



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE CARAGUATATUBA/SP

CARAGUAPREV

AVALIAÇÃO FINANCEIRA

1º TRIMESTRE DE 2024



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	11
6.	RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS.....	12
7.	PERSPECTIVAS	16
9.	TABELA DE LIQUIDEZ	18
10.	MOVIMENTAÇÕES DO TRIMESTRE.....	19
11.	EXECUÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS.....	23
12.	RELAÇÃO DE GESTORES DOS RECURSOS.....	25
13.	RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV. MARÇO/2024	26
14.	RENTABILIDADE POR ARTIGO DA RESOLUÇÃO CMN DO TRIMESTRE AVALIADO.....	28
15.	PRÓ GESTÃO – NÍVEL III	28
16.	CONCLUSÃO.....	30



RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

1º TRIMESTRE DE 2024

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);
- Marcia Denise Gusmão Coelho (Certificação TOTUM);
- Roberta Alice Zimbres Franzolin (Certificação TOTUM);
- Ronaldo Cheberle (Certificação TOTUM);
- Diego Passos do Nascimento (Certificação TOTUM);
- Margarete Soares de Oliveira (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);
- Gabriela Cristina da Silva Coelho (Certificação TOTUM).

Comitê de Investimentos:

- Luana Moussalli Forcioni Guedes (Presidente do Comitê de Investimentos, Certificação TOTUM e Certificação Profissional CPA-10), término do mandato 12/01/2024;
- Anderson Franco Boytchuk do Nascimento (Presidente do Comitê de Investimentos, Certificação TOTUM), mandato à partir de 13/01/2024;
- 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), término do mandato 12/01/2024;
- Anderson Franco Boytchuk do Nascimento (Diretor Financeiro, Certificação TOTUM), mandato à partir de 13/01/2024;
- Rose Ellen de Oliveira Faria (Diretora de Benefícios, Certificação TOTUM); e



- Paulo Henrique Passos do Nascimento (Diretor Administrativo, Certificação TOTUM);

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

2. CENÁRIO MACROECONÔMICO

JANEIRO

GERAL: O cenário internacional, embora em janeiro os índices de ações globais tenham apresentado retornos positivos, o mês foi marcado pela resiliência da economia norte-americana e pelas discussões sobre o início do ciclo de corte de juros nos EUA. O que resultou na alta dos juros futuros e, conseqüentemente, no ganho de força do dólar em relação às demais moedas. Já na China, a deterioração do setor imobiliário prossegue, limitando a efetividade dos estímulos adotados pelo governo.

BRASIL: A carteira de investimentos do CaraguaPrev em renda fixa, exterior BDR e investimentos estruturados, apresentaram performance positivas no mês, já a renda variável apresentou performance negativa no mês. A rentabilidade geral da carteira foi de 0,63%, sendo que no acumulado do ano a rentabilidade é de 0,63%, abaixo da meta atuarial de 0,85%. O IPCA apresentou a variação de 0,41% em janeiro e a Taxa Selic recuou para 11,25%, alinhado com as perspectivas do mercado. No Brasil as curvas de juros futuras aumentaram no mês, acompanhando o movimento observado dos juros globais, além de terem sido impactadas negativamente. O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo na direção oposta dos índices globais e sendo impactada pela curva de juros, apresentando um retorno negativo de -4,79% no mês

FEVEREIRO

GERAL: O cenário internacional, continuando o movimento observado no mês anterior, houve uma alta de juros globais. Sendo este movimento originado pelas discussões sobre o início do ciclo de redução de juros norte-americanos e economia do país ainda aquecida. Nos EUA, a



atividade segue em uma direção robusta, com o PIB forte e o mercado de trabalho ainda aquecido. Os dados recentes de inflação se mostraram mais pressionados que o esperado, sugerindo que a desinflação deve ocorrer de maneira mais lenta do que o previsto. Já na China, ainda permanece um cenário de cautela, apesar dos estímulos do governo, o setor imobiliário residencial mostra elevado nível de fragilidade.

BRASIL: A carteira de investimentos do CaraguaPrev em renda fixa, renda variável, exterior BDR e investimentos estruturados, apresentaram performance positivas no mês. A rentabilidade geral da carteira foi de 1,12%, sendo que no acumulado do ano a rentabilidade é de 1,76%, abaixo da meta atuarial anual de 2,06%. O IPCA apresentou a variação de 0,83% em fevereiro, o resultado veio acima das expectativas do mercado financeiro, impulsionado com reajuste anual da educação e a Taxa Selic manteve-se em 11,25%, alinhado com as perspectivas do mercado. No Brasil as curvas de juros futuras aumentaram no mês, acompanhando, mesmo que em menor intensidade, o movimento observado dos juros globais. Com relação aos dados fiscais, as notícias foram marginalmente positivas, devido a uma arrecadação acima das expectativas. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo na direção dos índices globais. Apresentando um retorno positivo de +0,99% no mês. Entretanto, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -3,85% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +22,96%.

MARÇO

GERAL: O cenário internacional foi marcado pelas discussões sobre a velocidade da redução da inflação nas economias desenvolvidas e a manutenção da taxa de juros básica nos EUA. Além disso, houve continuidade do avanço dos ativos de risco nos mercados globais. Esse movimento ocorreu à medida que as curvas de juros mantiveram-se relativamente estáveis, apesar das declarações dos principais banqueiros centrais indicando que o início dos ciclos de redução de juros poderá ocorrer um pouco mais tarde.

BRASIL: A carteira de investimentos do CaraguaPrev em renda fixa, exterior BDR e investimentos estruturados, apresentaram performance positivas no mês, já a renda variável apresentou rentabilidade negativa. A rentabilidade geral da carteira no mês foi de 0,91%, sendo que no acumulado do ano a rentabilidade é de 2,68%, acima da meta atuarial anual de 2,63%. O IPCA apresentou a variação de 0,16% em março e a Taxa Selic reduziu para 10,75%, onde



números de inflação e de atividade acima das expectativas fizeram com que o Banco Central apresentasse uma mensagem mais conservadora em sua última reunião do Copom, sinalizando apenas mais um corte de 0,5% na Selic e deixando os próximos passos em aberto, a depender dos dados. No Brasil as curvas de juros futuras aumentaram no mês, refletindo o aumento da incerteza sobre a condução da política econômica. Assim, o Ibovespa ficou em território negativo e o Real perdeu espaço frente ao dólar. O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo na direção oposta dos índices globais. Apresentando um retorno de -0,71% no mês. Dessa forma, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -4,53% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +25,74%.

