



INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICÍPIO DE CARAGUATATUBA/SP

CARAGUAPREV

AVALIAÇÃO FINANCEIRA

2º 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	12
6.	RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS.....	13
7.	PERSPECTIVAS	17
8.	GERENCIAMENTO DE RISCOS - INDICADORES DE DESEMPENHO E RISCO	18
9.	TABELA DE LIQUIDEZ	19
10.	MOVIMENTAÇÕES DO TRIMESTRE.....	20
11.	EXECUÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS.....	28
12.	RELAÇÃO DE GESTORES DOS RECURSOS.....	30
13.	RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV. JUNHO/2023.....	30
14.	RENTABILIDADE POR ARTIGO DA RESOLUÇÃO CMN DO TRIMESTRE AVALIADO.....	33
15.	PRÓ GESTÃO – NÍVEL 1	34
16.	CONCLUSÃO.....	34



RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

2º 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);
- Valeria Regina Rodrigues De Lima (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

ABRIL

GERAL: O mês de abril foi relativamente calmo no cenário global, depois do mês de março dominado pelos receios de uma crise bancária sistêmica. Ainda há uma leitura cautelosa, especialmente pela perspectiva mais desfavorável para as economias desenvolvidas, onde a inflação elevada e os juros restritivos sugerem crescimento fraco e alto grau de incerteza.

BRASIL: No Brasil, a carteira de investimentos do CaraguaPrev em renda fixa, investimentos estruturados, investimentos renda variável e exterior, apresentaram performance positivas no mês, já os em investimentos em BDR apresentaram performance negativa. O IPCA avançou 0,61% (M/M) em abril. Com o resultado da última reunião do COPOM apresentando a manutenção da taxa Selic em 13,75%. No Brasil, a melhora na percepção sobre os riscos fiscais domésticos contribuiu para uma redução das taxas de juros em vértices mais longos da curva, com a valorização do Real amplificando esse sentimento. Apesar disso, o Banco Central enfrenta um ambiente inflacionário bastante desafiador. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo o movimento dos índices internacionais e sendo favorecido pela queda dos juros locais. Apresentando um retorno positivo de 2,50% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento negativo anual de -4,83% e de -3,19% nos últimos 12 meses.

MAIO

GERAL: Ao longo do mês de maio os ecos da crise bancária americana, iniciada em meados de março, se dissiparam. Além disso, a volatilidade no segmento de renda fixa permaneceu alta, com especial destaque para o mercado americano. Ainda há uma leitura cautelosa, especialmente pela perspectiva mais desfavorável para as economias desenvolvidas, onde a inflação elevada e os



juros restritivos sugerem crescimento fraco e alto grau de incerteza.

BRASIL: A carteira de investimentos do CaraguaPrev em renda fixa, investimentos estruturados, investimentos renda variável, investimentos no exterior e BDR apresentaram performance positivas no mês. O IPCA avançou 0,23% (M/M) em maio. Com o resultado da última reunião do COPOM apresentando a manutenção da taxa Selic em 13,75%. No Brasil, dado o alívio nas expectativas de inflação para este ano e o avanço na aprovação do novo arcabouço fiscal, observamos queda ao longo da curva de juros locais. Adicionalmente, a atividade econômica continuou a dar sinais mais fortes, o que foi ratificado pelo crescimento de 1,9% do PIB do primeiro trimestre. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo o movimento dos índices internacionais. Apresentando um retorno positivo de 3,47% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento negativo anual de -1,28% e de -2,71% nos últimos 12 meses.

JUNHO

GERAL: Ao longo do mês de junho, permaneceu a visão de um cenário internacional ainda desafiador. A inflação nas principais economias desenvolvidas continua elevada e acima da meta, com o processo de desinflação ocorrendo em ritmo mais lento. Adicionalmente, o mercado de trabalho apertado apresenta risco para a desinflação prevista. Ainda há uma leitura cautelosa, especialmente pela perspectiva mais desfavorável para as economias desenvolvidas, onde a inflação elevada e os juros restritivos sugerem crescimento fraco e alto grau de incerteza.

BRASIL: A carteira de investimentos do CaraguaPrev em renda fixa, investimentos estruturados, investimentos renda variável, investimentos no exterior BDR apresentaram performance positivas no mês. O IPCA recuou -0,08% (M/M) em junho e a última reunião do COPOM manteve a taxa Selic em 13,75%. No Brasil, houve a queda dos juros que foi sustentada pelo alívio nas expectativas de inflação para este ano, a aprovação do novo arcabouço fiscal e a manutenção da meta de inflação para os próximos anos. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, devido ao sentimento gerado pela queda dos juros futuros e a aprovação do novo arcabouço fiscal. Apresentando um retorno positivo de 9,00% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de 7,61% e de 19,83% nos últimos 12 meses.



3. BOLETIM FOCUS

Mediana - Agregado	2023							2024							2025				
	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. **
IPCA (variação %)	5,69	5,06	4,98	▼ (7)	153	4,92	81	4,12	3,98	3,92	▼ (5)	151	3,90	79	4,00	3,80	3,60	▼ (1)	131
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	1,68	2,18	2,19	▲ (8)	114	2,19	46	1,28	1,22	1,28	▲ (2)	105	1,34	42	1,70	1,83	1,81	▼ (1)	81
Câmbio (R\$/US\$)	5,10	5,00	5,00	= (2)	123	5,00	53	5,16	5,10	5,08	▼ (1)	120	5,10	52	5,20	5,15	5,17	▲ (1)	88
Selic (% a.a)	12,50	12,25	12,00	▼ (1)	147	12,00	90	10,00	9,50	9,50	= (2)	144	9,50	88	9,00	9,00	9,00	= (21)	118
IGP-M (variação %)	-0,08	-1,86	-2,50	▼ (12)	77	-2,68	33	4,10	4,00	4,00	= (2)	68	4,00	30	4,00	4,00	4,00	= (19)	58
IPCA Administrados (variação %)	9,41	9,03	8,97	▼ (9)	99	8,83	42	4,53	4,44	4,46	▲ (1)	86	4,51	38	4,00	4,00	4,00	= (15)	60
Conta corrente (US\$ bilhões)	-47,53	-43,90	-43,22	▲ (4)	34	-42,00	11	-53,00	-51,01	-50,40	▲ (3)	33	-50,50	10	-50,30	-50,30	-50,15	▲ (1)	22
Balança comercial (US\$ bilhões)	58,75	62,00	63,76	▲ (4)	34	67,75	12	55,30	55,61	55,65	▲ (1)	30	60,00	9	60,00	55,00	57,30	▲ (1)	20
Investimento direto no país (US\$ bilhões)	80,00	78,80	79,50	▲ (1)	30	79,40	8	80,00	80,00	80,00	= (22)	29	75,00	7	82,00	80,50	81,00	▲ (1)	21
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	60,70	60,47	60,60	▲ (1)	31	60,65	12	64,45	63,90	64,00	▲ (1)	29	64,40	11	66,25	65,50	65,85	▲ (1)	24
Resultado primário (% do PIB)	-1,10	-1,01	-1,02	▼ (1)	46	-1,10	16	-0,70	-0,80	-0,80	= (2)	44	-1,00	15	-0,34	-0,45	-0,50	▼ (1)	34
Resultado nominal (% do PIB)	-7,93	-7,74	-7,74	= (1)	30	-7,50	9	-7,00	-7,00	-7,00	= (10)	28	-7,00	9	-6,20	-6,30	-6,20	▲ (2)	21

