



INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICÍPIO DE CARAGUATATUBA/SP

CARAGUAPREV

AVALIAÇÃO FINANCEIRA

1º TRIMESTRE DE 2023



SUMÁRIO

| | | |
|-----|---|----|
| 1. | INTRODUÇÃO..... | 3 |
| 2. | CENÁRIO MACROECONÔMICO | 5 |
| 3. | BOLETIM FOCUS | 7 |
| 4. | CARTEIRA DE INVESTIMENTOS..... | 7 |
| 4.1 | ESTUDO ALM | 8 |
| 5. | RENTABILIDADE DO PLANO PREVIDENCIÁRIO | 10 |
| 6. | RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS..... | 12 |
| 7. | PERSPECTIVAS | 17 |
| 8. | GERENCIAMENTO DE RISCOS - INDICADORES DE DESEMPENHO E RISCO | 18 |
| 9. | TABELA DE LIQUIDEZ | 19 |
| 10. | MOVIMENTAÇÕES DO TRIMESTRE..... | 19 |
| 11. | EXECUÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS..... | 27 |
| 12. | RELAÇÃO DE GESTORES DOS RECURSOS..... | 28 |
| 13. | RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV. MARÇO/2023 | 29 |
| 14. | RENTABILIDADE POR ARTIGO DA RESOLUÇÃO CMN DO TRIMESTRE AVALIADO..... | 32 |
| 15. | PRÓ GESTÃO – NÍVEL 1 | 33 |
| 16. | CONCLUSÃO..... | 33 |



RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

1º TRIMESTRE DE 2023

Parâmetros:

- *Resolução 4.963/21 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 trimestral 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 trimestre avaliado:

Todos os membros da Diretoria Executiva e dos Conselhos Deliberativo, Fiscal e Comitê de Investimentos, possuem certificação, por meio de processo realizado por entidade certificadora para comprovação de atendimento e verificação de conformidade com os requisitos técnicos necessários para o exercício de determinado cargo ou função, conforme requisitos mínimos exigidos no artigo 8º-B da Lei Federal nº 9.717, de 27 de novembro de 1998 e Portaria MTP Nº 1.467, de 02 de junho de 2022 ou norma que a complemente, atualize ou substitua.

Conselho Deliberativo:

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

Conselho Fiscal:

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

Comitê de Investimentos:

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

Diretoria Executiva:

- Pedro Ivo de Sousa tau (Presidente do CaraguaPrev, Certificação profissional CPA-10 e Certificação TOTUM);
- Luana Moussalli Forcioni Guedes (Diretora Financeira, Certificação profissional CPA-10 e Certificação TOTUM);
- Rose Ellen de Oliveira Faria (Diretora de Benefícios, Certificação TOTUM); e
- Paulo Henrique Passos do Nascimento (Diretor Administrativo, Certificação TOTUM);



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 do Conselho Monetário Nacional e a Política Anual de Investimentos do CaraguaPrev.

2. CENÁRIO MACROECONÔMICO

JANEIRO

GERAL: No mês de janeiro, os mercados globais caminharam na direção positiva, com desaceleração dos indicadores de inflação, divulgações mais construtivas de crescimento econômico e reabertura da economia chinesa.

BRASIL: No Brasil, a carteira de investimentos do CaraguaPrev em renda fixa, renda variável, investimentos estruturados, investimentos no exterior e BDR apresentaram performance positivas no mês. O IPCA avançou 0,53% (M/M) em janeiro. Com o resultado da última reunião do COPOM apresentando a manutenção da taxa Selic em 13,75%. No Brasil, a curva de juros teve alta, refletindo as incertezas no cenário fiscal e levando a uma alta da expectativa de inflação. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo o movimento dos índices internacionais e ainda sendo beneficiado pelo movimento de reabertura da China, o que vem ajudando os mercados emergentes.

FEVEREIRO

GERAL: No mês de fevereiro, o sentimento de aversão a risco aumentou nos mercados globais devido à resiliência da inflação, contratações do mercado de trabalho e à expectativa de altas adicionais nos juros americanos. Assim, o discurso de diversos bancos centrais evoluiu em uma direção ainda mais conservadora, o que influenciou as Bolsas globais recuarem e o dólar ganhou força contra as moedas internacionais.

BRASIL: No Brasil, a carteira de investimentos do CaraguaPrev em renda fixa, investimentos estruturados, investimentos no exterior e BDR apresentaram performance positivas no mês, já os investimentos em renda variável apresentaram performance negativa. O IPCA avançou 0,84% (M/M) em fevereiro. Com o resultado da última reunião do COPOM apresentando a manutenção



da taxa Selic em 13,75%. No Brasil, a desaceleração da atividade e inflação segue em curso, entretanto a incerteza em relação à sustentabilidade fiscal e a discussão sobre uma possível mudança nas metas de inflação seguem dominando o cenário. O Ibovespa fechou o mês com performance negativa de 7,49% em fevereiro de 2023, essa foi uma das maiores quedas mensais do índice em 20 anos, menor apenas que o recuo de 8,34% observado em 2020, quando estourou a pandemia de covid. A baixa agora foi puxada em parte pela ofensiva do presidente Lula contra a atuação do Banco Central, comandado por Roberto Campos Neto, mas principalmente pela resiliência da inflação e a perspectiva de um aperto monetário ainda maior nos Estados Unidos – que deixa ativos de risco de países emergentes, como o Brasil, menos atrativos. seguindo o movimento dos índices internacionais e ainda sofrendo com as incertezas no quadro fiscal.

MARÇO

GERAL: No mês de março, houve queda acentuada na curva de juros dos EUA, em somatória a uma visão mais cautelosa para a economia global. Esses movimentos foram originados pelos eventos negativos relacionados aos bancos nos EUA (bancos regionais) e na Europa (bancos suíços), reforçando um contexto de incerteza em torno do cenário econômico.

BRASIL: No Brasil, a carteira de investimentos do CaraguaPrev em renda fixa, investimentos estruturados, investimentos no exterior e BDR apresentaram performance positivas no mês, já os investimentos em renda variável apresentaram performance negativa. O IPCA avançou 0,71% (M/M) em março. Com o resultado da última reunião do COPOM apresentando a manutenção da taxa Selic em 13,75%. No Brasil, apesar do discurso conservador do Copom, a curva de juros apresentou queda seguindo a tendência do cenário global, devido aos problemas enfrentados pelos bancos no exterior, combinado com o aperto das condições de crédito internas que começaram a se intensificar após os problemas apresentados pelas Lojas Americanas. O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, divergindo do movimento dos índices internacionais e ainda sofrendo com as incertezas locais, em somatório com a queda no preço das commodities. Apresentando um retorno negativo de -2,91% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento negativo anual de -7,16% e de -15,10% nos últimos 12 meses.



3. BOLETIM FOCUS

| Mediana - Agregado | 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. *** |
| IPCA (variação %) | 5,90 | 5,93 | 5,96 | ▲ (1) | 149 | 6,03 | 52 | 4,02 | 4,13 | 4,13 | = (1) | 142 | 4,05 | 50 |
| PIB Total (variação % sobre ano anterior) | 0,85 | 0,90 | 0,90 | = (1) | 107 | 0,85 | 33 | 1,50 | 1,40 | 1,48 | ▲ (1) | 96 | 1,50 | 29 |
| Câmbio (R\$/US\$) | 5,25 | 5,25 | 5,25 | = (9) | 112 | 5,20 | 40 | 5,30 | 5,30 | 5,30 | = (5) | 104 | 5,25 | 39 |
| Selic (% a.a) | 12,75 | 12,75 | 12,75 | = (7) | 137 | 12,50 | 63 | 10,00 | 10,00 | 10,00 | = (7) | 130 | 10,00 | 60 |
| IGP-M (variação %) | 4,11 | 4,00 | 3,70 | ▼ (3) | 78 | 3,51 | 31 | 4,17 | 4,20 | 4,20 | = (2) | 66 | 4,20 | 29 |
| IPCA Administrados (variação %) | 9,05 | 9,48 | 9,65 | ▲ (18) | 98 | 9,95 | 28 | 4,40 | 4,40 | 4,40 | = (1) | 81 | 4,31 | 26 |
| Conta corrente (US\$ bilhões) | -50,00 | -50,40 | -50,84 | ▼ (2) | 26 | -51,80 | 9 | -51,50 | -51,39 | -52,50 | ▼ (2) | 25 | -53,60 | 8 |
| Balança comercial (US\$ bilhões) | 57,00 | 55,00 | 55,00 | = (2) | 25 | 56,24 | 8 | 55,00 | 52,44 | 52,44 | = (1) | 22 | 58,00 | 6 |
| Investimento direto no país (US\$ bilhões) | 80,00 | 80,00 | 80,00 | = (14) | 23 | 80,00 | 7 | 80,00 | 80,00 | 80,00 | = (9) | 22 | 80,15 | 6 |
| Dívida líquida do setor público (% do PIB) | 61,00 | 61,00 | 61,15 | ▲ (2) | 26 | 61,50 | 6 | 64,00 | 64,50 | 64,50 | = (2) | 22 | 64,00 | 4 |
| Resultado primário (% do PIB) | -1,00 | -1,02 | -1,01 | ▲ (1) | 40 | -1,10 | 11 | -0,75 | -0,80 | -0,80 | = (2) | 36 | -0,75 | 9 |
| Resultado nominal (% do PIB) | -7,85 | -7,80 | -7,80 | = (2) | 26 | -7,80 | 7 | -7,35 | -7,40 | -7,10 | ▲ (2) | 23 | -7,00 | 5 |

