



---

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE CARAGUATATUBA/SP

CARAGUAPREV

**RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS**

**ABRIL DE 2024**



## SUMÁRIO

### Sumário

|  |    |
|--|----|
| 1. INTRODUÇÃO.....   | 3  |
| 2. CENÁRIO MACROECONÔMICO.....   | 5  |
| 3. BOLETIM FOCUS.....  | 8  |
| 4. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS .....                                     | 8  |
| 4.1 ESTUDO ALM.....  | 10 |
| 5. RENTABILIDADE DO PLANO PREVIDENCIÁRIO .....                         | 13 |
| 6. RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS .....                                  | 14 |
| 7. PERSPECTIVAS.....   | 23 |
| 8. GERENCIAMENTO DE RISCOS - INDICADORES DE DESEMPENHO E RISCO.....    | 24 |
| 9. TABELA DE LIQUIDEZ.....   | 25 |
| 10. RENTABILIDADE POR ARTIGO .....                                     | 26 |
| 11. MOVIMENTAÇÕES DO MÊS .....   | 26 |
| 12. EXECUÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS .....                        | 30 |
| 13. RELAÇÃO DE GESTORES DOS RECURSOS .....                             | 31 |
| 14. RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO ..... | 32 |
| CARAGUAPREV.....   | 32 |
| 15. PRÓ GESTÃO – NÍVEL III.....  | 34 |
| 16. CONCLUSÃO.....   | 35 |



## RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

**ABRIL 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 mês de abril de 2024 vem implementando ações que demonstram transparência nos processos decisórios dos investimentos financeiros e divulgação das informações aos seus segurados.

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

O Relatório Mensal de Investimentos do CaraguaPrev tem o intuito de informar à sociedade os dados quantitativos e qualitativos da carteira de investimentos do Plano Previdenciário, detalhando os ativos financeiros que o compõe, inclusive quanto aos indicadores de desempenho e gerenciamento de riscos.



### ***Participantes da Gestão do CaraguaPrev no mês avaliado:***

Todos os membros da Diretoria Executiva, Conselhos Deliberativo, Comitê de Investimentos e a maioria dos membros do Conselho Fiscal 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 (Certificação TOTUM), afastamento temporário à partir de 01/04/2024;
- Gabriela Cristina da Silva Coelho (Certificação TOTUM);
- Benedita Auxiliadora de Moraes, nomeação à partir de 15/05/2024.

### **Comitê de Investimentos:**

- Anderson Franco Boytchuk do Nascimento (Presidente do Comitê de Investimentos, Certificação TOTUM);
- 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);
- Anderson Franco Boytchuk do Nascimento (Diretor Financeiro, Certificação TOTUM);
- Rose Ellen de Oliveira Faria (Diretora de Benefícios, Certificação TOTUM); e
- Paulo Henrique Passos do Nascimento (Diretor Administrativo, Certificação TOTUM);



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

## 2. CENÁRIO MACROECONÔMICO

**GERAL:** O cenário internacional reagiu a dados mais resilientes de inflação e atividade nos EUA. Os juros futuros apresentaram alta, os índices de ações tiveram desempenho negativo e o dólar se valorizou frente às demais moedas. Além disso, houve a continuidade das discussões sobre o início do ciclo de redução dos juros americanos. A tensão no oriente médio continua, em abril, o destaque foi o aumento da tensão entre o Irã e Israel, evento que aumentou a aversão ao risco em meio ao temor de uma escalada do conflito.

**BRASIL:** A carteira de investimentos do CaraguaPrev em renda fixa e exterior BDR, apresentaram performance positivas no mês, já a renda variável e os investimentos estruturados apresentaram rentabilidade negativa. A rentabilidade geral da carteira no mês foi de 0,24%, sendo que no acumulado do ano a rentabilidade é de 2,93%, abaixo da meta atuarial anual de 3,46%. O IPCA apresentou a variação de 0,38% em abril e a Taxa Selic permaneceu em 10,75%, onde a economia local está mais forte que o previsto, o que dificulta a tarefa de desinflacionar a economia, podendo inclusive afetar desfavoravelmente a inflação projetada. Neste contexto, o presidente do Banco Central suspendeu a sinalização de um corte de 0,5% na próxima reunião do Copom, condicionando esse movimento a uma melhora do cenário e tornando mais provável uma desaceleração do ritmo de afrouxamento monetário. No Brasil as curvas de juros locais apresentaram alta e os ativos geral acompanharam o movimento dos mercados internacionais, devido expectativa de juros altos por mais tempo nos EUA, sendo também afetados pelas incertezas em relação à condução da política econômica local. O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo na direção observada nos índices globais. Apresentando a performance de -1,70% no mês. Dessa forma, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -6,16% no ano.

### COMENTÁRIO DO MÊS:

#### MERCADOS INTERNACIONAIS



*“Em abril, os mercados globais reagiram a dados mais resilientes de inflação e atividade nos EUA. Os juros futuros apresentaram alta, os índices de ações tiveram desempenho negativo e o dólar se valorizou frente às demais moedas. Além disso, houve a continuidade das discussões sobre o início do ciclo de redução dos juros americanos.*

*Nos EUA, os indicadores de atividade seguem crescendo de forma robusta, com destaque para o bom desempenho do consumo das famílias. Da mesma forma, mercado de trabalho continua aquecido, com desemprego baixo e crescimento relevante dos salários. Já o processo de desinflação mostra-se mais gradual que o esperado, inclusive com o núcleo da inflação de serviços passando por aceleração recentemente.*

*Assim, ainda nos EUA, o FED indicou ser necessário mais tempo para avaliar a convergência da inflação para a meta, sugerindo que não tem pressa para afrouxar a política monetária. Todavia, a instituição segue afirmando que a política monetária está apertada, sendo improvável nova elevação da taxa básica.*

*Na zona do euro, a inflação de serviços mais resistente e a melhora da atividade também se destacam. Esta combinação acarretou na redução das expectativas do mercado em relação ao ciclo total de corte de juros por parte do Banco Central Europeu, apesar da instituição indicar um corte de juros em junho.*

*Assim, no mês de abril de 2024, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território negativo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, desvalorizaram -3,39% e -4,16%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam retornos de +15,51% e +20,78%, respectivamente.*

*Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +0,00% e -0,79%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +19,47% e +24,91% nos últimos 12 meses.”*

## **BRASIL**

*“Localmente, as curvas de juros locais apresentaram alta e os ativos geral acompanharam o movimento dos mercados internacionais, devido expectativa de juros altos por mais tempo nos EUA, sendo também afetados pelas incertezas em relação à condução da política econômica local.*



*Na parte fiscal, o governo enviou o projeto da Lei de Diretrizes Orçamentárias com um resultado primário inferior ao sinalizado anteriormente. Ainda assim, a meta permanece desafiadora e demanda uma elevação significativa das receitas.*

*A economia local está mais forte que o previsto, o que dificulta a tarefa de desinflacionar a economia, podendo inclusive afetar desfavoravelmente a inflação projetada. Por outro lado, a inflação corrente ainda caminha numa direção de desaceleração, ainda que gradual e não homogênea.*

*Neste contexto, o presidente do Banco Central suspendeu a sinalização de um corte de 0,5% na próxima reunião do Copom, condicionando esse movimento a uma melhora do cenário e tornando mais provável uma desaceleração do ritmo de afrouxamento monetário. Dessa forma, as expectativas, presentes no mercado, de um corte de juros de 0,25% em maio ganhou força.*

*Aqui, somente a título de exemplo da “Estrutura a Termo das Taxas de Juros - ETTJ” para o IPCA, estimada e divulgada pela ANBIMA para o fechamento de 07.05.2024, a taxa de juros real com vencimento para 10 anos apresentava taxa de retorno estimada em 6,17% a.a., continuando acima da taxa máxima pré-fixada de 5,10% limitada pela SPREV para o ano de 2024.*

*O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo na direção observada nos índices globais. Apresentando a performance de -1,70% no mês. Dessa forma, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -6,16% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +20,58%.*

*Mediante a todo esse cenário exposto acima e em linha com o último relatório disponibilizado, tentando elucidar muitos questionamentos recebidos acerca dos prêmios trazidos pelas NTN-Bs atualmente, a estratégia de compra direta de NTN-Bs, respaldada por um estudo de ALM, pode auxiliar na “ancoragem de rentabilidade” ainda acima da meta atuarial dos RPPS. Tal estratégia, em especial para carregamento até o vencimento, pode contribuir proporcionalmente para a redução da volatilidade global da carteira de investimentos do RPPS, devido ao benefício da “marcação na curva” do preço desse ativo.”*

## **DINÂMICA DAS EXPECTATIVAS DE MERCADO**

*Como destaques para o final de 2024, o último Boletim Focus apresentou expectativas estáveis para a taxa Selic e o câmbio, e elevadas para o PIB e inflação.*



**Inflação (IPCA):** Para o final de 2024 a expectativa foi reduzida para 3,72%. Seguindo na mesma direção, para o final de 2025, a expectativa foi elevada para 3,64%.

**SELIC:** Para o final de 2024 as expectativas, em relação à taxa Selic, foram aumentada para 9,63%. Já para o final de 2025 houve a estabilidade das expectativas em 9,00%.

**PIB:** A expectativa para o final de 2024, em relação ao PIB, foi elevada para 2,05%. Já para o final de 2025 a expectativa foi mantida em 2,00%.

**Câmbio (Dólar/ Real):** Para o final de 2024 a expectativa foi mantida em R\$ 5,00. Já para o final de 2025, em relação ao último relatório, a expectativa manteve-se em R\$ 5,05.

(Fonte Relatório Macroeconômico LDB Consultoria).

