/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA FUNDACC – REFERENTE AO MÊS DE OUTUBRO DO ANO DE 2021	FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI CNPJ n.º 00.832.435/0001-00	R\$ 23.641,67	APLICAÇÃO
201	29/11/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M1 - CNPJ n.º 08.703.063/0001-16	PAGAMENTO DE DESPESAS PREVIDENCIÁRIAS	R\$ 2.687.710,10	RESGATE
202	29/11/2021	Caixa Econômica Federal, Agência 0797, Conta Corrente 1000-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA CÂMARA – REFERENTE AO MÊS DE NOVEMBRO DO ANO DE 2021	Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP- CNPJ 03.737.206/0001-97	R\$ 106.355,62	APLICAÇÃO
203	29/11/2021	Caixa Econômica Federal, Agência 0797, Conta Corrente 1000-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DO CARAGUAPREV PATRONAL REFERENTE AO MÊS DE NOVEMBRO DO ANO DE 2021	Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP- CNPJ 03.737.206/0001-97	R\$ 13.737,00	APLICAÇÃO
204	29/11/2021	Caixa Econômica Federal, agência 0797, conta corrente 9999-0 - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - CNPJ 03.737.206/0001-97	PAGAMENTO DE DESPESAS ADMINISTRATIVAS	R\$ 150.449,86	APLICAÇÃO

205	30/11/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA PREFEITURA MUNICIPAL E CÂMARA MUNICIPAL – APOSENTADOS E PENSIONISTAS REFERENTE AO MÊS DE NOVEMBRO DE 2021	FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI CNPJ n.º 00.832.435/0001-00	R\$ 2.404,36	APLICAÇÃO
206	30/11/2021	Caixa Econômica Federal, Agência 0797, Conta Corrente 1000-0 - RESTITUIÇÃO CORRESPONDENTE A BENEFÍCIO PREVIDENCIÁRIO DE APOSENTADA DO CARAGUAPREV	Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP- CNPJ 03.737.206/0001-97	R\$ 270,00	APLICAÇÃO
207	30/11/2021	Caixa Econômica Federal, Agência 0797, Conta Corrente 1000-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DO CARAGUAPREV PATRONAL REFERENTE AO MÊS DE NOVEMBRO DO ANO DE 2021	Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP- CNPJ 03.737.206/0001-97	R\$ 10.684,33	APLICAÇÃO
208	30/11/2021	Caixa Econômica Federal, agência 0797, conta corrente 9999-0 - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - CNPJ 03.737.206/0001-97	PAGAMENTO DE DESPESAS ADMINISTRATIVAS	R\$ 10.684,33	APLICAÇÃO
209	07/12/2021	Banco do Brasil, ag. 1741-8, conta corrente 9999-6 - REPASSE DAS COMPENSAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS – COMPREV, REFERENTE AO MÊS DE OUTUBRO E 13º SALÁRIO DO ANO DE 2021	fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP - CNPJ n.º 11.328.882/0001-35	R\$ 439.411,37	APLICAÇÃO
210	07/12/2021	Banco do Brasil, ag. 1741-8, conta corrente 37299-4 - REPASSE DO APOORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DA FUNDACC REFERENTE AO MÊS DE DEZEMBRO DE 2021	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP- CNPJ n.º 11.328.882/0001-35	R\$ 2.314,51	APLICAÇÃO
211	07/12/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - RESTITUIÇÃO CORRESPONDENTE A BENEFÍCIO PREVIDENCIÁRIO DE PENSIONISTA DO CARAGUAPREV	Fundo Itaú Institucional Renda Fixa IRF-M1 – CNPJ 08.703.063/0001-16	R\$ 400,00	APLICAÇÃO
212	08/12/2021	Caixa Econômica Federal, agência 0797, conta corrente 9999-0 - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - CNPJ 03.737.206/0001-97	PAGAMENTO DE DESPESAS ADMINISTRATIVAS	R\$ 186.000,00	APLICAÇÃO
213	10/12/2021	Banco do Brasil, ag. 1741-8, conta corrente 37299-4 - REPASSE DO APOORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DO CARAGUAPREV REFERENTE AO MÊS DE DEZEMBRO DE 2021	Fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP- CNPJ n.º 11.328.882/0001-35	R\$ 2.207,61	APLICAÇÃO
214	10/12/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA FUNDACC – REFERENTE AO MÊS DE NOVEMBRO DO ANO DE 2021	Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP- CNPJ 03.737.206/0001-97	R\$ 23.641,67	APLICAÇÃO