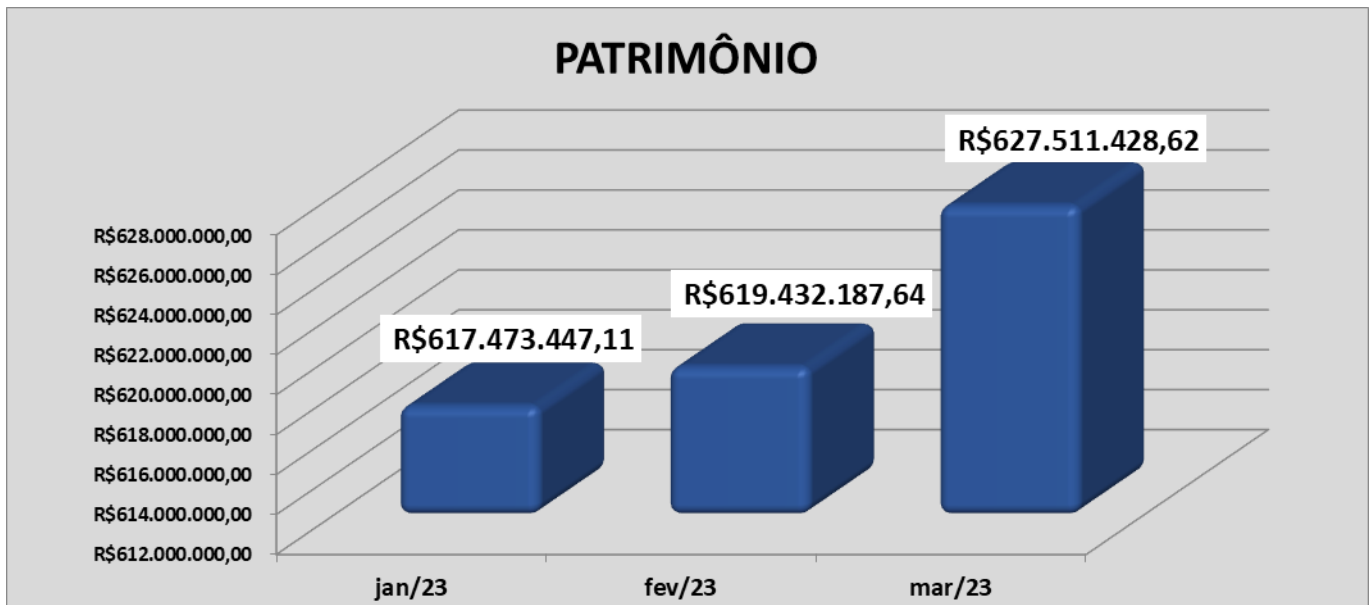
Relatório Focus de 31.03.2023. Fonte: <https://www.bcb.gov.br/publicacoes/focus>

4. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

A carteira de investimentos do CaraguáPrev encerrou o trimestre com o patrimônio total de **R\$ 627.511.428,62** (seiscentos e vinte e sete milhões e quinhentos e onze mil e quatrocentos e vinte e oito reais e sessenta e dois centavos).

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)



| Mês 2023 | PATRIMÔNIO |
|----------|-------------------|
| jan/23 | R\$617.473.447,11 |
| fev/23 | R\$619.432.187,64 |
| mar/23 | R\$627.511.428,62 |

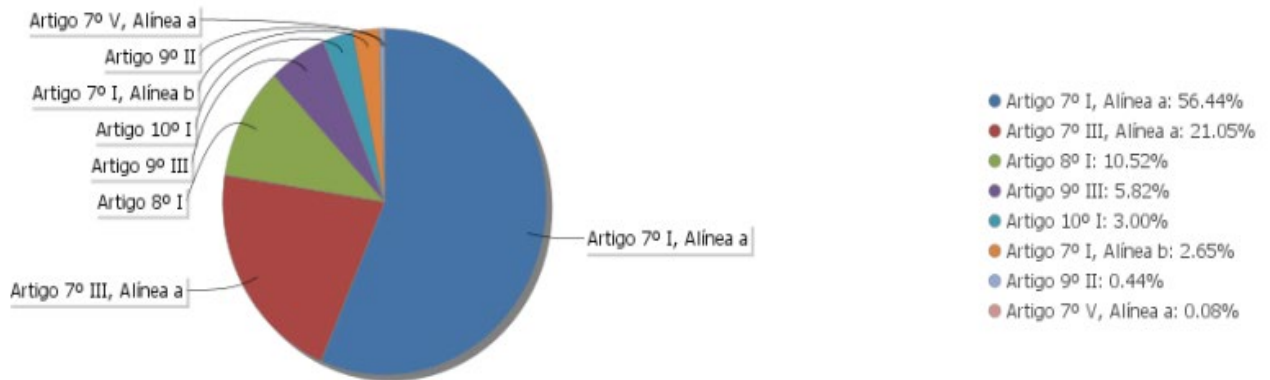
4.1 ESTUDO ALM

O Estudo de Asset Liability Management (ALM) foi realizado na data de 31/10/2021.

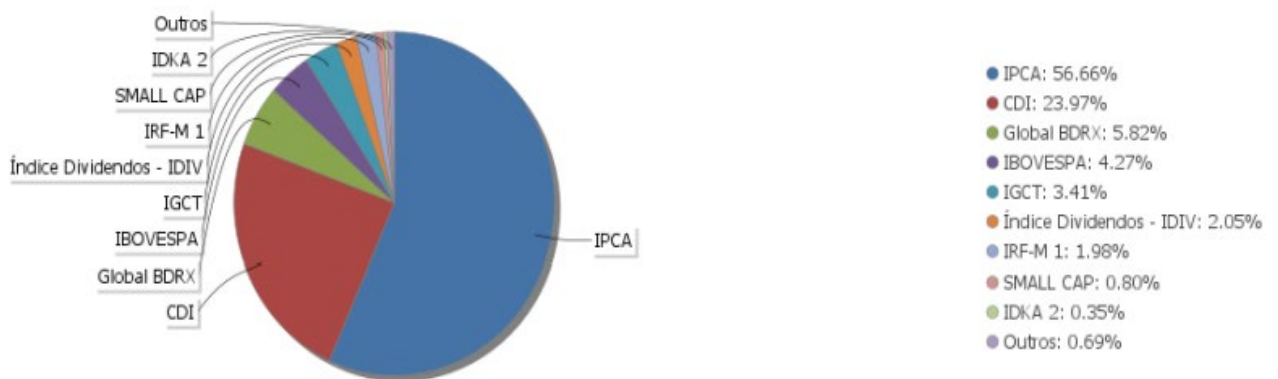
Foram realizadas várias movimentações ao longo dos anos de 2021 e 2022, para adequar ao momento econômico do país, diante do cenário negativo do acumulado dos fundos de investimento da carteira do CaraguaPrev, com a aquisição de quase 50% da carteira em Títulos Públicos Federais, com taxas acima da meta atuarial,

Foram zeradas as posições em fundos atrelados a IRFM, IRFM-1+ e IMA B 5+ que são fundos de investimento em títulos públicos pós-fixados longos, passando para fundos de renda fixa atrelados a DI e compra direta de Títulos Públicos Federais.

4.2 Alocação por Artigo – Resolução CMN.



4.2.1 Alocação por Estratégia



4.3 Conceitos de Classes de Ativos, conforme Resolução do Conselho Monetário Nacional n.º 4.963/2021 e alterações.

- 4.3.1 Artigo 7º I, Alínea a: até 100% (cem por cento) em títulos de emissão do Tesouro Nacional, registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (Selic);
- 4.3.2 Artigo 7º I, Alínea b: até 100% (cem por cento) em cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa, conforme regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários, constituídos sob a forma de condomínio aberto, cujos regulamentos determinem que seus recursos sejam aplicados exclusivamente em títulos definidos na alínea "a", ou compromissadas lastreadas nesses títulos;
- 4.3.3 Artigo 7º, III, "a" Fundos de Investimento de Renda Fixa - até 60% (sessenta por cento) no somatório dos seguintes ativos: a) cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa, conforme regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários, constituídos sob a forma de condomínio aberto (fundos de renda fixa); 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).