### 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         | 3,73        | 3,72   | ▼ (1)          | 155      | 3,71         | 116       | 3,53         | 3,60        | 3,64   | ▲ (1)          | 152      | 3,65         | 113       | 3,50         | 3,50        | 3,50   | = (44)         | 128      |
| PIB Total (variação % sobre ano anterior)  | 1,90         | 2,02        | 2,05   | ▲ (1)          | 118      | 2,10         | 74        | 2,00         | 2,00        | 2,00   | = (21)         | 111      | 2,00         | 69        | 2,00         | 2,00        | 2,00   | = (39)         | 86       |
| Câmbio (R\$/US\$)                          | 4,95         | 5,00        | 5,00   | = (2)          | 125      | 5,01         | 83        | 5,00         | 5,05        | 5,05   | = (2)          | 122      | 5,05         | 81        | 5,04         | 5,10        | 5,10   | = (2)          | 92       |
| Selic (% a.a)                              | 9,00         | 9,50        | 9,63   | ▲ (1)          | 148      | 9,75         | 100       | 8,50         | 9,00        | 9,00   | = (2)          | 144      | 9,00         | 96        | 8,50         | 8,63        | 8,75   | ▲ (2)          | 122      |
| IGP-M (variação %)                         | 2,00         | 2,00        | 2,32   | ▲ (1)          | 79       | 2,36         | 58        | 3,65         | 3,71        | 3,75   | ▲ (1)          | 70       | 3,80         | 51        | 3,90         | 3,87        | 3,80   | ▼ (1)          | 61       |
| IPCA Administrados (variação %)            | 4,13         | 4,02        | 4,00   | ▼ (5)          | 97       | 3,99         | 77        | 3,92         | 3,92        | 3,91   | ▼ (2)          | 84       | 3,92         | 68        | 3,50         | 3,50        | 3,50   | = (12)         | 58       |
| Conta corrente (US\$ bilhões)              | -32,00       | -32,10      | -32,15 | ▼ (1)          | 30       | -32,00       | 17        | -35,00       | -40,00      | -40,00 | = (2)          | 28       | -39,45       | 16        | -40,00       | -41,20      | -41,60 | ▼ (1)          | 20       |
| Balança comercial (US\$ bilhões)           | 80,50        | 80,00       | 79,75  | ▼ (1)          | 28       | 80,00        | 16        | 74,55        | 75,00       | 76,00  | ▲ (1)          | 23       | 75,00        | 12        | 77,00        | 77,50       | 77,50  | = (2)          | 16       |
| Investimento direto no país (US\$ bilhões) | 65,00        | 67,00       | 68,75  | ▲ (1)          | 26       | 69,00        | 15        | 73,10        | 73,00       | 73,00  | = (1)          | 25       | 73,00        | 14        | 80,00        | 79,00       | 80,00  | ▲ (1)          | 19       |
| Dívida líquida do setor público (% do PIB) | 63,85        | 63,85       | 63,85  | = (2)          | 25       | 64,00        | 11        | 66,42        | 66,40       | 66,50  | ▲ (1)          | 25       | 66,50        | 11        | 68,50        | 68,00       | 68,40  | ▲ (1)          | 21       |
| Resultado primário (% do PIB)              | -0,70        | -0,70       | -0,67  | ▲ (1)          | 46       | -0,67        | 24        | -0,60        | -0,68       | -0,68  | = (1)          | 44       | -0,60        | 22        | -0,50        | -0,50       | -0,50  | = (9)          | 32       |
| Resultado nominal (% do PIB)               | -6,90        | -6,80       | -6,80  | = (3)          | 24       | -6,80        | 11        | -6,30        | -6,26       | -6,25  | ▲ (1)          | 23       | -6,19        | 10        | -6,00        | -5,92       | -5,84  | ▲ (1)          | 17       |

Relatório Focus de 03.05.2024. Fonte: <https://www.bcb.gov.br/publicacoes/focus>

### 4. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

A carteira de investimentos do Caraguaprev encerrou o mês com o patrimônio total de **R\$ 742.990.009,16** (setecentos e quarenta e dois milhões e novecentos e noventa mil e nove reais e dezesseis centavos).

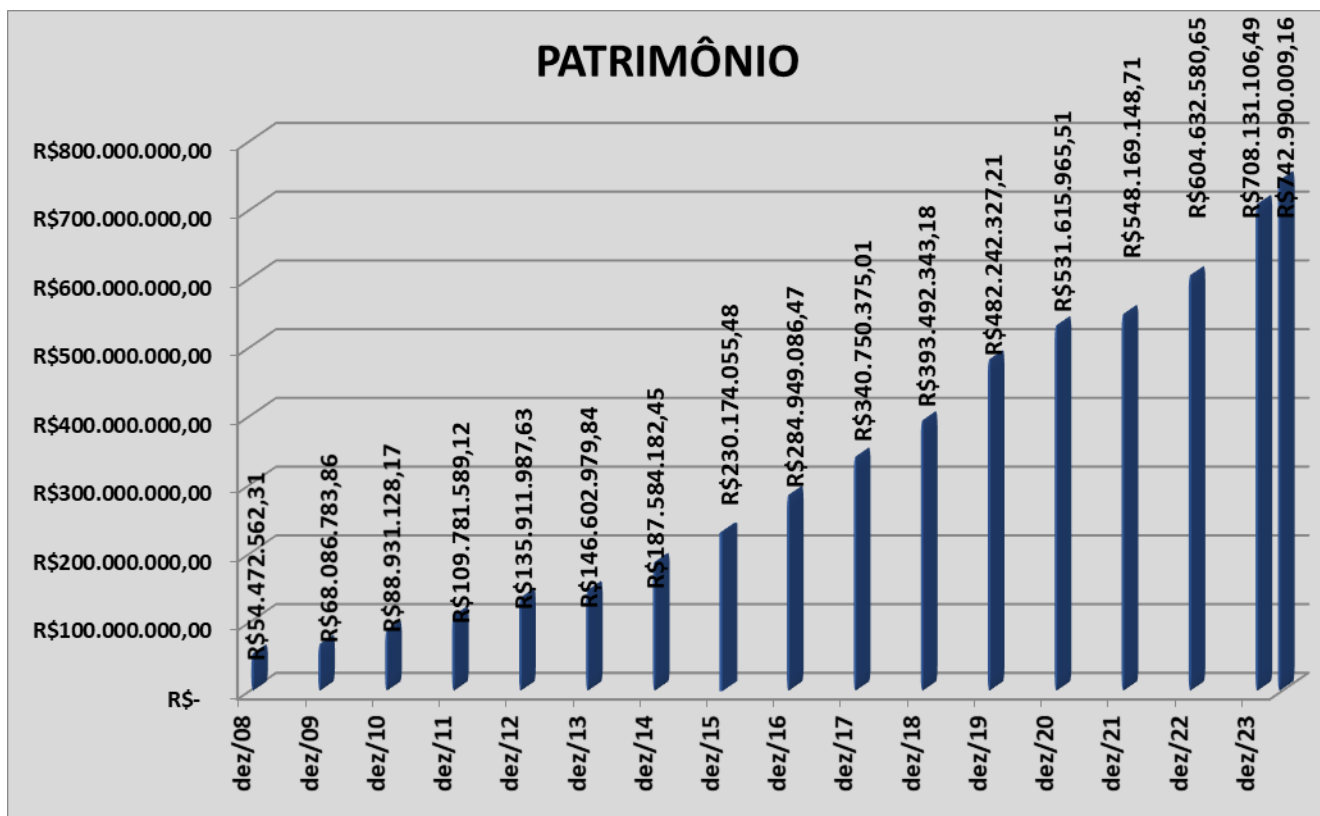
É composta por ativos que estão vinculados ao seu respectivo Plano Previdenciário, também compõe a carteira de investimentos os recursos oriundos da taxa de administração, que são





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.

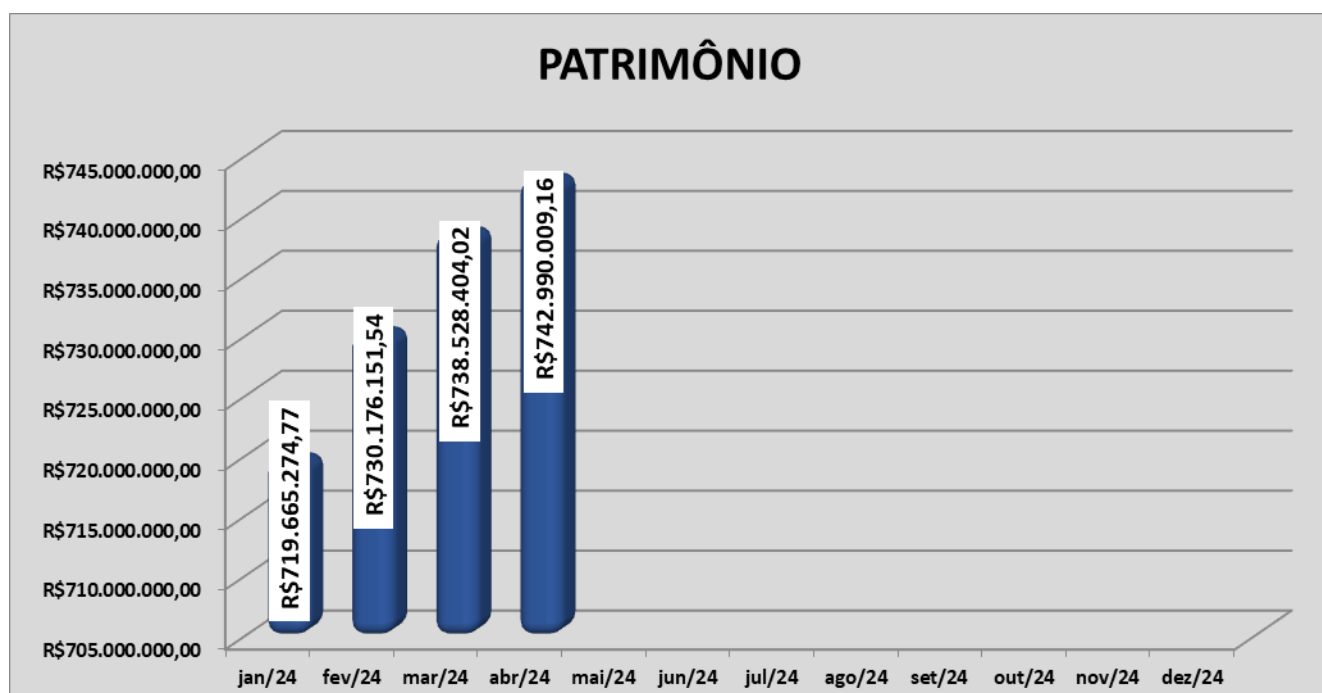
Evolução Patrimonial da Carteira de Investimentos (R\$ mil)



| 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 |
| dez/23   | R\$ 708.131.106,49 |
| Abril/24 | R\$ 742.990.009,16 |