3. BOLETIM FOCUS

Mediana - Agregado	2024							2025							2026						
	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 %)	3,76	3,75	3,75	= (1)	150	3,74	104	3,51	3,51	3,51	= (1)	145	3,54	99	3,50	3,50	3,50	= (39)	122		
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	1,77	1,85	1,89	▲ (7)	112	1,89	62	2,00	2,00	2,00	= (16)	103	2,00	55	2,00	2,00	2,00	= (34)	80		
Câmbio (R\$/US\$)	4,93	4,95	4,95	= (2)	120	4,95	78	5,00	5,00	5,00	= (12)	113	5,00	75	5,04	5,03	5,04	▲ (1)	85		
Selic (% a.a)	9,00	9,00	9,00	= (14)	141	9,00	93	8,50	8,50	8,50	= (17)	137	8,50	89	8,50	8,50	8,50	= (35)	109		
IGP-M (variação %)	2,91	2,38	2,00	▼ (11)	75	2,00	55	3,80	3,79	3,65	▼ (2)	62	3,61	47	3,90	3,90	3,90	= (7)	57		
IPCA Administrados (variação %)	4,07	4,15	4,15	= (1)	97	4,15	68	3,93	3,92	3,92	= (1)	82	3,92	61	3,50	3,50	3,50	= (7)	57		
Conta corrente (US\$ bilhões)	-35,50	-32,00	-32,00	= (2)	26	-32,35	14	-40,00	-35,00	-36,95	▼ (1)	26	-40,00	14	-40,00	-40,00	-40,00	= (7)	17		
Balança comercial (US\$ bilhões)	80,98	81,50	82,00	▲ (2)	23	82,87	13	72,05	74,55	74,55	= (1)	20	76,00	10	77,80	77,00	77,00	= (2)	13		
Investimento direto no país (US\$ bilhões)	68,92	65,50	65,00	▼ (1)	23	69,50	10	75,00	73,10	73,10	= (1)	23	77,50	10	80,00	80,00	80,00	= (1)	16		
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	63,74	63,94	63,85	▼ (1)	24	64,00	13	66,50	66,42	66,42	= (2)	24	66,60	13	68,65	68,60	68,60	= (1)	20		
Resultado primário (% do PIB)	-0,78	-0,75	-0,70	▲ (1)	42	-0,70	22	-0,60	-0,60	-0,60	= (10)	41	-0,50	22	-0,50	-0,50	-0,50	= (4)	28		
Resultado nominal (% do PIB)	-6,90	-6,80	-6,90	▼ (1)	23	-7,00	12	-6,30	-6,29	-6,29	= (2)	22	-6,40	12	-5,95	-6,00	-6,00	= (2)	16		

Relatório Focus de 28.03.2024. Fonte: <https://www.bcb.gov.br/publicacoes/focus>

4. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

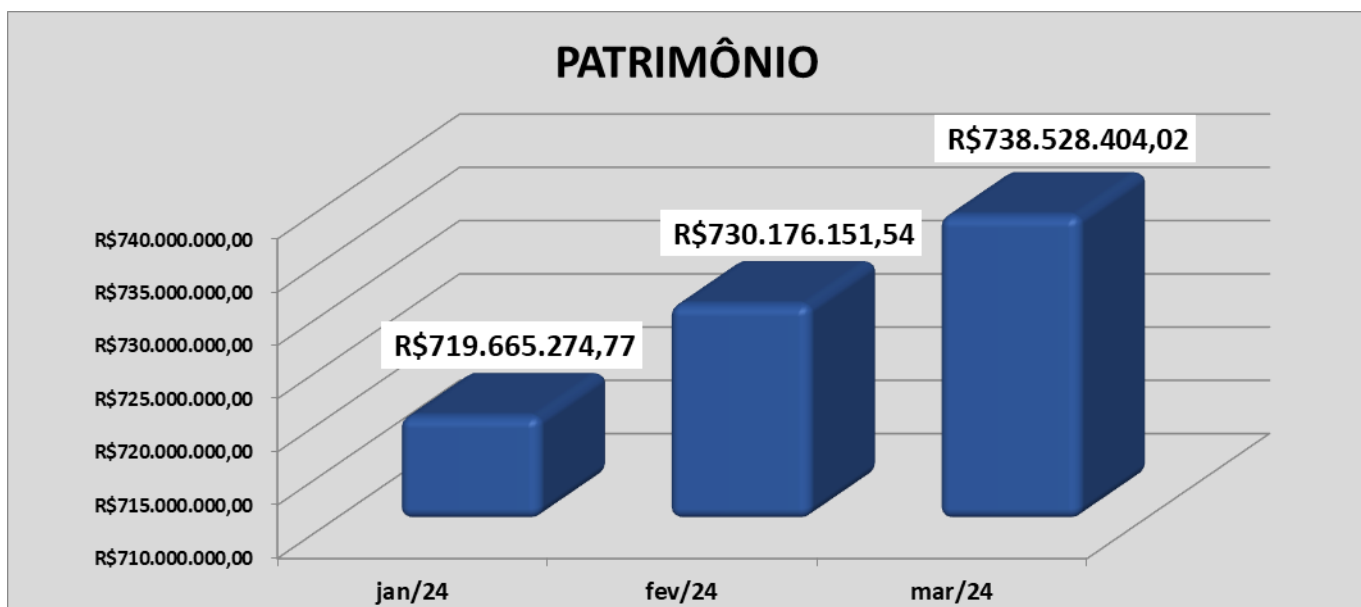
A carteira de investimentos do CaraguáPrev encerrou o trimestre com o patrimônio total de **R\$ 738.528.404,02** (setecentos e trinta e oito milhões e quinhentos e vinte e oito mil e quatrocentos e quatro reais e dois centavos).

É composta por ativos que estão vinculados ao seu respectivo Plano Previdenciário (PPREV), também compõe a carteira de investimentos os recursos oriundos da taxa de administração, que são utilizados na manutenção dos serviços e pagamento de pessoal da autarquia. O Plano Previdenciário



possui meta atuarial estabelecida, sendo este um fundo previdenciário em regime de capitalização dos recursos, este relatório dará enfoque aos ativos a ele vinculados.

