



INSTITUTO DE PREVIDENCIA DO MUNICÍPIO DE CARAGUATATUBA/SP

CARAGUAPREV

**RELATÓRIO SEMESTRAL DE DILIGÊNCIAS DE
VERIFICAÇÃO DOS LASTROS RELATIVOS AOS
TÍTULOS PÚBLICOS E DEMAIS PAPÉIS INCLUÍDOS
NAS CARTEIRAS DE ATIVOS DOS FUNDOS DE
INVESTIMENTOS APLICADOS PELO RPPS.**

1º SEMESTRE 2023.



SUMÁRIO

| | |
|--|----|
| 1. INTRODUÇÃO..... | 3 |
| 2. POSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS | 4 |
| 3. POSIÇÃO DA CARTEIRA NO SEMESTRE | 7 |
| 4. CREDENCIAMENTO DAS INSTITUIÇÕES | 8 |
| 5. INSTITUIÇÕES – RELAÇÃO DE GESTORES DOS RECURSOS..... | 10 |
| 6. RENTABILIDADE DO PLANO PREVIDENCIÁRIO | 13 |
| 7. RENTABILIDADE POR ARTIGO DA RESOLUÇÃO CMN | 14 |
| 8. EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS..... | 15 |
| 9. ANÁLISE DOS LASTROS RELATIVOS AOS INVESTIMENTOS | 16 |
| 10. PRINCIPAIS AÇÕES DE DILIGÊNCIA DO CARAGUAPREV:..... | 17 |
| 11. PRÓ GESTÃO – NÍVEL 1..... | 18 |
| 12. CONCLUSÃO..... | 18 |



RELATÓRIO SEMESTRAL DE DILIGÊNCIAS

1º SEMESTRE 2023.

1. INTRODUÇÃO

Em atendimento as obrigações legais cabíveis vigentes no manual do Pró-Gestão, a fim de conferir maior transparência ao processo, e permitindo o monitoramento dos interessados, o CaraguaPrev, apresenta semestralmente este relatório de diligência de verificação de lastros aos títulos públicos e demais papéis incluídos nas carteiras de ativos dos fundos de investimentos.

O relatório semestral de diligências 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.

Participantes da Gestão do CaraguaPrev no semestre 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. POSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

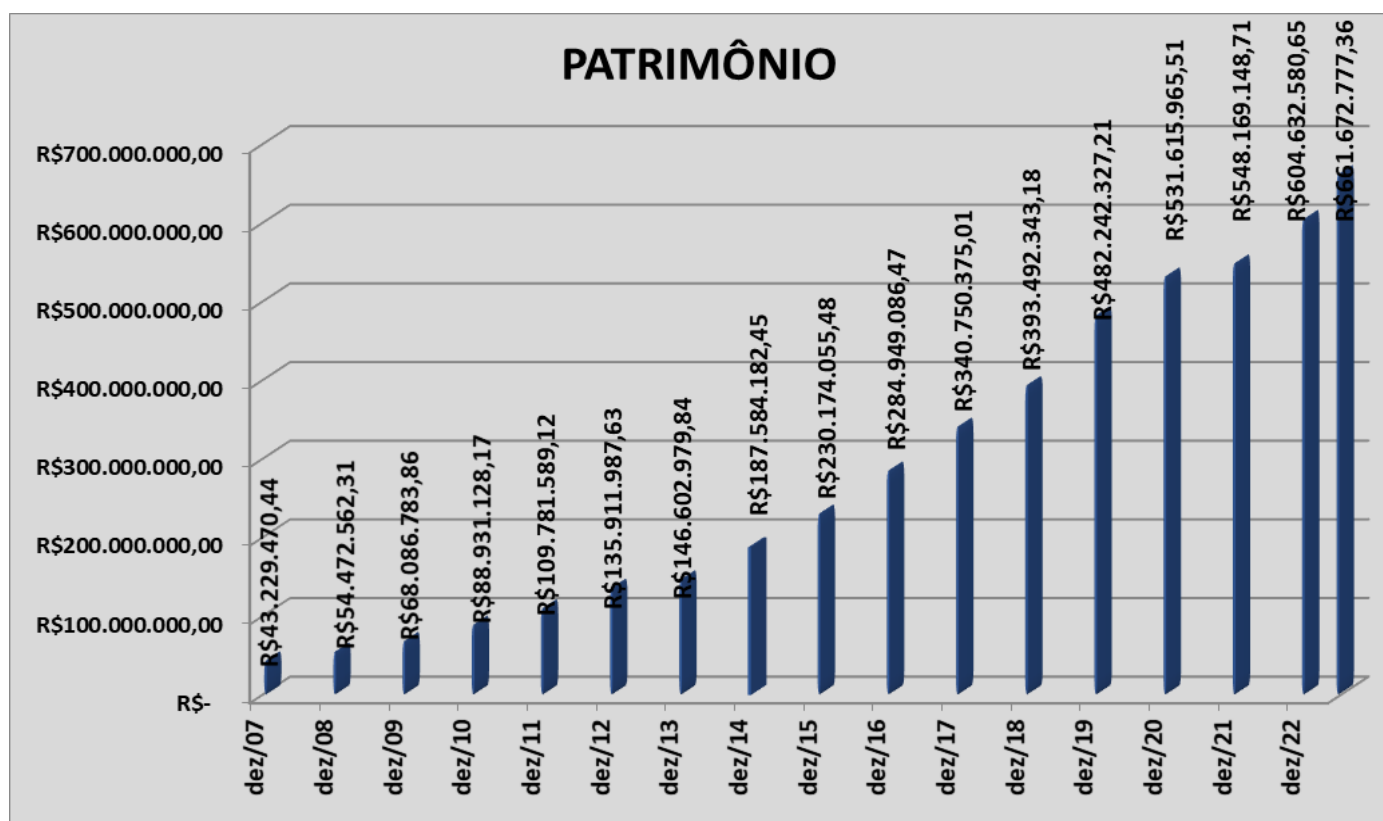
A carteira de investimentos do CaraguaPrev encerrou o semestre com o patrimônio total de **R\$ 661.672.777,36** (seiscentos e sessenta e um milhões e seiscentos e setenta e dois mil e setecentos e setenta e sete reais e trinta e seis centavos).