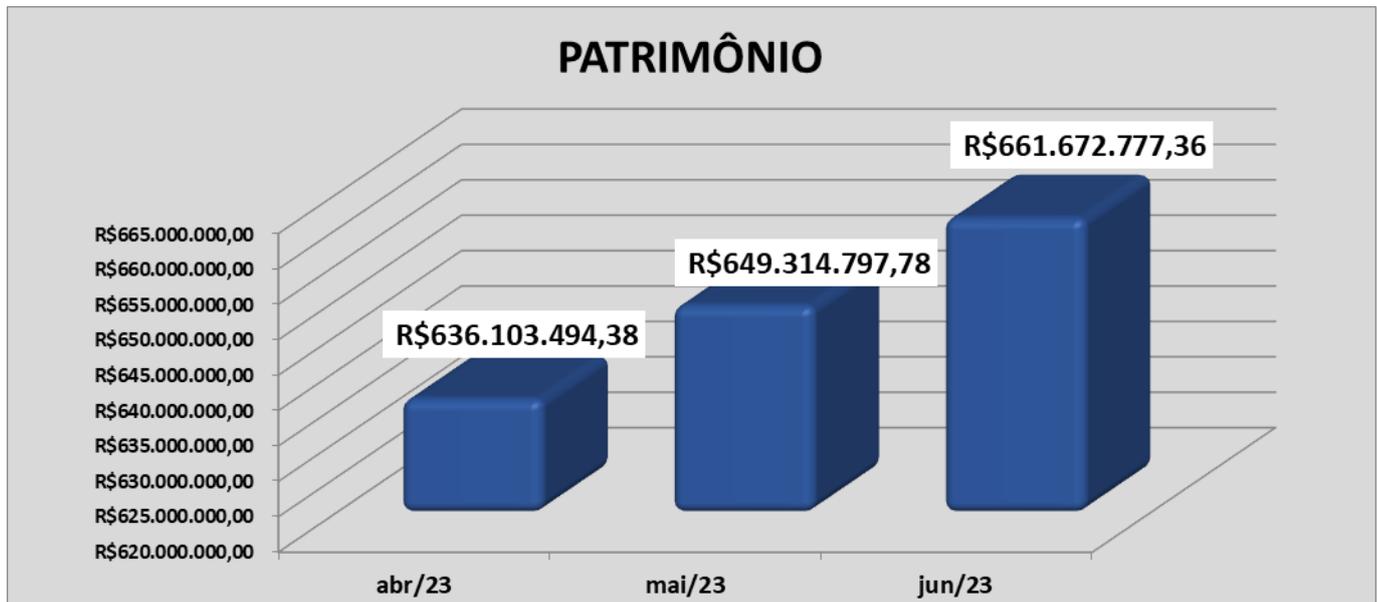
Relatório Focus de 30.06.2023. Fonte: <https://www.bcb.gov.br/publicacoes/focus>

4. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

A carteira de investimentos do Caraguaprev encerrou o trimestre com o patrimônio total de **R\$ 661.672.777,36** (seiscentos e sessenta e um milhões e seiscentos e setenta e dois mil e setecentos e setenta e sete reais e trinta e seis 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
abr/23	R\$ 636.103.494,38
mai/23	R\$ 649.314.797,78
jun/23	R\$ 661.672.777,36

4.1 ESTUDO ALM

O estudo de Asset Liability Management (ALM) foi realizado na data de 31/05/2023, onde foram estudados os patamares de riscos x retorno (fronteira eficiente Markowitz). O estudo ALM trouxe como diagnóstico na renda fixa: DIMINUIR A ALOCAÇÃO EM FUNDOS QUE NÃO SEJAM ATRELADOS AO IMA-B, DO ARTIGO 7º, I, B, NUM TOTAL DE R\$ 10.812.971,40 (1,70%); DIMINUIR A ALOCAÇÃO EM FUNDOS ATRELADOS A SELIC/CDI, NUM TOTAL DE R\$ 24.961.884,57 (3,92%). O estudo ALM trouxe como diagnóstico na renda variável: DIMINUIR A ALOCAÇÃO EM FUNDOS DE AÇÕES DO ARTIGO 8º, I, NUM TOTAL DE R\$ 36.141.331,85 (5,68%), desde que as cotas estejam positivas desde sua aplicação inicial, para que não seja contabilizado prejuízo, o que deve acontecer no segundo semestre de 2023, com a estabilidade econômica do país. O estudo ALM trouxe como diagnóstico em investimentos no exterior: AUMENTAR A ALOCAÇÃO EM FUNDOS DE AÇÕES BDR NÍVEL 1, DO ARTIGO 9º, III, NUM TOTAL DE R\$ 27.304.806,91 (4,29%), sendo que os investimentos no exterior tendem a performar positivamente no segundo semestre.



de 2023. REVER OS LIMITES DA ALOCAÇÃO OBJETIVO, MÍNIMOS E MÁXIMOS DA ATUAL POLÍTICA ANUAL DE INVESTIMENTOS. Por fim, de maneira geral a carteira de investimentos do CaraguaPrev está bem perto dos limites estabelecidos no estudo ALM.

O estudo ALM trouxe como diagnóstico em investimentos no exterior: *“Aumentar a alocação em fundos de ações BDR NÍVEL 1, do artigo 9º, III, num total de (4,29%)”*. *“Aumentar a alocação em fundos Multimercados atrelados ao S&P500, do artigo 10, I, num total de (7,01%)”*. *“Rever os limites da alocação objetivo, mínimos e máximos da atual Política Anual de Investimentos”*. Conforme deliberação do Comitê de Investimentos na Ata n.º 149 e do Conselho Deliberativo na Ata n.º 318, ambas de 29 de junho de 2023, diante do cenário de maior desaceleração econômica, tanto global quanto local, consequência dos efeitos defasados dos apertos monetários promovidos pelos bancos centrais, além do impacto cada vez maior da restrição a crédito causado pelos eventos mais recentes, apesar de reconhecer que os dados têm mostrado, de forma geral, economias mais resilientes do que o previsto, o destaque da economia dos Estados Unidos, com uma perspectiva de inflação continua persistente no curto prazo, o que levará o Fed (Banco Central americano) a manter uma postura rígida em relação à inflação, ou seja, juros altos por um período prolongado e por outro lado, a maior rentabilidade proporcionada pelo aumento dos juros também traz consigo maiores riscos e volatilidade. Portanto, investimentos nessas classes de ativos exigem bastante cautela e o Conselho Deliberativo mantém a sua posição de não aplicação em fundos em fundos Multimercados atrelados ao S&P500 e manutenção e possível redução em fundos de ações BDR NÍVEL 1, sem alteração dos limites da Política anual de Investimentos, a fim de proteção da carteira de investimentos do CaraguaPrev diante do atual cenário global, não aumentando a exposição a risco, já que os investimentos em renda fixa estão performando acima da meta atuarial. Caso haja uma inversão de posicionamento e estabilidade nos investimentos no exterior e S&P500, a aplicação e aumento de exposição nessas classes de ativos serão discutidas em outra reunião do Conselho Deliberativo.