215	14/12/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M1 - CNPJ n.º 08.703.063/0001-16	PAGAMENTO DE DESPESAS PREVIDENCIÁRIAS	R\$ 2.533.499,34	RESGATE
216	14/12/2021	Caixa Econômica Federal, Agência 0797, Conta Corrente 1000-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA PREFEITURA MUNICIPAL REFERENTE AO MÊS DE NOVEMBRO DE 2021	Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP- CNPJ 03.737.206/0001-97	R\$ 294.357,88	APLICAÇÃO
217	14/12/2021	Caixa Econômica Federal, Agência 0797, Conta Corrente 1000-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DO CARAGUAPREV PATRONAL REFERENTE AO 13º SALÁRIO DO ANO DE 2021	Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP- CNPJ 03.737.206/0001-97	R\$ 24.421,33	APLICAÇÃO
218	14/12/2021	Caixa Econômica Federal, agência 0797, conta corrente 9999-0 - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - CNPJ 03.737.206/0001-97	PAGAMENTO DE DESPESAS ADMINISTRATIVAS	R\$ 86.000,00	RESGATE
219	15/12/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA PREFEITURA MUNICIPAL E CÂMARA MUNICIPAL – APOSENTADOS E PENSIONISTAS REFERENTE AO 13º SALÁRIO DE 2021	FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI CNPJ n.º 00.832.435/0001-00	R\$ 2.404,36	APLICAÇÃO
220	16/12/2021	Caixa Econômica Federal, Agência 0797, Conta Corrente 1000-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA CÂMARA – REFERENTE AO 13º SALÁRIO DO ANO DE 2021	Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP- CNPJ 03.737.206/0001-97	R\$ 107.684,65	APLICAÇÃO
221	17/12/2021	Banco do Brasil, ag. 1741-8, conta corrente 37299-4, - REPASSE DO APOORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DA CÂMARA MUNICIPAL REFERENTE AO MÊS DE DEZEMBRO DE 2021.	fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP- CNPJ n.º 11.328.882/0001-35	R\$ 12.309,70	APLICAÇÃO
222	17/12/2021	Banco do Brasil, ag. 1741-8, conta corrente 37299-4 - REPASSE DO APOORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DA PREFEITURA MUNICIPAL REFERENTE AO MÊS DE DEZEMBRO DE 2021	fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP- CNPJ n.º 11.328.882/0001-35	R\$ 316.501,58	APLICAÇÃO
223	17/12/2021	Caixa Econômica Federal, Agência 0797, Conta Corrente 1000-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA PREFEITURA MUNICIPAL REFERENTE AO MÊS DE NOVEMBRO DE 2021	Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP- CNPJ 03.737.206/0001-97	R\$ 3.675.758,60	APLICAÇÃO

224	20/12/2021	Fundo de Investimento Itaú Institucional Alocação Dinâmica CNPJ 21.838.150/0001-49 - para RESGATE PARA COMPRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 760199 COM VENCIMENTO EM 15/05/2023	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - COMPRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 760199 COM VENCIMENTO EM 15/05/2023	R\$ 37.965.926,42	RESGATE
225	20/12/2021	Caixa Econômica Federal, Agência 0797, Conta Corrente 1000-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA PREFEITURA MUNICIPAL REFERENTE AO 13º SALÁRIO DO ANO DE 2021	Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP- CNPJ 03.737.206/0001-97	R\$ 3.908.317,80	APLICAÇÃO
226	20/12/2021	Caixa Econômica Federal, agência 0797, conta corrente 9999-0 - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - CNPJ 03.737.206/0001-97	PAGAMENTO DE DESPESAS ADMINISTRATIVAS	R\$ 86.000,00	RESGATE
227	21/12/2021	Fundo de investimento Itaú RENDA FIXA IMA-B ATIVO FIC FI – CNPJ 05.073656/0001-58 - Para RESGATE PARA COMPRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 760199 COM VENCIMENTO EM 15/08/2022	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - COMPRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 760199 COM VENCIMENTO EM 15/08/2022	R\$ 15.379.158,21	RESGATE
228	21/12/2021	XP Investimentos, Agência 0001, Conta Corrente 804158-0 - COMPRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 760199 COM VENCIMENTO EM 15/05/2023	10.000 (dez mil) Títulos Públicos Federais NTN-B – 760199, vencimento 15/05/2023	R\$ 37.965.926,42	APLICAÇÃO
229	22/12/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - AMORTIZAÇÃO FIDC MULTISSETORIAL ITALIA	FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI CNPJ n.º 00.832.435/0001-00	R\$ 101.766,68	APLICAÇÃO
230	22/12/2021	XP Investimentos, Agência 0001, Conta Corrente 804158-0 - COMPRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 760199 COM VENCIMENTO EM 15/08/2022	4.000 (quatro mil) Títulos Públicos Federais NTN-B – 760199, vencimento 15/08/2022	R\$ 15.379.158,21	APLICAÇÃO
231	22/12/2021	Caixa Econômica Federal, Agência 0797, Conta Corrente 1000-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA CÂMARA – REFERENTE AO MÊS DE DEZEMBRO DO ANO DE 2021	Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP- CNPJ 03.737.206/0001-97	R\$ 86.725,29	APLICAÇÃO
232	27/12/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA FUNDACC – REFERENTE AO 13º SALÁRIO DO ANO DE 2021	Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP- CNPJ 03.737.206/0001-97	R\$ 24.165,70	APLICAÇÃO