É composta por ativos que estão vinculados ao seu respectivo Plano Previdenciário, também compõe a carteira de investimentos os recursos oriundos da taxa de administração, que são



utilizados na manutenção dos serviços e pagamento de pessoal da autarquia. O Plano Previdenciário possui meta atuarial estabelecida, sendo este um fundo previdenciário em regime de capitalização dos recursos, este relatório dará enfoque aos ativos a ele vinculados.

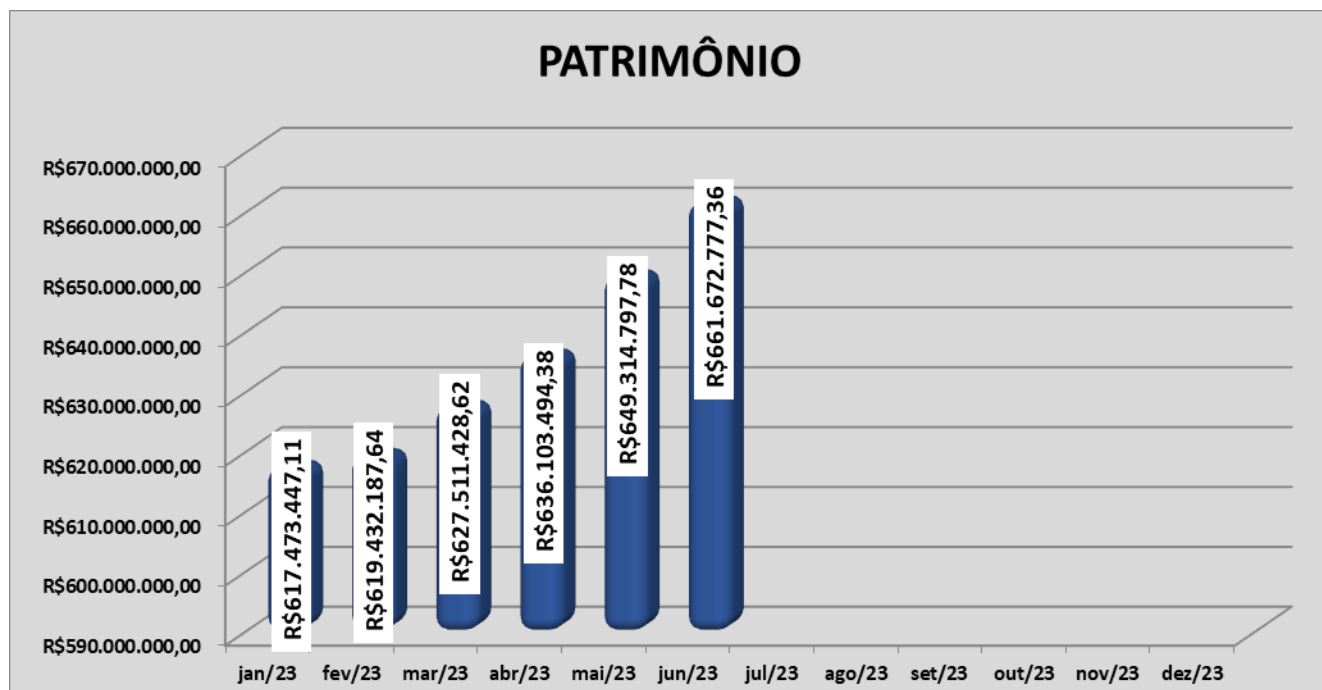
Evolução Patrimonial da Carteira de Investimentos (R\$ mil)