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



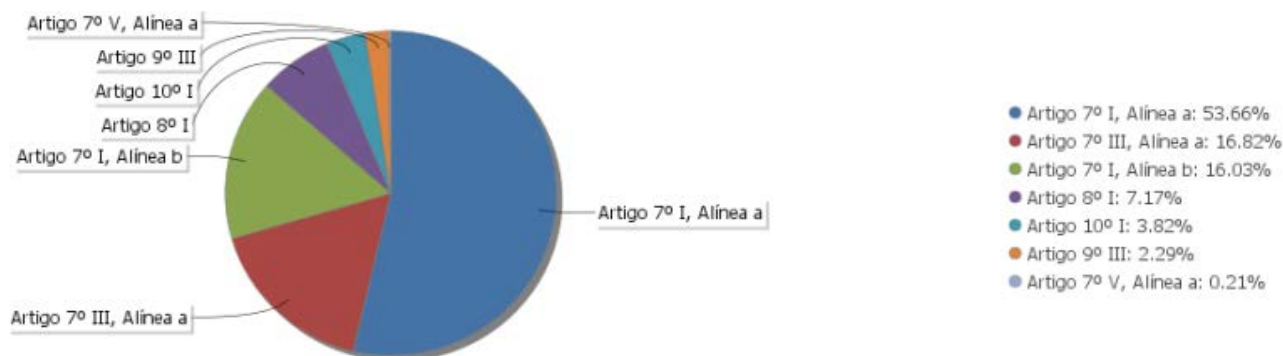
Mês 2024	PATRIMÔNIO
jan/24	R\$ 719.665.274,77
fev/24	R\$ 730.176.151,54
mar/24	R\$ 738.528.404,02

4.1 ESTUDO ALM

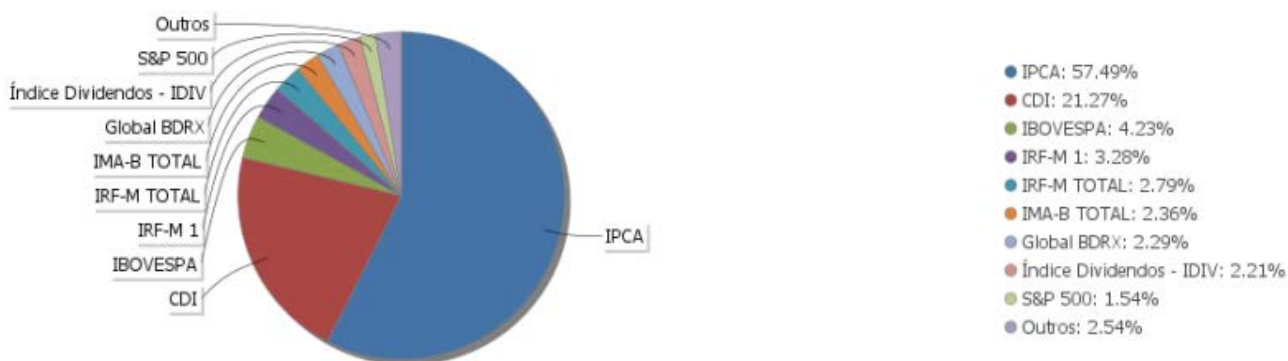
O estudo de Asset Liability Management (ALM) foi realizado na data de 31/05/2023, onde foram estudados os patamares de riscos x retorno (fronteira eficiente Markowitz).



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
2024	0,83	1,12	0,91										2,88
IPCA + 5,02%	0,85	1,20	0,55										2,63
p.p. indexador	-0,22	-0,08	0,38										0,08
2023	1,75	-0,11	0,98	0,97	1,68	1,53	0,99	0,35	0,50	0,40	1,81	1,45	12,95
IPCA + 5,03%	0,96	1,19	1,18	0,96	0,68	0,33	0,53	0,68	0,65	0,65	0,67	0,95	9,82
p.p. indexador	0,79	-1,30	-0,20	0,00	1,00	1,20	0,48	-0,33	-0,15	-0,25	1,14	0,50	3,13
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 + 4,98%	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 + 5,48%	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	2,80	3,94	-1,32	-1,68	-0,06	3,29	4,43	5,12
IPCA + 5,88%	0,71	0,68	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,88	10,85
p.p. indexador	-0,45	-1,88	-9,40	2,11	1,97	1,86	3,08	-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	1,18	0,11	1,85	2,11	-0,78	2,17	15,34
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,84	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	29	48,03
Meses abaixo - Meta Atuarial	34	53,97
	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	2,88	2,63	0,08	1,10
06 meses	6,48	4,98	1,50	1,33
12 meses	13,02	9,04	3,98	1,54
24 meses	18,58	19,82	-1,28	3,32
36 meses	21,04	40,49	-19,45	4,29
48 meses	38,08	57,61	-19,55	5,44
60 meses	40,58	72,62	-32,04	6,98
Desde 31/12/2018	43,82	77,71	-33,89	6,84

No trimestre a carteira de investimentos do plano previdenciário obteve rentabilidade de 2,68%, acima da meta atuarial do trimestre, que é de 2,63%. No acumulado do ano corrente a rentabilidade é de 2,68%, acima da meta atuarial do ano que é de 2,63%.

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 + 5,02%.



6. RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS

6.1 FUNDOS DE RENDA FIXA E TÍTULOS PÚBLICOS.

RENDA FIXA 86,73%

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%)	2,94	0,03	1,01	3,12	21.083.152,82	2,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	0,28	0,04	1,02	3,12	10.763.841,61	1,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (6,080000%)	4,16	0,03	0,15	0,15	20.027.785,41	2,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	0,32	0,03	1,02	3,15	5.326.026,44	0,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,42	0,03	0,98	3,03	17.572.585,61	2,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,43	0,03	1,00	3,09	20.566.078,48	2,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,55	0,03	1,00	3,06	33.618.740,57	4,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,55	0,03	1,00	3,07	11.179.310,26	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,55	0,03	1,00	3,08	11.161.329,23	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,64	0,03	1,00	3,09	11.143.847,72	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,61	0,01	1,01	3,09	10.776.165,27	1,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,892000%)	0,27	0,03	1,01	3,10	5.631.124,95	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,910000%)	0,27	0,03	1,01	3,11	10.644.795,69	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,090000%)	0,27	0,04	1,02	3,15	5.323.331,54	0,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,440000%)	0,27	0,04	1,05	3,23	20.817.147,19	2,82



Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,480000%)	0,27	0,04	1,05	3,24	21.677.844,29	2,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,680000%)	0,27	0,04	1,07	3,29	5.350.336,61	0,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,990300%)	0,27	0,04	1,09	3,36	30.974.249,57	4,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	0,30	0,03	1,04	3,21	15.557.704,76	2,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	0,32	0,02	1,04	3,21	15.557.071,58	2,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,36	0,03	1,00	3,06	11.121.550,88	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,650000%)	0,48	0,03	0,99	3,05	947.557,79	0,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,49	0,03	1,00	3,08	11.154.484,46	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,60	0,03	1,00	3,06	11.217.426,44	1,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,60	0,03	1,00	3,08	10.841.558,79	1,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,60	0,03	1,00	3,09	11.140.409,05	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,61	0,03	1,01	3,11	3.998.679,07	0,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,58	0,01	1,01	3,11	10.709.936,05	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,970000%)	2,99	0,02	1,02	3,12	20.516.270,88	2,78
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,39	0,03	1,02	3,14	396.400.343,01	53,67

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.				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	0,97	0,03	0,77	2,41	10.332.431,29	1,40	6.783.435.564,44	0,15



CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	2,58	0,03	0,50	1,64	2.589.521,00	0,35	285.628.413,52	0,91
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,06	0,04	0,82	2,60	21.127.284,18	2,86	7.500.793.542,93	0,28
BB	BB	BB PREV RF IRF M	2,20	0,02	0,50	1,61	20.598.602,89	2,79	4.229.973.113,40	0,49
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	0,25	0,04	0,84	2,43	489.223,02	0,07	538.968.478,15	0,09
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,24	0,04	0,80	2,43	23.754.284,03	3,22	8.304.571.205,30	0,29
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,88	-0,00	0,06	0,13	10.229.659,46	1,39	5.029.824.301,86	0,20
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	3,18	0,02	0,39	1,30	10.727.244,58	1,45	1.526.568.432,06	0,70
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,36	0,03	0,58	1,80	17.867.560,06	2,42	5.431.217.487,91	0,33
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,83	0,02	0,44	1,37	657.211,69	0,09	317.864.934,45	0,21
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,17	0,03	0,61	1,89	118.373.022,20	16,03		

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.				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,26	-0,00	0,00	-0,29	7.208.169,89	0,98	428.881.205,20	1,68
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,04	0,87	2,72	21.841.647,04	2,96	16.216.695.874,70	0,13
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,09	0,04	0,90	2,80	23.221.994,15	3,14	5.551.814.336,71	0,42
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,85	2,65	54.313.428,72	7,35	16.860.564.075,44	0,32
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,10	0,04	0,85	2,70	17.607.415,53	2,38	6.030.179.613,18	0,29
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,20	0,04	0,82	2,54	124.192.655,33	16,82		

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	111,75	0,30	0,30	1,74	1.542.313,64	0,21	60.439.905,56	2,55
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			111,75	0,30	0,30	1,74	1.542.313,64	0,21		

Os investimentos em Renda Fixa que compõem a carteira do CaraguaPrev são compostos por Títulos Públicos Federais – art. 7º, I, alínea “a”, FUNDOS 100% TITULOS PUBLICOS - ART. 7º, I, alínea “b”, FUNDOS DE RENDA FIXA – ART. 7º, III, alínea “a” e Cota Sênior de FIDC, ART. 7º, V, alínea “a”, representam 86,73% 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 2,77%, acima da meta atuarial que foi de 2,63% no trimestre.



6.2 FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL.

RENDA VARIÁVEL										7,17%
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	13,72	0,15	-0,97	-4,21	1.675.400,84	0,23	576.527.415,79	0,29
BRAM	BEM	BRABESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	20,52	0,08	-0,11	-5,08	5.464.520,40	0,74	652.744.629,19	0,84
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	15,52	0,39	-0,44	-3,57	8.242.017,84	1,12	743.274.690,86	1,11
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	12,81	0,12	-1,01	-2,33	16.292.389,65	2,21	1.020.718.638,42	1,60
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	13,98	0,47	0,97	1,44	6.880.213,33	0,93	1.248.705.426,92	0,55
BRAM	BEM	BRABESCO F I A SELECTION	15,41	0,14	-0,62	-3,04	5.786.498,31	0,78	398.177.050,35	1,45
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	18,04	-0,04	0,80	-5,56	8.619.372,63	1,17	147.570.225,77	5,84
Sub-total Artigo 8º I			14,91	0,18	-0,24	-3,02	52.960.413,00	7,17		
Renda Variável			14,91	0,18	-0,24	-3,02	52.960.413,00	7,17		

Os Fundos de renda variável - AÇÕES que compõem a carteira do CaraguaPrev são compostos por FUNDOS DE AÇÕES - ART. 8º, I e representam 7,17% da Carteira de Investimentos. (*Resolução CMN n.º 4.963/21*).

No trimestre avaliado a rentabilidade do FUNDO DE AÇÕES foi de -3,02%, abaixo da meta atuarial que foi de 2,63% no trimestre.

6.3 FUNDOS ESTRUTURADOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS										3,82%
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	0,38	0,03	0,70	2,33	16.772.734,42	2,27	1.243.282.265,99	1,35
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,49	0,14	3,39	11,13	11.402.973,70	1,54	1.864.604.527,50	0,61
Sub-total Artigo 10º I			2,20	0,08	1,77	5,72	28.175.708,12	3,82		
Investimentos Estruturados			2,20	0,08	1,77	5,72	28.175.708,12	3,82		

Os Investimentos Estruturados, Fundo Multimercado - ART. 10, I, que compõem a carteira do CaraguaPrev representa 3,82% da Carteira de Investimentos. (*Resolução CMN n.º 4.963/21*)

No trimestre avaliado a rentabilidade dos INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS foi de 5,72%, acima da meta atuarial que foi de 2,63% no trimestre.

6.4 FUNDOS DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR											2,29%
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	14,00	0,35	3,48	14,98	16.883.948,72	2,29	2.280.222.056,45	0,74	
Sub-total Artigo 9º III			14,00	0,35	3,48	14,98	16.883.948,72	2,29			
Investimentos no Exterior			13,97	0,35	3,48	14,98	16.883.948,72	2,29			

Os Fundos de Investimento no Exterior Ações BDR Nível I – Art. 9º, III, que compõem a carteira do CaraguaPrev representam 2,29% da Carteira de Investimentos. (*Resolução CMN n.º 4.963/21*).

No trimestre avaliado a rentabilidade do fundo de Investimento no Exterior foi de 14,98%, acima da meta atuarial que foi de 2,63% no trimestre.

7. PERSPECTIVAS

Renda Fixa: A gradual redução da taxa básica de juros no Brasil vem diminuindo a intensidade dos “raios solares” na renda fixa brasileira. Entretanto, assim como vemos na renda fixa global, isso não significa que a classe de ativos perdeu sua atratividade. Em março, a Selic foi reduzida para 10,75% ao ano pelo Banco Central, conforme amplamente esperado pelos investidores. Porém, com incertezas sobre quando os juros começarão a cair no mundo desenvolvido e dados mostrando uma inflação ainda teimosa, especialmente no setor de serviços (diante de um mercado de trabalho também aquecido por aqui), as sinalizações do Banco Central foram de cautela em relação ao futuro da queda dos juros. Mesmo diante da queda da Selic, títulos pós-fixados atrelados ao CDI ou a Selic devem continuar apresentando retornos elevados, acima dos níveis de inflação. Exemplo disso é o retorno registrado em março, de 0,8%, que ficou acima dos retornos observados nas outras classes de renda fixa.



Renda Variável: Enquanto o primeiro trimestre de 2024 foi o melhor para ações globais em 5 anos (com o MSCI ACWI, índice de ações internacionais, subindo 7,7%), o Ibovespa acumulou perdas de -4,4%. Por aqui, estrangeiros continuam tirando dinheiro da bolsa diante do cenário incerto sobre os juros nos EUA, pressionando para baixo os preços.