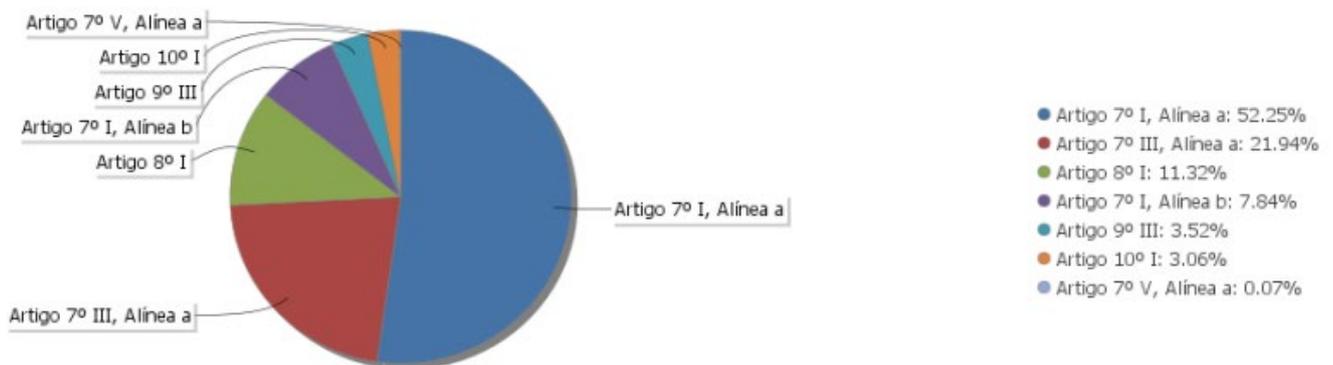


CARAGUAPREV 28/04/2023: R\$ 636.103.494,38

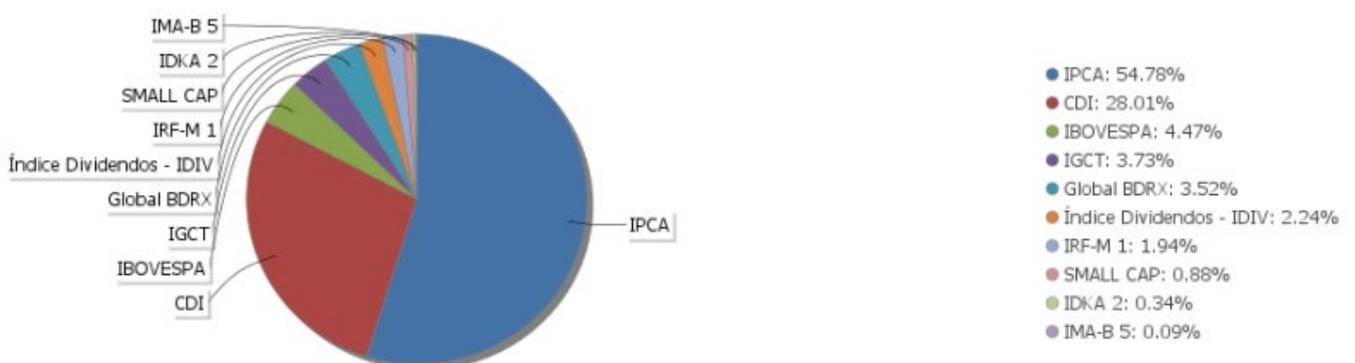


ALOCAÇÃO MARKOWITZ		
BENCHMARKS	% ALOCAÇÃO	R\$
SELIC/CDI	15,00%	95.415.524,16
IMA-B	60,08%	382.198.741,31
SMLL	4,92%	31.268.530,04
MSCI AC	10,00%	63.610.349,44
S&P500	10,00%	63.610.349,44
IFIX	0,00%	-
TOTAL	100,00%	636.103.494,38

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	0,97	1,66	1,53							6,95
IPCA + 5,03%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33							5,38
p.p. indexador	0,79	-1,30	-0,20	0,00	1,00	1,20							1,56
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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	25	46,30
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	53,70
	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	4,22	1,96	2,25	1,97
06 meses	6,95	5,38	1,56	2,06
12 meses	12,05	8,31	3,74	3,40
24 meses	8,45	27,52	-19,07	4,94
36 meses	18,91	45,98	-27,07	5,29
48 meses	22,75	57,99	-35,24	7,72
Desde 31/12/2018	32,61	66,17	-33,56	7,36

No trimestre a carteira de investimentos do plano previdenciário obteve rentabilidade de 4,22%, acima da meta atuarial do trimestre, que foi de 1,96%. No acumulado do ano corrente a rentabilidade foi de 6,95%, acima da meta atuarial do ano que é de 5,38%.

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**

82,09%

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 150525 (5,940000%)	4,11	0,02	0,47	0,90	20.181.117,14	3,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	0,47	0,03	0,47	2,52	10.300.923,43	1,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	0,47	0,02	0,48	2,55	5.091.235,60	0,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,47	0,02	0,44	2,43	16.830.448,65	2,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,47	0,02	0,46	2,49	19.672.189,65	2,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,47	0,02	0,45	2,46	32.144.465,53	4,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,47	0,02	0,46	2,47	10.686.971,80	1,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,47	0,02	0,46	2,48	10.668.898,31	1,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,47	0,02	0,46	2,49	10.645.132,11	1,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,49	-0,01	0,46	2,49	10.292.658,87	1,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	0,47	0,02	0,47	2,50	5.552.596,70	0,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,910000%)	3,02	0,02	0,47	2,51	10.494.905,94	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,090000%)	3,03	0,02	0,48	2,55	5.242.424,87	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,440000%)	3,02	0,02	0,51	2,63	20.453.047,19	3,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,480000%)	3,03	0,03	0,51	2,64	21.294.095,58	3,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,680000%)	3,07	0,02	0,53	2,69	5.248.597,29	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,990300%)	4,23	0,02	0,55	1,08	30.323.957,11	4,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	3,04	0,01	0,50	2,61	15.293.035,29	2,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	3,05	0,01	0,50	2,61	15.293.464,40	2,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,47	0,02	0,45	2,46	10.960.379,69	1,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,47	0,02	0,45	2,45	932.428,65	0,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,47	0,02	0,46	2,48	10.974.457,78	1,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,47	0,02	0,45	2,46	11.025.730,43	1,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,47	0,02	0,46	2,48	10.656.335,75	1,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,47	0,02	0,46	2,49	10.950.127,19	1,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,47	0,02	0,47	2,51	3.930.434,55	0,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,49	-0,01	0,47	2,51	10.527.173,96	1,59
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	0,47	0,02	0,48	2,53	345.667.233,46	52,24



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.				
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	3,92	0,29	2,19	2,42	2.247.465,28	0,34	234.003.023,06	0,96
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,03	0,05	1,08	3,08	19.416.841,23	2,93	6.942.662.276,99	0,28
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,37	0,06	1,15	3,14	444.471,70	0,07	307.873.930,44	0,14
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,38	0,07	1,16	3,14	12.365.322,09	1,87	6.781.214.720,11	0,18
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,40	0,22	1,03	2,49	615.140,16	0,09	1.128.559.610,31	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,43	0,35	2,10	4,86	16.799.185,26	2,54	5.348.206.988,95	0,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,23	0,17	1,48	3,49	51.888.425,72	7,84		

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	0,06	0,05	1,12	3,25	65.316.226,21	9,87	15.331.819.820,88	0,43
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,05	1,17	3,25	27.884.685,68	4,21	4.788.352.840,29	0,58
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	1,09	3,16	30.846.584,45	4,66	14.982.085.274,92	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,06	1,16	3,32	21.101.436,63	3,19	6.131.327.523,66	0,34
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,08	0,05	1,13	3,24	145.148.932,97	21,94		

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	15,93	-0,03	-0,03	0,47	487.238,57	0,07	19.087.385,82	2,55
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			15,93	-0,03	-0,03	0,47	487.238,57	0,07		
Renda Fixa			0,33	0,04	0,75	2,81	543.191.830,72	82,09		

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 82,09% 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 2,81%, enquanto que no ano a performance desses fundos é de 6,42%,



6.2 FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL.

RENDA VARIÁVEL 11,32%

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	19,05	0,08	7,90	14,22	1.546.175,84	0,23	592.169.733,93	0,26
BRAM	BEM	BRABESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	25,56	0,79	6,48	15,83	5.796.521,69	0,88	759.747.191,78	0,76
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,01	0,00	8,32	15,91	0,00	0,00	391.223.289,46	0,00
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,16	-0,25	8,88	15,45	24.674.470,96	3,73	810.368.157,20	3,04
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	21,46	-0,11	8,37	15,81	7.610.811,98	1,15	691.932.262,79	1,10
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,59	-0,09	8,09	15,22	14.844.645,89	2,24	961.071.884,08	1,54
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,51	-0,09	5,27	7,34	5.990.503,61	0,91	1.502.509.907,38	0,40
BRAM	BEM	BRABESCO F I A SELECTION	20,82	0,31	8,01	14,39	5.600.389,59	0,85	468.779.708,09	1,19
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,94	1,04	7,83	15,32	8.855.940,85	1,34	173.835.368,96	5,09
Sub-total Artigo 8º I			20,49	0,09	7,98	14,67	74.919.460,41	11,32		
Renda Variável			20,49	0,09	7,98	14,67	74.919.460,41	11,32		

Os Fundos de renda variável - AÇÕES que compõem a carteira do CaraguaPrev são compostos por FUNDOS DE AÇÕES - ART. 8º, I e representam 11,32% da Carteira de Investimentos. (Resolução CMN n.º 4.963/21).