| ANO | PATRIMÔNIO |
|--------|--------------------|
| dez/01 | R\$ 2.332.587,11 |
| dez/02 | R\$ 6.251.543,12 |
| dez/03 | R\$ 11.583.959,19 |
| dez/04 | R\$ 15.612.385,27 |
| dez/05 | R\$ 23.150.759,30 |
| dez/06 | R\$ 33.449.995,07 |
| dez/07 | R\$ 43.229.470,44 |
| dez/08 | R\$ 54.472.562,31 |
| dez/09 | R\$ 68.086.783,86 |
| dez/10 | R\$ 88.931.128,17 |
| dez/11 | R\$ 109.781.589,12 |
| dez/12 | R\$ 135.911.987,63 |



| | |
|----------|--------------------|
| dez/13 | R\$ 146.602.979,84 |
| dez/14 | R\$ 187.584.182,45 |
| dez/15 | R\$ 230.174.055,48 |
| dez/16 | R\$ 284.949.086,47 |
| dez/17 | R\$ 340.750.375,01 |
| dez/18 | R\$ 393.492.343,18 |
| dez/19 | R\$ 482.242.327,21 |
| dez/20 | R\$ 531.615.965,51 |
| dez/21 | R\$ 548.169.148,71 |
| dez/22 | R\$ 604.546.473,82 |
| junho/23 | R\$ 661.672.777,36 |



| Mês 2023 | PATRIMÔNIO |
|--------------|--------------------|
| Janeiro/23 | R\$ 617.473.447,11 |
| Fevereiro/23 | R\$ 619.432.187,64 |
| Março/23 | R\$ 627.511.428,62 |
| Abril/23 | R\$ 636.103.494,38 |
| maio/23 | R\$ 649.314.797,78 |
| Junho/23 | R\$ 661.672.777,36 |



3. POSIÇÃO DA CARTEIRA NO SEMESTRE

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, Alínea a | Títulos do Tesouro Nacional | 345.667.233,46 | 52,24 | 0,00 | 50,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 51.888.425,72 | 7,84 | 0,00 | 11,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa | 145.148.932,97 | 21,94 | 0,00 | 25,00 | 60,00 | 0,00 | 65,00 |
| Artigo 7º V, Alínea 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 | | | | | |

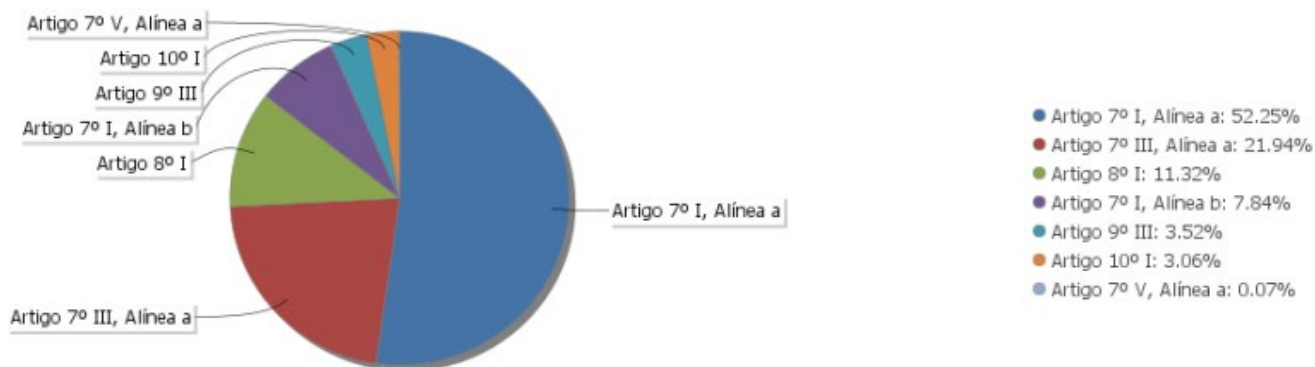
A posição da carteira do CaraguaPrev, finalizou o primeiro semestre de 2023, posicionado em renda fixa em 82,09% do volume total dos investimentos, na renda variável de 11,32%, Investimentos no exterior em 3,52% e Investimentos Estruturados em 3,06%, os valores investidos estão dentro dos percentuais autorizados pela Resolução do Conselho Monetário Nacional n.º 4.963/21 e alterações.

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 horizonte de planejamento utilizado na sua elaboração compreende o período de 12 meses que se estende de janeiro a dezembro de 2023.