Investimentos Estruturados e Exterior: Apesar do efeito negativo dos juros altos nos ativos de maior risco (como ações), março foi outro mês marcado pela alta nas bolsas americanas, desafiando o “tempo fechado” para esse tipo de investimento. Nem mesmo os múltiplos elevados têm sido o suficiente para derrubar as bolsas americanas. Ou seja, apesar de estarem “caras”, quando comparado ao histórico, as bolsas americanas seguem em alta. Uma série de fatores tem contribuído para o otimismo nos mercados globais, incluindo a redução da probabilidade de uma recessão nos EUA, a expectativa de lucros das empresas com a eficiência fruto da inteligência artificial e a iminência do ciclo de corte de juros no mundo desenvolvido. Apesar do otimismo atual de investidores, investir no mercado de ações americano continua apresentando riscos elevados, especialmente para quem não tem horizonte de longo prazo ou perfil para esse tipo de investimento.

8. GERENCIAMENTO DE RISCOS - INDICADORES DE DESEMPENHO E RISCO

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%	Value-At-Risk (R\$): 4.185.667,78	Value-At-Risk: 0,57%
---	---	--------------------------------

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,35	0,12		0,05	0,20	0,90	640.508.334,18	86,73
Artigo 8º	10,29	6,04		0,41	-0,10	-0,24	52.960.413,00	7,17
Artigo 9º	12,38	5,51		0,04	0,21	3,48	16.883.948,72	2,29
Artigo 10º	3,97	2,07		0,06	0,24	1,77	28.175.708,12	3,82
CARAGUATATUBA	1,07	0,57		0,57	0,07	0,91	738.528.404,02	100,00

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

8.1 Índice de Sharpe

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

8.2 VaR

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

8.3 Volatilidade

A volatilidade é uma medida estática que mede o risco de um ativo, de acordo com a intensidade e frequência de sua oscilação de preço em um determinado período. Por meio dela, é possível entender o histórico de um ativo, qual a probabilidade de ele subir ou cair, de acordo com o período preestabelecido, e qual será a estimativa de oscilação do seu preço no futuro. Se o preço de um ativo for muito volátil, por exemplo, é sinal de que sua cotação, em relação às flutuações do mercado, oscila muito, tornando sua compra arriscada, mas, por outro lado, proporciona maior possibilidade de lucro no curtíssimo prazo.

9. TABELA DE LIQUIDEZ

Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	302.094.067,56	40,90		302.094.067,56	40,90
de 31 dias a 365 dias	140.452.823,29	19,02		442.546.890,85	59,92
acima de 365 dias	295.981.513,17	40,08		738.528.404,02	100,00



Liquidez, em contabilidade, corresponde à velocidade e facilidade com a qual um ativo pode ser convertido em caixa. 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, 40,90% 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
1	08/01/2024	Repasso da compensação previdenciária – COMPREV 11/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 9999-6	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 237.786,29	APLICAÇÃO
2	10/01/2024	Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial CaraguaPrev 01/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 8.379,03	APLICAÇÃO
3	10/01/2024	Resgate na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO.	R\$ 53.000,00	RESGATE
4	10/01/2024	Restituição Benefício Previdenciário de Pensionista do CaraguaPrev, Banco Itaú, Ag 0248 C/C 04042-0	FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M1	R\$ 400,00	APLICAÇÃO
5	18/01/2024	Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Câmara Municipal, referente mês 01/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 46.721,45	APLICAÇÃO
6	18/01/2024	Repasso Aporte para cobertura do déficit atuarial FUNDACC, referente ao mês 01/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 8.784,75	APLICAÇÃO
7	19/01/2024	Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Prefeitura Municipal, referente ao mês 01/2024, 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
8	19/01/2024	Repasso das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal referente ao mês 12/2023 e 13º salário/2023, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	R\$ 8.995.101,95	APLICAÇÃO



9	19/01/2024	Transferência do valor da Taxa de administração correspondente ao mês 01/2024, CEF, Ag 0797, C/C 9999-0	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 837.446,62	APLICAÇÃO
10	30/01/2024	Resgate na CEF, AG 0797, C/C 1000-0, FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP - CNPJ Nº 03.737.206/0001-97	FOLHA DE PAGAMENTO DOS APOSENTADOS E PENSIONISTAS DO CARAGUAPREV REF. JANEIRO DO ANO DE 2024.	R\$ 4.177.062,82	RESGATE
11	30/11/2024	Repasse das contribuições previdenciárias da Câmara Municipal referente mês 01/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	R\$ 107.059,93	APLICAÇÃO
12	30/01/2024	Repasse das contribuições previdenciárias do CaraguaPrev, referente ao mês 01/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	R\$ 36.960,08	APLICAÇÃO
13	30/01/2024	Resgate na CEF, AG 0797, C/C 9999-0, FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP - CNPJ Nº 03.737.206/0001-97	FOLHA DE PAGAMENTO DOS ATIVOS REF JANEIRO/2024	R\$ 251.090,97	RESGATE
14	31/01/2024	Repasse das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal e Câmara Municipal – aposentados e pensionistas referente ao mês de 01/2024.	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI	R\$ 2.303,19	APLICAÇÃO
15	02/02/2024	Repasse Aporte para cobertura do déficit atuarial FUNDACC, referente ao mês 02/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 8.784,75	APLICAÇÃO
16	06/02/2024	Restituição Benefício Previdenciário de Pensionista do CaraguaPrev, Banco Itaú, Ag 0248 C/C 04042-0	FI ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M1	R\$ 400,00	APLICAÇÃO
17	07/02/2024	Repasse da compensação previdenciária – COMPREV 12/2023, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 9999-6	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 237.786,29	APLICAÇÃO
18	09/02/2024	Repasse do Aporte para cobertura do déficit atuarial CaraguaPrev 02/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 8.379,03	APLICAÇÃO
19	09/02/2024	Repasse das contribuições previdenciárias da Fundacc referente mês 01/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	R\$ 60.487,26	APLICAÇÃO
20	09/02/2024	Resgate na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.	FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO.	R\$ 70.000,00	RESGATE
21	16/02/2024	Recebimento de cupom NTN-B, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP	R\$ 6.449.004,25	APLICAÇÃO