233	28/12/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M1 - CNPJ n.º 08.703.063/0001-16	PAGAMENTO DE DESPESAS PREVIDENCIÁRIAS	R\$ 2.710.826,18	RESGATE
234	28/12/2021	Caixa Econômica Federal, Agência 0797, Conta Corrente 1000-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DO CARAGUAPREV PATRONAL REFERENTE AO MÊS DE DEZEMBRO DO ANO DE 2021	Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP- CNPJ 03.737.206/0001-97	R\$ 24.421,33	APLICAÇÃO
235	28/12/2021	Caixa Econômica Federal, agência 0797, conta corrente 9999-0 - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - CNPJ 03.737.206/0001-97	PAGAMENTO DE DESPESAS ADMINISTRATIVAS	R\$ 206.960,84	RESGATE
236	28/12/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA FUNDACC – REFERENTE AO MÊS DE DEZEMBRO DO ANO DE 2021	Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP- CNPJ 03.737.206/0001-97	R\$ 23.641,67	APLICAÇÃO
237	29/12/2021	Banco Itaú, agência 0248, conta corrente 04042-0 - REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA PREFEITURA MUNICIPAL E CÂMARA MUNICIPAL – APOSENTADOS E PENSIONISTAS REFERENTE AO MÊS DE DEZEMBRO DO ANO DE 2021	FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI CNPJ n.º 00.832.435/0001-00	R\$ 2.404,36	APLICAÇÃO

As principais movimentações do 4º trimestre de 2021, diante do cenário econômico e pandêmico, que trazem as seguintes considerações:

Conforme a deterioração do ambiente político-institucional do país, pelos imbrólios fiscais que permanecem, com destaque para os precatórios, o valor do Auxílio Brasil (eventual substituto do Bolsa Família), briga entre os poderes, greve dos caminhoneiros, a crise hídrica, aumento da Taxa Selic, inflação fora de controle, ano pré-eleitoral, a possível extensão dos auxílios emergenciais para 2022 e ainda um cenário de pandemia de COVID-19, que somente o 3º trimestre de 2021 com a vacinação começa a dar sinais de redução; na cena internacional, destaque para a sinalização do FOMC para o início do tapering ainda neste ano, que resultou na esperada abertura da curva americana que impacta também a renda fixa soberana global e desaceleração do mercado imobiliário Chinês, devido a dificuldades da incorporadora Evergrande e a ocorrência de blackouts mais frequentes vem ameaçando a produção industrial chinesa, a exemplo do setor siderúrgico.

Diante do cenário descrito acima os fundos de investimentos compostos por títulos públicos pré-fixados (IRFM, IRFM-1 e IRFM-1+), e os fundos de investimentos compostos por títulos públicos pós-fixados mais longos (IMA B 5+) terão maior volatilidade ao longo de 2021, assim a orientação

do consultor financeiro e com a aprovação do Comitê de Investimentos e do Conselho Deliberativo em suas reuniões ordinárias, é de reduzir a exposição em fundos atrelados a IRFM, IRFM-1 e IRFM-1+ e de diminuir a carteira de fundos de investimento em títulos públicos pós-fixados mais longos (IMA B 5+), passando para fundos compostos por títulos públicos pós-fixados mais curtos, como o IMA B 5 (títulos públicos com até 5 anos de vencimento), compra direta de Títulos Públicos Federais e maior investimento em fundos do exterior.