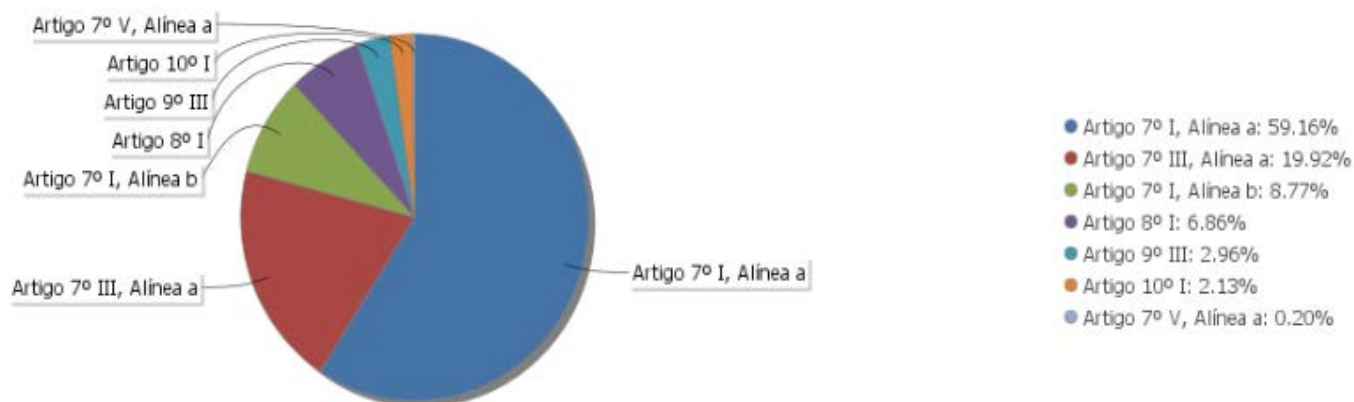


| Mês 2024     | PATRIMÔNIO         |
|--------------|--------------------|
| Janeiro/24   | R\$ 719.665.274,77 |
| Fevereiro/24 | R\$ 730.176.151,54 |
| Março/24     | R\$ 738.528.404,02 |
| Abril/24     | R\$ 742.990.009,16 |

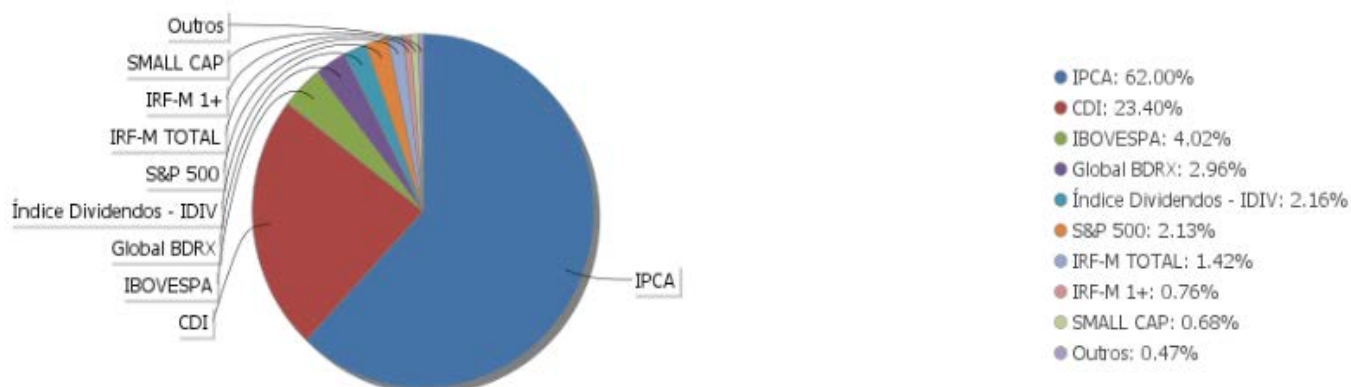
#### 4.1 ESTUDO ALM

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.



#### 4.3 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

| Ano            | Jan   | Fev   | Mar   | Abr   | Mai  | Jun   | Jul   | Ago   | Set   | Out   | Nov   | Dez   | Rent. Ano |
|----------------|-------|-------|-------|-------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| 2024           | 0,63  | 1,12  | 0,91  | 0,24  |      |       |       |       |       |       |       |       | 2,93      |
| IPCA + 5,02%   | 0,85  | 1,20  | 0,55  | 0,81  |      |       |       |       |       |       |       |       | 3,46      |
| p.p. indexador | -0,22 | -0,08 | 0,36  | -0,57 |      |       |       |       |       |       |       |       | -0,52     |
| 2023           | 1,75  | -0,11 | 0,96  | 0,97  | 1,66 | 1,53  | 0,99  | 0,35  | 0,50  | 0,40  | 1,81  | 1,45  | 12,95     |
| IPCA + 5,03%   | 0,96  | 1,19  | 1,16  | 0,96  | 0,66 | 0,33  | 0,53  | 0,88  | 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  | 0,46  | -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 + 4,90%   | 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  | 1,88  | 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  | 29         | 45,31     |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 35         | 54,69     |

|                                 | 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         | 2,28     | 2,58          | -0,30      | 1,14               |
| 06 meses         | 6,31     | 5,14          | 1,17       | 1,25               |
| 12 meses         | 12,21    | 8,88          | 3,33       | 1,50               |
| 24 meses         | 20,90    | 19,09         | 1,82       | 3,10               |
| 36 meses         | 20,10    | 40,59         | -20,49     | 4,24               |
| 48 meses         | 35,34    | 58,66         | -23,32     | 4,88               |
| 60 meses         | 39,81    | 72,19         | -32,58     | 6,97               |
| Desde 31/12/2018 | 44,17    | 79,15         | -34,98     | 6,79               |

Em Abril/2024, a carteira de investimentos do plano previdenciário obteve rentabilidade de 0,24%, abaixo da meta atuarial do mês, que é de 0,81%. No acumulado do ano corrente a rentabilidade é de 2,93%, abaixo da meta atuarial do ano que é de 3,46%.

Nos últimos 12 meses a rentabilidade foi de 12,21% e no acumulado dos últimos 24 meses a rentabilidade do plano previdenciário foi de 20,10%.

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 88,05%

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

| Emissor          | Título Público           | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |      |      | Valor (R\$)   | % Carteira |
|------------------|--------------------------|------------------------|-------------------|------|------|---------------|------------|
|                  |                          |                        | Dia               | Mês  | Ano  |               |            |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150525 (5,940000%) | 2,91                   | 0,04              | 0,74 | 3,88 | 21.230.313,62 | 2,86       |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150525 (5,980000%) | 0,28                   | 0,04              | 0,74 | 3,89 | 10.843.893,94 | 1,46       |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150525 (6,080000%) | 4,12                   | 0,04              | 0,75 | 0,90 | 20.178.497,34 | 2,72       |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150527 (6,090000%) | 0,32                   | 0,04              | 0,75 | 3,93 | 5.366.145,02  | 0,72       |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (5,580000%) | 0,42                   | 0,04              | 0,71 | 3,76 | 17.697.185,57 | 2,38       |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (5,821000%) | 0,43                   | 0,04              | 0,73 | 3,84 | 20.716.385,58 | 2,79       |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,710000%) | 0,54                   | 0,04              | 0,72 | 3,81 | 33.861.349,01 | 4,56       |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,780000%) | 0,55                   | 0,04              | 0,73 | 3,82 | 11.280.448,39 | 1,52       |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150545 (5,781000%) | 0,55                   | 0,04              | 0,73 | 3,83 | 11.242.533,08 | 1,51       |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,815000%) | 0,63                   | 0,04              | 0,73 | 3,84 | 11.225.239,08 | 1,51       |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150555 (5,850000%) | 0,60                   | 0,01              | 0,73 | 3,85 | 10.855.202,83 | 1,46       |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (5,892000%) | 0,26                   | 0,04              | 0,74 | 3,86 | 5.672.610,58  | 0,76       |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (5,910000%) | 0,27                   | 0,04              | 0,74 | 3,87 | 10.723.402,24 | 1,44       |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (6,090000%) | 0,27                   | 0,04              | 0,75 | 3,93 | 5.363.411,45  | 0,72       |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (6,440000%) | 0,26                   | 0,04              | 0,78 | 4,04 | 20.979.999,66 | 2,82       |



| Emissor          | Título Público                         | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |             |             | Valor (R\$)           | % Carteira   |
|------------------|--|------------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|
|                  |  |                        | Dia               | Mês         | Ano         |                       |              |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (6,480000%)               | 0,27                   | 0,04              | 0,79        | 4,05        | 21.848.027,94         | 2,94         |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (6,680000%)               | 0,26                   | 0,04              | 0,80        | 4,12        | 5.393.242,77          | 0,73         |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150824 (6,990300%)               | 0,26                   | 0,04              | 0,83        | 4,22        | 31.230.545,72         | 4,20         |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150826 (6,350000%)               | 0,29                   | 0,03              | 0,77        | 4,01        | 15.678.273,50         | 2,11         |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150828 (6,350000%)               | 0,32                   | 0,03              | 0,77        | 4,01        | 15.677.637,41         | 2,11         |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150830 (5,708000%)               | 0,36                   | 0,04              | 0,72        | 3,80        | 11.201.795,24         | 1,51         |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150832 (6,070000%)               | 4,14                   | 0,05              | 0,36        | 0,36        | 40.129.403,47         | 5,40         |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,650000%)               | 0,48                   | 0,04              | 0,72        | 3,79        | 954.347,93            | 0,13         |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150840 (5,770000%)               | 0,49                   | 0,04              | 0,73        | 3,82        | 11.235.527,35         | 1,51         |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,713000%)               | 0,59                   | 0,04              | 0,72        | 3,81        | 11.298.397,94         | 1,52         |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,780000%)               | 0,59                   | 0,04              | 0,73        | 3,83        | 10.920.414,74         | 1,47         |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,815000%)               | 0,60                   | 0,04              | 0,73        | 3,84        | 11.221.774,28         | 1,51         |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,916000%)               | 0,60                   | 0,04              | 0,74        | 3,87        | 4.028.218,08          | 0,54         |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,920000%)               | 0,57                   | 0,01              | 0,74        | 3,87        | 10.789.115,11         | 1,45         |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150850 (5,970000%)               | 2,97                   | 0,02              | 0,74        | 3,89        | 20.668.789,66         | 2,78         |
|                  | <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b> | <b>0,39</b>            | <b>0,04</b>       | <b>0,75</b> | <b>3,91</b> | <b>439.501.108,51</b> | <b>59,15</b> |



| Gestor                                 | Admin.    | Ativo  | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |             |             | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo       | % Fundo |
|--|-----------|--|------------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|-------------------|---------|
|  |           |  |                        | Dia               | Mês         | Ano         |                      |             |                   |         |
| BB                                     | BB        | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI         | 0,90                   | -0,14             | 0,28        | 2,70        | 10.361.871,47        | 1,39        | 6.756.075.412,20  | 0,15    |
| CAIXA DTVM                             | CEF       | FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO | 2,64                   | -0,37             | -0,55       | 1,08        | 2.575.278,02         | 0,35        | 295.997.810,61    | 0,87    |
| SANTANDER                              | SANTANDER | SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI         | 0,07                   | 0,04              | 0,88        | 3,49        | 11.304.230,82        | 1,52        | 7.611.269.017,74  | 0,15    |
| BB                                     | BB        | BB PREV RF IRF M                                       | 2,29                   | -0,34             | -0,56       | 1,04        | 10.518.565,81        | 1,42        | 4.126.258.083,34  | 0,25    |
| ITAU                                   | ITAU      | ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI                     | 0,31                   | 0,06              | 0,66        | 3,10        | 492.833,70           | 0,07        | 554.358.543,16    | 0,09    |
| BB                                     | BB        | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI              | 0,32                   | 0,00              | 0,56        | 3,00        | 0,00                 | 0,00        | 8.334.507.355,54  | 0,00    |
| CAIXA DTVM                             | CEF       | FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP           | 3,89                   | -0,62             | -1,64       | -1,51       | 210.407,30           | 0,03        | 4.738.343.434,12  | 0,00    |
| BB                                     | BB        | BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO  | 0,06                   | 0,04              | 0,08        | 0,08        | 13.203.369,71        | 1,78        | 28.684.758.881,76 | 0,05    |
| CAIXA DTVM                             | CEF       | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP        | 3,25                   | -0,47             | -1,03       | 0,25        | 5.633.929,83         | 0,76        | 1.216.911.907,65  | 0,46    |
| CAIXA DTVM                             | CEF       | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF           | 1,48                   | -0,06             | -0,32       | 1,47        | 10.810.792,73        | 1,46        | 5.183.551.580,62  | 0,21    |
| SANTANDER                              | SANTANDER | SANTANDER RF ATIVO FIC                                 | 1,90                   | -0,26             | -0,35       | 1,01        | 56.105,01            | 0,01        | 288.910.967,43    | 0,02    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |           |  | <b>1,25</b>            | <b>-0,13</b>      | <b>0,05</b> | <b>1,94</b> | <b>65.167.384,40</b> | <b>8,77</b> |                   |         |