22	20/02/2024	Repasse do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Câmara Municipal, referente mês 02/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 46.721,45	APLICAÇÃO
23	20/02/2024	Repasse do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Prefeitura Municipal, referente ao mês 02/2024, 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
24	20/02/2024	Repasse das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal referente ao mês 01/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP	R\$ 4.520.903,35	APLICAÇÃO
25	20/02/2024	Transferência do valor da Taxa de administração correspondente ao mês 02/2024, CEF, Ag 0797, C/C 9999-0	FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 837.446,62	APLICAÇÃO
26	21/02/2024	Resgate na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.	FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO.	R\$ 126.000,00	RESGATE
27	28/02/2024	Resgate na CEF, AG 0797, C/C 1000-0, FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP - CNPJ Nº 03.737.206/0001-97	FOLHA DE PAGAMENTO DOS APOSENTADOS E PENSIONISTAS DO CARAGUAPREV REF. FEVEREIRO DO ANO DE 2024.	R\$ 4.214.589,92	RESGATE
28	28/02/2024	Repasse das contribuições previdenciárias do CaraguaPrev, referente ao mês 02/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP	R\$ 37.874,62	APLICAÇÃO
29	28/02/2024	Resgate na CEF, AG 0797, C/C 9999-0, FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP - CNPJ Nº 03.737.206/0001-97	FOLHA DE PAGAMENTO DOS ATIVOS REF FEVEREIRO/2024	R\$ 244.476,97	RESGATE
30	29/02/2024	Repasse das contribuições previdenciárias da Câmara Municipal referente mês 02/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP	R\$ 111.580,77	APLICAÇÃO
31	29/02/2024	Repasse das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal e Câmara Municipal – aposentados e pensionistas referente ao mês de 02/2024.	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI	R\$ 2.303,19	APLICAÇÃO
32	07/03/2024	Repasse da compensação previdenciária – COMPREV 01/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 9999-6	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 246.607,10	APLICAÇÃO
33	07/03/2024	Repasse Aporte para cobertura do déficit atuarial FUNDACC, referente ao mês 03/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 8.784,75	APLICAÇÃO
34	08/03/2024	Repasse das contribuições previdenciárias da Fundacc referente mês 02/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	R\$ 65.580,09	APLICAÇÃO
35	08/03/2024	Resgate na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.	FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO.	R\$ 60.000,00	RESGATE



36	11/03/2024	Restituição Benefício Previdenciário de Pensionista do CaraguaPrev, Banco Itaú, Ag 0248 C/C 04042-0	FI ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-MI	R\$ 400,00	APLICAÇÃO
37	12/03/2024	Resgate na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.	FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO.	R\$ 36.000,00	RESGATE
38	15/03/2024	Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial CaraguaPrev 03/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 8.379,03	APLICAÇÃO
39	20/03/2024	Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Prefeitura Municipal, referente ao mês 03/2024, 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
40	20/03/2024	Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Câmara Municipal, referente mês 03/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 46.721,45	APLICAÇÃO
41	20/03/2024	Repasso das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal referente ao mês 02/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	R\$ 4.867.868,69	APLICAÇÃO
42	21/03/2024	Resgate na CEF, AG 0797, C/C 9999-0, FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP - CNPJ Nº 03.737.206/0001-97	AQUISIÇÃO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B 760199 COM VENC. 15/05/2025	R\$ 19.998.350,12	RESGATE
43	21/03/2024	Transferência do valor da Taxa de administração correspondente ao mês 03/2024, CEF, Ag 0797, C/C 9999-0	FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 837.446,62	APLICAÇÃO
44	22/03/2024	Resgate na CEF, AG 0797, C/C 9999-0, FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP - CNPJ Nº 03.737.206/0001-97	AQUISIÇÃO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B 760199 COM VENC. 15/05/2025	R\$ 19.998.350,11	APLICAÇÃO
45	25/03/2024	Resgate na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.	FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO.	R\$ 142.000,00	RESGATE
46	27/03/2024	Repasso das contribuições previdenciárias do CaraguaPrev, referente ao mês 03/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP	R\$ 38.446,82	APLICAÇÃO
47	27/03/2024	Repasso das contribuições previdenciárias da Câmara Municipal referente mês 03/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP	R\$ 111.580,77	APLICAÇÃO
48	27/03/2024	Resgate na CEF, AG 0797, C/C 1000-0, FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP - CNPJ Nº 03.737.206/0001-97	FOLHA DE PAGAMENTO DOS APOSENTADOS E PENSIONISTAS DO CARAGUAPREV REF. MARÇO E PRECATÓRIOS DO ANO DE 2024.	R\$ 4.791.511,02	RESGATE
49	27/03/2024	Resgate na CEF, AG 0797, C/C 9999-0, FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP - CNPJ Nº 03.737.206/0001-97	FOLHA DE PAGAMENTO DOS ATIVOS REF FEVEREIRO E PRECATÓRIOS	R\$ 675.023,69	RESGATE



50	28/03/2024	Repasse das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal e Câmara Municipal – aposentados e pensionistas referente ao mês de 03/2024.	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI	R\$ 2.303,19	APLICAÇÃO
----	------------	--	---------------------------------------	-----------------	-----------

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

1. RESGATE de R\$ 19.998.350,11 (dezenove milhões, novecentos e noventa e oito mil, trezentos e cinquenta reais e onze centavos), do Fundo de Investimento FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP, Caixa Econômica Federal, ag. 0797, c/c 1000-0, em 22/03/2024, para AQUISIÇÃO 4.612 (quatro mil seiscentos e doze) NTN-B TITULOS PÚBLICOS, com vencimento em 15/05/2025, a taxa de 6,0820 %.

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 horizonte de planejamento utilizado na sua elaboração compreende o período de 12 meses que se estende de janeiro a dezembro de 2024.



CARAGUAPREV

Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba
Estado de São Paulo



ICQ BRASIL RPPS SPREV



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.

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 2024.

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

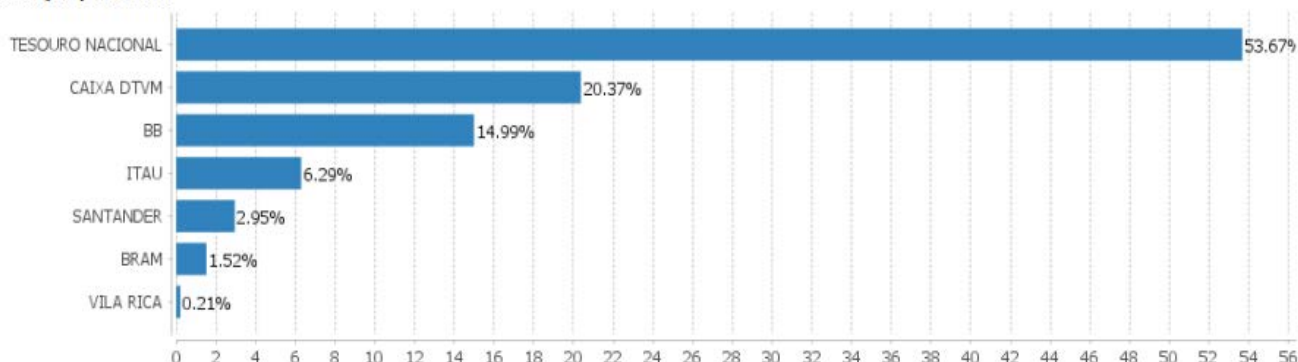
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 3	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Titulos do Tesouro Nacional	396.400.343,01	53,67	0,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Titulos Públicos	118.373.022,20	16,03	0,00	16,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	124.192.655,33	16,82	0,00	19,80	75,00	0,00	75,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.542.313,64	0,21	0,00	0,20	15,00	0,00	15,00
	Total Renda Fixa	640.508.334,18	86,73					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	52.960.413,00	7,17	0,00	6,00	45,00	0,00	45,00
	Total Renda Variável	52.960.413,00	7,17					45,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	16.883.948,72	2,29	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	16.883.948,72	2,29					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	28.175.708,12	3,82	0,00	8,00	15,00	0,00	15,00
	Total Investimentos Estruturados	28.175.708,12	3,82					20,00
Total		738.528.404,02	100,00					