Após a orientação do consultor financeiro, o **Conselho Deliberativo aprova aplicação em Títulos do Tesouro Direto, de forma gradual até a porcentagem máxima da atual Política de Investimentos do Instituto, que é de 10% (dez por cento), que deverão ser contabilizados pelo valor da curva**, saindo assim de um investimento com alta volatilidade para um com rentabilidade positiva fixa, após estudo de Asset Liability Management (ALM) Determinístico para a determinação dos vértices de títulos públicos federais para serem adquiridos e proteger o Passivo do RPPS, em consonância com a Resolução CMN nº 3.922/10 e alterações posteriores, as normas da Secretaria de Previdência do Ministério da Economia, principalmente o estabelecido no Manual do Pró Gestão.

Para a redução da exposição em fundos atrelados a IRFM, IRFM-1 e IRFM-1+ e redução de fundos de investimento em títulos públicos pós-fixados mais longos (IMA B e IMA B 5+), passando para fundos compostos por títulos públicos pós-fixados mais curtos, como o IMA B 5 (títulos públicos com até 5 anos de vencimento), fundos de investimento do exterior e compra de Títulos Públicos Federais, foi aprovado pelos membros do **Conselho Deliberativo**, as seguintes movimentações:

- Conforme deliberação do Conselho Deliberativo na Ata de n.º 292, de 23/09/2021, ficou aprovado o resgate de R\$ 5.000.000,00 (cinco milhões de reais) do fundo Itaú Institucional RF Inflação FICFI, que está com rentabilidade positiva acumulada, pois após estudo do acumulado dos fundos com vértices longos, que estão sofrendo mais com o cenário macroeconômico, devemos resgatar desses fundos, desde que no acumulado esteja positivo, para aplicação no fundo de investimento ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO S&P500 BRL FIC FI, CNPJ: 26.269.692/0001-61, o Standard & Poor's 500 (S&P 500) é um índice americano composto pelas 500 maiores empresas dos EUA (companhias norte-americanas ou domiciliada no país), negociadas nas bolsas NYSE e NASDAQ. Tem um importante papel na economia mundial por ser considerado o principal indicador de avaliação das ações do mercado norte-americano, obteve uma rentabilidade positiva no ano de 2021 de

17,45% (data Base até setembro de 2021), aplicação que foi efetivada em 14/10/2021.

- Conforme aprovação do Conselho Deliberativo na Ata n.º 294, em 17 de novembro de 2021, após estudo de Asset Liability Management (ALM) realizado na data de 31/10/2021, onde foram estudados os patamares de riscos x retorno (fronteira eficiente Markowitz). O estudo ALM trouxe como diagnostico na Renda Variável aumentar a aplicação em fundos multimercados atrelados à S&P500, portanto foi deliberado aplicação de R\$ 5.000.000,00 (cinco milhões de reais) no fundo de investimento ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO S&P500 BRL FIC FI, retirando do fundo ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI, que está com rentabilidade positiva acumulada, pois após estudo do acumulado dos fundos com vértices longos, que estão sofrendo mais com o cenário macroeconômico, devemos resgatar desses fundos, desde que no acumulado esteja positivo, sendo a movimentação efetivada em 19/11/2021.
- Conforme aprovação do Conselho Deliberativo na Ata n.º 294, em 17 de novembro de 2021, após estudo de Asset Liability Management (ALM) realizado na data de 31/10/2021, onde foram estudados os patamares de riscos x retorno (fronteira eficiente Markowitz). O estudo ALM trouxe como diagnostico dos fundos de investimento no Exterior em aumentar a aplicação, portanto foi deliberado aplicação de R\$ 5.000.000,00 (cinco milhões de reais) no fundo de investimento da Caixa econômica Federal FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I, retirando do fundo ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI, que está com rentabilidade positiva acumulada, pois após estudo do acumulado dos fundos com vértices longos, que estão sofrendo mais com o cenário macroeconômico, devemos resgatar desses fundos, desde que no acumulado esteja positivo, sendo a movimentação efetivada em 22/11/2021.
- Registre-se que em dezembro de 2021, em consonância ao estudo ALM, conforme aprovação do Comitê de Investimentos na Ata n.º 127, de 23 de setembro de 2021 e do Conselho Deliberativo na Ata n.º 292, de 23 de setembro de 2021 e ratificada na Ata n.º 294, de 17/11/2021 a aplicação em Títulos do Tesouro Direto, de forma gradual, até a porcentagem máxima da atual Política de Investimentos do Instituto, que é de 10% (dez por cento), em 2021, que deverão ser contabilizados pelo valor da curva, saindo assim de um