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

| Gestor                                   | Admin.    | Ativo  | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |             |             | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo       | % Fundo |
|--|-----------|--|------------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|-------------------|---------|
|  |           |  |                        | Dia               | Mês         | Ano         |                       |              |                   |         |
| ITAU                                     | ITAU      | ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO                      | 4,33                   | -0,76             | -2,33       | -2,62       | 191.089,70            | 0,03         | 399.008.910,92    | 0,05    |
| CAIXA DTVM                               | CEF       | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP    | 0,08                   | 0,04              | 0,89        | 3,64        | 52.041.461,15         | 7,00         | 15.720.644.238,34 | 0,33    |
| ITAU                                     | ITAU      | ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 0,10                   | 0,04              | 0,91        | 3,73        | 30.569.874,06         | 4,11         | 5.857.258.977,50  | 0,52    |
| BB                                       | BB        | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI               | 0,07                   | 0,04              | 0,88        | 3,55        | 16.161.030,50         | 2,18         | 16.797.040.223,44 | 0,10    |
| CAIXA DTVM                               | CEF       | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                  | 0,12                   | 0,04              | 0,83        | 3,55        | 17.752.919,68         | 2,39         | 5.682.499.214,74  | 0,31    |
| SANTANDER                                | SANTANDER | SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI | 0,10                   | 0,04              |             |             | 10.810.228,72         | 1,43         | 2.900.137.907,64  | 0,37    |
| BB                                       | BB        | BB INSTITUCIONAL FI RF                           | 0,12                   | 0,04              | 0,04        | 0,04        | 20.702.905,89         | 2,79         | 2.174.017.580,88  | 0,95    |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |           |  | <b>0,20</b>            | <b>0,04</b>       | <b>0,87</b> | <b>3,42</b> | <b>148.029.507,70</b> | <b>19,92</b> |                   |         |

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

| Gestor                                 | Admin.   | Ativo              | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |             |             | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo   | % Fundo |
|--|----------|--------------------|------------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|---------------|---------|
|  |          |                    |                        | Dia               | Mês         | Ano         |                       |              |               |         |
| VILA RICA                              | BRL DTVM | FIDC ITALIA SENIOR | 110,86                 | -0,00             | 0,79        | 2,54        | 1.478.130,32          | 0,20         | 58.098.795,51 | 2,54    |
| <b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b> |          |                    | <b>110,86</b>          | <b>-0,00</b>      | <b>0,79</b> | <b>2,54</b> | <b>1.478.130,32</b>   | <b>0,20</b>  |               |         |
| <b>Renda Fixa</b>                      |          |                    | <b>0,38</b>            | <b>0,02</b>       | <b>0,66</b> | <b>3,45</b> | <b>654.176.130,93</b> | <b>88,05</b> |               |         |





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 88,05% da Carteira de Investimentos. (*Resolução CMN n.º 4.963/21*).

No mês avaliado a rentabilidade dos fundos de Investimento em Renda Fixa foi de 0,66%, abaixo da meta atuarial do mês que foi de 0,81%, enquanto que no ano a performance desses fundos é de 3,45%, em linha com a meta atuarial anual.

Conforme artigo 88 da Portaria MTP n.º 1.467, de 02 de junho de 2022, o Comitê de Investimentos e o Conselho Deliberativo aprovam, referente aos investimentos dos recursos em alocação, manutenção e desinvestimentos das aplicações:

- a) Títulos do Tesouro Nacional, que representam 59,15% da carteira do Instituto, apresentaram rentabilidade acima da meta atuarial no ano, sendo que a estratégia de compra direta de NTN-Bs, para carregamento até o vencimento, auxilia numa “ancoragem de rentabilidade” acima da meta atuarial e contribui para uma redução da volatilidade global da carteira de investimentos do instituto, devido ao benefício da “marcação na curva” do preço desse ativo e risco soberano, conforme aprovação nas atas anteriores, permanece a decisão do Conselho de realocação dos recursos dos vencimentos dos títulos e dos seus cupons de juros semestrais em recompra de Títulos, desde que as taxas estejam acima da meta atuarial.
- b) Fundos 100% Títulos Públicos que representam 8,77% da carteira do Instituto, apresentaram rentabilidade abaixo da meta atuarial no ano, com redução da posição atual no próximo mês;
- c) Fundos Renda Fixa que representam 19,92% da carteira do Instituto, apresentaram rentabilidade acima da meta atuarial no mês e abaixo no ano, com aprovação do Conselho para alocação de recursos oriundos de contribuições previdenciárias, aplicação dos resgates de fundos de investimento de renda variável, sendo ainda um investimento atrativo, com pouca volatilidade e rentabilidade acima da meta atuarial. Também foi aprovado pelo Conselho Deliberativo o desinvestimento desses fundos para compra de Títulos do Tesouro Nacional;



d) FIDC Cota Sênior que representa 0,20% da carteira do Instituto, apresentou rentabilidade abaixo da meta atuarial no mês, com manutenção da posição atual desses ativos.

Houve as Movimentações típicas no período avaliado, com despesas administrativas, despesas previdenciárias, repasse das contribuições sociais e aportes para cobertura do déficit, e:

- 1) RESGATE de R\$ 7.000.000,00 (sete milhões de reais) do Fundo de investimento ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO, CNPJ: 05.073.656/0001-58, Banco Itaú Unibanco S.A., ag.0248, c/c 04042-0, em 02/04/2024, para APLICAÇÃO R\$ 7.000.000,00 (sete milhões de reais) no Fundo de Investimento ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI, CNPJ: 00.832.435/0001-00, Banco Itaú Unibanco S.A., ag.0248, c/c 04042-0, em 02/04/2024.
- 2) RESGATE de R\$ 10.000.000,00 (dez milhões de reais) do Fundo de investimentos CAIXA BRASIL IMA B TITULOS PUBLICOS RF LP, CNPJ: 10.740.658/0001-93, Caixa econômica Federal ag.0797, c/c 1000-0, em 01/04/2024, para APLICAÇÃO R\$ 5.000.000,00 (cinco milhões de reais) no Fundo de Investimento FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I, CNPJ: 17.502.937/0001-68, Caixa econômica Federal ag.0797, c/c 1000-0, sendo R\$ 4.206.693,51 em 01/04/2024 e R\$ 793.306,49 em 02/04/2024 e APLICAÇÃO R\$ 5.000.000,00 (cinco milhões de reais) no Fundo de Investimento CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP, CNPJ: 30.036.235/0001-02, Caixa econômica Federal ag.0797, c/c 1000-0, em 01/04/2024.
- 3) RESGATE de R\$ 39.987.230,73 (trinta e nove milhões e novecentos e oitenta e sete mil e duzentos e trinta reais e setenta e três centavos) do fundo de investimento BB Previdenciário Renda Fixa Perfil, CNPJ: 13.077.418/0001-49, Banco do Brasil, vinculado a conta corrente n.º 37.299-4, com recursos dos aportes para cobertura do déficit atuarial, em 16/04/2024, para COMPRA de R\$ 39.987.230,73 (trinta e nove milhões e novecentos e oitenta e sete mil e duzentos e trinta reais e setenta e três centavos) em Títulos Públicos Federais NTN-B – 15/08/2032, taxa 6,0680%, quantidade 9.326, em 17/04/2024.
- 4) RESGATE de R\$ 10.000.000,00 (dez milhões de reais) do Fundo de investimentos SANTANDER DI TITULOS PUBLICOS PREMIUM, CNPJ: 09.577.447/0001-00, Banco Santander, em 26/04/2024 e RESGATE de R\$ 600.000,00 (seiscentos mil reais) do Fundo de



- investimentos SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA, CNPJ: 26.507.132/0001-06, Banco Santander, em 26/04/2024, para APLICAÇÃO R\$ 10.600.000,00 (dez milhões e seiscentos mil reais) no Fundo de Investimento SANTANDER RF REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM, CNPJ: 02.224.354/0001-45, Banco Santander, sendo R\$ 10.000.000,00 em 26/04/2024 e R\$ 600.000,00 em 29/04/2024.
- 5) RESGATE total R\$ 10.694.095,43 (dez milhões e seiscentos e noventa e quatro mil e noventa e cinco reais e quarenta e três centavos) do Fundo de investimentos FUNDO BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP, CNPJ: 11.328.882/0001-35, Banco do Brasil, em 26/04/2024 e RESGATE de R\$ 10.000.000,00 (dez milhões de reais) do Fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI, CNPJ: 07.111.384/0001-69, Banco do Brasil, em 29/04/2024, para APLICAÇÃO R\$ 20.694.295,43 (vinte milhões e seiscentos e noventa e quatro mil e duzentos e noventa e cinco reais e quarenta e três centavos) no Fundo de Investimento FUNDO BB INSTITUCIONAL FI RF, CNPJ: 02.296.928/0001-90, Banco do Brasil, sendo R\$ 10.361.426,37 em 26/04/2024, R\$ 10.000.000,00 em 29/04/2024 e R\$ 332.669,06 em 29/04/2024.
- 6) RESGATE total R\$ 13.193.004,33 (treze milhões e cento e noventa e três mil e quatro reais e trinta e três centavos) do Fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP, CNPJ: 11.328.882/0001-35, Banco do Brasil, c/c n.º 37.299-4 (conta recebimento aportes do plano de amortização), em 26/04/2024, para APLICAÇÃO R\$ 13.193.004,33 (treze milhões e cento e noventa e três mil e quatro reais e trinta e três centavos) no Fundo de Investimento FUNDO BB RF REFERENCIADO DI TP FI LONGO PRAZO, CNPJ: 11.046.645/0001-81, Banco do Brasil, c/c n.º 37.299-4 (conta recebimento aportes do plano de amortização), sendo R\$ 12.782.599,74 em 26/04/2024 e R\$ 410.404,59 em 29/04/2024.
- 7) RESGATE de R\$ 5.000.000,00 (cinco milhões de reais) do FUNDO FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP, CNPJ: 10.577.519/0001-90, Caixa Econômica Federal, em 26/04/2024, RESGATE de R\$ 7.000.000,00 (sete milhões de reais) do FUNDO CAIXA FIC BR GESTÃO ESTRATÉGICA, CNPJ: 23.215.097/0001-55, Caixa Econômica Federal, em 26/04/2024 e RESGATE de R\$ 16.847.902,45 (dezesseis milhões e oitocentos e quarenta e sete mil e novecentos e dois reais e quarenta e cinco centavos) do FUNDO CAIXA FI JUROS E MOEDAS, CNPJ: 14.120.520/0001-42, Caixa Econômica Federal, sendo R\$ 16.000.000,00 em 26/04/2024 e R\$ 847.902,45 em 29/04/2024, para APLICAÇÃO R\$ 28.847.902,45 (vinte e oito milhões e oitocentos e quarenta e sete mil e novecentos e dois reais e quarenta e cinco