- 4.3.4 Artigo 7º, V, “a”- até 5% (cinco por cento) em: a) cotas de classe sênior de fundos de investimento em direitos creditórios (FIDC);
- 4.3.5 Artigo 8º I - No segmento de renda variável, as aplicações dos recursos dos regimes próprios de previdência social subordinam-se ao limite de até 30% (trinta por cento) em cotas de fundos de investimento classificados como ações, constituídos sob a forma de condomínio aberto, conforme regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários (fundos de renda variável);
- 4.3.6 Art. 9º, II - 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: II - cotas de fundos de investimento constituídos no Brasil sob a forma de condomínio aberto com o sufixo “Investimento no Exterior”, nos termos da regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários, que invistam, no mínimo, 67% (sessenta e sete por cento) do seu patrimônio líquido em cotas de fundos de investimento constituídos no exterior;
- 4.3.7 Art. 9º, 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.
- 4.3.8 Art. 10, I - No segmento de investimentos estruturados, as aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social subordinam-se ao limite global de até 15% (quinze por cento), e adicionalmente aos seguintes: I - até 10% (dez por cento) em cotas de fundos de investimento classificados como multimercado (FIM) e em cotas de fundos de investimento em cotas de fundos de investimento classificados como multimercado (FICFIM)

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 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| 2023 | 1,75 | -0,11 | 0,96 | | | | | | | | | | 2,62 |
| IPCA + 5,03% | 0,96 | 1,19 | 1,16 | | | | | | | | | | 3,35 |
| p.p. indexador | 0,79 | -1,30 | -0,20 | | | | | | | | | | -0,73 |
| 2022 | -0,53 | -0,27 | 2,35 | -1,70 | 1,01 | -1,73 | 2,27 | 0,51 | -0,83 | 2,08 | 0,78 | -0,10 | 3,79 |
| IPCA + 4,99% | 0,95 | 1,38 | 2,05 | 1,43 | 0,90 | 1,08 | -0,28 | 0,08 | 0,12 | 0,98 | 0,80 | 1,05 | 11,04 |
| p.p. indexador | -1,48 | -1,65 | 0,30 | -3,13 | 0,11 | -2,81 | 2,54 | 0,42 | -0,95 | 1,10 | -0,02 | -1,15 | -7,25 |
| 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

Relatório

| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 22 | 43,14 | 03 meses | 2,62 | 3,35 | -0,73 | 2,15 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 29 | 56,86 | 06 meses | 5,48 | 6,30 | -0,83 | 3,26 |
| | | | 12 meses | 4,91 | 9,88 | -4,98 | 4,41 |
| | | | 24 meses | 7,09 | 28,84 | -21,74 | 5,12 |
| Maior rentabilidade da Carteira | 4,43 | 2020-12 | 36 meses | 22,15 | 44,54 | -22,38 | 6,20 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -8,82 | 2020-03 | 48 meses | 24,38 | 58,30 | -33,92 | 7,75 |
| | | | Desde 31/12/2018 | 27,25 | 62,97 | -35,72 | 7,55 |

No trimestre a carteira de investimentos do plano previdenciário obteve rentabilidade de 2,62%. 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 + 5,03%.

Desde o ano de 2020 a performance dos investimentos apresenta grande volatilidade, ela foi ocasionada pelo atual cenário econômico, pandêmico e político, do país e do mundo, com aumento das taxas de juros mundial, além de cenário de guerra entre Rússia e Ucrânia, sendo um risco sistemático, que são os que englobam a economia como um todo, ou seja, comprometem todo o mercado financeiro. Existem certas situações que são tão importantes que afetam toda a economia, onde é dado o nome de risco de mercado (ou risco sistemático).

Esse tipo de questão, portanto, é algo inerente a todos os tipos de ativos da carteira de investimentos. Assim, é seguro dizer que o risco de mercado é aquele do qual não dá para se proteger com diversificação. Ou seja, é um risco não diversificável, afinal, todos os ativos que você pode ter na carteira



são vulneráveis a ele.

Por isso, o risco sistemático é capaz de impactar toda a economia ou um determinado mercado em sua integralidade. No entanto, nem todos os ativos são afetados igualmente por todos os riscos sistemáticos, mas de uma maneira ou de outra, todos são impactados por esse risco. Alguns exemplos de riscos sistemáticos que afetaram e afetam os investimentos como um todo são:

1. variação do dólar;
2. oscilação da taxa Selic;
3. variação da inflação;
4. crise que afeta toda a economia (como a do coronavírus);
5. crise política;
6. insegurança jurídica no país;
7. queda do PIB e outros elementos do cenário macroeconômico.

A fim de mitigar os riscos que afetam os investimentos, o CaraguaPrev realocou em 2022 boa parte dos seus investimentos para Títulos Públicos Federais, que possuem risco soberano e apresentam rentabilidade acima da meta atuarial.

6. RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS

6.1 RENDA FIXA



RENDA FIXA

80,21%

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

| Emissor | Título Público | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira |
|------------------|--------------------------|------------------------|-------------------|------|-------|---------------|------------|
| | | | Dia | Mês | Trim. | | |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150523 (5,831000%) | 0,60 | 0,06 | 1,48 | 3,66 | 20.967.109,14 | 3,34 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150523 (5,900000%) | 0,60 | 0,06 | 1,49 | 3,68 | 41.755.810,80 | 6,65 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150525 (5,980000%) | 2,94 | 0,07 | 1,49 | 3,70 | 10.344.226,33 | 1,65 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150527 (6,090000%) | 2,95 | 0,05 | 1,50 | 3,73 | 5.111.815,10 | 0,81 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (5,560000%) | 0,60 | 0,06 | 1,46 | 3,60 | 16.899.560,20 | 2,69 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (5,821000%) | 0,60 | 0,06 | 1,48 | 3,66 | 19.753.154,54 | 3,15 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,710000%) | 0,60 | 0,06 | 1,47 | 3,63 | 32.266.562,31 | 5,14 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,760000%) | 0,60 | 0,06 | 1,47 | 3,65 | 10.728.130,38 | 1,71 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,781000%) | 0,60 | 0,06 | 1,47 | 3,65 | 10.710.225,22 | 1,71 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,815000%) | 0,60 | 0,06 | 1,48 | 3,66 | 10.685.495,80 | 1,70 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,850000%) | 0,61 | 0,03 | 1,48 | 3,67 | 10.332.315,15 | 1,65 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (5,892000%) | 0,60 | 0,06 | 1,48 | 3,68 | 5.416.959,91 | 0,86 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (5,910000%) | 3,04 | 0,05 | 1,49 | 3,68 | 10.238.042,89 | 1,63 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (6,090000%) | 3,05 | 0,06 | 1,50 | 3,73 | 5.112.096,15 | 0,81 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (6,440000%) | 3,05 | 0,06 | 1,53 | 2,60 | 19.928.404,97 | 3,18 |



| | | | | | | | |
|--|--------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (6,480000%) | 3,05 | 0,07 | 1,54 | 3,82 | 20.746.324,26 | 3,31 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (6,680000%) | 3,09 | 0,06 | 1,55 | 3,87 | 5.111.199,57 | 0,81 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150826 (6,350000%) | 3,06 | 0,05 | 1,52 | 2,33 | 14.903.775,31 | 2,38 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150828 (6,350000%) | 3,07 | 0,05 | 1,52 | 2,33 | 14.904.196,06 | 2,38 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150830 (5,708000%) | 0,60 | 0,06 | 1,47 | 3,63 | 10.697.131,56 | 1,70 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,650000%) | 0,60 | 0,06 | 1,46 | 3,62 | 910.155,23 | 0,15 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,770000%) | 0,60 | 0,06 | 1,47 | 3,65 | 10.709.357,99 | 1,71 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,713000%) | 0,60 | 0,06 | 1,47 | 3,64 | 10.760.803,98 | 1,71 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,780000%) | 0,60 | 0,06 | 1,47 | 3,65 | 10.398.684,89 | 1,66 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,815000%) | 0,60 | 0,06 | 1,48 | 3,66 | 10.684.512,87 | 1,70 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,916000%) | 0,60 | 0,06 | 1,49 | 3,68 | 3.834.212,21 | 0,61 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,920000%) | 0,61 | 0,03 | 1,49 | 3,69 | 10.269.313,65 | 1,64 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 0,60 | 0,06 | 1,49 | 3,69 | 354.179.576,47 | 56,44 |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|-----------|---|---------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| ITAU | ITAU | ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI | 0,42 | 0,07 | 1,21 | 3,32 | 428.332,68 | 0,07 | 250.248.048,84 | 0,17 |
| BB | BB | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 0,42 | 0,04 | 1,20 | 3,25 | 11.988.801,41 | 1,91 | 6.754.991.755,09 | 0,18 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI | 2,55 | -0,09 | 1,49 | 4,32 | 600.169,54 | 0,10 | 1.028.999.958,58 | 0,06 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,89 | -0,13 | 1,39 | 4,37 | 2.170.459,19 | 0,35 | 6.990.840.946,14 | 0,03 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 1,76 | 0,02 | 1,21 | 3,25 | 1.414.776,37 | 0,23 | 5.074.930.034,52 | 0,03 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 1,71 | 0,01 | 1,24 | 3,37 | 16.602.539,19 | 2,65 | | |

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|-----------|--|---------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|-------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,08 | 0,06 | 1,15 | 3,08 | 43.423.725,82 | 6,92 | 15.856.812.759,76 | 0,27 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 0,12 | 0,05 | 1,12 | 3,11 | 27.001.223,83 | 4,30 | 4.244.545.130,14 | 0,64 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,09 | 0,05 | 1,16 | 3,17 | 25.450.036,79 | 4,06 | 14.298.760.943,23 | 0,18 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI | 0,08 | 0,05 | 1,16 | 2,12 | 20.423.900,11 | 3,25 | 5.527.183.481,99 | 0,37 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI | 0,08 | 0,05 | 1,13 | 3,02 | 15.771.078,76 | 2,51 | 2.908.858.412,17 | 0,54 |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a | | | 0,49 | 0,05 | 1,15 | 3,10 | 132.069.965,31 | 21,05 | | |



Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|----------|--------------------|------------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|---------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| VILA RICA | BRL DTVM | FIDC ITALIA SENIOR | 15,91 | 0,26 | 0,26 | 0,77 | 484.953,81 | 0,08 | 56.027.774,26 | 0,87 |
| Sub-total Artigo 7º V, Alínea a | | | 15,91 | 0,26 | 0,26 | 0,77 | 484.953,81 | 0,08 | | |
| Renda Fixa | | | 0,53 | 0,05 | 1,39 | 3,51 | 503.337.034,78 | 80,21 | | |