investimento com alta volatilidade para um com rentabilidade positiva fixa, desde que a taxa indicativa esteja equivalente a meta atuarial do Instituto, que é de 5,46%a.a.. Assim foi realizada a compra de 10.000 (dez mil títulos NTN-B), no valor de R\$ 37.965.926,42, no dia 21 de dezembro de 2021, para o vencimento de 15/05/2023, a taxa de 5,90% e a compra de 4.000 (quatro mil títulos NTN-B), no valor de R\$ 15.379.158,21, no dia 22 de dezembro de 2021, para o vencimento de 15/08/2022, a taxa de 6,09%, sendo essas taxas superiores a meta atuarial do Instituto.

11. EXECUÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

A tabela abaixo descreve os limites de aplicação por artigo da Resolução CMN nº 3.922/2010 conforme aqueles autorizados pela política de investimentos do CaraguaPrev para o exercício corrente, que estabelece os princípios e as diretrizes a serem seguidas na gestão dos recursos correspondentes às reservas técnicas, fundos e provisões, sob a administração deste CaraguaPrev, visando atingir e preservar o equilíbrio financeiro e atuarial e a solvência do plano.

				Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	53.543.454,32	9,77	0,00	5,00	10,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	265.569.822,51	48,45	20,00	40,00	80,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	44.950.626,84	8,20	10,00	19,50	35,00	0,00	45,00
Artigo 7º VII, Alínea a	Cota Sênior de FIDC	930.827,37	0,17	0,00	0,50	1,00	0,00	5,00
Total Renda Fixa		364.994.731,04	66,58					100,00

**Renda Variável e
Investimentos
Estruturados**

Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	22.617.348,87	4,13	0,00	5,00	10,00	0,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	60.658.468,63	11,07	5,00	15,00	20,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	49.476.009,96	9,03	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Total Renda Variável e Investimentos Estruturados		132.751.827,46	24,22					35,00

Investimentos no Exterior

Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	3.268.685,32	0,60	0,00	5,00	5,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	47.153.904,89	8,60	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Total Investimentos no Exterior		50.422.590,21	9,20					10,00

Registre-se que no dia 20/05/2021 foi alterada a Política de Investimentos do CaraguaPrev, adequando a taxa anual de juros para 5,46%, de acordo com o critério estabelecido pela Portaria ME nº 12.223/2020 e disposto na Portaria MF nº 464/2018, que é definida, para o Fundo em Capitalização, como a menor entre a taxa associada à duração do passivo verificada na avaliação atuarial do exercício anterior e a meta estabelecida pela política de investimentos do Fundo, considerada a expectativa de rentabilidade dos ativos garantidores, estando em conformidade com a Avaliação Atuarial para 2021.

No dia 23/06/2021 foi alterada a Política de Investimentos do CaraguaPrev, adequando os recursos alocados no Artigo 8º, Inciso I, Alínea A, para 10% do limite superior ao máximo estipulado em Política de Investimentos.

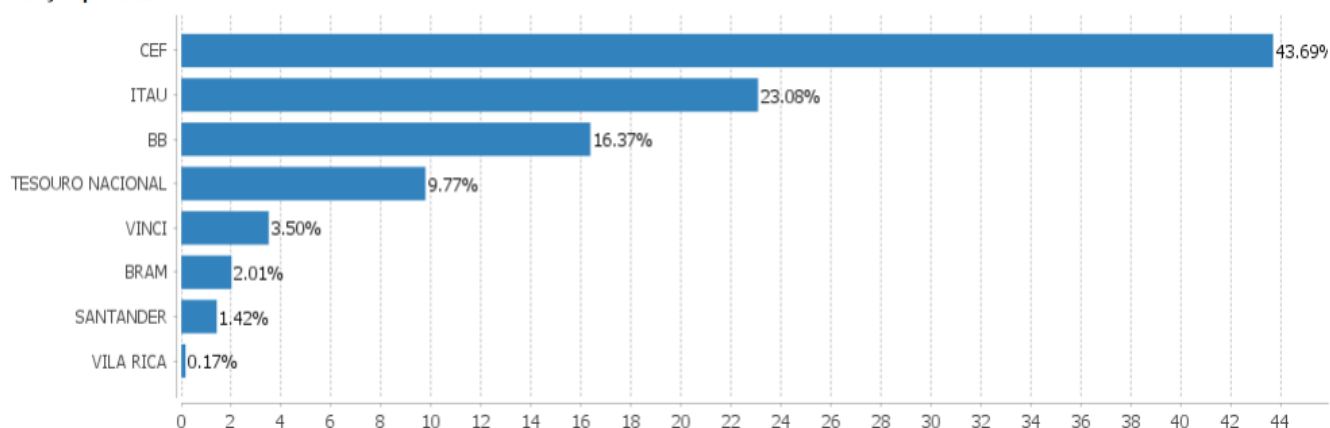
Ainda de acordo com os normativos, os investimentos do CaraguaPrev estão em aderência com a Política de Investimentos e de acordo com o art. 13 e 14 da Resolução do Conselho Monetário Nacional n.º 3.922/10 e alterações, sendo que todas as aplicações nos fundos de investimento não excederam a 20% (vinte por cento) das aplicações dos recursos do CaraguaPrev e não