No trimestre avaliado a rentabilidade do FUNDO DE AÇÕES foi de 14,67%, enquanto que no ano sua performance é de 5,97%.

6.3 FUNDOS ESTRUTURADOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 3,06%

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	0,50	0,10	1,22	3,37	20.268.093,18	3,06	1.654.107.518,67	1,23
Sub-total Artigo 10º I			0,50	0,10	1,22	3,41	20.268.093,18	3,06		
Investimentos Estruturados			17,11	0,10	1,22	3,41	20.268.093,18	3,06		

O Investimento Estruturado, Fundo Multimercado - ART. 10, I, que compõem a carteira do CaraguaPrev representa 3,06% da Carteira de Investimentos. (Resolução CMN n.º 4.963/21)



No trimestre avaliado a rentabilidade do FUNDO MULTIMERCADO foi de 3,41%, enquanto que no ano sua performance é de 12,24%.

6.4 FUNDOS DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR										3,52%
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	23,77	0,25	0,47	5,60	23.293.393,05	3,52	2.036.420.590,68	1,14
Sub-total Artigo 9º III			23,77	0,25	0,47	5,60	23.293.393,05	3,52		
Investimentos no Exterior			23,19	0,25	0,47	5,79	23.293.393,05	3,52		

Os Fundos de Investimento no Exterior Ações BDR Nível I – Art. 9º, III, que compõem a carteira do CaraguaPrev representam 3,52% da Carteira de Investimentos. (*Resolução CMN n.º 4.963/21*).

No trimestre avaliado a rentabilidade do fundo de Investimento no Exterior foi de 5,79%, enquanto que no ano sua performance é de 14,51%.

7. PERSPECTIVAS

Renda Fixa: Pós-fixado – CDI médio dos próximos 12 meses deve rodar entre 12,5% e 12,0%, o que ainda garante mantermos a maior parcela da renda fixa local nesse indexador nas carteiras de menor risco. Prefixado – foi ganhando maior exposição nas carteiras no 2º trimestre de 2023 por identificarmos cada vez mais um cenário a frente favorável para esse tipo de investimento, que são os de proximidade de afrouxamento monetário e maiores chances de uma inflação mais baixa e mais controlada. Inflação – é o indexador predileto para renda fixa nas carteiras de mais risco (Energética e Destemida). Historicamente, alocações em IPCA+ nos períodos de estabilidade da Selic e que antecederam ciclos de queda de juros, como o que se aproxima, possuem maior probabilidade de obter rentabilidades acima do CDI em prazos superiores a 2 ou 3 anos principalmente quando as taxas dos títulos são adquiridas acima de IPCA + 5%. Nossa atenção está voltada para a gestão consciente dos riscos para manter a estabilidade dos investimentos, adaptando-nos ao cenário global em constante mudança.

Renda Variável: A combinação de taxas de juros nominais e reais mais baixas, maior visibilidade em relação aos gastos fiscais e melhores perspectivas para a atividade econômica no Brasil vem trazendo um



tom mais otimista para os ativos brasileiros, inclusive para a renda variável. As principais altas recentes têm sido nos setores mais sensíveis às taxas de juros e que vinham sofrendo bastante até poucos meses atrás: Educação, Construtoras e Varejo. Essas altas vêm refletindo inclusive na melhora do desempenho dos fundos de ações das nossas carteiras que possuem maior exposição exatamente a esses papéis que são mais sensíveis aos juros.

Investimentos Estruturados e Exterior: Rendimentos (yields) das Treasuries seguem subindo, principalmente nos vencimentos mais curtos (até 2 anos), o que tem trazido boas oportunidades para investimentos em títulos públicos e privados (bonds), sem necessidade de alongar demasiadamente prazos. Assim como no mercado local, a seletividade e diversificação seguem sendo importantes, uma vez que os juros devem se manter altos por mais tempo, impactando de forma bastante distinta emissores de diferentes setores e segmentos da economia e em diferentes geografias. Não temos visto ainda aberturas relevantes nos spreads de crédito, mesmo dos títulos high yield e de mercados emergentes, mas esse risco vai se tornando maior nos meses à frente, com empresas sendo cada vez mais pressionadas por altos custos de empréstimos e encargos de dívida cada vez mais onerosos.

8. GERENCIAMENTO DE RISCOS - INDICADORES DE DESEMPENHO E RISCO

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%						Value-At-Risk (R\$): 6.038.680,86	Value-At-Risk: 0,91%
	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,31	0,07	-0,00	-1,04	0,75	543.191.830,72	82,09
Artigo 8º	15,35	8,03	0,87	0,45	7,98	74.919.460,41	11,32
Artigo 9º	13,88	7,63	0,04	-0,04	0,47	23.293.393,05	3,52
Artigo 10º	0,44	0,18	0,00	0,34	1,22	20.268.093,18	3,06
CARAGUATATUBA	1,67	0,91	0,91	0,28	1,53	661.672.777,36	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

30/06/2023

ANÁLISE DE LIQUIDEZ

Período	Valor		Valor Acumulado		
	Valor (R\$)	(%)	(R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	278.703.641,57	42,12	278.703.641,57	42,12	
de 31 dias a 365 dias	37.301.902,33	5,64	316.005.543,90	47,76	
acima de 365 dias	345.667.233,46	52,24	661.672.777,36	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, 42,12% da carteira de investimentos do CaraguaPrev 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
67	03/04/2023	RESGATE TOTAL NO BANCO SANTANDER, AGÊNCIA 4171, C/C 13.001576-2, APLICADO NO FUNDO DE INVESTIMENTO SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM – CNPJ 02.224.354/0001-45	SANTANDER DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM	R\$ 15.779.468,99	RESGATE
68	03/04/2023	APLICAÇÃO NO FUNDO DE INVESTIMENTO SANTANDER DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM – CNPJ 09.577.447/0001-00.	SANTANDER RF REF DI TP PREMIUM FIC FI	R\$ 15.779.468,99	APLICAÇÃO
69	04/04/2023	RESGATE TOTAL NO BANCO SANTANDER, AGÊNCIA 4171, C/C 13.001576-2, APLICADO NO FUNDO DE INVESTIMENTO SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER MULTIMERCADO – CNPJ 17.804.792/0001-50	SANTANDER DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM	R\$ 1.211.832,94	RESGATE
70	06/04/2023	Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da FUNDACC referente mês 04/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 8.784,78	APLICAÇÃO
71	06/04/2023	Repasso das contribuições previdenciárias da FUNDACC referente mês 03/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LP	R\$ 31.264,40	APLICAÇÃO
72	10/04/2023	Repasso da compensação previdenciária – COMPREV 02/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 9999-6	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 240.640,57	APLICAÇÃO
73	10/04/2023	Repasso Aporte para cobertura do déficit atuarial CaraguaPrev 04/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 8.379,03	APLICAÇÃO
74	10/04/2023	Resgate parcial no Banco CEF, agência 0797, conta corrente 9999-0, FI CAIXA BRASIL RF REF DI LP	PAGAMENTO DE DESPESAS ADMINISTRATIVAS	R\$ 80.000,00	RESGATE