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, III, alínea “a” e Cota Sênior de FIDC, ART. 7º, V, alínea “a”, representam 80,21% da Carteira de Investimentos. (Resolução CMN n.º 4.963/21)

No trimestre avaliado a rentabilidade dos fundos de Investimento em Renda Fixa foi de 3,51%, enquanto que no ano a performance desses fundos é de 3,51%,

6.2 FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL.

RENDA VARIÁVEL 10,52%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|------------------------------|--------|--|------------------------|-------------------|--------------|--------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| BB | BB | BB AÇÕES DIVIDENDOS | 19,34 | -1,15 | -2,21 | -6,07 | 1.353.680,62 | 0,22 | 546.684.027,54 | 0,25 |
| BRAM | BEM | BRABESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | 25,68 | -1,88 | -4,61 | -10,03 | 5.004.307,60 | 0,80 | 757.942.677,27 | 0,66 |
| ITAU | ITAU | ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 20,39 | -1,59 | -3,60 | -7,25 | 684.973,96 | 0,11 | 404.778.749,37 | 0,17 |
| BB | BB | BB AÇÕES GOVERNANÇA FI | 21,60 | -1,72 | -3,50 | -7,74 | 21.372.980,89 | 3,41 | 718.755.405,54 | 2,97 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS | 21,56 | -1,79 | -3,48 | -7,27 | 6.571.626,06 | 1,05 | 604.910.874,03 | 1,09 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 18,99 | -1,14 | -1,50 | -4,43 | 12.883.955,46 | 2,05 | 847.735.550,84 | 1,52 |
| ITAU | ITAU | ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 20,09 | -1,45 | -3,93 | -8,30 | 5.580.920,27 | 0,89 | 1.537.795.489,08 | 0,36 |
| BRAM | BEM | BRABESCO F I A SELECTION | 21,32 | -1,53 | -4,02 | -7,71 | 4.895.744,39 | 0,78 | 402.856.447,05 | 1,22 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | 23,11 | -1,93 | -5,28 | -10,50 | 7.679.206,80 | 1,22 | 174.749.727,23 | 4,39 |
| Sub-total Artigo 8º I | | | 20,80 | -1,60 | -3,46 | -7,58 | 66.027.396,05 | 10,52 | | |
| Renda Variável | | | 20,80 | -1,60 | -3,46 | -7,58 | 66.027.396,05 | 10,52 | | |

Os Fundos de renda variável - AÇÕES que compõem a carteira do CaraguaPrev são compostos por FUNDOS DE AÇÕES - ART. 8º, I e representam 10,52% da Carteira de Investimentos. (Resolução CMN



n.º 4.963/21).

No trimestre avaliado a rentabilidade do FUNDO DE AÇÕES foi de -7,58%, enquanto que no ano sua performance é de -7,58%.

6.3 FUNDOS ESTRUTURADOS

| INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS | | | | | | | | | | 3,00% |
|-------------------------------------|--------|---|------------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| Artigo 10º I (Fundos Multimercados) | | | | | | | | | | |
| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP | 0,51 | 0,03 | 1,14 | 2,06 | 16.687.479,24 | 2,66 | 1.704.930.004,41 | 0,98 |
| ITAU | ITAU | ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI | 23,42 | 1,46 | 4,03 | 8,80 | 2.142.432,65 | 0,34 | 1.144.923.043,92 | 0,19 |
| Sub-total Artigo 10º I | | | 22,32 | 0,20 | 1,46 | 8,54 | 18.829.911,89 | 3,00 | | |
| Investimentos Estruturados | | | 22,32 | 0,20 | 1,46 | 8,54 | 18.829.911,89 | 3,00 | | |

O Investimento Estruturado, Fundo Multimercado - ART. 10, I, que compõem a carteira do Caraguaprev representa 3,00% da Carteira de Investimentos. (Resolução CMN n.º 4.963/21)

No trimestre avaliado a rentabilidade do FUNDO MULTIMERCADO foi de 8,54%, enquanto que no ano sua performance é de 8,54%.

6.4 FUNDOS DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | | | | | | | | | | 6,27% |
|---|-----------|--|------------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior) | | | | | | | | | | |
| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 20,91 | 0,16 | -1,43 | 0,90 | 1.201.457,73 | 0,19 | 855.551.032,35 | 0,14 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI | 22,38 | 1,13 | 5,05 | 9,44 | 1.570.403,73 | 0,25 | 348.894.587,74 | 0,45 |
| Sub-total Artigo 9º II | | | 19,13 | 0,71 | 2,14 | 5,57 | 2.771.861,46 | 0,44 | | |
| Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I) | | | | | | | | | | |
| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 25,51 | 0,87 | 3,19 | 8,45 | 36.545.224,44 | 5,82 | 2.012.391.655,50 | 1,82 |
| Sub-total Artigo 9º III | | | 25,51 | 0,87 | 3,19 | 8,45 | 36.545.224,44 | 5,82 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 24,82 | 0,86 | 3,12 | 8,24 | 39.317.085,90 | 6,27 | | |



Os Fundos de Investimento no Exterior - ART. 9º, II, e o Fundo de Ações BDR Nível I – Art. 9º, III, que compõem a carteira do CaraguaPrev representam 6,27% da Carteira de Investimentos. (*Resolução CMN n.º 4.963/21*).

No trimestre avaliado a rentabilidade do fundo de Investimento no Exterior foi de 8,24%, enquanto que no ano sua performance é de 8,24%.

7. PERSPECTIVAS

Renda Fixa: Conforme reunião de política monetária no mês março a taxa SELIC se manteve pela quinta vez consecutiva em seu percentual de 13,75%, o COPOM apresentou que diante de ambiente externo desafiador, com incertezas do mercado exterior e as problemáticas do sistema financeiro americano e europeu, há uma resiliente inflação nas grandes economias. Já no contexto brasileiro o comitê destaca um cenário de desaceleração gradual do crescimento, tendo como um vetor de baixa as incertezas sobre o arcabouço fiscal. Para o COPOM a inflação está em estágio de desinflação lenta, levando a manutenção da taxa básica de juros, visando manter a sua estratégia de estabilidade dos preços e convergência da inflação em torno da meta em 2024.

Renda Variável: A performance de preços pressionados das principais commodities vem dando espaço às perspectivas negativas para a atividade global a longo prazo. Já no cenário doméstico, os parâmetros para o novo arcabouço fiscal apresentam reações confiantes diante dos aspectos apresentados terem sido relativamente bem recebidos pelo mercado, mesmo que contenha dúvida sobre sua execução e se a nova regra será suficiente para ancorá-la as expectativas de inflação e permitir ao Banco Central iniciar o processo de flexibilização monetária, que beneficiaria os ativos de risco. Assim, é possível considerar que há grande parte dos riscos precificados, entretanto não a ponto de triggers positivos que possam impulsionar o índice diante de tantas oscilações e incertezas, sendo preciso manter uma visão neutra para o Ibovespa.

Investimentos Estruturados e Exterior: O mercado ainda segue dividido em relação ao crescimento global nos próximos meses, com a China e Europa mostrando recuperação na margem (destaque para a China), uma vez que a reabertura recente da economia chinesa visa apresentar um vetor positivo para atividades nesse ano, enquanto EUA revela uma trajetória mais clara de desaceleração do consumo, elevando sua taxa básica de juros em 0,25p.p. Já a redução dos preços de energia impactou positivamente as expectativas dos indicadores agregados de inflação no mundo, mas a resiliência dos preços de serviços não dá suporte para mudança de posicionamento das autoridades monetárias, em especial o Fed,



principalmente diante dos acontecimentos recentes do sistema bancário norte-americano refletindo em toda sua atividade econômica.

8. GERENCIAMENTO DE RISCOS - INDICADORES DE DESEMPENHO E RISCO

| | | |
|---|--|---------------------------------|
| Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% | Value-At-Risk (R\$): 6.255.721,76 | Value-At-Risk: 1,00% |
|---|--|---------------------------------|

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|---------------|
| Artigo 7º | 0,19 | 0,05 | 0,01 | 1,11 | 1,39 | 503.337.034,78 | 80,21 |
| Artigo 8º | 17,37 | 10,45 | 0,90 | -0,27 | -3,46 | 66.027.396,05 | 10,52 |
| Artigo 9º | 16,72 | 9,81 | 0,08 | 0,12 | 3,12 | 39.317.085,90 | 6,27 |
| Artigo 10º | 2,01 | 0,89 | 0,01 | 0,14 | 1,46 | 18.829.911,89 | 3,00 |
| CARAGUATATUBA | 1,92 | 1,00 | 1,00 | -0,11 | 0,96 | 627.511.428,62 | 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

CARAGUATATUBA

31/03/2023

ANÁLISE DE LIQUIDEZ

| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo |
|-----------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|-------------------|
| de 0 a 30 dias | 240.616.143,56 | 38,34 | 240.616.143,56 | 38,34 | |
| de 31 dias a 365 dias | 95.438.628,53 | 15,21 | 336.054.772,09 | 53,55 | |
| acima de 365 dias | 291.456.656,53 | 46,45 | 627.511.428,62 | 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, 38,34% da carteira de investimentos do CaraguáPrev possui liquidez de até 30 dias, que podem ser resgatados e monetizados dentro desse período de tempo.