representaram, no máximo, 15% (quinze por cento) do patrimônio líquido dos fundos de investimentos.

12. RELAÇÃO DE GESTORES DOS RECURSOS

Gestor	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financeiro Mês (R\$)
BB	87.815.068,32	772.744,85	0,00	0,00	89.712.412,29	1.124.599,12
BRAM	10.688.008,32	0,00	0,00	0,00	11.012.416,41	324.408,09
CEF	229.730.415,08	8.193.135,92	-578.960,84	0,00	239.476.300,77	2.131.710,61
ITAU	13.724.324,31	0,00	0,00	0,00	13.982.271,75	257.947,44
ITAU	168.193.157,11	106.975,40	-58.589.410,15	0,00	112.524.169,08	2.813.446,72
SANTANDER	7.661.043,50	0,00	0,00	0,00	7.798.166,53	137.123,03
TESOURO NACIONAL	0,00	53.345.084,63	0,00	0,00	53.543.454,32	198.369,69
VILA RICA	1.027.727,29	0,00	0,00	101.766,67	930.827,37	4.866,75
VINCI	19.225.613,01	0,00	0,00	0,00	19.189.130,19	-36.482,82

Alocação por Gestor



13. RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV. DEZEMBRO 2021

FUNDO	CNPJ	VALOR	% RECURSOS	GESTOR	ADMINISTRADOR
BB PREV RF IRF-M 1	11.328.882/0001-35	4.591.252,28	0,8376	BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL
BB PREV RF IRF-M 1 (APORTES 37299-4)	11.328.882/0001-35	6.401.681,97	1,1678	BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL
BB PREV TP IPCA VII (2016, 2018, 2020, 2022)	19.523.305/0001-06	478.291,11	0,0873	BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL
BB PREV RF IRF-M	07.111.384/0001-69	16.124.140,18	2,9415	BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL
BB PREV IMA-B TITULOS PUBLICOS	07.442.078/0001-05	16.366.053,99	2,9856	BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5+ TP FI (APORTES)	13.327.340/0001-73	4.806.285,43	0,8768	BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5+ TP FI	13.327.340/0001-73	16.975.780,53	3,0968	BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL
CEF FI BRASIL IDKA2	14.386.926/0001-71	11.738.583,84	2,1414	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
CEF FI BRASIL IRFM 1+	10.577.519/0001-90	32.675.659,51	5,9609	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
CEF FI BRASIL IRFM	14.508.605/0001-00	4.889.433,76	0,8920	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
CEF BRASIL IMA B5+	10.577.503/0001-88	35.062.910,60	6,3964	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
CEF BRASIL IMA B TIT PUBL	10.740.658/0001-93	45.534.437,80	8,3066	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
SANTANDER IMA-B5 PREMIUM FIC RF	13.455.117/0001-01	4.529.481,21	0,8263	SANTANDER BRASIL GESTÃO	SANTANDER
CEF FIC BR GESTAO ESTRATEGICA C/C 1000-0	23.215.097/0001-55	46.347.554,82	8,4550	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
CEF FIC BR GESTAO ESTRATEGICA C/C 9999-0	23.215.097/0001-55	2.786.485,37	0,5083	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
ITAU INSTITUCIONAL RF IRF-M 1	08.703.063/0001-16	359.354,25	0,0656	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO
ITAU RENDA FIXA IMAB5+ FIC FI	14.437.684/0001-06	4.200.131,05	0,7662	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO
ITAU INSTITUCIONAL RF IMA-B FIC FI (INFLAÇÃO)	10.474.513/0001-98	11.702.304,81	2,1348	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO
FIDC FECHADO MULTISETORIAL ITALIA	13.990.000/0001-28	930.827,37	0,1698	VILA RICA	BRL DTVM
CEF FI BRASIL REF DI LP 9999-0	03.737.206/0001-97	912.841,35	0,1665	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
CEF FI BRASIL REF DI LP 1000-0	03.737.206/0001-97	12.374.488,83	2,2574	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

