



CARAGUAPREV

Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba
Estado de São Paulo



**CERTIFICADO
Pró-Gestão**

ICQ BRASIL RPPS
SPREV



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE CARAGUATATUBA/SP

CARAGUAPREV

AVALIAÇÃO FINANCEIRA

3º TRIMESTRE DE 2024



SUMÁRIO

1.	INTRODUÇÃO.....	3
2.	CENÁRIO MACROECONÔMICO	5
3.	BOLETIM FOCUS	6
4.	CARTEIRA DE INVESTIMENTOS.....	7
4.1	ESTUDO ALM	8
5.	RENTABILIDADE DO PLANO PREVIDENCIÁRIO	9
6.	RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS.....	10
7.	PERSPECTIVAS	14
8.	GERENCIAMENTO DE RISCOS - INDICADORES DE DESEMPENHO E RISCO	15
9.	TABELA DE LIQUIDEZ	16
10.	MOVIMENTAÇÕES DO TRIMESTRE.....	17
11.	EXECUÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS.....	28
12.	RELAÇÃO DE GESTORES DOS RECURSOS.....	30
13.	RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV.....	31
14.	RENTABILIDADE POR ARTIGO DA RESOLUÇÃO CMN DO TRIMESTRE AVALIADO.....	33
15.	PRÓ GESTÃO – NÍVEL III	33
16.	CONCLUSÃO.....	35



RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

3º TRIMESTRE DE 2024

Parâmetros:

- *Resolução 4.963/21 do CMN e alterações – Legislação Vigente;*
- *Política Anual de Investimentos - elaborada pelo CARAGUAPREV;*
- *Diversificação, Segurança, Liquidez e Transparência;*
- *Diluição dos riscos de perda e do retorno nos Investimentos;*
- *Aumento da rentabilidade da carteira de forma inteligente;*
- *Expectativas do Mercado.*

1. INTRODUÇÃO

O CaraguaPrev no trimestre avaliado vem implementando ações que demonstram transparência nos processos decisórios dos investimentos financeiros e divulgação das informações aos seus segurados.

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

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



Participantes da Gestão do CaraguaPrev no trimestre avaliado:

Todos os membros da Diretoria Executiva, Conselhos Deliberativo, Comitê de Investimentos e 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, Certificação TOTUM);
- Gabriela Cristina da Silva Coelho (Certificação TOTUM);
- Benedita Auxiliadora de Moraes, nomeação à partir de 15/05/2024 (Certificação TOTUM).

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

JULHO

BRASIL: No mês de julho toda a carteira de investimentos do CaraguaPrev em renda fixa, renda variável, investimentos estruturados e BDR, apresentaram performance positivas no mês. A rentabilidade geral da carteira no mês foi de 1,00%, acima da meta atuarial do mês que foi de 0,83%, sendo que no acumulado do ano a rentabilidade é de 6,20%, acima da meta atuarial anual de 5,86%. O IPCA apresentou a variação de 0,38% em julho e a Taxa Selic manteve-se em 10,50%. Houve certo alívio nas curvas de juros, principalmente nos vencimentos mais longos, refletindo o cenário global e uma melhora na margem sobre as perspectivas locais. Entretanto, ainda há incerteza em relação à condução da política fiscal. Em relação ao câmbio, houve o movimento de desvalorização da moeda local, a qual, também, foi observado em outras economias ligadas a commodities. Entretanto, o Real apresentou maior volatilidade devido às incertezas sobre a política fiscal local. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo na mesma direção observada nos índices globais. Apresentando a performance de +3,02% no mês.

GERAL: Em julho, apesar do FED ter mantido a taxa de juros inalterada, as curvas de juros globais caíram devido ao alívio contínuo nos dados de inflação dos EUA, assim, aumentando as expectativas de que o FED possa iniciar em breve um ciclo de afrouxamento monetário. Na China, a atividade segue consistentemente fraca e na zona do euro, a inflação de núcleo segue mais resiliente. Por fim, julho foi marcado por reviravoltas na corrida presidencial nos EUA, com o atentado contra o candidato Donald Trump e a desistência do atual presidente Joe Biden em favor de sua vice, Kamala Harris.