10. MOVIMENTAÇÕES DO TRIMESTRE

| N.º | Data | Origem | Destino | Valor | Motivo |
|-----|------------|---|---|-------------------|-----------|
| 1 | 06/01/2023 | Repasso da compensação previdenciária – COMPREV 11/ 2022, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 9999-6 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | R\$ 235.543,86 | APLICAÇÃO |



| | | | | | |
|----|------------|--|---|-------------------|-----------|
| 2 | 06/01/2023 | Restituição Benefício Previdenciário de Pensionista do Caraguaprev, Banco Itaú, Ag 0248 C/C 04042-0 | FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M1 | R\$ 627,50 | APLICAÇÃO |
| 3 | 10/01/2023 | Repasso Aporte para cobertura do déficit atuarial Caraguaprev 01/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | R\$ 8.379,03 | APLICAÇÃO |
| 4 | 10/01/2023 | CEF, agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas. | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO. | R\$ 48.000,00 | RESGATE |
| 5 | 12/01/2023 | Repasso Aporte para cobertura do déficit atuarial FUNDACC 01/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | R\$ 8.784,75 | APLICAÇÃO |
| 6 | 16/01/2023 | CEF, agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas. | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | R\$ 5.000,00 | RESGATE |
| 7 | 19/01/2023 | Repasso das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal referente mês 12/2022, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0 | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | R\$ 351.710,70 | APLICAÇÃO |
| 8 | 19/01/2023 | Resgate parcial Itaú Private Multimercado SP500BRL para aplicação em FI Itaú Institucional REFERENCIADO DI, Banco Itaú, Ag 0248, C/C 04042-0 | ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | R\$ 10.000.000,00 | RESGATE |
| 9 | 20/01/2023 | Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Prefeitura Municipal mês 01/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | R\$ 1.201.288,58 | APLICAÇÃO |
| 10 | 20/01/2023 | Repasso das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal mês 12/2022, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0 | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | R\$ 3.645.212,99 | APLICAÇÃO |
| 11 | 20/01/2023 | Transferência do valor da Taxa de administração correspondente ao mês 01/2023, CEF, Ag 0797, C/C 9999-0 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | R\$ 657.778,97 | APLICAÇÃO |
| 12 | 20/01/2023 | Resgate parcial do FI ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL – CNPJ Nº 26.269.692/0001-61, Banco Itaú, Ag 0248, C/C 04042-0 | FUNDO DE INVESTIMENTO ITAÚ INSTITUCIONAL REFER. DI - CNPJ Nº 00.832.435/0001-00 | R\$ 10.000.000,00 | APLICAÇÃO |
| 13 | 23/01/2023 | Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Câmara mês 01/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | R\$ 46.721,45 | APLICAÇÃO |



| | | | | | |
|----|------------|---|---|-------------------|-----------|
| 14 | 24/01/2023 | Repasse das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal mês 12/2022, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0 | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | R\$ 602,08 | APLICAÇÃO |
| 15 | 26/01/2023 | Resgate parcial do FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO – CNPJ Nº 03.737.206/0001-97, CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FIXA - CNPJ Nº 23.215.008/0001-70 | R\$ 20.000.000,00 | APLICAÇÃO |
| 16 | 26/01/2023 | Resgate parcial do FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO – CNPJ Nº 03.737.206/0001-97, CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FIXA - CNPJ Nº 23.215.008/0001-70 | R\$ 20.000.000,00 | RESGATE |
| 17 | 26/01/2023 | Resgate total do FUNDO DE INVESTIMENTO ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO – CNPJ 05.073.656/0001-58, Banco Itaú, Ag 0248, C/C 04042-0 | FUNDO DE INVESTIMENTO FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP – CNPJ 14.120.520/0001-42 | R\$ 695.723,08 | RESGATE |
| 18 | 26/01/2023 | Resgate total do FUNDO DE INVESTIMENTO ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA – CNPJ 21.838.150/0001-49, Banco Itaú, Ag 0248, C/C 04042-0 | FUNDO DE INVESTIMENTO FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP – CNPJ 14.120.520/0001-42 | R\$ 2.665.507,45 | RESGATE |
| 19 | 26/01/2023 | Resgate parcial do FUNDO DE INVESTIMENTO ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI – CNPJ Nº 26.269.692/0001-6, Banco Itaú, Ag 0248, C/C 04042-0 | FUNDO DE INVESTIMENTO FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP – CNPJ 14.120.520/0001-42 | R\$ 13.000.000,00 | RESGATE |
| 20 | 27/01/2023 | Aplicação do resgate total FUNDO DE INVESTIMENTO ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO, ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA e parcial do ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI do Banco Itaú, Ag 0248-0, C/C 04042-0 | FUNDO DE INVESTIMENTO FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP – CNPJ 14.120.520/0001-42 | R\$ 16.351.230,53 | APLICAÇÃO |
| 21 | 30/01/2023 | Aquisição de títulos públicos com resgate parcial do FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - CNPJ n.º 03.737.206/0001-97, CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 | COMPRA DE TITULOS PUBLICOS NTN-B 760199 | R\$ 20.000.954,27 | APLICAÇÃO |
| 22 | 30/01/2023 | Repasse das contribuições previdenciárias do CaraguaPrev patronal e servidor mês 01/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0 | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | R\$ 30.873,99 | APLICAÇÃO |



| | | | | | |
|----|------------|---|---|-------------------|-----------|
| 23 | 30/01/2023 | Resgate parcial do FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - CNPJ n.º 03.737.206/0001-97 para compra de títulos públicos, CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 | COMPRA DE TITULOS PUBLICOS NTN-B 760199 | R\$ 20.000.954,27 | RESGATE |
| 24 | 30/01/2023 | Resgate pagamento dos aposentados e pensionistas do CaraguaPrev referente mês 01/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | R\$ 3.607.576,07 | RESGATE |
| 25 | 30/01/2023 | Resgate para folha de pagamento dos servidores ativos referente mês 01/2023, CEF, Ag 0797 C/C 9999-0 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | R\$ 224.103,40 | RESGATE |
| 26 | 31/01/2023 | Repasse das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal e Câmara Municipal - aposentados e pensionistas referente ao mês 01/2023, Itaú, Ag 0248 C/C 04042-0 | FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | R\$ 2.067,58 | APLICAÇÃO |
| 27 | 01/02/2023 | Repasse das contribuições previdenciárias da Câmara Municipal referente mês 01/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0 | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | R\$ 94.048,71 | APLICAÇÃO |
| 28 | 02/02/2023 | CEF, agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento de despesas previdenciárias. | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO. | R\$ 3.738,06 | RESGATE |
| 29 | 02/02/2023 | Restituição Benefício Previdenciário de Pensionista do CaraguaPrev, Banco Itaú, Ag 0248 C/C 04042-0 | FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M1 | R\$ 642,19 | APLICAÇÃO |
| 30 | 03/02/2023 | Resgate parcial do ITAU RF REF DI - CNPJ N° 00.832.435/0001-00, Banco Itaú, Agência 0248-0, C/C 04042-0 | COMPRA DE TITULOS PUBLICOS NTN-B 760199 | R\$ 30.001.506,13 | RESGATE |
| 31 | 06/02/2023 | Aquisição de títulos públicos com resgate parcial do ITAU RF REF DI - CNPJ N° 00.832.435/0001-00, Banco Itaú, Agência 0248-0, C/C 04042-0 | COMPRA DE TITULOS PUBLICOS NTN-B 760199 | R\$ 14.999.539,65 | APLICAÇÃO |
| 32 | 06/02/2023 | Aquisição de títulos públicos com resgate parcial do ITAU RF REF DI - CNPJ N° 00.832.435/0001-00, Banco Itaú, Agência 0248-0, C/C 04042-0 | COMPRA DE TITULOS PUBLICOS NTN-B 760199 | R\$ 15.001.966,48 | APLICAÇÃO |
| 33 | 07/02/2023 | Repasse da compensação previdenciária – COMPREV 12/2022, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 9999-6 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | R\$ 246.385,24 | APLICAÇÃO |
| 34 | 07/02/2023 | Repasse das contribuições previdenciárias da FUNDACC referente mês 01/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0 | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | R\$ 30.143,45 | APLICAÇÃO |



CARAGUAPREV

Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba
Estado de São Paulo



CERTIFICADO
Pró-Gestão

ICo BRASIL RPPS SPREV



| | | | | | |
|----|------------|---|---|---------------------|-----------|
| 35 | 10/02/2023 | Repasso Aporte para cobertura do déficit atuarial CaraguaPrev 02/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | R\$ 8.379,03 | APLICAÇÃO |
| 36 | 10/02/2023 | CEF, agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas. | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO. | R\$ 62.000,00 | RESGATE |
| 37 | 15/02/2023 | Aplicação de recebimento de cupons das NTN-B no fundo de investimento CAIXA BRASIL RF REF DI LP CNPJ N° 03.737.206/0001-97 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO. | R\$ 4.738.995,60 | APLICAÇÃO |
| 38 | 17/02/2023 | Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Prefeitura Municipal referente mês 02/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | R\$ 1.201.288,58 | APLICAÇÃO |
| 39 | 17/02/2023 | Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da FUNDACC referente mês 02/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | R\$ 8.784,81 | APLICAÇÃO |
| 40 | 17/02/2023 | Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Câmara Municipal referente mês 02/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | R\$ 46.721,45 | APLICAÇÃO |
| 41 | 17/02/2023 | Repasso das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal referente mês 01/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0 | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | R\$ 4.254.919,47 | APLICAÇÃO |
| 42 | 17/02/2023 | Aplicação da Taxa de Administração no Fundo de Investimento CAIXA BRASIL REF DI LP CNPJ N° 03.737.206/0001-97, CEF, Ag 0797 CC 9999-0 | CAIXA BRASIL REF DI LONGO PRAZO | R\$ 657.778,97 | APLICAÇÃO |
| 43 | 27/02/2023 | Repasso das contribuições previdenciárias do caraguaprev patronal e servidor referente ao mês 02/2023 | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | R\$ 29.454,30 | APLICAÇÃO |
| 44 | 27/02/2023 | Resgate pagamento dos aposentados e pensionistas do CaraguaPrev referente mês 02/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | R\$ 3.652.381,37 | RESGATE |
| 45 | 27/02/2023 | Resgate para folha de pagamento dos servidores ativos referente mês 02/2023, CEF, Ag 0797 C/C 9999-0 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | R\$ 204.070,21 | RESGATE |
| 46 | 28/02/2023 | Repasso das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal e Câmara Municipal - aposentados e pensionistas referente ao mês 02/2023, Itaú, Ag 0248 C/C 04042-0 | FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | R\$ 2.067,58 | APLICAÇÃO |