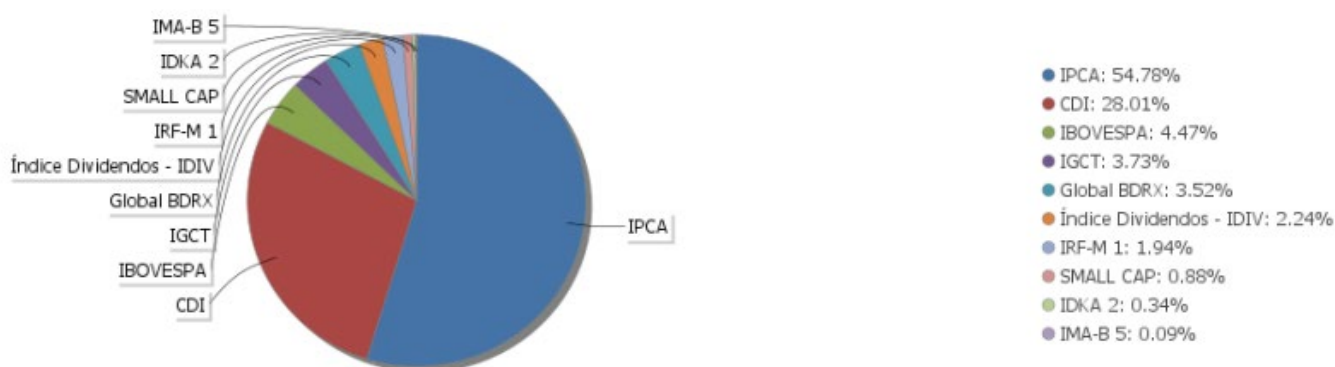
O CaraguaPrev aplicou os seus recursos obedecendo os segmentos de alocação determinados na Política de investimentos, não há investimento diverso.

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.

3.1 Alocação por Artigo – Resolução CMN.



3.2 Alocação por Estratégia



4. CREDENCIAMENTO DAS INSTITUIÇÕES

O CaraguaPrev com base na Portaria MTP 1.467/2022 e da Instrução Normativa n.º 34, de 27 de julho de 2022, verifica a situação patrimonial, fiscal, jurídica e comercial das instituições financeiras que possuem ou pretendem possuir ativos investidos com recursos previdenciários. Este processo geralmente é mensal, de acordo com o vencimento de credenciamento de cada instituição e tem como objetivos:

- Avaliar as Instituições no que se refere aos requisitos de saúde institucional (patrimonial, fiscal, jurídica e comercial);



- b) Fornecer a equipe de gestão parâmetros atualizados, para identificar, mensalmente, possíveis desvios das informações fornecidas;
- c) Fornecer informações para este presente relatório semestral.

4.1. Itens analisados no processo de credenciamento

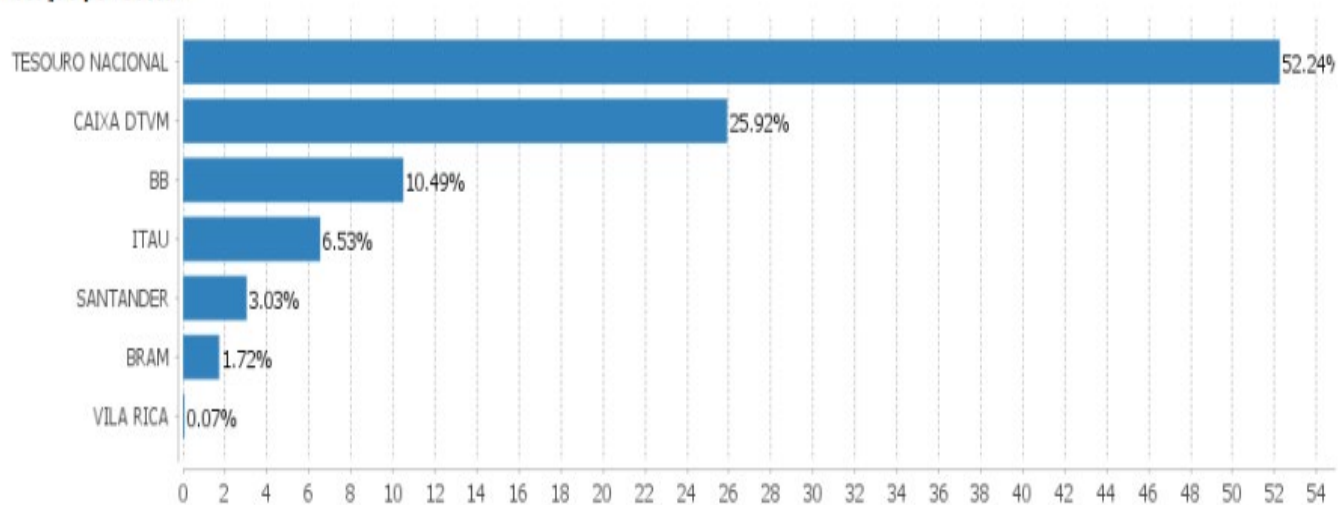
- a) **Patrimonial:** Os documentos buscam identificar a situação atual do patrimônio da Instituição como um todo e o controle de riscos internos para sua prevenção. • Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence (QDD) para a instituição e para Fundos de Investimento, preenchido e assinado pelos responsáveis pela instituição financeira, com as informações sobre a empresa e seus anexos: • Relatório de Rating's válido, conforme limites mínimos estabelecidos na "Política de Investimentos", com avaliação de grau de investimento de pelo menos uma das seguintes agências classificadoras de risco: Standard & Poors, Moody's, Fitch Ratings, Austin Rating.
- b) **Fiscal:** Os documentos permitem comprovar as situações fiscais em dia, no ato do credenciamento: • Certificado de Regularidade do FGTS – CRF; • Certidão da Fazenda Municipal, Estadual e Federal e Dívida Ativa da União; • Certidão Estadual de Distribuições Cíveis (Falência e Concordata);
- c) **Jurídico:** Os documentos permitem avaliar os atos de constituição da empresa, seus registros de funcionamento junto aos órgãos de regulação e suas vinculações legais perante a legislação vigente para os Institutos de Previdência. • Ato de registro ou autorização expedido pelo Banco Central do Brasil ou Comissão de Valores Mobiliários ou órgão competente; • Contrato Social ou Estatuto Social; • Comprovar o atendimento aos requisitos previstos na Resolução do Conselho Monetário Nacional n.º 4.963/21 e alterações;
- d) **Comercial:** Os documentos identificam a estrutura organizacional da equipe comercial que terá relacionamento com a gestão, estrutura própria ou via Agente Autônomo de Investimentos (AAI). Permite também dar ciência quanto os contratos de remuneração com terceiros, sem entrar no mérito de valores. Caso a distribuição dos ativos seja feita por AAI, a empresa, também é credenciada e apresenta todo o rol de documentação necessária. • Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence - Estrutura de distribuição dos produtos de investimentos (própria ou por meio de Agente Autônomo de Investimentos – AAI).