75	12/04/2023	RESGATE TOTAL NO BANCO SANTANDER, AGÊNCIA 4171, C/C 13.001576-2, APLICADO NO FUNDO DE INVESTIMENTO SANTANDER EQUITIES ESG REAIS MULTIMERCADO – CNPJ 34.258.351/0001-19	SANTANDER DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM	R\$ 1.574.447,61	RESGATE
76	12/04/2023	APLICAÇÃO NO FUNDO DE INVESTIMENTO SANTANDER DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM – CNPJ 09.577.447/0001-00.	SANTANDER RF REF DI TP PREMIUM FIC FI	R\$ 1.211.832,94	APLICAÇÃO
77	17/04/2023	Resgate parcial no Banco CEF, agência 0797, conta corrente 1000-0, FI CAIXA BRASIL RF REF DI LP	PAGAMENTO DE DESPESAS PREVIDENCIÁRIAS	R\$ 4.153,05	RESGATE
78	17/04/2023	Restituição Benefício Previdenciário de Pensionista do Caraguaprev, Banco Itaú, Ag 0248 C/C 04042-0	ITAU SOBERANO RF IRFM 1 FI	R\$ 872,35	APLICAÇÃO
79	18/04/2023	Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Câmara mês 04/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 46.721,45	APLICAÇÃO
80	19/04/2023	Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Prefeitura Municipal mês 04/2023, 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
81	19/04/2023	Repasso das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal referente mês 03/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LP	R\$ 4.202.695,45	APLICAÇÃO
82	19/04/2023	Transferência do valor da Taxa de administração correspondente ao mês 04/2023, CEF, Ag 0797, C/C 9999-0	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LP	R\$ 657.778,97	APLICAÇÃO
83	19/04/2023	APLICAÇÃO NO FUNDO DE INVESTIMENTO SANTANDER DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM – CNPJ 09.577.447/0001-00.	SANTANDER RF REF DI TP PREMIUM FIC FI	R\$ 1.574.447,61	APLICAÇÃO
84	27/04/2023	Repasso das contribuições previdenciárias da Câmara Municipal referente mês 04/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LP	R\$ 105.778,95	APLICAÇÃO
85	27/04/2023	Repasso das contribuições previdenciárias do Caraguaprev patronal e servidor mês 04/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LP	R\$ 32.543,06	APLICAÇÃO
86	27/04/2023	Resgate do Fundo CAIXA BRASIL REF DI, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	PAGAMENTO DOS APOSENTADOS E PENSIONISTAS CARAGUAPREV 04/2023	R\$ 3.734.633,75	RESGATE
87	27/04/2023	Resgate do Fundo CAIXA BRASIL REF DI, CEF, Ag 0797 C/C 9999-0	FOLHA DE PAGAMENTOS ATIVOS 04/2023	R\$ 188.638,44	RESGATE
88	28/04/2023	REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA PREFEITURA MUNICIPAL E CÂMARA MUNICIPAL – APOSENTADOS E PENSIONISTAS REFERENTE AO 04/2023	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI	R\$ 2.067,59	APLICAÇÃO



CARAGUAPREV

Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba
Estado de São Paulo



89	03/05/2023	Restituição Benefício Previdenciário de Pensionista do CaraguaPrev, Banco Itaú, Ag 0248 C/C 04042-0	ITAU SOBERANO RF IRFM 1 FI	R\$ 872,35	APLICAÇÃO
90	04/05/2023	Repasse do Aporte para cobertura do déficit atuarial da FUNDACC referente mês 05/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 8.784,78	APLICAÇÃO
91	04/05/2023	Repasse das contribuições previdenciárias da FUNDACC referente mês 04/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LP	R\$ 31.122,69	APLICAÇÃO
92	08/05/2023	Repasse da compensação previdenciária – COMPREV 03/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 9999-6	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 242.449,04	APLICAÇÃO
93	08/05/2023	Pagamento de RPV - CEF, Ag0797 C/C 1000-0	FI CAIXA BRASIL REF DI LP	R\$ 49.942,81	RESGATE
94	10/05/2023	Repasse Aporte para cobertura do déficit atuarial CaraguaPrev 05/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 8.379,03	APLICAÇÃO
95	10/05/2023	CEF, agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento de despesas administrativas.	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO.	R\$ 60.000,00	RESGATE
96	12/05/2023	Resgate parcial no Fundo de Investimento CAIXA BRASIL REF DI LP para compra de Títulos Públicos NTN-B 760199 - Ag. 0797, C/C 1000-0	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B 761099	R\$ 30.001.376,51	RESGATE
97	15/05/2023	AQUISIÇÃO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B 760199 COM VENCIMENTO EM 15/08/2024	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B 761099	R\$ 30.001.376,51	APLICAÇÃO
98	15/05/2023	RESGATE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B 760199 COM VENCIMENTO EM 15/05/2023	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B 761099	R\$ 42.403.684,54	RESGATE
99	15/05/2023	RESGATE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B 760199 COM VENCIMENTO EM 15/05/2023	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B 761099	R\$ 21.290.890,02	RESGATE
100	16/05/2023	AQUISIÇÃO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B 760199 COM VENCIMENTO EM 15/05/2025	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B 761099	R\$ 20.001.255,28	APLICAÇÃO
101	17/05/2023	APLICAÇÃO FINANCEIRA NA CAIXA ECONÔMICA FEDERAL - RECEBIMENTO DE CUPOM e RESGATE TOTAL DAS NTN-B	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LP	R\$ 47.299.562,75	APLICAÇÃO
102	19/05/2023	REPASSE DO APORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DA PREFEITURA MUNICIPAL REFERENTE AO MÊS DE MAIO DE 2023.	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 1.201.288,58	APLICAÇÃO
103	19/05/2023	REPASSE DO APORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DA CÂMARA MUNICIPAL REFERENTE AO MÊS DE MAIO DE 2023.	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 43.721,45	APLICAÇÃO



104	19/05/2023	REPASSE DO APORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DA CÂMARA MUNICIPAL REFERENTE AO MÊS DE MAIO DE 2023.	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 3.000,00	APLICAÇÃO
105	19/05/2023	Repasse das contribuições previdenciárias da Câmara Municipal referente mês 05/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO.	R\$ 4.206.642,99	APLICAÇÃO
106	19/05/2023	Aplicação Financeira - Taxa de administração	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO.	R\$ 657.778,97	APLICAÇÃO
107	24/05/2023	APLICAÇÃO FINANCEIRA NO BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A - SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM – CNPJ 02.224.354/0001-45, RESSARCIMENTO DA DIFERENÇA CAUSADA PELO RESGATE DO FUNDO DE INVESTIMENTO GLOBAL EQUITIES DOLAR	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM	R\$ 288.167,06	APLICAÇÃO
108	25/05/2023	RESGATE TOTAL NA CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0, APLICADO NO FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP – CNPJ Nº 14.386.926/0001-71	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RF LP	R\$ 2.194.546,46	RESGATE
109	25/05/2023	APLICAÇÃO NO FUNDO DE INVESTIMENTO FIC CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RF LP – CNPJ Nº 45.163.710/0001-70.	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$ 1.974.973,45	APLICAÇÃO
110	25/05/2023	RESGATE TOTAL NO BANCO ITAÚ, AGÊNCIA 0248, C/C 04042-0, APLICADO NO FUNDO DE INVESTIMENTO ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL – CNPJ Nº 26.269.692/0001-61	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA JUROS & MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 2.189.816,22	RESGATE
111	26/05/2023	APLICAÇÃO NO FUNDO DE INVESTIMENTO FIC CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RF LP – CNPJ Nº 45.163.710/0001-70.	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	R\$ 219.573,01	APLICAÇÃO
112	26/05/2023	RESGATE PARCIAL NA CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0, APLICADO NO FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I – CNPJ Nº 17.502.937/0001-68	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRÉGICA	R\$ 15.000.000,00	RESGATE