| | | | | | |
|----|------------|--|---|---------------------|-----------|
| 47 | 01/03/2023 | Repasse das contribuições previdenciárias da Câmara Municipal referente mês 02/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0 | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | R\$ 94.175,97 | APLICAÇÃO |
| 48 | 02/03/2023 | Repasse das contribuições previdenciárias da FUNDACC referente mês 02/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0 | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | R\$ 31.924,86 | APLICAÇÃO |
| 49 | 03/03/2023 | Restituição Benefício Previdenciário de Pensionista do CaraguaPrev, Banco Itaú, Ag 0248 C/C 04042-0 | FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M1 | R\$ 872,35 | APLICAÇÃO |
| 50 | 06/03/2023 | CEF, agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas. | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO. | R\$ 5.231,66 | RESGATE |
| 51 | 08/03/2023 | Repasse da compensação previdenciária – COMPREV 01/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 9999-6 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | R\$ 233.892,08 | APLICAÇÃO |
| 52 | 10/10/2023 | Repasse Aporte para cobertura do déficit atuarial CaraguaPrev 03/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | R\$ 8.379,03 | APLICAÇÃO |
| 53 | 10/10/2023 | Resgate Financeiro - Pagamento de precatórios do ano de 2023 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO. | R\$ 564.535,81 | RESGATE |
| 54 | 16/03/2023 | CEF, agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas. | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO. | R\$ 66.000,00 | RESGATE |
| 55 | 17/03/2023 | Repasse Aporte para cobertura do déficit atuarial FUNDACC 03/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | R\$ 8.784,78 | APLICAÇÃO |
| 56 | 17/03/2023 | Repasse do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Prefeitura Municipal mês 03/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | R\$ 1.201.288,58 | APLICAÇÃO |
| 57 | 17/03/2023 | Repasse das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal referente mês 02/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0 | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | R\$ 4.210.822,67 | APLICAÇÃO |
| 58 | 17/03/2023 | Aplicação - Taxa de administração referente mês 03/2023 - CEF, Ag 0797, C/C 9999-0 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | R\$ 657.778,97 | APLICAÇÃO |



| | | | | | |
|----|------------|---|--|------------------|-----------|
| 59 | 20/03/2023 | Resgate financeiro - Pagamento de requisição de pequeno valor - CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | R\$ 9.553,69 | RESGATE |
| 60 | 21/03/2023 | Repasse do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Câmara mês 03/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4 | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI | R\$ 46.721,45 | APLICAÇÃO |
| 61 | 28/03/2023 | Repasse das contribuições previdenciárias da Câmara Municipal referente mês 03/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0 | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | R\$ 104.701,32 | APLICAÇÃO |
| 62 | 30/03/2023 | Repasse das contribuições previdenciárias do CaraguaPrev patronal e servidor mês 03/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0 | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | R\$ 30.212,65 | APLICAÇÃO |
| 63 | 30/03/2023 | Pagamento de rescisão de pensionista do CaraguaPrev, referente mês 03/2023 | CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP | R\$ 1.611,67 | RESGATE |
| 64 | 30/03/2023 | Resgate pagamento dos aposentados e pensionistas do CaraguaPrev referente mês 03/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0 | CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP | R\$ 3.715.026,45 | RESGATE |
| 65 | 30/03/2023 | Resgate para folha de pagamento dos servidores ativos referente mês 03/2023, CEF, Ag 0797 C/C 9999-0 | CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP | R\$ 184.889,72 | RESGATE |
| 66 | 31/03/2023 | Repasse das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal e Câmara Municipal - aposentados e pensionistas referente ao mês 03/2023, Itaú, Ag 0248 C/C 04042-0 | FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | R\$ 2.067,58 | APLICAÇÃO |

Segue descritivo completo movimentações financeiras entre fundos de investimentos e títulos públicos federais:

1. RESGATE de R\$ 20.000.000,00 (vinte milhões de reais) do Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97, Caixa Econômica Federal, ag. 0797, c/c 1000-0, em 26/01/2023, para APLICAÇÃO de R\$ 20.000.000,00 (vinte milhões de reais) no Fundo de Investimento CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FIXA, CNPJ: 23.215.008/0001-70, Caixa Econômica Federal, ag. 0797, c/c 1000-0, em 26/01/2023.
2. RESGATE TOTAL de R\$ 2.655.507,45 (dois milhões e seiscentos e cinquenta e cinco mil e quinhentos e sete reais e quarenta e cinco centavos) do Fundo de Investimento ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA, CNPJ: 21.838.150/0001-49, Banco Itaú, em



- 27/01/2023, para APLICAÇÃO de R\$ 2.655.507,45 (dois milhões e seiscentos e cinquenta e cinco mil e quinhentos e sete reais e quarenta e cinco centavos) no Fundo de Investimento FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP, CNPJ: 14.120.520/0001-42, Caixa Econômica Federal, ag. 0797, c/c 1000-0, em 27/01/2023.
3. RESGATE TOTAL de R\$ 695.723,08 (seiscentos e noventa e cinco mil e setecentos e vinte e três reais e oito centavos) do Fundo de Investimento ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RF, CNPJ: 05.073.656/0001-58, Banco Itaú, em 27/01/2023, para APLICAÇÃO de R\$ 695.723,08 (seiscentos e noventa e cinco mil e setecentos e vinte e três reais e oito centavos) no Fundo de Investimento FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP, CNPJ: 14.120.520/0001-42, Caixa Econômica Federal, ag. 0797, c/c 1000-0, em 27/01/2023.
 4. RESGATE de R\$ 20.000.954,27 (vinte milhões e novecentos e cinquenta e quatro reais e dezessete centavos) do Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97, Caixa Econômica Federal, ag. 0797, c/c 1000-0, em 30/01/2023, para COMPRA de 4.871 NTN-B, R\$ 20.000.954,27 (vinte milhões e novecentos e cinquenta e quatro reais e dezessete centavos), no dia 30/01/2023, para o vencimento de 15/08/2024, a taxa de 6,442%;
 5. RESGATE de R\$ 10.000.000,00 (dez milhões de reais) do Fundo de Investimento ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO S&P 500 BRL FIC FI, CNPJ: 26.269.692/0001-61, Banco Itaú, em 20/01/2023, para APLICAÇÃO de R\$ 10.000.000,00 (dez milhões de reais) no Fundo de Investimento ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI, CNPJ: 00.832.435/0001-00, Banco Itaú, em 20/01/2023.
 6. RESGATE de R\$ 13.000.000,00 (treze milhões de reais) do Fundo de Investimento ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO S&P 500 BRL FIC FI, CNPJ: 26.269.692/0001-61, Banco Itaú, em 27/01/2023, para APLICAÇÃO de R\$ 13.000.000,00 (treze milhões de reais) no Fundo de Investimento FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP, CNPJ: 14.120.520/0001-42, Caixa Econômica Federal, ag. 0797, c/c 1000-0, em 27/01/2023.
 7. RESGATE de R\$ 30.001.506,13 (trinta milhões e um mil e quinhentos e seis reais e treze centavos) do Fundo de Investimento ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI, CNPJ: 00.832.435/0001-00, Banco Itaú, em 03/02/2023, para COMPRA de R\$ 14.999.539,65 (quatorze milhões e novecentos e noventa e nove mil, quinhentos e trinta e nove reais e sessenta e cinco centavos) em Títulos Públicos Federais NTN-B – 15/08/2026, taxa 6,353%, quantidade 3.661, em 06/02/2023 e COMPRA de R\$ 15.001.966,48 (quinze milhões, e um mil novecentos e sessenta



e seis reais e quarenta e oito centavos) em Títulos Públicos Federais NTN-B – 15/08/2028, taxa 6,353%, quantidade 3.678, em 06/02/2023.

11. EXECUÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

A tabela abaixo descreve os limites de aplicação por artigo da Resolução CMN 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.

Ainda de acordo com os normativos, os investimentos do CaraguaPrev estão em aderência com a Política de Investimentos e de acordo com a Resolução do Conselho Monetário Nacional.

A Política Anual de Investimentos traz, em seu contexto principal, os limites de alocação em ativos de Renda Fixa, Renda Variável, Investimentos no Exterior, Investimentos Estruturados em consonância com a legislação vigente. Além destes limites, vedações específicas visam dotar os gestores de orientações quanto à alocação dos recursos financeiros em produtos e ativos adequados ao perfil e as necessidades atuariais do Instituto.