ITAU INSTIT ALOCAÇÃO DINAMICA	21.838.150/0001-49	2.449.310,46	0,4468	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO
ITAU INSTIT RF DI	00.832.435/0001-00	3.494.021,36	0,6374	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO FIC FI	05.073.656/0001-58	25.719.964,84	4,6920	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	10.418.335/0001-88	22.617.348,87	4,1260	BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL
BB DIVIDENDOS FIC FIA	05.100.191/0001-87	1.351.577,93	0,2466	BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS 9999-0	15.154.441/0001-15	12.425.705,45	2,2668	VINCI	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
FIC AÇÕES VALOR SMALL CAP RPPS	14.507.699/0001-95	6.763.424,74	1,2338	VINCI	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
ITAU FOF RPI AÇÕES IBOBESPA ATIVO FIC FIA	08.817.414/0001-10	13.982.271,75	2,5507	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	24.571.992/0001-75	5.787.099,75	1,0557	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO
ITAU ACOES MOMENTO 30 II FIC	42.318.981/0001-60	9.335.972,60	1,7031	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO
BRADERCO FIA SELECTION	03.660.879/0001-96	4.950.175,70	0,9030	BEM DTVM LTDA	BRADERCO
BRADERCO FIA SMALL CAP PLUS	06.988.623/0001-09	6.062.240,71	1,1059	BEM DTVM LTDA	BRADERCO
FIA CAIXA INSTIT BDR NIVEL I	17.502.937/0001-68	47.153.904,89	8,6021	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL	26.269.692/0001-61	49.476.009,96	9,0257	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG	34.258.351/0001-19	1.669.255,25	0,3045	SANTANDER BRASIL GESTÃO	SANTANDER
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR	17.804.792/0001-50	1.599.430,07	0,2918	SANTANDER BRASIL GESTÃO	SANTANDER
Total em Bancos R\$		494.625.694,39	90,2323		

TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS		VALOR INVESTIDO	% RECURSOS	
NTN-F 760199 - 15/05/2023	10.000	38.112.344,74	6,9527	
NTN-F 760199 - 15/08/2022	4.000	15.431.109,58	2,8150	
Total em Títulos R\$		53.543.454,32	9,7677	

Total Geral		548.169.148,71	100,0000	
--------------------	--	-----------------------	-----------------	--

14. PRÓ GESTÃO – NÍVEL 1

O Instituto de Previdência do município de Caraguatatuba (CaraguaPrev) conquistou a certificação Pró-Gestão RPPS (Regime Próprio de Previdência Social) Nível I da Secretaria Especial de Previdência e Trabalho (SEPRT) do Ministério da Economia.

A certificação busca garantir aos RPPSs: excelência na gestão; melhoria na organização das atividades e processos; aumento da motivação por parte dos colaboradores; incremento da produtividade; redução de custos e do retrabalho; transparência e facilidade de acesso à informação; perpetuação das boas práticas, pela padronização; e reconhecimento no mercado onde atua.

Para alcançar o Nível I do Pró-Gestão, Caraguatatuba atingiu 98% (mínimo era 70%) das ações nas dimensões Controles Internos, Governança Corporativa e Educação Previdenciária.

Na dimensão Controles Internos são observados o mapeamento das atividades das áreas de atuação do RPPS; manualização das atividades das áreas de atuação do RPPS; capacitação e certificação dos gestores e servidores das áreas de risco; estrutura de controle interno; política de segurança da informação; e gestão e controle da base de dados cadastrais dos servidores públicos, aposentados e pensionistas. A dimensão Governança Corporativa envolve tópicos relacionados ao relatório de governança corporativa; planejamento; relatório de gestão atuarial; código de ética da instituição; políticas previdenciárias de saúde e segurança do servidor; política de investimentos; Comitê de Investimentos; transparência; definição de limites de alçadas; segregação das atividades; ouvidoria; qualificação do órgão de direção; Conselho Fiscal; Conselho Deliberativo; mandato, representação e recondução; e gestão de pessoas. A Educação Previdenciária é baseada em um plano de ação de capacitação e nas ações de diálogo com os segurados e a sociedade.