113	26/05/2023	APLICAÇÃO DO RESGATE TOTAL DO FUNDO DE INVESTIMENTO ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 - CNPJ Nº 26.269.692/0001-61	FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP	R\$ 2.189.816,22	APLICAÇÃO
114	29/05/2023	Repasso das contribuições previdenciárias da Câmara Municipal referente mês 05/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LP	R\$ 105.824,78	APLICAÇÃO
115	30/05/2023	Resgate para folha de pagamento dos servidores ativos referente mês 05/2023, CEF, Ag 0797 C/C 9999-0	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO.	R\$ 210.259,96	RESGATE
116	30/05/2023	REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DO CARAGUAPREV PATRONAL E SERVIDOR REFERENTE AO MÊS DE MAIO DO ANO DE 2023.	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LP	R\$ 32.647,90	APLICAÇÃO
117	30/05/2023	Resgate pagamento dos aposentados e pensionistas do CaraguaPrev referente mês 05/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 3.759.836,67	RESGATE
118	31/05/2023	APLICAÇÃO DO RESGATE DO FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I - CNPJ Nº 17.502.937/0001-68	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 15.000.000,00	RESGATE
119	31/05/2023	REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA PREFEITURA MUNICIPAL E CÂMARA MUNICIPAL - APOSENTADOS E PENSIONISTAS REFERENTE AO MÊS DE MAIO DO ANO DE 2023.	FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	R\$ 2.067,59	APLICAÇÃO
120	02/06/2023	Restituição Benefício Previdenciário de Pensionista do CaraguaPrev, Banco Itaú, Ag 0248 C/C 04042-0	ITAÚ SOBERANO RF IRFM 1 FI	R\$ 885,74	APLICAÇÃO
121	05/06/2023	Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da FUNDACC referente mês 06/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 8.784,78	APLICAÇÃO
122	05/06/2023	Repasso das contribuições previdenciárias da FUNDACC referente mês 05/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LP	R\$ 32.351,87	APLICAÇÃO
123	06/06/2023	REPASSE DO APORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DA CÂMARA MUNICIPAL REFERENTE AO MÊS DE JUNHO DE 2023.	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 46.721,45	APLICAÇÃO
124	07/06/2023	Repasso da compensação previdenciária - COMPREV 03/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 9999-6	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 242.449,04	APLICAÇÃO
125	07/06/2023	Repasso Aporte para cobertura do déficit atuarial CaraguaPrev 06/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 8.379,03	APLICAÇÃO



CARAGUAPREV

Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba
Estado de São Paulo



126	07/06/2023	CEF, agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento de despesas administrativas.	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO.	R\$ 73.000,00	RESGATE
127	07/06/2023	Pagamento de RPV - CEF, Ag0797 C/C 1000-0	FI CAIXA BRASIL REF DI LP	R\$ 16.129,40	RESGATE
128	14/06/2023	Pagamento de Folha complementar - CEF, Ag0797 C/C 1000-0	FI CAIXA BRASIL REF DI LP	R\$ 12.754,41	RESGATE
129	16/06/2023	RESGATE TOTAL NO BANCO ITAÚ, AGÊNCIA 0248, C/C 04042-0, APLICADO NO FUNDO DE INVESTIMENTO ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO – CNPJ Nº 08.817.414/0001-10	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA JUROS & MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 793.958,65	RESGATE
130	19/06/2023	Repasso das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal referente mês 05/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LP	R\$ 372.006,95	APLICAÇÃO
131	20/06/2023	APLICAÇÃO DO RESGATE TOTAL NO BANCO ITAÚ, AGÊNCIA 0248, C/C 04042-0, APLICADO NO FUNDO DE INVESTIMENTO ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO – CNPJ Nº 08.817.414/0001-10	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA JUROS & MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 793.958,65	APLICAÇÃO
132	20/06/2023	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
133	20/06/2023	Repasso das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal referente mês 05/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LP	R\$ 3.814.577,22	APLICAÇÃO
134	21/06/2023	REPASSE DO APORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DA PREFEITURA MUNICIPAL REFERENTE AO MÊS DE JUNHO DE 2023.	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 1.201.288,58	APLICAÇÃO
135	27/06/2023	Repasso das contribuições previdenciárias da Câmara Municipal referente mês 06/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LP	R\$ 105.824,78	APLICAÇÃO
136	29/03/2023	Resgate para folha de pagamento dos servidores ativos referente mês 06/2023, CEF, Ag 0797 C/C 9999-0	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO.	R\$ 224.903,27	RESGATE
137	29/06/2023	REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DO CARAGUAPREV PATRONAL E SERVIDOR REFERENTE AO MÊS DE JUNHO DO ANO DE 2023.	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LP	R\$ 32.647,90	APLICAÇÃO
138	29/06/2023	Resgate pagamento dos aposentados e pensionistas do CaraguaPrev referente mês 06/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 3.802.638,92	RESGATE



139	30/06/2023	REPASSE DAS CONTRIBUIÇÕES PREVIDENCIÁRIAS DA PREFEITURA MUNICIPAL E CÂMARA MUNICIPAL – APOSENTADOS E PENSIONISTAS REFERENTE AO MÊS DE JUNHO DO ANO DE 2023.	FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	R\$ 1.952,71	APLICAÇÃO
-----	------------	---	---	-----------------	-----------

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

1. RESGATE TOTAL de R\$ 15.779.468,99 (quinze milhões e setecentos e setenta e nove mil e quatrocentos e sessenta e oito reais e noventa e nove centavos) do Fundo de Investimento SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS, CNPJ: 02.224.354/0001-45, Banco Santander, em 03/04/2023, para APLICAÇÃO de R\$ 15.779.468,99 (quinze milhões e setecentos e setenta e nove mil e quatrocentos e sessenta e oito reais e noventa e nove centavos) do Fundo de Investimento SANTANDER DI TITULOS PÚBLICOS PREMIUM, CNPJ: 09.577.447/0001-00, Banco Santander, em 03/04/2023.
2. RESGATE TOTAL de R\$ 1.574.447,61 (um milhão e quinhentos e setenta e quatro mil e quatrocentos e quarenta e sete reais e sessenta e um centavos) do Fundo de Investimento SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO, CNPJ: 34.258.351/0001-19, Banco Santander, em 18/04/2023, para APLICAÇÃO de R\$ 1.574.447,61 (um milhão e quinhentos e setenta e quatro mil e quatrocentos e quarenta e sete reais e sessenta e um centavos) no Fundo de Investimento SANTANDER DI TITULOS PÚBLICOS PREMIUM, CNPJ: 09.577.447/0001-00, Banco Santander, em 19/04/2023.
3. RESGATE TOTAL de R\$ 1.211.832,94 (um milhão e duzentos e onze mil e oitocentos e trinta e dois reais e noventa e quatro centavos) do Fundo de Investimento SANTANDER GLOBAL EQUITIES MASTER MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI, CNPJ: 17.804.792/0001-50, Banco Santander, em 04/04/2023, para APLICAÇÃO de R\$ 1.211.832,94 (um milhão e duzentos e onze mil e oitocentos e trinta e dois reais e noventa e quatro centavos) no Fundo de Investimento SANTANDER DI TITULOS PÚBLICOS PREMIUM, CNPJ: 09.577.447/0001-00, Banco Santander, em 12/04/2023.