Essa alocação tem como intuito determinar a alocação estratégica a ser perseguida ao longo do exercício da Política de Investimento que melhor reflita as necessidades do passivo e durante a sua vigência, os seus procedimentos serão alterados gradativamente, de forma a evitar perdas de rentabilidade ou exposição desnecessária a riscos.

O CaraguaPrev aplicou os seus recursos obedecendo os segmentos de alocação determinados na Política de investimentos, não há investimento diverso.

Portanto, a Política de Investimentos é um instrumento de balizamento e determinou os segmentos dos investimentos a serem alocados com os recursos do CaraguaPrev e os seus limites de alocação, limite mínimo, alocação objetivo e limite superior.



Enquadramento da Carteira

| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Política de Investimentos | | | Pró-Gestão Nivel 1 | |
|-----------------------------------|---|-----------------------|---------------|---------------------------|----------|--------|--------------------|--------------|
| | | | | Mínimo | Objetivo | Máximo | ALM | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea a | Titulos do Tesouro Nacional | 354.179.576,47 | 56,44 | 0,00 | 50,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Titulos Públicos | 16.602.539,19 | 2,65 | 0,00 | 11,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa | 132.069.965,31 | 21,05 | 0,00 | 25,00 | 60,00 | 0,00 | 65,00 |
| Artigo 7º V, Alínea a | FIDC Cota Sênior | 484.953,81 | 0,08 | 0,00 | 0,10 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | Total Renda Fixa | 503.337.034,78 | 80,21 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável | | | | | | | | |
| Artigo 8º I | Fundos de Ações | 66.027.396,05 | 10,52 | 0,00 | 5,00 | 30,00 | 0,00 | 35,00 |
| | Total Renda Variável | 66.027.396,05 | 10,52 | | | | | 35,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | | |
| Artigo 9º II | Fundos de Investimento no Exterior | 2.771.861,46 | 0,44 | 0,00 | 0,90 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 9º III | Fundos de Ações - BDR Nivel I | 36.545.224,44 | 5,82 | 0,00 | 4,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 39.317.085,90 | 6,27 | | | | | 10,00 |
| Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 10º I | Fundos Multimercados | 18.829.911,89 | 3,00 | 0,00 | 4,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos Estruturados | 18.829.911,89 | 3,00 | | | | | 15,00 |
| Total | | 627.511.428,62 | 100,00 | | | | | |

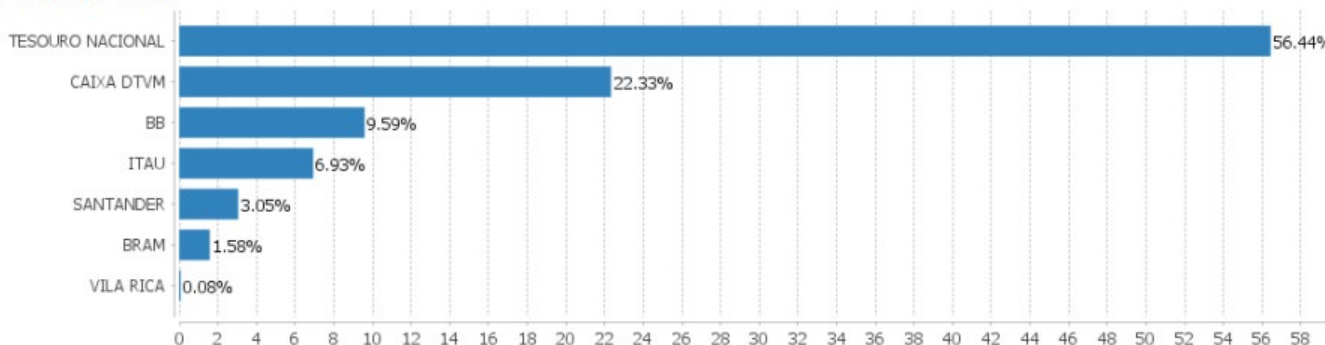
Registre-se que no dia 29/03/2023 foi alterada a Política de Investimentos do CaraguaPrev, adequando a taxa anual de juros para 5,03%, de acordo com o critério estabelecido pela Portaria ME nº 6.132/2021 e disposto na Portaria MF nº 1.467, de 02 de junho de 2022, a taxa de desconto atuarial efetiva máxima real admitida nas projeções atuariais será a resultante do disposto no Art. 2º do Anexo VII, estando em conformidade com a Avaliação Atuarial para 2023.

12. RELAÇÃO DE GESTORES DOS RECURSOS



| Gestor | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financeiro Mês (R\$) |
|------------------|----------------|--------------|---------------|-------------|----------------|--------------------------------|
| BB | 59.046.148,29 | 1.499.065,92 | 0,00 | 0,00 | 60.165.499,71 | -379.714,50 |
| BRAM | 10.346.544,55 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9.900.051,99 | -446.492,56 |
| CAIXA DTVM | 137.865.472,67 | 5.129.616,44 | -4.546.849,00 | 0,00 | 140.121.146,69 | 1.672.906,58 |
| ITAU | 43.808.293,60 | 2.939,93 | 0,00 | 0,00 | 43.517.090,19 | -294.143,34 |
| SANTANDER | 18.899.930,10 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 19.143.109,76 | 243.179,66 |
| TESOURO NACIONAL | 348.982.113,33 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 354.179.576,47 | 5.197.463,14 |
| VILA RICA | 483.685,10 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 484.953,81 | 1.268,71 |

Alocação por Gestor



13. RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV. MARÇO/2023

| FUNDO | CNPJ | VALOR | % RECURSOS | GESTOR | ADMINISTRADOR |
|--|--------------------|---------------|------------|-------------------------|-------------------------|
| BB PREV RF IRF-M 1 | 11.328.882/0001-35 | 273.186,74 | 0,0435 | BANCO DO BRASIL | BANCO DO BRASIL |
| BB PREV RF IRF-M 1 (APORTES 37299-4) | 11.328.882/0001-35 | 11.715.614,67 | 1,8670 | BANCO DO BRASIL | BANCO DO BRASIL |
| CEF FI BRASIL IDKA2 | 14.386.926/0001-71 | 2.170.459,19 | 0,3459 | CAIXA DTVM | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| SANTANDER IMA-B5 PREMIUM FIC RF | 13.455.117/0001-01 | 600.169,54 | 0,0956 | SANTANDER BRASIL GESTÃO | SANTANDER |
| CEF FIC BR GESTAO ESTRATEGICA C/C 1000-0 | 23.215.097/0001-55 | 1.414.776,37 | 0,2255 | CAIXA DTVM | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |



CARAGUAPREV

Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba
Estado de São Paulo



| | | | | | |
|--|--------------------|----------------------|--------|-------------------------|-------------------------|
| ITAU INSTITUCIONAL RF IRF-M 1 | 08.703.063/0001-16 | 428.332,68 | 0,0683 | ITAÚ UNIBANCO | ITAÚ UNIBANCO |
| FIDC FECHADO MULTISSETORIAL ITALIA | 13.990.000/0001-28 | 484.953,81 | 0,0773 | ITAÚ UNIBANCO | ITAÚ UNIBANCO |
| CEF FI BRASIL REF DI LP 9999-0 (TX ADMINISTRATIVA) | 03.737.206/0001-97 | 12.690.811,03 | 2,0224 | CAIXA DTVM | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| CEF FI BRASIL REF DI LP 1000-0 | 03.737.206/0001-97 | 30.732.914,79 | 4,8976 | CAIXA DTVM | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| CAIXA FI BRASIL MATRIZ RF | 23.215.008/0001-70 | 20.423.900,11 | 3,2547 | CAIXA DTVM | ITAÚ UNIBANCO |
| ITAU INSTIT RF DI | 00.832.435/0001-00 | 27.001.223,83 | 4,3029 | ITAÚ UNIBANCO | ITAÚ UNIBANCO |
| BB PREV RF PERFIL | 13.077.418/0001-49 | 3.700.507,67 | 0,5897 | BANCO DO BRASIL | BANCO DO BRASIL |
| BB PREV RF PERFIL (APORTES 37299-4) | 13.077.418/0001-49 | 21.749.529,12 | 3,2547 | BANCO DO BRASIL | BANCO DO BRASIL |
| SANTANDER DI INSTITUCIONAL PREMIUM | 02.224.354/0001-45 | 15.771.078,76 | 2,5133 | SANTANDER BRASIL GESTÃO | SANTANDER |
| BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI | 10.418.335/0001-88 | 21.372.980,89 | 3,4060 | BANCO DO BRASIL | BANCO DO BRASIL |
| BB DIVIDENDOS FIC FIA | 05.100.191/0001-87 | 1.353.680,62 | 0,2157 | BANCO DO BRASIL | BANCO DO BRASIL |
| FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS 9999-0 | 15.154.441/0001-15 | 12.883.955,46 | 2,0532 | CAIXA DTVM | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| FIC AÇÕES EXPERT VINCI VALOR RPPS | 14.507.699/0001-95 | 6.571.626,06 | 1,0473 | CAIXA DTVM | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| ITAU FOF RPI AÇÕES IBOBESPA ATIVO FIC FIA | 08.817.414/0001-10 | 684.973,96 | 0,1092 | ITAÚ DTVM S.A | ITAÚ UNIBANCO |
| ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC | 24.571.992/0001-75 | 5.580.920,27 | 0,8894 | ITAÚ UNIBANCO | ITAÚ UNIBANCO |
| ITAU ACOES MOMENTO 30 II FIC | 42.318.981/0001-60 | 7.679.206,80 | 1,2238 | ITAÚ UNIBANCO | ITAÚ UNIBANCO |
| BRADESCO FIA SELECTION | 03.660.879/0001-96 | 4.895.744,39 | 0,7802 | BEM DTVM LTDA | BRADESCO |
| BRADESCO FIA SMALL CAP PLUS | 06.988.623/0001-09 | 5.004.307,60 | 0,7975 | BEM DTVM LTDA | BRADESCO |
| FIA CAIXA INSTIT BDR NIVEL I | 17.502.937/0001-68 | 36.545.224,44 | 5,8238 | CAIXA DTVM | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL | 26.269.692/0001-61 | 2.142.432,65 | 0,3414 | ITAÚ UNIBANCO | ITAÚ UNIBANCO |
| CAIXA FI JUROS E MOEDAS | 14.120.520/0001-42 | 16.687.479,24 | 2,6593 | CAIXA DTVM | CAIXA ECONÔMICA FEDERAL |
| SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG | 34.258.351/0001-19 | 1.570.403,73 | 0,2503 | SANTANDER BRASIL GESTÃO | SANTANDER |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR | 17.804.792/0001-50 | 1.201.457,73 | 0,1915 | SANTANDER BRASIL GESTÃO | SANTANDER |