12. RELAÇÃO DE GESTORES DOS RECURSOS

Gestor	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financeiro Mês (R\$)
BB	108.356.480,67	1.511.780,94	0,00	0,00	110.674.147,77	805.886,16
BRAM	11.292.878,38	0,00	0,00	0,00	11.251.018,71	-41.859,67
CAIXA DTVM	168.743.163,37	5.920.922,99	-25.702.884,83	0,00	150.457.112,00	1.495.910,47
ITAU	46.069.565,32	2.703,19	0,00	0,00	46.418.973,02	346.704,51
SANTANDER	21.608.838,50	0,00	0,00	0,00	21.784.495,87	175.657,37
TESOURO NACIONAL	372.567.033,23	19.998.350,11	0,00	0,00	396.400.343,01	3.834.959,67
VILA RICA	1.537.692,07	0,00	0,00	0,00	1.542.313,64	4.621,57



Alocação por Gestor



13. RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV. MARÇO/2024

Aplicações em Fundos de Investimentos e Títulos Públicos

MARÇO – 2024

FUNDO	CNPJ	VALOR	% RECURSOS
BB PREV RF RETORNO TOTAL	35.292.588/0001-69	10.332.431,29	1,4248
BB PREVID RENDA FIXA IRF-M TP FI	07.111.384/0001-69	20.598.602,89	2,8628
BB PREV RF IRF-M 1	11.328.882/0001-35	10.634.634,76	1,4400
BB PREV RF IRF-M 1 (APORTES 37299-4)	11.328.882/0001-35	13.119.649,27	1,7765
CEF FI BRASIL IDKA2 PRÉ	45.163.710/0001-70	2.589.521,00	0,3506
CEF FIC BR GESTAO ESTRATEGICA C/C 1000-0	23.215.097/0001-55	17.867.560,06	2,4193
ITAU INSTITUCIONAL RF IRF-M 1	08.703.063/0001-16	489.223,02	0,0662
CAIXA FI BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	10.740.658/0001-93	10.229.659,46	1,3851
CAIXA FI BRASIL IRF-M1+ TP RF LP	10.577.519/0001-90	10.727.244,58	1,4525
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	26.507.132/0001-06	657.211,69	0,0890
FIDC FECHADO MULTISSETORIAL ITALIA	13.990.000/0001-28	1.542.313,64	0,2088
CEF FI BRASIL REF DI LP 9999-0 (TX ADMINISTRATIVA)	03.737.206/0001-97	16.295.315,71	2,2065
CEF FI BRASIL REF DI LP 1000-0	03.737.206/0001-97	5.546.331,33	0,7510
CAIXA FI BRASIL MATRIZ RF	23.215.008/0001-70	17.607.415,53	2,3841
ITAU INSTIT RF DI	00.832.435/0001-00	23.221.994,15	3,1444
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RF	05.073.656/0001-58	7.208.169,89	0,9760
BB PREV RF PERFIL	13.077.418/0001-49	13.823.025,64	1,8717
BB PREV RF PERFIL (APORTES 37299-4)	13.077.418/0001-49	40.490.403,08	2,3841
SANTANDER DI TITULOS PUBLICOS PREMIUM	09.577.447/0001-00	21.127.284,18	2,8607
BB DIVIDENDOS FIC FIA	05.100.191/0001-87	1.675.400,84	0,2269



CARAGUAPREV

Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba
Estado de São Paulo



CERTIFICADO
Pró-Gestão

ICQ BRASIL RPPS
SPREV



FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	15.154.441/0001-15	16.292.389,65	2,2061
FIC AÇÕES EXPERT VINCI VALOR RPPS	14.507.699/0001-95	8.242.017,84	1,1160
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	24.571.992/0001-75	6.880.213,33	0,9316
ITAU ACOES MOMENTO 30 II FIC	42.318.981/0001-60	8.619.372,63	1,1671
BRADESCO FIA SELECTION	03.660.879/0001-96	5.786.498,31	0,7835
BRADESCO FIA SMALL CAP PLUS	06.988.623/0001-09	5.464.520,40	0,7399
FIA CAIXA INSTIT BDR NIVEL I	17.502.937/0001-68	16.883.948,72	2,2862
CAIXA FI JUROS E MOEDAS	14.120.520/0001-42	16.772.734,42	2,2711
CAIXA FI INDEXA BOLSA AMERICANA	30.036.235/0001-02	11.402.973,70	1,5440
Total em Bancos R\$		342.128.061,01	46,3256