centavos) no Fundo de Investimento CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP, CNPJ: 03.737.206/0001-97, Caixa Econômica Federal, sendo R\$ 26.310.292,29 em 26/04/2024, R\$ 1.689.707,71 em 29/04/2024, R\$ 720.397,11 em 29/04/2024 e R\$ 127.505,34 em 30/04/2024.

## 6.2 FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL – AÇÕES

| RENDA VARIÁVEL                |        |  |                        |                   |              |              |                      |             |                  | 6,86%   |
|-------------------------------|--------|--|------------------------|-------------------|--------------|--------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| Artigo 8º I (Fundos de Ações) |        |  |                        |                   |              |              |                      |             |                  |         |
| Gestor                        | Admin. | Ativo  | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |              |              | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo      | % Fundo |
|                               |        |  |                        | Dia               | Mês          | Ano          |                      |             |                  |         |
| BB                            | BB     | BB AÇÕES DIVIDENDOS                              | 13,36                  | -0,84             | -2,16        | -8,28        | 1.639.217,81         | 0,22        | 563.931.238,10   | 0,29    |
| BRAM                          | BEM    | BRABESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS              | 20,06                  | -1,46             | -7,91        | -12,59       | 5.032.391,78         | 0,68        | 591.352.904,26   | 0,85    |
| CAIXA DTVM                    | CEF    | FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS    | 14,94                  | -1,41             | -3,03        | -8,49        | 7.992.318,50         | 1,08        | 739.292.621,28   | 1,08    |
| CAIXA DTVM                    | CEF    | FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 12,50                  | -0,81             | -1,34        | -3,64        | 16.073.527,84        | 2,16        | 1.011.981.812,09 | 1,59    |
| ITAU                          | ITAU   | ITAU ACOES DUNAMIS FIC                           | 13,81                  | -0,97             | -1,02        | 0,40         | 6.809.985,99         | 0,92        | 1.225.011.016,40 | 0,56    |
| BRAM                          | BEM    | BRABESCO FIA SELECTION                           | 15,30                  | -2,07             | -6,73        | -9,55        | 5.398.146,40         | 0,73        | 371.277.783,63   | 1,45    |
| ITAU                          | ITAU   | ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI               | 17,78                  | -1,77             | -8,55        | -11,75       | 8.054.865,15         | 1,08        | 138.119.947,17   | 5,92    |
| <b>Sub-total Artigo 8º I</b>  |        |  | <b>14,47</b>           | <b>-1,28</b>      | <b>-3,70</b> | <b>-6,61</b> | <b>51.000.433,47</b> | <b>6,86</b> |                  |         |
| <b>Renda Variável</b>         |        |  | <b>14,47</b>           | <b>-1,28</b>      | <b>-3,70</b> | <b>-6,61</b> | <b>51.000.433,47</b> | <b>6,86</b> |                  |         |

Os Fundos de renda variável - AÇÕES que compõem a carteira do CaraguaPrev são compostos por FUNDOS DE AÇÕES - ART. 8º, I e representa 6,86% da Carteira de Investimentos. (*Resolução CMN n.º 4.963/21*).

No mês avaliado a rentabilidade dos fundos de Investimento em Renda Variável foi de -3,70%, abaixo da meta atuarial do mês e do ano, enquanto que no ano a performance desses fundos é de -6,61%.

Conforme artigo 88 da Portaria MTP n.º 1.467, de 02 de junho de 2022, o Comitê de Investimentos e o Conselho Deliberativo aprovam, referente aos investimentos dos recursos em alocação, manutenção e desinvestimentos das aplicações:

- e) Fundos de Ações que representam 6,86% da carteira do Instituto, apresentaram rentabilidade abaixo da meta atuarial do ano, diante do cenário econômico a renda



variável ainda apresentará volatilidade, com aprovação de manutenção e desinvestimento gradativo.

Não houve movimentações no período avaliado.

### 6.3 FUNDOS ESTRUTURADOS

#### INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,13%

#### Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Gestor                            | Admin. | Ativo                                    | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |              |             | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo      | % Fundo |
|-----------------------------------|--------|--|------------------------|-------------------|--------------|-------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
|                                   |        |  |                        | Dia               | Mês          | Ano         |                      |             |                  |         |
| CAIXA DTVM                        | CEF    | FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP  | 0,41                   | 0,00              | 0,49         | 2,83        | 0,00                 | 0,00        | 1.183.679.059,75 | 0,00    |
| CAIXA DTVM                        | CEF    | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 11,85                  | -1,42             | -3,80        | 6,90        | 15.791.557,14        | 2,13        | 1.805.438.252,39 | 0,87    |
| <b>Sub-total Artigo 10º I</b>     |        |  | <b>3,18</b>            | <b>-1,42</b>      | <b>-2,24</b> | <b>3,35</b> | <b>15.791.557,14</b> | <b>2,13</b> |                  |         |
| <b>Investimentos Estruturados</b> |        |  | <b>3,18</b>            | <b>-1,42</b>      | <b>-2,24</b> | <b>3,35</b> | <b>15.791.557,14</b> | <b>2,13</b> |                  |         |

O Investimento Estruturado, Fundo Multimercado - ART. 10, I, que compõem a carteira do CaraguaPrev representa 2,13% da Carteira de Investimentos. (*Resolução CMN n.º 4.963/21*).

No mês avaliado a rentabilidade dos Investimentos Estruturados é de -2,24%, abaixo da meta atuarial do mês e do ano, com performance anual de 3,35%.

Conforme artigo 88 da Portaria MTP n.º 1.467, de 02 de junho de 2022, o Comitê de Investimentos e o Conselho Deliberativo aprovam, referente aos investimentos dos recursos em alocação, manutenção e desinvestimentos das aplicações:

- f) Fundos de Investimento Estruturados representam 2,13% da carteira do Instituto e apresentaram rentabilidade abaixo da meta atuarial no mês e no ano, com aprovação de aumento gradativo das aplicações nestes ativos.

Houve as movimentações no período avaliado;



- 1) APLICAÇÃO R\$ 5.000.000,00 (cinco milhões de reais) no Fundo de Investimento CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP, CNPJ: 30.036.235/0001-02, Caixa econômica Federal ag.0797, c/c 1000-0, em 01/04/2024.

## 6.4 FUNDOS DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,96%

#### Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

| Gestor                    | Admin. | Ativo                               | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |      |       | Valor (R\$)   | % Carteira | PL do Fundo      | % Fundo |
|---------------------------|--------|-------------------------------------|------------------------|-------------------|------|-------|---------------|------------|------------------|---------|
|                           |        |                                     |                        | Dia               | Mês  | Ano   |               |            |                  |         |
| CAIXA DTVM                | CEF    | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 14,13                  | 0,14              | 0,80 | 15,90 | 22.021.887,62 | 2,96       | 2.311.782.090,34 | 0,95    |
| Sub-total Artigo 9º III   |        |                                     | 14,13                  | 0,14              | 0,80 | 15,90 | 22.021.887,62 | 2,96       |                  |         |
| Investimentos no Exterior |        |                                     | 14,13                  | 0,14              | 0,80 | 15,90 | 22.021.887,62 | 2,96       |                  |         |

Os Fundos de Investimento no Exterior Ações BDR Nível I – Art. 9º, III, que compõem a carteira do CaraguáPrev representam 2,96% da Carteira de Investimentos. (*Resolução CMN n.º 4.963/21*).

No mês avaliado a rentabilidade do fundo de Investimento no Exterior foi de 0,80%, abaixo da meta atuarial do mês e acima da meta atuarial do ano, sendo a performance anual de 15,90%.

Conforme artigo 88 da Portaria MTP n.º 1.467, de 02 de junho de 2022, o Comitê de Investimentos e o Conselho Deliberativo aprovam, referente aos investimentos dos recursos em alocação, manutenção e desinvestimentos das aplicações:

- g) Fundos de Investimento no exterior representam 2,96% da carteira do Instituto e apresentaram rentabilidade acima da meta atuarial no ano, com aumento gradativo das aplicações nestes ativos.

Houve as movimentações no período avaliado;



- 1) APLICAÇÃO R\$ 5.000.000,00 (cinco milhões de reais) no Fundo de Investimento FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I, CNPJ: 17.502.937/0001-68, Caixa econômica Federal ag.0797, c/c 1000-0, sendo R\$ 4.206.693,51 em 01/04/2024 e R\$ 793.306,49 em 02/04/2024

## 7 PERSPECTIVAS

**Renda Fixa:** No que diz respeito ao cenário prospectivo, seguimos acompanhando os desafios do cenário externo, especialmente no que se refere à velocidade da desinflação em um cenário de atividade ainda resiliente, além dos conflitos geopolíticos e riscos em torno das eleições americanas, que podem acrescentar volatilidade aos ativos. No cenário doméstico, seguimos acompanhando os desdobramentos das discussões fiscais, trajetória de inflação, dados de atividade e ciclo de política monetária diante das mudanças relevantes na comunicação do BCB. A postergação na precificação de cortes de juros nos EUA levou a um estreitamento no diferencial de juros, o que juntamente com outros fatores na economia doméstica, devem fazer com que o BCB siga um caminho de flexibilização mais cauteloso.