5. INSTITUIÇÕES – 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



a) BANCO DO BRASIL

Banco Público com concentração de recursos do seguimento de RPPS. Encaminhou documentação e renovou seu credenciamento, dentro das obrigações legais. Ao longo do semestre não foi encontrado indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial própria com atendimento através de agência bancária. Gestora BB ASSET MANAGEMENT (e suas subsidiárias) ocupa a posição número 1º no ranking de gestores da ANBIMA. Fundos investidos:



| | | |
|---------------------------------------|--------------------|---------------|
| BB PREV RF IRF-M 1 | 11.328.882/0001-35 | 281.766,45 |
| BB PREV RF IRF-M 1 (APORTES 37299-4) | 11.328.882/0001-35 | 12.083.555,64 |
| BB PREV RF PERFIL | 13.077.418/0001-49 | 4.556.940,33 |
| BB PREV RF PERFIL (APORTES 37299-4) | 13.077.418/0001-49 | 26.289.644,12 |
| BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI | 10.418.335/0001-88 | 24.674.470,96 |
| BB DIVIDENDOS FIC FIA | 05.100.191/0001-87 | 1.546.175,84 |

b) BRADESCO

Um dos maiores bancos privados do país, encaminhou documentação e renovou seu credenciamento, dentro das obrigações legais. Ao longo do semestre não foi encontrado indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial própria com atendimento através de agência bancária. A Gestora Bradesco (e suas subsidiárias) ocupa a posição número 8º no ranking de gestores da ANBIMA. Fundos investidos:

| | | |
|-----------------------------|--------------------|--------------|
| BRADESCO FIA SELECTION | 03.660.879/0001-96 | 5.600.389,59 |
| BRADESCO FIA SMALL CAP PLUS | 06.988.623/0001-09 | 5.796.521,69 |

c) CAIXA DTVM

Principal instituição da carteira do CaraguaPrev, em alocação de recursos. Banco Público com concentração de recursos do seguimento de RPPS. Encaminhou documentação e renovou seu credenciamento, dentro das obrigações legais. Ao longo do semestre não foi encontrado indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial própria com atendimento através de agência bancária. A Gestora CAIXA DTVM S/A (e suas subsidiárias) ocupa a posição número 4º no ranking de gestores da ANBIMA (dados referentes competência 04/2023) com R\$ 487.801,70 milhões sob gestão. Fundos investidos:

| | | |
|--|--------------------|---------------|
| CEF FI BRASIL IDKA2 PRÉ | 45.163.710/0001-70 | 2.247.465,28 |
| CEF FIC BR GESTAO ESTRATEGICA C/C 1000-0 | 23.215.097/0001-55 | 16.799.185,26 |
| CEF FI BRASIL REF DI LP 9999-0 (TX ADMINISTRATIVA) | 03.737.206/0001-97 | 14.258.556,35 |



| | | |
|--------------------------------|--------------------|---------------|
| CEF FI BRASIL REF DI LP 1000-0 | 03.737.206/0001-97 | 51.057.669,86 |
| CAIXA FI BRASIL MATRIZ RF | 23.215.008/0001-70 | 21.101.436,63 |
| FIA CAIXA INSTIT BDR NIVEL I | 17.502.937/0001-68 | 23.293.393,05 |
| CAIXA FI JUROS E MOEDAS | 14.120.520/0001-42 | 20.268.093,18 |

d) ITAÚ

Um dos maiores bancos privados do país, encaminhou documentação e renovou seu credenciamento, dentro das obrigações legais. Ao longo do semestre não foi encontrado indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial própria com atendimento através de agência bancária. A Gestora Itaú Unibanco Asset Management LTDA (e suas subsidiárias) ocupa a posição número 2º no ranking de gestores da ANBIMA (dados referentes competência 05/2023) com R\$ 821.809,77 milhões sob gestão. Fundos investidos:

| | | |
|-------------------------------|--------------------|---------------|
| ITAU INSTITUCIONAL RF IRF-M 1 | 08.703.063/0001-16 | 444.471,70 |
| ITAU INSTIT RF DI | 00.832.435/0001-00 | 27.884.685,68 |
| ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC | 24.571.992/0001-75 | 5.990.503,61 |
| ITAU ACOES MOMENTO 30 II FIC | 42.318.981/0001-60 | 8.855.940,85 |

e) SANTANDER

Banco Privado que integra o Grupo Santander, que é um grupo bancário global, liderado pelo Banco Santander, S.A., quarto maior banco da Zona Euro. Encaminhou documentação e renovou seu credenciamento, dentro das obrigações legais. Ao longo do semestre não foi encontrado indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Possui equipe comercial própria com atendimento através de agência bancária. A Gestora BANCO SANTANDER BRASIL S.A. (holding e suas subsidiárias) ocupa a 5º posição no ranking de gestores da ANBIMA (dados referentes competência 05/2023) com R\$ 311.994,25 milhões sob gestão. Fundos investidos:

| | | |
|---------------------------------------|--------------------|---------------|
| SANTANDER IMA-B5 PREMIUM FIC RF | 13.455.117/0001-01 | 615.140,16 |
| SANTANDER DI TITULOS PUBLICOS PREMIUM | 09.577.447/0001-00 | 19.416.841,23 |



f) VILA RICA

A Vila Rica Capital é uma gestora de recursos independente que atua há 08 (oito) anos no mercado de capitais brasileiro, especializada em gestão de fundos em condições especiais (special situations), fundos de reestruturação de créditos (NPL) e fundos estruturados, com atuação em operações de crédito e reestruturação de ativos. Ao longo do semestre não foi encontrado indícios de que as condições de patrimônio, fiscal, comercial ou jurídica tenham se prejudicado ao ponto de atuação de contingência por parte do instituto. Fundo investido:

| | | |
|------------------------------------|--------------------|------------|
| FIDC FECHADO MULTISSETORIAL ITALIA | 13.990.000/0001-28 | 487.238,57 |
|------------------------------------|--------------------|------------|

6. 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 |



Com relação à rentabilidade das aplicações, o CaraguáPrev apresentou no primeiro semestre de 2023 uma rentabilidade acumulada 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%.

7. RENTABILIDADE POR ARTIGO DA RESOLUÇÃO CMN

| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | Atribuição Desemp. (%) | No Ano(R\$) |
|-------------------------------------|----------------|-----------------|----------------|-----------------|------------------|---------------------|------------------------|----------------------|
| Artigo 7º I, Alínea a % do CDI | 0,48 44,72 | 6,31 97,08 | 2,53 80,42 | 6,31 97,08 | 9,69 71,56 | 1.649.217,71 | 0,25 | 20.819.790,75 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 1,48 137,62 | 6,98 107,35 | 3,49 110,90 | 6,98 107,35 | 11,84 87,41 | 754.368,46 | 0,12 | 1.995.132,70 |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | 1,13 105,10 | 6,44 99,02 | 3,24 102,92 | 6,44 99,02 | 13,50 99,67 | 1.615.569,17 | 0,25 | 8.495.442,98 |
| Artigo 7º V, Alínea a % do CDI | -0,03 -2,79 | 1,24 19,10 | 0,47 14,98 | 1,24 19,10 | -12,71 -93,83 | -145,65 | -0,00 | 5.974,68 |
| Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p. | 7,98 -1,02 | 5,97 -1,64 | 14,67 -1,24 | 5,97 -1,64 | 14,59 -5,24 | 5.595.430,68 | 0,86 | 4.267.075,90 |
| Artigo 9º II % do CDI | 0,00 0,00 | 6,13 94,38 | 0,54 17,01 | 6,13 94,38 | 11,03 81,44 | 0,00 | 0,00 | 160.631,81 |
| Artigo 9º III % do CDI | 0,47 43,67 | 14,53 223,59 | 5,60 178,11 | 14,53 223,59 | 13,40 98,98 | 108.526,22 | 0,02 | 4.596.658,54 |
| Artigo 10º I % do CDI | 1,22 114,02 | 12,24 188,41 | 3,41 108,37 | 12,24 188,41 | 19,96 147,41 | 238.789,97 | 0,04 | 2.059.166,12 |
| Artigo 7º | 0,75 | 6,42 | 2,81 | 6,42 | 10,72 | 4.019.009,69 | 0,62 | 31.316.341,11 |
| Artigo 8º | 7,98 | 5,97 | 14,67 | 5,97 | 14,59 | 5.595.430,68 | 0,86 | 4.267.075,90 |
| Artigo 9º | 0,47 | 14,51 | 5,79 | 14,51 | 13,83 | 108.526,22 | 0,02 | 4.757.290,35 |
| Artigo 10º | 1,22 | 12,24 | 3,41 | 12,24 | 19,96 | 238.789,97 | 0,04 | 2.059.166,12 |
| CARAGUATATUBA (Total) | | | | | | 9.961.756,56 | 1,53 | 42.399.873,48 |



8. EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

| Segmento | Jun/23 | Mai/23 | Abr/23 | Mar/23 | Fev/23 | Jan/23 |
|----------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Renda Fixa | 82,09 | 82,67 | 80,71 | 80,21 | 79,81 | 78,90 |
| Renda Variável | 11,32 | 10,80 | 10,60 | 10,52 | 11,04 | 11,98 |
| Investimentos no Exterior | 3,52 | 3,57 | 5,71 | 6,27 | 6,16 | 6,14 |
| Investimentos Estruturados | 3,06 | 2,96 | 2,99 | 3,00 | 3,00 | 2,99 |

RENTABILIDADE POR SEGMENTO

| Segmento | Jun/23 | Mai/23 | Abr/23 | Mar/23 | Fev/23 | Jan/23 |
|----------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Renda Fixa | 0,75 | 1,11 | 0,93 | 1,39 | 0,93 | 1,15 |
| Renda Variável | 7,98 | 4,02 | 2,09 | -3,46 | -7,52 | 3,51 |
| Investimentos no Exterior | 0,47 | 5,80 | -0,48 | 3,12 | 0,64 | 4,30 |
| Investimentos Estruturados | 1,22 | 1,25 | 0,90 | 1,46 | 0,53 | 6,42 |

ALOCAÇÃO POR INDEXADOR

| Indexador | Jun/23 | Mai/23 | Abr/23 | Mar/23 | Fev/23 | Jan/23 |
|--------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| CDI | 28,01 | 27,73 | 24,51 | 23,97 | 23,68 | 27,22 |
| Global BDRX | 3,52 | 3,57 | 5,71 | 5,82 | 5,72 | 5,69 |
| IBOVESPA | 4,47 | 4,35 | 4,28 | 4,27 | 4,51 | 4,90 |
| IGCT | 3,73 | 3,49 | 3,42 | 3,41 | 3,58 | 3,89 |
| IPCA | 54,78 | 55,52 | 56,44 | 56,67 | 56,56 | 52,12 |
| IRF-M 1 | 1,94 | 1,95 | 1,97 | 1,98 | 1,98 | 1,97 |
| Outros | 0,09 | 0,00 | 0,00 | 0,10 | 0,10 | 0,00 |
| Índice Dividendos - IDIV | 2,24 | 2,12 | 2,11 | 2,05 | 2,11 | 2,26 |

VAR POR SEGMENTO

| Segmento | Jun/23 | Mai/23 | Abr/23 | Mar/23 | Fev/23 | Jan/23 |
|----------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Renda Fixa | 0,07 | 0,05 | 0,05 | 0,05 | 0,11 | 0,09 |
| Renda Variável | 8,03 | 7,98 | 9,01 | 10,45 | 11,50 | 12,16 |
| Investimentos no Exterior | 7,63 | 7,57 | 8,98 | 9,81 | 11,41 | 11,91 |
| Investimentos Estruturados | 0,18 | 0,16 | 0,87 | 0,89 | 1,16 | 1,23 |

CVAR POR SEGMENTO

| Segmento | Jun/23 | Mai/23 | Abr/23 | Mar/23 | Fev/23 | Jan/23 |
|----------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| Renda Fixa | -0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,01 | 0,01 | 0,01 |
| Renda Variável | 0,87 | 0,81 | 0,77 | 0,85 | 0,97 | 1,16 |
| Investimentos no Exterior | 0,04 | 0,03 | 0,07 | 0,07 | 0,09 | 0,07 |
| Investimentos Estruturados | 0,00 | 0,00 | 0,01 | 0,01 | 0,02 | 0,02 |
| Carteira | 0,91 | 0,84 | 0,86 | 0,95 | 1,08 | 1,25 |



9. ANÁLISE DOS LASTROS RELATIVOS AOS INVESTIMENTOS

Com o objetivo de garantir os lastros dos investimentos, ou seja, compreender a garantia de cada investimento que o Caraguaprev possui, trazemos a explosão da carteira de cada fundo, com suas respectivas proporções nos ativos, utilizando a carteira mais recente de cada fundo.

Para melhor visualizar e gerir os ativos investidos, o processo de análise de lastros fornece a composição final dos ativos investidos, sejam eles realizados de forma direta, caso do investimento nos títulos públicos, seja de forma indireta, caso dos investimentos realizados via fundos de investimentos.

| | | |
|------------------|----------------|---------|
| Títulos Públicos | 413.624.955,32 | 62,51 % |
| Títulos Privados | 48.291.279,17 | 7,30 % |
| Ações | 72.147.490,26 | 10,90 % |