TITULOS PUBLICOS FEDERAIS		VALOR INVESTIDO	% RECURSOS
NTN-B - 15/05/2035 (5,56%)	3.900	17.572.585,61	2,3794
NTN-B - 15/08/2040 (5,65%)	213	947.557,79	0,1283
NTN-B - 15/08/2050 (5,713%)	2.514	11.217.426,44	1,5189
NTN-B - 15/05/2045 (5,71%)	7.457	33.618.740,57	4,5521
NTN-B - 15/05/2045 (5,76%)	2.494	11.179.310,26	1,5137
NTN-B - 15/05/2045 (5,781%)	2.496	11.161.329,23	1,5113
NTN-B - 15/05/2030 (5,708%)	2.555	11.121.550,88	1,5059
NTN-B - 15/08/2040 (5,77%)	2.538	11.154.484,46	1,5104
NTN-B - 15/08/2050 (5,815%)	2.530	11.140.409,05	1,5085
NTN-B - 15/05/2055 (5,815%)	2.490	11.143.847,72	1,5089
NTN-B - 15/05/2035 (5,821%)	4.657	20.566.078,48	2,7847
NTN-B - 15/08/2024 (5,892%)	1.315	5.631.124,95	0,7625
NTN-B - 15/08/2050 (5,916%)	920	3.998.679,07	0,5414
NTN-B - 15/08/2050 (5,780%)	2.451	10.841.558,79	1,4680
NTN-B - 15/05/2055 (5,852%)	2.420	10.776.165,27	1,4591
NTN-B - 15/08/2050 (5,922%)	2.466	10.709.936,05	1,4502
NTN-B - 15/08/2024 (6,4750%)	5.073	21.677.844,29	2,9353
NTN-B - 15/05/2025 (5,9752%)	2.476	10.763.841,61	1,4575
NTN-B - 15/08/2024 (5,91%)	2.486	10.644.795,69	1,4414
NTN-B - 15/08/2024 (6,09%)	1.244	5.323.331,54	0,7208
NTN-B - 15/05/2027 (6,09%)	1.228	5.326.026,44	0,7212
NTN-B - 15/08/2024 (6,68%)	1.253	5.350.336,61	0,7245
NTN-B - 15/08/2024 (6,44%)	4.871	20.817.147,19	2,8187
NTN-B - 15/08/2026 (6,353%)	3.661	15.557.704,76	2,1066
NTN-B - 15/08/2028 (6,353%)	3.678	15.557.071,58	2,1065
NTN-B - 15/08/2024 (6,9903%)	7.262	30.974.249,57	4,1940
NTN-B - 15/05/2025 (5,940%)	4.848	21.083.152,82	2,8548
NTN-B - 15/08/2050 (5,9715%)	4.754	20.516.270,88	2,7780
NTN-B - 15/05/2025 (6,08%)	4.612	20.027.785,41	2,7119

27



Total Títulos Públicos		396.400.343,01	53,6744
Total Geral		738.528.404,02	100,0000

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

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	1,02 122,57	3,14 119,66	3,14 119,66	5,63 101,74	10,46 84,59	3.834.959,67	0,52	11.583.504,84
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,61 72,83	1,89 72,00	1,89 72,00	5,28 95,37	11,23 90,83	714.216,02	0,10	2.195.449,81
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,82 98,77	2,54 96,66	2,54 96,66	5,60 101,17	12,45 100,67	1.136.183,90	0,16	3.368.557,16
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,30 36,06	1,74 66,35	1,74 66,35	232,37 4.196,44	278,07 2.249,35	4.621,57	0,00	26.399,75
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,24 0,47	-3,02 1,51	-3,02 1,51	9,14 -0,76	21,23 -4,51	-126.255,24	-0,02	-1.650.898,81
Artigo 9º III % do CDI	3,48 417,27	14,98 570,76	14,98 570,76	23,77 429,35	32,44 262,42	567.468,40	0,08	2.199.827,34
Artigo 10º I % do CDI	1,77 212,65	5,72 217,80	5,72 217,80	9,47 170,95	16,34 132,18	490.685,76	0,07	1.523.617,89
Artigo 7º	0,90	2,77	2,77	5,72	11,17	5.689.981,16	0,78	17.173.911,56
Artigo 8º	-0,24	-3,02	-3,02	9,14	21,23	-126.255,24	-0,02	-1.650.898,81
Artigo 9º	3,48	14,98	14,98	23,77	32,68	567.468,40	0,08	2.199.827,34
Artigo 10º	1,77	5,72	5,72	9,47	16,34	490.685,76	0,07	1.523.617,89
CARAGUATATUBA (Total)						6.621.880,08	0,91	19.246.457,98

15. PRÓ GESTÃO – NÍVEL III

O Instituto de Previdência do município de Caraguatatuba (CaraguaPrev) conquistou a certificação **Pró-Gestão RPPS (Regime Próprio de Previdência Social) Nível III** do Ministério da Previdência.



CERTIFICADO

O Instituto de Certificação Qualidade Brasil
certifica que a empresa:

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE CARAGUATATUBA – CARAGUAPREV

Endereço: Avenida Prestes Maia, Nº 302, Centro, Caraguatatuba, São Paulo, CEP 11660-400.

Vinculado ao ente federativo do
Município de Caraguatatuba

Implantou os requisitos do

PRÓ-GESTÃO RPPS

“Programa de Certificação Institucional e Modernização da Gestão dos Regimes Próprios de Previdência Social da União, dos Estados, do Distrito Federal e dos Municípios”, instituído pela Portaria MPS nº 577/2017, obtendo a certificação institucional no

Nível III

por meio de auditoria realizada pelo Instituto de Certificação Qualidade Brasil - ICQ Brasil, tendo atendido ao estabelecido no Manual do Pró-Gestão RPPS, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

Validade do Certificado: 24/10/2026
Certificado Nº - CPG 147/2023

Goiânia, 31 de Outubro de 2023
Av. Araguaia, nº 1544, Ed. Albano Franco,
St. Leste Vila Nova – Goiânia – GO – CEP 74645-070



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 29



CARAGUAPREV

Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba
Estado de São Paulo



dimensão Governança Corporativa envolve tópicos relacionados ao relatório de governança corporativa; planejamento; relatório de gestão atuarial; código de ética da instituição; políticas previdenciárias de saúde e segurança do servidor; política de investimentos; Comitê de Investimentos; transparência; definição de limites de alçadas; segregação das atividades; ouvidoria; qualificação do órgão de direção; Conselho Fiscal; Conselho Deliberativo; mandato, representação e recondução; e gestão de pessoas. A Educação Previdenciária é baseada em um plano de ação de capacitação e nas ações de diálogo com os segurados e a sociedade.

16. CONCLUSÃO

Quanto ao desempenho das aplicações financeiras do CaraguaPrev do 1º trimestre de 2024, 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, 25 de abril de 2024.

Anderson Franco B. do Nascimento
Diretor Financeiro
Presidente do Comitê de Investimentos



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





PARECER DO CONSELHO FISCAL

Os membros do Conselho Fiscal do Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba – CaraguaPrev, em reunião realizada nesta data, cumprindo o que determina o artigo 73 da Lei complementar nº 59, de 05 de novembro de 2015, tendo examinado as Demonstrações Financeiras e Contábeis referentes ao **1º TRIMESTRE de 2024**, 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, 25 de abril de 2024.

Cristiano Paulo Silva
Presidente do Conselho Fiscal



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



Gabriela Cristina da Silva Coelho
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 n° 59, de 05 de novembro de 2015, tendo examinado as Demonstrações Financeiras e Contábeis referentes ao **1º TRIMESTRE de 2024**, 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, 25 de abril de 2024.

Marcus da Costa Nunes Gomes
Presidente do Conselho Deliberativo



Roberta Alice Zimbres Franzolin
Membro do Conselho Deliberativo



Margarete Soares de Oliveira
Membro do Conselho Deliberativo



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



Marcia Denise Gusmão Coelho
Membro do Conselho Deliberativo



Diego Passos Nascimento
Membro do Conselho Deliberativo



Ivone Cardoso Vicente Alfredo
Membro do Conselho Deliberativo