| | | | | |
|----------------------------|--|-----------------------|----------------|--|
| Total em Bancos R\$ | | 273.331.852,15 | 43,5581 | |
|----------------------------|--|-----------------------|----------------|--|

| TITULOS PUBLICOS FEDERAIS | | VALOR INVESTIDO | % RECURSOS | % POR ADEQUAÇÃO | LIMITE P. INVEST CARAGUA PREV |
|------------------------------|--------|-----------------|------------|-----------------|-------------------------------|
| NTN-B - 15/05/2023 (5,90%) | 10.000 | 41.755.810,80 | 6,6542 | 56,4419 | 50,0% |
| NTN-B - 15/05/2035 (5,56%) | 3.900 | 16.899.560,20 | 2,6931 | | |
| NTN-B - 15/08/2040 (5,65%) | 213 | 910.155,23 | 0,1450 | | |
| NTN-B - 15/08/2050 (5,713%) | 2.514 | 10.760.803,98 | 1,7148 | | |
| NTN-B - 15/05/2045 (5,71%) | 7.457 | 32.266.562,31 | 5,1420 | | |
| NTN-B - 15/05/2045 (5,76%) | 2.494 | 10.728.130,38 | 1,7096 | | |
| NTN-B - 15/05/2045 (5,781%) | 2.496 | 10.710.225,22 | 1,7068 | | |
| NTN-B - 15/05/2030 (5,708%) | 2.555 | 10.697.131,56 | 1,7047 | | |
| NTN-B - 15/08/2040 (5,77%) | 2.538 | 10.709.357,99 | 1,7066 | | |
| NTN-B - 15/08/2050 (5,815%) | 2.530 | 10.684.512,87 | 1,7027 | | |
| NTN-B - 15/05/2055 (5,815%) | 2.490 | 10.685.495,80 | 1,7028 | | |
| NTN-B - 15/05/2035 (5,821%) | 4.657 | 19.753.154,54 | 3,1479 | | |
| NTN-B - 15/08/2024 (5,892%) | 1.315 | 5.416.959,91 | 0,8632 | | |
| NTN-B - 15/08/2050 (5,916%) | 920 | 3.834.212,21 | 0,6110 | | |
| NTN-B - 15/05/2023 (5,831%) | 5.021 | 20.967.109,14 | 3,3413 | | |
| NTN-B - 15/08/2050 (5,780%) | 2.451 | 10.398.684,89 | 1,6571 | | |
| NTN-B - 15/05/2055 (5,852%) | 2.420 | 10.332.315,15 | 1,6466 | | |
| NTN-B - 15/08/2050 (5,922%) | 2.466 | 10.269.313,65 | 1,6365 | | |
| NTN-B - 15/08/2024 (6,4750%) | 5.073 | 20.746.324,26 | 3,3061 | | |
| NTN-B - 15/05/2025 (5,9752%) | 2.476 | 10.344.226,33 | 1,6485 | | |
| NTN-B - 15/08/2024 (5,91%) | 2.486 | 10.238.042,89 | 1,6315 | | |
| NTN-B - 15/08/2024 (6,09%) | 1.244 | 5.112.096,15 | 0,8147 | | |
| NTN-B - 15/05/2027 (6,09%) | 1.228 | 5.111.815,10 | 0,8146 | | |
| NTN-B - 15/08/2024 (6,68%) | 1.253 | 5.111.199,57 | 0,8145 | | |
| NTN-B - 15/08/2024 (6,44%) | 4.871 | 19.928.404,97 | 3,1758 | | |
| NTN-B - 15/08/2026 (6,353%) | 3.661 | 14.903.775,31 | 2,3751 | | |
| NTN-B - 15/08/2028 (6,353%) | 3.678 | 14.904.196,06 | 2,3751 | | |

| | | | | |
|-------------------------------|--|-----------------------|----------------|--|
| Total Títulos Públicos | | 354.179.576,47 | 56,4419 | |
|-------------------------------|--|-----------------------|----------------|--|

| | | | | |
|--------------------|--|-----------------------|-----------------|--|
| Total Geral | | 627.511.428,62 | 100,0000 | |
|--------------------|--|-----------------------|-----------------|--|



14. RENTABILIDADE POR ARTIGO DA RESOLUÇÃO CMN DO TRIMESTRE AVALIADO.

CARAGUATATUBA

31/03/2023

RENTABILIDADES POR ARTIGO

| Estratégia Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | Atribuição Desemp. (%) | No Trimestre(R\$) |
|-------------------------------------|----------------|----------------|----------------|-------------------|-------------------|---------------------|------------------------|----------------------|
| Artigo 7º I, Alínea a % do CDI | 1,49 126,79 | 3,69 113,39 | 3,69 113,39 | 6,31 96,24 | 11,60 87,38 | 5.197.463,14 | 0,83 | 12.033.947,48 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 1,24 105,16 | 3,37 103,67 | 3,37 103,67 | 5,85 89,26 | 9,90 74,57 | 202.594,82 | 0,03 | 565.793,21 |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | 1,15 97,60 | 3,10 95,29 | 3,10 95,29 | 6,44 98,32 | 13,15 99,02 | 1.500.553,35 | 0,24 | 4.324.715,73 |
| Artigo 7º V, Alínea a % do CDI | 0,26 22,33 | 0,77 23,59 | 0,77 23,59 | -13,53 -206,54 | -13,32 -100,28 | 1.268,71 | 0,00 | 3.689,92 |
| Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p. | -3,46 -0,55 | -7,58 -0,43 | -7,58 -0,43 | -9,83 -2,42 | -16,65 -1,55 | -2.366.001,19 | -0,38 | -5.418.947,11 |
| Artigo 9º II % do CDI | 2,14 181,92 | 5,57 171,31 | 5,57 171,31 | 14,17 216,31 | -2,02 -15,22 | 57.993,05 | 0,01 | 146.212,72 |
| Artigo 9º III % do CDI | 3,19 271,66 | 8,45 260,06 | 8,45 260,06 | 12,27 187,23 | -3,59 -27,00 | 1.130.126,75 | 0,18 | 2.848.489,93 |
| Artigo 10º I % do CDI | 1,46 124,06 | 8,54 262,83 | 8,54 262,83 | 19,13 292,01 | -1,33 -9,99 | 270.469,06 | 0,04 | 1.414.943,48 |
| Artigo 7º | 1,39 | | 3,51 | 6,35 | 11,45 | 6.901.880,02 | 1,11 | 0,00 |
| Artigo 8º | -3,46 | | -7,58 | -9,83 | -16,65 | -2.366.001,19 | -0,38 | 0,00 |
| Artigo 9º | 3,12 | | 8,24 | 12,40 | -3,48 | 1.188.119,80 | 0,19 | 0,00 |
| Artigo 10º | 1,46 | | 8,54 | 19,13 | -1,33 | 270.469,06 | 0,04 | 0,00 |
| CARAGUATATUBA | | | | | | 5.994.467,69 | 0,96 | 15.918.845,36 |



15. 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.

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.

16. CONCLUSÃO

Quanto ao desempenho das aplicações financeiras do CaraguaPrev do 1º trimestre de 2023, 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

Caraguatatuba/SP, 27 de abril de 2023.

Ivone Cardoso Vicente Alfredo
Membro do Comitê



Pedro Ivo de Sousa Tau
Presidente do CaraguaPrev
Certificado ANBIMA CPA-10



Rosemeire Maria de Jesus
Membro do Comitê
Certificado ANBIMA CPA-10



Adriana Zambotto Fernandes
Membro do Comitê
Certificado ANBIMA CPA-10





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 **1º TRIMESTRE de 2023**, 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, 27 de abril de 2023.

Cristiano Paulo Silva
Presidente do Conselho Fiscal



Adriana Zambotto Fernandes
Membro do Conselho Fiscal
Certificado ANBIMA CPA-10



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



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 **1º TRIMESTRE de 2023**, 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, 27 de abril de 2023.

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



Ivone Cardoso Vicente Alfredo
Membro do Conselho Deliberativo



Ronaldo Cheberle
Membro do Conselho Deliberativo



Gilceli de Oliveira Ubiña
Membro do Conselho Deliberativo



Ivy Monteiro Malerba
Membro do Conselho Deliberativo



Marcia Denise Gusmão Coelho
Membro do Conselho Deliberativo