AGOSTO

BRASIL: No mês de agosto a carteira de investimentos do CaraguaPrev em renda fixa e renda variável, apresentaram performance positivas no mês, já os investimentos estruturados e BDR, apresentaram performance negativa no mês. A rentabilidade geral da carteira no mês foi de 0,72%, acima da meta atuarial do mês que foi de 0,41%, sendo que no acumulado do ano a rentabilidade



é de 6,96%, acima da meta atuarial anual de 6,29%. O IPCA apresentou a variação negativa de -0,02% em agosto e a Taxa Selic manteve-se em 10,50%. Localmente, as curvas de juros apresentaram alta, refletindo o aumento da probabilidade do Banco Central iniciar um novo ciclo de elevação da taxa Selic. Entretanto, devido ao aumento de apetite por risco no mercado internacional, o Ibovespa apresentou alta em agosto.

GERAL: Em agosto, houve o recuo dos juros globais, acarretados pela evolução construtiva do cenário econômico, com destaque para a dinâmica do controle inflacionário e atividade dos EUA, assim dando suporte a expectativa de corte de juros americanos. Na China, além da contínua deterioração do mercado imobiliário, a indústria começa a perder força. Esses fatores colocam em risco a meta de crescimento do país para este ano.

SETEMBRO

BRASIL: No mês de setembro a carteira de investimentos do CaraguaPrev em renda fixa e investimentos estruturados, apresentaram performance positivas no mês, já a renda variável apresentou performance negativa no mês. A rentabilidade geral da carteira no mês foi de 0,57%, abaixo da meta atuarial do mês que foi de 0,85%, sendo que no acumulado do ano a rentabilidade é de 7,57%, acima da meta atuarial anual de 7,19%. O IPCA apresentou a variação positiva de 0,44% em setembro. O Comitê de Política Monetária do Banco Central (Copom) decidiu, no dia 18 de setembro de 2024, aumentar a Selic em 0,25%, taxa básica de juros brasileira, de 10,50% para 10,75% ao ano, dando início ao que deve ser um breve ciclo de altas. Localmente, as curvas de juros apresentaram alta, refletindo a elevação da taxa Selic e pelo aumento das incertezas fiscais, consequentemente o Ibovespa apresentou queda no mês.

GERAL: Em setembro, o cenário internacional apresentou uma evolução construtiva, com alta das bolsas globais e recuo dos juros futuros, além de uma depreciação do dólar frente às demais moedas. Sendo este cenário, principalmente, advindo do movimento de redução de juros americanos, mais forte que o esperado, e sinalizações por parte do FED. Como contraponto, as tensões geopolíticas aumentaram.