**Renda Variável:** O valuation descontado somado à flexibilização monetária em curso reforçam a expectativa de um ciclo positivo para esta classe de ativos. É importante ressaltar, contudo, que os riscos deste cenário se elevaram, levando nosso balanço de riscos para o lado negativo. No curto prazo, o cenário deve seguir volátil e desfavorável a alocação em equities até que se tenha uma maior certeza acerca do início de cortes de juros pelo Fed. A política monetária norte-americana segue tendo grande influência no desempenho da bolsa brasileira e tem se mostrado o principal fator que dita o apetite a risco de emergentes. Espera-se que o fluxo estrangeiro para o Brasil aumente a partir de uma maior definição do início de cortes pelo FOMC.

**Investimentos Estruturados e Exterior:** Nos Estados Unidos, dados de inflação e atividade econômica jogaram uma verdadeira tempestade sobre aqueles que esperavam um início do corte de juros próximo. Com dados recentes reforçando que a inflação segue persistente e acima da meta, o presidente do Banco Central americano reafirmou a postura de juros altos por mais tempo. 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

|   |  |                                 |
|---|--|---------------------------------|
| <b>Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%</b> | <b>Value-At-Risk (R\$):<br/>3.986.576,48</b> | <b>Value-At-Risk:<br/>0,54%</b> |
|---|--|---------------------------------|

|               | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | Limite <sup>(5)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | %<br>Carteira |
|---------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|----------------|---------------|
| Artigo 7º     | 0,32                        | 0,09               |                       | 0,03                | -0,57  | 0,71  | 654.176.130,93 | 88,05         |
| Artigo 8º     | 13,08                       | 6,00               |                       | 0,36                | -0,35  | -3,70 | 51.000.433,47  | 6,86          |
| Artigo 9º     | 17,51                       | 5,88               |                       | 0,06                | -0,00  | 0,80  | 22.021.887,62  | 2,96          |
| Artigo 10º    | 7,62                        | 5,80               |                       | 0,09                | -0,41  | -2,24 | 15.791.557,14  | 2,13          |
| CARAGUATATUBA | 1,24                        | 0,54               |                       | 0,54                | -0,52  | 0,24  | 742.990.009,16 | 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        | 264.558.223,17 | 35,61 |                        | 264.558.223,17        | 35,61     |
| de 31 dias a 365 dias | 140.141.917,84 | 18,86 |                        | 404.700.141,01        | 54,47     |
| acima de 365 dias     | 338.289.868,15 | 45,53 |                        | 742.990.009,16        | 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, 35,61% da carteira de investimentos do CaraguaPrev possui liquidez de até 30 dias, que podem ser resgatados e monetizados dentro desse período de tempo.



## 10 RENTABILIDADE POR ARTIGO

| 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<br>% do CDI   | 0,75<br>84,51    | 3,91<br>110,71  | 2,83<br>111,13  | 5,65<br>104,22  | 10,23<br>83,00     | 3.113.534,77        | 0,41                   | 14.697.039,61        |
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI   | 0,05<br>6,09     | 1,94<br>55,01   | 1,27<br>50,02   | 4,85<br>89,53   | 10,34<br>83,88     | 88.057,63           | 0,01                   | 2.283.507,44         |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI | 0,87<br>97,51    | 3,42<br>96,85   | 2,50<br>98,38   | 5,55<br>102,33  | 12,41<br>100,66    | 971.207,60          | 0,13                   | 4.339.764,76         |
| Artigo 7º V, Alínea a<br>% do CDI   | 0,79<br>88,71    | 2,54<br>71,91   | 1,81<br>71,00   | 11,54<br>212,80 | 280,53<br>2.275,52 | 12.141,71           | 0,00                   | 38.541,46            |
| Artigo 8º I<br>Var. IBOVESPA p.p.   | -3,70<br>-2,00   | -6,61<br>-0,46  | -2,48<br>-1,05  | 10,26<br>-1,04  | 14,35<br>-6,24     | -1.961.220,73       | -0,26                  | -3.610.878,34        |
| Artigo 9º III<br>% do CDI           | 0,80<br>90,34    | 15,90<br>449,81 | 10,85<br>426,36 | 26,54<br>489,42 | 34,38<br>278,91    | 137.938,90          | 0,02                   | 2.337.766,24         |
| Artigo 10º I<br>% do CDI            | -2,24<br>-252,28 | 3,35<br>94,75   | 2,10<br>82,68   | 6,11<br>112,70  | 12,72<br>103,21    | -536.248,53         | -0,07                  | 987.369,36           |
| Artigo 7º                           | 0,66             | 3,45            | 2,48            | 5,45            | 10,87              | 4.184.941,71        | 0,56                   | 21.358.853,27        |
| Artigo 8º                           | -3,70            | -6,61           | -2,48           | 10,26           | 14,35              | -1.961.220,73       | -0,26                  | -3.610.878,34        |
| Artigo 9º                           | 0,80             | 15,90           | 10,85           | 26,54           | 34,38              | 137.938,90          | 0,02                   | 2.337.766,24         |
| Artigo 10º                          | -2,24            | 3,35            | 2,10            | 6,11            | 12,72              | -536.248,53         | -0,07                  | 987.369,36           |
| <b>CARAGUATATUBA (Total)</b>        |                  |                 |                 |                 |                    | <b>1.825.411,35</b> | <b>0,24</b>            | <b>21.073.110,53</b> |

## 11 MOVIMENTAÇÕES DO MÊS

### APR – AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO DE RESGATE

| N.º | Data       | Origem  | Destino                            | Valor            | Motivo  |
|-----|------------|---|------------------------------------|------------------|---------|
| 51  | 01/04/2024 | Resgate parcial no Banco Itaú, Agência 0248, C/C 04042-0 do FI ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO - CNPJ Nº 05.073.656/0001-58 | ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI | R\$ 7.000.000,00 | RESGATE |



|    |            |   |  |                      |           |
|----|------------|---|--|----------------------|-----------|
| 52 | 01/04/2024 | Aplicação do resgate parcial na CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 do FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP - CNPJ nº 10.740.658/0001-93                       | FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP - CNPJ Nº 30.036.235/0001-02   | R\$<br>5.000.000,00  | APLICAÇÃO |
| 53 | 01/04/2024 | Resgate parcial na CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 do FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP - CNPJ nº 10.740.658/0001-93                                    | FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I - CNPJ Nº 17.502.937/0001-68 e FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP - CNPJ Nº 30.036.235/0001-02 | R\$<br>10.000.000,00 | RESGATE   |
| 54 | 01/04/2024 | Repasse das contribuições previdenciárias da Fundacc referente mês 03/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0   | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP   | R\$<br>68.777,41     | APLICAÇÃO |
| 55 | 01/04/2024 | Repasse Aporte para cobertura do déficit atuarial FUNDACC, referente ao mês 04/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4                   | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI   | R\$<br>8.784,75      | APLICAÇÃO |
| 56 | 02/04/2024 | Restituição Benefício Previdenciário de Pensionista do CaraguaPrev, Banco Itaú, Ag 0248 C/C 04042-0   | FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M1   | R\$<br>400,00        | APLICAÇÃO |
| 57 | 02/04/2024 | Aplicação do resgate parcial no Banco Itaú, Agência 0248, C/C 04042-0 do FI ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO - CNPJ Nº 05.073.656/0001-58          | ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI   | R\$<br>7.000.000,00  | APLICAÇÃO |
| 58 | 02/04/2024 | Aplicação do resgate parcial na CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 do FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP - CNPJ nº 10.740.658/0001-93                       | FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I - CNPJ Nº 17.502.937/0001-68  | R\$<br>4.206.693,51  | APLICAÇÃO |
| 59 | 03/04/2024 | Aplicação do resgate parcial na CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 do FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP - CNPJ nº 10.740.658/0001-93                       | FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I - CNPJ Nº 17.502.937/0001-68  | R\$<br>793.306,49    | APLICAÇÃO |
| 60 | 05/04/2024 | Repasse da compensação previdenciária – COMPREV 02/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 9999-6  | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI   | R\$<br>246.607,10    | APLICAÇÃO |
| 61 | 08/04/2024 | Aplicação no Banco Itaú, Ag 0248, C/C 04042-0 do recebimento de amortização do FIDC ITÁLIA  | ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI   | R\$<br>76.325,01     | APLICAÇÃO |
| 62 | 10/04/2024 | Resgate na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.   | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO.  | R\$<br>68.000,00     | RESGATE   |
| 63 | 15/04/2024 | Repasse do Aporte para cobertura do déficit atuarial CaraguaPrev 04/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4                              | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI   | R\$<br>8.379,03      | APLICAÇÃO |
| 64 | 16/04/2024 | Resgate no Banco do Brasil, Ag 1741-8, C/C 37.299-4 do FI BB PREV RF REF DI LP - CNPJ Nº 13.077.418/0001-49                                   | COMPRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 760199 COM VENCIMENTO EM 15/08/2032  | R\$<br>39.987.230,73 | RESGATE   |
| 65 | 17/04/2024 | Aquisição de Títulos Públicos com resgate no Banco do Brasil, Ag 1741-8, C/C 37.299-4 do FI BB PREV RF REF DI LP - CNPJ Nº 13.077.418/0001-49 | COMPRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B 760199 COM VENCIMENTO EM   | R\$<br>39.987.230,73 | APLICAÇÃO |



|    |            |  |   |                      |           |
|----|------------|--|---|----------------------|-----------|
|    |            |  | 15/08/2032  |                      |           |
| 66 | 19/04/2024 | Repasso das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal referente ao mês 03/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0  | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                      | R\$<br>4.696.357,35  | APLICAÇÃO |
| 67 | 19/04/2024 | Transferência do valor da Taxa de administração correspondente ao mês 04/2024, CEF, Ag 0797, C/C 9999-0  | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO  | R\$<br>837.446,62    | APLICAÇÃO |
| 68 | 19/04/2024 | Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Prefeitura Municipal, referente ao mês 04/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4   | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI                    | R\$<br>1.201.288,58  | APLICAÇÃO |
| 69 | 22/04/2024 | Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Câmara Municipal, referente mês 04/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4  | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI                    | R\$<br>46.721,45     | APLICAÇÃO |
| 70 | 25/04/2024 | Resgate na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.  | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO. | R\$<br>78.000,00     | RESGATE   |
| 71 | 26/04/2024 | Resgate total no Banco do Brasil, Ag 1741-8, C/C 9999-6 do FI BB PREV RF IRF-M1 TP- CNPJ Nº 11.328.882/0001-35   | BB INSTITUCIONAL RF   | R\$<br>10.694.095,43 | RESGATE   |
| 72 | 26/04/2024 | Aplicação do resgate total no Banco do Brasil, Ag 1741-8, C/C 9999-6 do FI BB PREV RF IRF-M1 TP- CNPJ Nº 11.328.882/0001-35  | BB INSTITUCIONAL RF   | R\$<br>10.361.426,37 | APLICAÇÃO |
| 73 | 26/04/2024 | Resgate total no Banco do Brasil, Ag 1741-8, C/C 37.299-4 (aportes) do FI BB PREV RF IRF-M1 TP- CNPJ Nº 11.328.882/0001-35   | BB RF DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP                                 | R\$<br>13.193.004,33 | RESGATE   |
| 74 | 26/04/2024 | Aplicação do resgate total no Banco do Brasil, Ag 1741-8, C/C 37.299-4 (aportes) do FI BB PREV RF IRF-M1 TP- CNPJ Nº 11.328.882/0001-35  | BB RF DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP                                 | R\$<br>12.782.599,74 | APLICAÇÃO |
| 75 | 26/04/2024 | Resgate parcial na CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 do FI CAIXA BRASIL IRF-M1+ TP RF LP CNPJ 10.577.519/0001-90  | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                      | R\$<br>5.000.000,00  | RESGATE   |
| 76 | 26/04/2024 | Resgate parcial na CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 do FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA - CNPJ Nº 23.215.097/0001-55   | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                      | R\$<br>7.000.000,00  | RESGATE   |
| 77 | 26/04/2024 | Resgate total na CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 do FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP - CNPJ Nº 14.120.520/001-42   | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                      | R\$<br>16.000.000,00 | RESGATE   |
| 78 | 26/04/2024 | Aplicação do resgate parcial na CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 do FI BRASIL IRF-M1+ TP RF LP CNPJ 10.577.519/0001-90, FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA - CNPJ Nº 23.215.097/0001-55 e resgate total CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP - CNPJ Nº 14.120.520/001-42 | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                      | R\$<br>26.310.292,29 | APLICAÇÃO |