O instituto se profissionalizou com o maior programa de gestão do Brasil. A certificação Pró-Gestão RPPS tem três anos de validade e o CaraguaPrev passará por uma avaliação contínua no período até a renovação.

15. CONCLUSÃO

Quanto ao desempenho das aplicações financeiras do CaraguaPrev do 4º trimestre de 2021, os membros do Comitê de Investimentos, observaram as regras de segurança, solvência, liquidez, rentabilidade, proteção, prudência financeira e analisaram e atestaram a conformidade do relatório de investimentos do mês quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de

investimento à Política de Investimentos, a evolução da execução do orçamento do RPPS, os dados atualizados dos fluxos de caixa e dos investimentos, com visão de curto e longo prazo, e entendem que as peças pertinentes representam adequadamente a posição das aplicações financeiras e de tesouraria do Instituto, bem assim, a posição patrimonial e econômico-financeira da Autarquia, recebendo a aprovação deste Comitê.

COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV

LUANA M. FORCIONI GUEDES

Presidente do Comitê

Certificação: ANBIMA CPA-10

PEDRO IVO DE SOUSA TAU

Membro do Comitê

Certificação: ANBIMA CPA-10

ROSEMEIRE MARIA DE JESUS

Membro do Comitê

Certificação: ANBIMA CPA-10

ADRIANA ZAMBOTTO

Membro do Comitê

Certificação: ANBIMA CPA-10

IVONE CARDOSO VICENTE ALFREDO

Membro do Comitê

PARECER DO CONSELHO FISCAL

Os membros do Conselho Fiscal do Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba – CaraguaPrev, em reunião realizada nesta data, cumprindo o que determina o artigo 73 da Lei complementar nº 59, de 05 de novembro de 2015, tendo examinado as Demonstrações Financeiras e Contábeis referentes ao **4º TRIMESTRE de 2021**, analisaram e atestaram a conformidade do relatório de investimentos do mês quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos, a evolução da execução do orçamento do RPPS, os dados atualizados dos fluxos de caixa e dos investimentos, com visão de curto e longo prazo, conforme relatório da análise dos investimentos disponibilizado a todos os conselheiros e segurados do CaraguaPrev no site do Instituto e entendem que as peças pertinentes representam adequadamente a posição das aplicações financeiras e de tesouraria do Instituto, bem assim, a posição patrimonial e econômico-financeira da Autarquia, recebendo a aprovação deste Conselho.

Caraguatatuba/SP, 26 de janeiro de 2022.

Cristiano Paulo Silva
Presidente do Conselho Fiscal

Adriana Zambotto
Certificação: ANBIMA CPA-10
Membro do Conselho Fiscal

Priscila Sousa Giorgeti Vieira
Certificação: ANBIMA CPA-10
Membro do Conselho Fiscal

Marcia Regina Paiva Silva
Membro do Conselho Fiscal

PARECER DO CONSELHO DELIBERATIVO

Os membros do Conselho Deliberativo do Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba – CaraguaPrev, em reunião realizada nesta data, cumprindo o que determina o artigo 71, inciso VI, da Lei Complementar nº 59, de 05 de novembro de 2015, tendo examinado as Demonstrações Financeiras e Contábeis referentes ao **4º TRIMESTRE de 2021**, analisaram e atestaram a conformidade do relatório de investimentos do mês quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos, a evolução da execução do orçamento do RPPS, os dados atualizados dos fluxos de caixa e dos investimentos, com visão de curto e longo prazo, conforme relatório da análise dos investimentos disponibilizado a todos os conselheiros e segurados do CaraguaPrev no site do Instituto e entendem que as peças pertinentes representam adequadamente a posição das aplicações financeiras e de tesouraria do Instituto, bem assim, a posição patrimonial e econômico-financeira da Autarquia, recebendo a aprovação deste Conselho.

Caraguatatuba/SP, 26 de janeiro de 2022.

Marcus da Costa Nunes Gomes
Presidente do Conselho Deliberativo

Ivone Cardoso Vicente Alfredo
Membro do Conselho Deliberativo

Rosemeire Maria de Jesus
Membro do Conselho Deliberativo
Certificação: ANBIMA CPA-10

Gilceli de Oliveira Ubiña
Membro do Conselho Deliberativo

Ronaldo Cheberle
Membro do Conselho Deliberativo

Roberta Alice Zimbres Franzolin
Membro do Conselho Deliberativo

Ivy Monteiro Malerba
Membro do Conselho Deliberativo

Marcia Denise Gusmão Coelho
Membro do Conselho Deliberativo