POSIÇÃO: 30/06/2023

Patrimônio Líquido: 661.672.777,36

FUNDOS ANALISADOS

| | |
|--|----------------|
| 1. CARAGUATATUBA | 661.672.777,36 |
| 2. BB AÇÕES DIVIDENDOS | 1.546.175,84 |
| 3. BB AÇÕES GOVERNANÇA FI | 24.674.470,96 |
| 4. BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 12.365.322,09 |
| 5. BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 30.846.584,45 |
| 6. BRADESCO F I A SELECTION | 5.600.389,59 |
| 7. BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS | 5.796.521,69 |
| 8. FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI | 21.101.436,63 |
| 9. FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 65.316.226,21 |
| 10. FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP | 20.268.093,18 |
| 11. FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 23.293.393,05 |
| 12. FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 16.799.185,26 |
| 13. FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO | 2.247.465,28 |
| 14. FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS | 7.610.811,98 |
| 15. FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 14.844.645,89 |
| 16. FIDC ITALIA SENIOR | NaN |
| 17. ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 5.990.503,61 |
| 18. ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 27.884.685,68 |
| 19. ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | 8.855.940,85 |
| 20. ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI | 444.471,70 |
| 21. SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI | 615.140,16 |
| 22. SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI | 19.416.841,23 |
| 23. BRAM FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES INSTITUCIONAL | 5.607.031,07 |
| 24. CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FIA | 14.793.740,51 |



A abertura da Carteira de Investimentos referente a data base 30/06/2023 de cada fundo de investimento, consta no relatório em anexo, elaborado pela Consultoria Financeira LDB empresas, com a verificação dos ativos que compõem o patrimônio dos fundos de investimentos, incluindo os títulos e valores mobiliários aplicados pelo RPPS.

10. PRINCIPAIS AÇÕES DE DILIGÊNCIA DO CARAGUAPREV:

Com o objetivo de monitoramento de riscos e notícias realizamos o acompanhamento periodicamente na internet de informações que venham a impactar ou possam trazer algum prejuízo para os investimentos realizados pelo CaraguaPrev.

- Reuniões periódicas com os Bancos e gestores com acompanhamento dos Fundos de Investimentos;
- Acompanhamento de monitoramento dos riscos;
- Informações das mídias;
- Acompanhamento em conjunto com a Consultoria Financeira contratada LDB empresas.
- Conforme Ata n.º 145, do Comitê de Investimentos e da Ata n.º 313, do Conselho Deliberativo, ambas de 29 de março de 2023, foi aprovado o resgate do valor total aplicado no fundo de investimento SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI, CNPJ: 34.258.351/0001-19, para aplicação do valor total resgatado no Fundo de Investimento SANTANDER RENDA FIXA REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI, CNPJ: 09.577.447/0001-00. No dia 03 de abril de 2023, foi encaminhado por e-mail para o Banco Santander o Ofício do CaraguaPrev n.º 50/2023 com a solicitação o resgate do fundo de investimento - Santander GO Global Equity ESG Reais (CNPJ 34.258.351/0001-19). Em seguida os representantes do CaraguaPrev tiveram acesso aos extratos e constataram que o Banco Santander realizou o resgate do fundo errado, que foi feito do fundo de investimento Global Equities Dolar (cnpj 17.804.792/0001-50) e não do fundo de investimento - Santander GO Global Equity ESG Reais (cnpj 34.258.351/0001-19), conforme solicitado. O fundo resgatado estava com rentabilidade negativa acumulada e diante da situação foi necessário o registro contábil dessa perda, já o



fundo que foi solicitado estava com rentabilidade positiva no seu acumulado. O investimento inicial realizado foi de R\$ 1.500.000,00 (um milhão e quinhentos mil reais) em 30 de setembro de 2021, com o resgate foi realizado o registro contábil de perda de R\$ 288.167,06 (duzentos e oitenta e oito mil e cento e sessenta e sete reais e seis centavos), mas na data de 23 de maio de 2023 o banco realizou a restituição do valor integral do valor solicitado, que foi registrado como receita orçamentária.

11. 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 em 21 de junho de 2021. A certificação garante 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. Após deliberação dos Colegiados do CaraguaPrev, foi aprovado o estudo para implementação do Pró-Gestão Nível III.

12. CONCLUSÃO

O relatório semestral de diligências de verificação dos lastros relativos aos títulos públicos e demais papéis incluídos nas carteiras de ativos dos fundos de investimentos aplicados pelo rpps, com a verificação dos ativos que compõem o patrimônio dos fundos de investimentos, incluindo os títulos e valores mobiliários aplicados pelo RPPS apresentam a diligência no acompanhamento da carteira de investimentos.

Quanto ao desempenho das aplicações financeiras do CaraguaPrev do semestre, 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.



Este relatório buscou apresentar a metodologia de acompanhamento dos ativos investidos e instituições financeiras de acordo os propósitos de gestão adotados no Pró- Gestão. No decorrer do semestre avaliado o CaraguaPrev apresentou diligência dos atores envolvidos no processo de investimentos, não encontrando situação que envolvesse riscos ao patrimônio investido.

COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV

Caraguatatuba/SP, 24 de agosto de 2023.

Luana Moussalli Forcioni Guedes

Diretora Financeira
Certificado ANBIMA CPA-10



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



Ivone Cardoso Vicente Alfredo

Membro do Comitê