|    |            |   |   |                   |           |
|----|------------|---|---|-------------------|-----------|
| 79 | 26/04/2024 | Resgate parcial no Banco Santander, Ag 0342, C/C 13.001576-2 do FI SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA - CNPJ Nº 26.507.132/0001-06  | SANTANDER RF REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM  | R\$ 600.000,00    | RESGATE   |
| 80 | 26/04/2024 | Aplicação do resgate parcial no Banco Santander (Brasil) S.A, Agência 0342 da conta corrente n.º 13.001576-2 do FI SANTANDER DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM - CNPJ Nº 09.577.447/0001-00 | SANTANDER RF REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM  | R\$ 10.000.000,00 | APLICAÇÃO |
| 81 | 26/04/2024 | Resgate parcial no Banco Santander (Brasil) S.A, Agência 0342 da conta corrente n.º 13.001576-2 do FI SANTANDER DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM - CNPJ Nº 09.577.447/0001-00              | SANTANDER RF REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM  | R\$ 10.000.000,00 | RESGATE   |
| 82 | 29/04/2024 | Resgate parcial no Banco do Brasil, Ag 1741-8, C/C 9999-6 do FI BB PREV RF IRF-M TP- CNPJ Nº 07.111.384/0001-69   | BB INSTITUCIONAL RF   | R\$ 10.000.000,00 | RESGATE   |
| 83 | 29/04/2024 | Aplicação do resgate total no Banco do Brasil, Ag 1741-8, C/C 9999-6 do FI BB PREV RF IRF-M1 TP- CNPJ Nº 11.328.882/0001-35   | BB INSTITUCIONAL RF   | R\$ 332.669,06    | APLICAÇÃO |
| 84 | 29/04/2024 | Aplicação do resgate parcial no Banco do Brasil, Ag 1741-8, C/C 9999-6 do FI BB PREV RF IRF-M TP- CNPJ Nº 07.111.384/0001-69  | BB INSTITUCIONAL RF   | R\$ 10.000.000,00 | APLICAÇÃO |
| 85 | 29/04/2024 | Aplicação do resgate total no Banco do Brasil, Ag 1741-8, C/C 37.299-4 (aportes) do FI BB PREV RF IRF-M1 TP- CNPJ Nº 11.328.882/0001-35   | BB RF DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP   | R\$ 410.404,59    | APLICAÇÃO |
| 86 | 29/04/2024 | Resgate total na CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 do FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP - CNPJ Nº 14.120.520/001-42  | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP  | R\$ 847.902,45    | RESGATE   |
| 87 | 29/04/2024 | 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. ABRIL DO ANO DE 2024. | R\$ 4.254.725,51  | RESGATE   |
| 88 | 29/04/2024 | Aplicação do resgate total na CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 do FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP - CNPJ Nº 14.120.520/001-42   | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP  | R\$ 720.397,11    | APLICAÇÃO |
| 89 | 29/04/2024 | Repasse das contribuições previdenciárias do CaraguaPrev, referente ao mês 04/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0   | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP  | R\$ 38.160,72     | APLICAÇÃO |
| 90 | 29/04/2024 | Aplicação do resgate total na CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 do FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP - CNPJ Nº 14.120.520/001-42   | CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP  | R\$ 1.689.707,71  | APLICAÇÃO |
| 91 | 29/04/2024 | 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\$ 231.168,64    | RESGATE   |
| 92 | 29/04/2024 | Aplicação do resgate parcial no Banco Santander, Ag 0342, C/C 13.001576-2 do FI SANTANDER ATIVO FIC RENDA   | SANTANDER RF REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL  | R\$ 600.000,00    | APLICAÇÃO |



|    |            | FIXA - CNPJ Nº 26.507.132/0001-06  | PREMIUM  |                   |           |
|----|------------|--|--|-------------------|-----------|
| 93 | 30/04/2024 | Repasse das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal e Câmara Municipal – aposentados e pensionistas referente ao mês de 04/2024. | ITAU INSTITUCIONAL<br>RF REF DI FI               | R\$<br>2.303,19   | APLICAÇÃO |
| 94 | 30/04/2024 | Repasse das contribuições previdenciárias da Câmara Municipal referente mês 04/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0                                   | CAIXA BRASIL RENDA<br>FIXA REFERENCIADO<br>DI LP | R\$<br>111.120,53 | APLICAÇÃO |
| 95 | 30/04/2024 | Aplicação do resgate total na CEF, Ag 0797, C/C 1000-0 do FI CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LP - CNPJ Nº 14.120.520/001-42                  | CAIXA BRASIL RENDA<br>FIXA REFERENCIADO<br>DI LP | R\$<br>127.505,34 | APLICAÇÃO |

## 12 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.

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

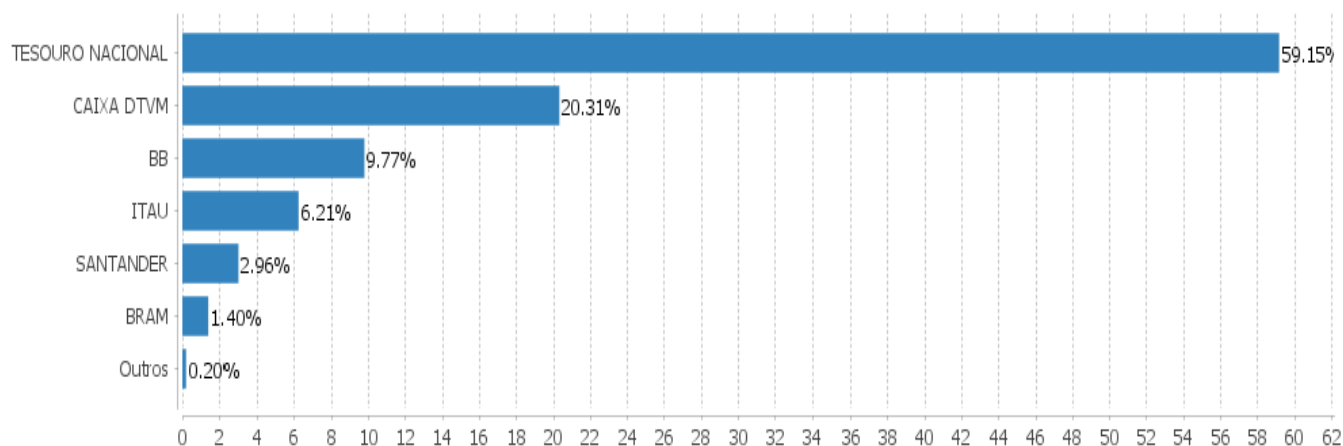
| Artigo                            | Tipo de Ativo                           | Valor(R\$)            | % Carteira    | Política de Investimentos |          |        | Pró-Gestão Nível 3 |               |
|-----------------------------------|---|-----------------------|---------------|---------------------------|----------|--------|--------------------|---------------|
|                                   |   |                       |               | Mínimo                    | Objetivo | Máximo | ALM                | Limite Legal  |
| <b>Renda Fixa</b>                 |   |                       |               |                           |          |        |                    |               |
| Artigo 7º I, Alínea a             | Títulos do Tesouro Nacional             | 439.501.108,51        | 59,15         | 0,00                      | 45,00    | 100,00 | 0,00               | 100,00        |
| Artigo 7º I, Alínea b             | Fundos 100% Títulos Públicos            | 65.167.384,40         | 8,77          | 0,00                      | 16,00    | 100,00 | 0,00               | 100,00        |
| Artigo 7º III, Alínea a           | Fundos Renda Fixa                       | 148.029.507,70        | 19,92         | 0,00                      | 19,80    | 75,00  | 0,00               | 75,00         |
| Artigo 7º V, Alínea a             | FIDC Cota Sênior                        | 1.478.130,32          | 0,20          | 0,00                      | 0,20     | 15,00  | 0,00               | 15,00         |
|                                   | <b>Total Renda Fixa</b>                 | <b>664.176.130,93</b> | <b>88,05</b>  |                           |          |        |                    | <b>100,00</b> |
| <b>Renda Variável</b>             |   |                       |               |                           |          |        |                    |               |
| Artigo 8º I                       | Fundos de Ações                         | 51.000.433,47         | 6,86          | 0,00                      | 6,00     | 45,00  | 0,00               | 45,00         |
|                                   | <b>Total Renda Variável</b>             | <b>51.000.433,47</b>  | <b>6,86</b>   |                           |          |        |                    | <b>45,00</b>  |
| <b>Investimentos no Exterior</b>  |   |                       |               |                           |          |        |                    |               |
| Artigo 9º III                     | Fundos de Ações - BDR Nível I           | 22.021.887,62         | 2,96          | 0,00                      | 5,00     | 10,00  | 0,00               | 10,00         |
|                                   | <b>Total Investimentos no Exterior</b>  | <b>22.021.887,62</b>  | <b>2,96</b>   |                           |          |        |                    | <b>10,00</b>  |
| <b>Investimentos Estruturados</b> |   |                       |               |                           |          |        |                    |               |
| Artigo 10º I                      | Fundos Multimercados                    | 15.791.557,14         | 2,13          | 0,00                      | 8,00     | 15,00  | 0,00               | 15,00         |
|                                   | <b>Total Investimentos Estruturados</b> | <b>15.791.557,14</b>  | <b>2,13</b>   |                           |          |        |                    | <b>20,00</b>  |
| <b>Total</b>                      |   | <b>742.990.009,16</b> | <b>100,00</b> |                           |          |        |                    |               |