4. RESGATE de R\$ 30.001.376,51 (trinta milhões e um mil e trezentos e setenta e seis reais e cinquenta e um 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 12/05/2023, para APLICAÇÃO / COMPRA de R\$ 30.001.376,51 (trinta milhões e um mil e trezentos e setenta e seis reais e cinquenta e um centavos) em Títulos Públicos Federais NTN-B – 15/08/2024, taxa 6,9903%, quantidade 7.262, em 15/05/2023.
5. APLICAÇÃO de R\$ 47.299.562,75 (quarenta e sete milhões e duzentos e noventa e nove mil e quinhentos e sessenta e dois reais e setenta e cinco centavos) no 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 17/05/2023, referente ao recebimento de cupons de juros dos Títulos Públicos Federais e recebimento do principal das NTN-B com vencimento em 15/05/2023.
6. RESGATE de R\$ 2.194.546,46 (dois milhões e cento e noventa e quatro mil e quinhentos e quarenta e seis reais e quarenta e seis centavos) do Fundo de Investimento Caixa Brasil IDKA 2 A Títulos Públicos Renda Fixa Longo Prazo, CNPJ: 14.386.926/0001-71, Caixa Econômica Federal, ag. 0797, c/c 1000-0, em 25/05/2023, para APLICAÇÃO de R\$ 2.194.546,46 (dois milhões e cento e noventa e quatro mil e quinhentos e quarenta e seis reais e quarenta e seis centavos) do Fundo de Investimento Caixa Brasil IDKA PRE 2 A Renda Fixa Longo Prazo, CNPJ: 45.163.710/0001-70, Caixa Econômica Federal, ag. 0797, c/c 1000-0, em 25/05/2023.
7. RESGATE de R\$ 15.000.000,00 (quinze milhões de reais) do Fundo de Investimento FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I, CNPJ: 17.502.937/0001-68, Caixa Econômica Federal, ag. 0797, c/c 1000-0, em 31/05/2023, para APLICAÇÃO de R\$ 15.000.000,00 (quinze milhões de reais) no Fundo de Investimento FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATEGICA, CNPJ: 23.215.097/0001-55, Caixa Econômica Federal, ag. 0797, c/c 1000-0, em 31/05/2023.
8. RESGATE de R\$ 2.189.816,22 (dois milhões e cento e oitenta e nove mil e oitocentos e dezesseis reais e vinte e dois centavos) do Fundo de Investimento ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO S&P 500 BRL FIC FI, CNPJ: 26.269.692/0001-61, Banco Itaú, em 26/05/2023, para APLICAÇÃO de R\$ 2.189.816,22 (dois milhões e cento e oitenta e nove mil e oitocentos e dezesseis reais e vinte e dois 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 26/05/2023.



9. RESGATE de R\$ 15.000.000,00 (quinze milhões de reais) do Fundo de Investimento FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I, CNPJ: 17.502.937/0001-68, Caixa Econômica Federal, ag. 0797, c/c 1000-0, em 31/05/2023, para APLICAÇÃO de R\$ 15.000.000,00 (quinze milhões de reais) no Fundo de Investimento FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATEGICA, CNPJ: 23.215.097/0001-55, Caixa Econômica Federal, ag. 0797, c/c 1000-0, em 31/05/2023.
10. RESGATE de R\$ 793.958,65 (setecentos e noventa e três mil e novecentos e cinquenta e oito reais e sessenta e cinco centavos) do Fundo de Investimento ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FIA, CNPJ: 08.817.414/0001-10, Banco Itaú, em 20/06/2023 e APLICAÇÃO de R\$ 793.958,65 (setecentos e noventa e três mil e novecentos e cinquenta e oito reais e sessenta 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 20/06/2023.

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 Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alinea a	Títulos do Tesouro Nacional	345.667.233,46	52,24	0,00	50,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alinea b	Fundos 100% Títulos Públicos	51.888.425,72	7,84	0,00	11,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alinea a	Fundos Renda Fixa	145.148.932,97	21,94	0,00	25,00	60,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alinea a	FIDC Cota Sênior	487.238,57	0,07	0,00	0,10	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	543.191.830,72	82,09					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	74.919.460,41	11,32	0,00	5,00	30,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	74.919.460,41	11,32					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.293.393,05	3,52	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.293.393,05	3,52					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	20.268.093,18	3,06	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	20.268.093,18	3,06					15,00
Total		661.672.777,36	100,00					

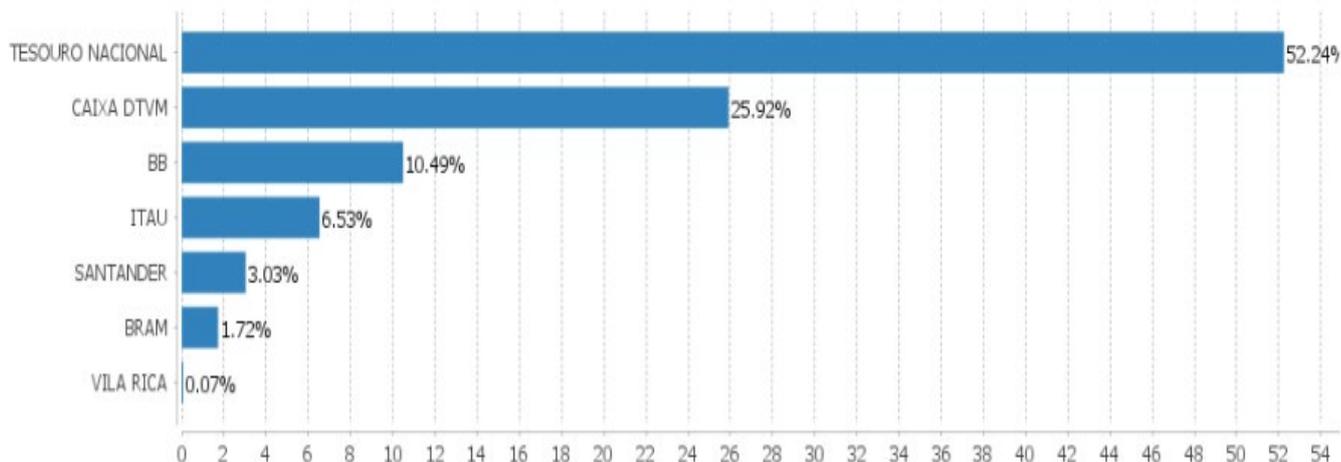
Registre-se que no dia 29/03/2023 foi alterada a Política de Investimentos do CaraguaPrev, adequando a taxa anual de juros para 5,03%, de acordo com o critério estabelecido pela Portaria ME nº 6.132/2021 e disposto na Portaria MF nº 1.467, de 02 de junho de 2022, a taxa de desconto atuarial efetiva máxima 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	65.334.398,44	1.507.622,88	0,00	0,00	69.432.553,34	2.590.532,02
BRAM	10.628.723,51	0,00	0,00	0,00	11.396.911,28	768.187,77
CAIXA DTVM	166.391.187,51	5.809.146,34	-4.129.426,00	0,00	171.481.257,48	3.410.349,63
ITAU	42.636.299,60	2.838,45	-793.958,65	0,00	43.175.601,84	1.330.422,44
SANTANDER	19.818.788,75	0,00	0,00	0,00	20.031.981,39	213.192,64
TESOURO NACIONAL	344.018.015,75	0,00	0,00	0,00	345.667.233,46	1.649.217,71
VILA RICA	487.384,22	0,00	0,00	0,00	487.238,57	-145,65

Alocação por Gestor



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

FUNDO	CNPJ	VALOR	% RECURSOS	GESTOR	ADMINISTRADOR
BB PREV RF IRF-M 1	11.328.882/0001-35	281.766,45	0,0426	BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL
BB PREV RF IRF-M 1 (APORTES 37299-4)	11.328.882/0001-35	12.083.555,64	1,8262	BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL



CARAGUAPREV

Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba
Estado de São Paulo



CEF FI BRASIL IDKA2 PRÉ	45.163.710/0001-70	2.247.465,28	0,3397	CAIXA DTVM	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
SANTANDER IMA-B5 PREMIUM FIC RF	13.455.117/0001-01	615.140,16	0,0930	SANTANDER BRASIL GESTÃO	SANTANDER
CEF FIC BR GESTAO ESTRATEGICA C/C 1000-0	23.215.097/0001-55	16.799.185,26	2,5389	CAIXA DTVM	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
ITAU INSTITUCIONAL RF IRF-M 1	08.703.063/0001-16	444.471,70	0,0672	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO
FIDC FECHADO MULTISSETORIAL ITALIA	13.990.000/0001-28	487.238,57	0,0736	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO
CEF FI BRASIL REF DI LP 9999-0 (TX ADMINISTRATIVA)	03.737.206/0001-97	14.258.556,35	2,1549	CAIXA DTVM	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
CEF FI BRASIL REF DI LP 1000-0	03.737.206/0001-97	51.057.669,86	7,7165	CAIXA DTVM	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
CAIXA FI BRASIL MATRIZ RF	23.215.008/0001-70	21.101.436,63	3,1891	CAIXA DTVM	ITAÚ UNIBANCO
ITAU INSTIT RF DI	00.832.435/0001-00	27.884.685,68	4,2143	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO
BB PREV RF PERFIL	13.077.418/0001-49	4.556.940,33	0,6887	BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL
BB PREV RF PERFIL (APORTES 37299-4)	13.077.418/0001-49	26.289.644,12	3,1891	BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL
SANTANDER DI TITULOS PUBLICOS PREMIUM	09.577.447/0001-00	19.416.841,23	2,9345	SANTANDER BRASIL GESTÃO	SANTANDER
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	10.418.335/0001-88	24.674.470,96	3,7291	BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL
BB DIVIDENDOS FIC FIA	05.100.191/0001-87	1.546.175,84	0,2337	BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS 9999-0	15.154.441/0001-15	14.844.645,89	2,2435	CAIXA DTVM	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
FIC AÇÕES EXPERT VINCI VALOR RPPS	14.507.699/0001-95	7.610.811,98	1,1502	CAIXA DTVM	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	24.571.992/0001-75	5.990.503,61	0,9054	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO
ITAU ACOES MOMENTO 30 II FIC	42.318.981/0001-60	8.855.940,85	1,3384	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO
BRADESCO FIA SELECTION	03.660.879/0001-96	5.600.389,59	0,8464	BEM DTVM LTDA	BRADESCO
BRADESCO FIA SMALL CAP PLUS	06.988.623/0001-09	5.796.521,69	0,8760	BEM DTVM LTDA	BRADESCO
FIA CAIXA INSTIT BDR NIVEL I	17.502.937/0001-68	23.293.393,05	3,5204	CAIXA DTVM	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
CAIXA FI JUROS E MOEDAS	14.120.520/0001-42	20.268.093,18	3,0632	CAIXA DTVM	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



CARAGUAPREV

Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba
Estado de São Paulo



CERTIFICADO
Pró-Gestão

ICo BRASIL RPPS
SPREV



<i>Total em Bancos R\$</i>		<i>316.005.543,90</i>	<i>47,7586</i>				
TITULOS PUBLICOS FEDERAIS		VALOR INVESTIDO	% RECURSOS	% POR ADEQUAÇÃO	LIMITE P. INVEST		
NTN-B - 15/05/2035 (5,56%)	3.900	16.830.448,65	2,5436	52,2414	50,0%		
NTN-B - 15/08/2040 (5,65%)	213	932.428,65	0,1409				
NTN-B - 15/08/2050 (5,713%)	2.514	11.025.730,43	1,6663				
NTN-B - 15/05/2045 (5,71%)	7.457	32.144.465,53	4,8581				
NTN-B - 15/05/2045 (5,76%)	2.494	10.686.971,80	1,6151				
NTN-B - 15/05/2045 (5,781%)	2.496	10.668.898,31	1,6124				
NTN-B - 15/05/2030 (5,708%)	2.555	10.960.379,69	1,6565				
NTN-B - 15/08/2040 (5,77%)	2.538	10.974.457,78	1,6586				
NTN-B - 15/08/2050 (5,815%)	2.530	10.950.127,19	1,6549				
NTN-B - 15/05/2055 (5,815%)	2.490	10.645.132,11	1,6088				
NTN-B - 15/05/2035 (5,821%)	4.657	19.672.189,65	2,9731				
NTN-B - 15/08/2024 (5,892%)	1.315	5.552.596,70	0,8392				
NTN-B - 15/08/2050 (5,916%)	920	3.930.434,55	0,5940				
NTN-B - 15/08/2050 (5,780%)	2.451	10.656.335,75	1,6105				
NTN-B - 15/05/2055 (5,852%)	2.420	10.292.658,87	1,5556				
NTN-B - 15/08/2050 (5,922%)	2.466	10.527.173,96	1,5910				
NTN-B - 15/08/2024 (6,4750%)	5.073	21.294.095,58	3,2182				
NTN-B - 15/05/2025 (5,9752%)	2.476	10.300.923,43	1,5568				
NTN-B - 15/08/2024 (5,91%)	2.486	10.494.905,94	1,5861				
NTN-B - 15/08/2024 (6,09%)	1.244	5.242.424,87	0,7923				
NTN-B - 15/05/2027 (6,09%)	1.228	5.091.235,60	0,7694				
NTN-B - 15/08/2024 (6,68%)	1.253	5.248.597,29	0,7932				
NTN-B - 15/08/2024 (6,44%)	4.871	20.453.047,19	3,0911				
NTN-B - 15/08/2026 (6,353%)	3.661	15.293.035,29	2,3113				
NTN-B - 15/08/2028 (6,353%)	3.678	15.293.464,40	2,3113				
NTN-B - 15/08/2024 (6,9903%)	7.262	30.323.957,11	4,5829				
NTN-B - 15/05/2025 (5,940%)	4.848	20.181.117,14	3,0500				
Total Títulos Públicos		345.667.233,46	52,2414				
Total Geral		661.672.777,36	100,0000				



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

CARAGUATATUBA

30/06/2023

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	0,48 44,72	2,53 80,42	2,53 80,42	6,31 97,08	9,69 71,56	1.649.217,71	0,25	8.785.843,27
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,48 137,62	3,49 110,90	3,49 110,90	6,98 107,35	11,84 87,41	754.368,46	0,12	1.429.339,49
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,13 105,10	3,24 102,92	3,24 102,92	6,44 99,02	13,50 99,67	1.615.569,17	0,25	4.170.727,25
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,03 -2,79	0,47 14,98	0,47 14,98	1,24 19,10	-12,71 -93,83	-145,65	-0,00	2.284,76
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	7,98 -1,02	14,67 -1,24	14,67 -1,24	5,97 -1,64	14,59 -5,24	5.595.430,68	0,86	9.686.023,01
Artigo 9º II % do CDI	0,00 0,00	0,54 17,01	0,54 17,01	6,13 94,38	11,03 81,44	0,00	0,00	14.419,09
Artigo 9º III % do CDI	0,47 43,67	5,60 178,11	5,60 178,11	14,53 223,59	13,40 98,98	108.526,22	0,02	1.748.168,61
Artigo 10º I % do CDI	1,22 114,02	3,41 108,37	3,41 108,37	12,24 188,41	19,96 147,41	238.789,97	0,04	644.222,64
Artigo 7º	0,75		2,81	6,42	10,72	4.019.009,69	0,62	0,00
Artigo 8º	7,98		14,67	5,97	14,59	5.595.430,68	0,86	0,00
Artigo 9º	0,47		5,79	14,51	13,83	108.526,22	0,02	0,00
Artigo 10º	1,22		3,41	12,24	19,96	238.789,97	0,04	0,00
CARAGUATATUBA (Total)						9.961.756,56	1,53	26.481.028,12



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 2º 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, 26 de julho de 2023.

Luana Moussalli Forcioni Guedes

Diretora Financeira
Certificado ANBIMA CPA-10



Pedro Ivo de Sousa Tau

Presidente do CaraguaPrev
Certificado ANBIMA CPA-10



Ivone Cardoso Vicente Alfredo

Membro do Comitê



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 **2º 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, 26 de julho de 2023.

Cristiano Paulo Silva
Presidente do Conselho Fiscal



Adriana Zambotto Fernandes
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 **2º 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, 26 de julho de 2023.

Marcus da Costa Nunes Gomes
Presidente do Conselho Deliberativo



Roberta Alice Zimbres Franzolin
Membro do Conselho Deliberativo



Ivy Monteiro Malerba
Membro do Conselho Deliberativo



Ivone Cardoso Vicente Alfredo
Membro do Conselho Deliberativo



Marcia Denise Gusmão Coelho
Membro do Conselho Deliberativo



Gilceli de Oliveira Ubiña
Membro do Conselho Deliberativo