## 13 RELAÇÃO DE GESTORES DOS RECURSOS

| Gestor           | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates       | Amortização | Saldo          | Resultado Financeiro Mês (R\$) |
|------------------|----------------|---------------|----------------|-------------|----------------|--------------------------------|
| BB               | 110.674.147,77 | 35.398.880,70 | -73.874.330,49 | 0,00        | 72.586.961,19  | 388.263,21                     |
| BRAM             | 11.252.259,91  | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 10.430.538,18  | -821.721,73                    |
| CAIXA DTVM       | 150.457.112,00 | 44.600.265,08 | -43.479.796,60 | 0,00        | 150.904.079,81 | -673.500,67                    |
| ITAU             | 46.418.973,02  | 7.079.028,20  | -7.000.000,00  | 0,00        | 46.118.628,60  | -379.372,62                    |
| SANTANDER        | 21.784.495,87  | 10.600.000,00 | -10.600.000,00 | 0,00        | 21.970.562,55  | 186.066,68                     |
| TESOURO NACIONAL | 396.400.343,01 | 39.987.230,73 | 0,00           | 0,00        | 439.501.108,51 | 3.113.534,77                   |
| VILA RICA        | 1.542.313,64   | 0,00          | 0,00           | 76.325,03   | 1.478.130,32   | 12.141,71                      |



#### Alocação por Gestor



## 14 RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV.

### Aplicações em Fundos de Investimentos e Títulos Públicos

ABRIL – 2024

| FUNDO  | CNPJ               | VALOR                | % RECURSOS |
|--|--------------------|----------------------|------------|
| BB PREV RF RETORNO TOTAL                             | 35.292.588/0001-69 | <b>10.361.871,47</b> | 1,4248     |
| BB PREVID RENDA FIXA IRF-M TP FI                     | 07.111.384/0001-69 | <b>10.518.565,81</b> | 2,8628     |
| BB RF DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP (APORTES 37299-4)    | 11.046.645/0001-81 | <b>13.203.369,71</b> | 1,7771     |
| CEF FI BRASIL IDKA2 PRÉ                              | 45.163.710/0001-70 | <b>2.575.278,02</b>  | 0,3466     |
| CEF FIC BR GESTAO ESTRATEGICA C/C 1000-0             | 23.215.097/0001-55 | <b>10.810.792,73</b> | 1,4550     |
| ITAU INSTITUCIONAL RF IRF-M 1                        | 08.703.063/0001-16 | <b>492.833,70</b>    | 0,0663     |
| CAIXA FI BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP | 10.740.658/0001-93 | <b>210.407,30</b>    | 0,0283     |
| CAIXA FI BRASIL IRF-M1+ TP RF LP                     | 10.577.519/0001-90 | <b>5.633.929,83</b>  | 0,7583     |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA                       | 26.507.132/0001-06 | <b>56.105,01</b>     | 0,0076     |
| FIDC FECHADO MULTISSETORIAL ITALIA                   | 13.990.000/0001-28 | <b>1.478.130,32</b>  | 0,1989     |
| CEF FI BRASIL REF DI LP 9999-0 (TX ADMINISTRATIVA)   | 03.737.206/0001-97 | <b>16.902.693,27</b> | 2,2750     |
| CEF FI BRASIL REF DI LP 1000-0                       | 03.737.206/0001-97 | <b>35.138.767,88</b> | 4,7294     |
| CAIXA FI BRASIL MATRIZ RF                            | 23.215.008/0001-70 | <b>17.752.919,68</b> | 2,3894     |
| SANTANDER DI INSTITUCIONAL PREMIUM                   | 02.224.354/0001-45 | <b>10.610.226,72</b> | 1,4280     |
| BB INSTITUCIONAL RF                                  | 02.296.928/0001-90 | <b>20.702.905,89</b> | 2,7864     |
| ITAU INSTIT RF DI                                    | 00.832.435/0001-00 | <b>30.569.874,06</b> | 4,1144     |
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RF                              | 05.073.656/0001-58 | <b>191.089,70</b>    | 0,0257     |
| BB PREV RF PERFIL                                    | 13.077.418/0001-49 | <b>14.193.513,59</b> | 1,9103     |





|  |                    |                       |                |
|--|--------------------|-----------------------|----------------|
| BB PREV RF PERFIL ( APORTES 37299-4)       | 13.077.418/0001-49 | <b>1.967.516,91</b>   | 2,3894         |
| SANTANDER DI TITULOS PUBLICOS PREMIUM      | 09.577.447/0001-00 | <b>11.304.230,82</b>  | 1,5215         |
| BB DIVIDENDOS FIC FIA                      | 05.100.191/0001-87 | <b>1.639.217,81</b>   | 0,2206         |
| FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS 9999-0 | 15.154.441/0001-15 | <b>16.073.527,84</b>  | 2,1634         |
| FIC AÇÕES EXPERT VINCI VALOR RPPS          | 14.507.699/0001-95 | <b>7.992.318,50</b>   | 1,0757         |
| ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC                     | 24.571.992/0001-75 | <b>6.809.965,99</b>   | 0,9166         |
| ITAU ACOES MOMENTO 30 II FIC               | 42.318.981/0001-60 | <b>8.054.865,15</b>   | 1,0841         |
| BRADERCO FIA SELECTION                     | 03.660.879/0001-96 | <b>5.398.146,40</b>   | 0,7265         |
| BRADERCO FIA SMALL CAP PLUS                | 06.988.623/0001-09 | <b>5.032.391,78</b>   | 0,6773         |
| FIA CAIXA INSTIT BDR NIVEL I               | 17.502.937/0001-68 | <b>22.021.887,62</b>  | 2,9640         |
| CAIXA FI INDEXA BOLSA AMERICANA            | 30.036.235/0001-02 | <b>15.791.557,14</b>  | 2,1254         |
| <b>Total em Bancos R\$</b>                 |                    | <b>303.488.900,65</b> | <b>40,8470</b> |

| <b>TITULOS PUBLICOS FEDERAIS</b> |       | <b>VALOR<br/>INVESTIDO</b> | <b>%<br/>RECURSOS</b> |
|----------------------------------|-------|----------------------------|-----------------------|
| NTN-B - 15/05/2035 (5,56%)       | 3.900 | <b>17.697.185,57</b>       | 2,3819                |
| NTN-B - 15/08/2040 (5,65%)       | 213   | <b>954.347,93</b>          | 0,1284                |
| NTN-B - 15/08/2050 (5,713%)      | 2.514 | <b>11.298.397,94</b>       | 1,5207                |
| NTN-B - 15/05/2045 (5,71%)       | 7.457 | <b>33.861.349,01</b>       | 4,5574                |
| NTN-B - 15/05/2045 (5,76%)       | 2.494 | <b>11.260.448,39</b>       | 1,5156                |
| NTN-B - 15/05/2045 (5,781%)      | 2.496 | <b>11.242.533,06</b>       | 1,5131                |
| NTN-B - 15/05/2030 (5,708%)      | 2.555 | <b>11.201.795,24</b>       | 1,5077                |
| NTN-B - 15/08/2040 (5,77%)       | 2.538 | <b>11.235.527,35</b>       | 1,5122                |
| NTN-B - 15/08/2050 (5,815%)      | 2.530 | <b>11.221.774,28</b>       | 1,5104                |
| NTN-B - 15/05/2055 (5,815%)      | 2.490 | <b>11.225.239,08</b>       | 1,5108                |
| NTN-B - 15/05/2035 (5,821%)      | 4.657 | <b>20.716.385,58</b>       | 2,7882                |
| NTN-B - 15/08/2024 (5,892%)      | 1.315 | <b>5.672.610,58</b>        | 0,7635                |
| NTN-B - 15/08/2050 (5,916%)      | 920   | <b>4.028.218,08</b>        | 0,5422                |
| NTN-B - 15/08/2050 (5,780%)      | 2.451 | <b>10.920.414,74</b>       | 1,4698                |
| NTN-B - 15/05/2055 (5,852%)      | 2.420 | <b>10.855.202,83</b>       | 1,4610                |
| NTN-B - 15/08/2050 (5,922%)      | 2.466 | <b>10.789.115,11</b>       | 1,4521                |
| NTN-B - 15/08/2024 (6,4750%)     | 5.073 | <b>21.848.027,94</b>       | 2,9406                |
| NTN-B - 15/05/2025 (5,9752%)     | 2.476 | <b>10.843.893,94</b>       | 1,4595                |
| NTN-B - 15/08/2024 (5,91%)       | 2.486 | <b>10.723.402,24</b>       | 1,4433                |
| NTN-B - 15/08/2024 (6,09%)       | 1.244 | <b>5.363.411,45</b>        | 0,7219                |
| NTN-B - 15/05/2027 (6,09%)       | 1.228 | <b>5.366.145,02</b>        | 0,7222                |
| NTN-B - 15/08/2024 (6,68%)       | 1.253 | <b>5.393.242,77</b>        | 0,7259                |
| NTN-B - 15/08/2024 (6,44%)       | 4.871 | <b>20.979.999,66</b>       | 2,8237                |
| NTN-B - 15/08/2026 (6,353%)      | 3.661 | <b>15.678.273,50</b>       | 2,1102                |
| NTN-B - 15/08/2028 (6,353%)      | 3.678 | <b>15.677.637,41</b>       | 2,1101                |
| NTN-B - 15/08/2024 (6,9903%)     | 7.262 | <b>31.230.545,72</b>       | 4,2034                |
| NTN-B - 15/05/2025 (5,940%)      | 4.848 | <b>21.239.313,62</b>       | 2,8586                |



|  |       |                       |                |
|--|-------|-----------------------|----------------|
| NTN-B - 15/08/2050 (5,9715%)                       | 4.754 | 20.668.769,66         | 2,7818         |
| NTN-B - 15/05/2025 (6,08%)                         | 4.612 | 20.178.497,34         | 2,7159         |
| NTN-B - 15/08/2032 (6,07%) - APORTES EQUAC DEFICIT | 9.326 | 40.129.403,47         | 5,4011         |
| <b>Total Títulos Públicos</b>                      |       | <b>439.501.108,51</b> | <b>59,1530</b> |

|                    |  |                       |                 |
|--------------------|--|-----------------------|-----------------|
| <b>Total Geral</b> |  | <b>742.990.009,16</b> | <b>100,0000</b> |
|--------------------|--|-----------------------|-----------------|

## 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 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 mês, 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, recebendo a aprovação deste Comitê.

### COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV

Caraguatatuba/SP, 23 de maio 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 **mês de ABRIL 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, 23 de maio 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



**Benedita Auxiliadora de Morais**  
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 **mês de ABRIL 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, 23 de maio 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



**Ronaldo Cheberle**  
Membro do Conselho Deliberativo