3. BOLETIM FOCUS



Mediana - Agregado	2024							2025						
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***
IPCA (variação %)	4,26	4,37	4,37	= (1)	149	4,36	64	3,92	3,97	3,97	= (1)	148	3,86	64
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	2,46	3,00	3,00	= (1)	115	3,00	35	1,85	1,90	1,92	▲ (1)	114	1,93	35
Câmbio (R\$/US\$)	5,33	5,40	5,40	= (2)	124	5,40	45	5,30	5,35	5,35	= (2)	123	5,30	45
Selic (% a.a)	10,50	11,50	11,75	▲ (2)	145	11,75	72	10,00	10,50	10,75	▲ (1)	142	11,00	70
IGP-M (variação %)	3,68	3,75	3,96	▲ (4)	79	4,00	28	3,97	4,00	4,00	= (2)	76	3,93	28
IPCA Administrados (variação %)	4,79	4,76	4,77	▲ (1)	99	4,76	35	3,85	3,80	3,80	= (2)	97	3,76	34
Conta corrente (US\$ bilhões)	-36,30	-39,00	-39,90	▼ (4)	28	-39,00	9	-43,50	-43,60	-44,00	▼ (3)	27	-44,00	9
Balança comercial (US\$ bilhões)	83,50	81,00	81,00	= (1)	26	81,05	8	79,00	76,29	76,19	▼ (3)	22	75,00	7
Investimento direto no país (US\$ bilhões)	71,00	70,75	70,50	▼ (1)	27	72,30	9	73,00	73,00	73,00	= (1)	26	74,60	9
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	63,65	63,50	63,50	= (2)	29	64,00	13	66,45	66,50	66,50	= (1)	29	66,90	13
Resultado primário (% do PIB)	-0,60	-0,60	-0,60	= (4)	44	-0,60	17	-0,76	-0,74	-0,73	▲ (2)	44	-0,70	17
Resultado nominal (% do PIB)	-7,40	-7,79	-7,78	▲ (1)	28	-7,60	10	-6,79	-7,20	-7,30	▼ (1)	28	-7,25	10

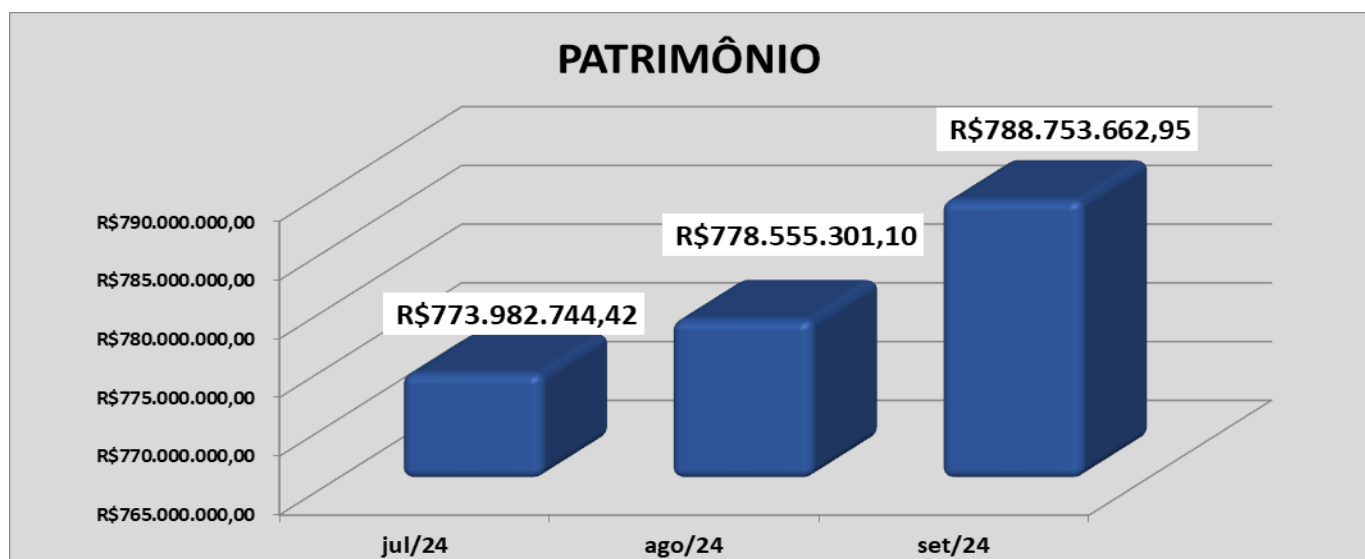
Relatório Focus de 27.09.2024. Fonte: <https://www.bcb.gov.br/publicacoes/focus>

4. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

A carteira de investimentos do Caraguaprev encerrou o mês com o patrimônio total de **R\$ 788.753.662,95** (setecentos e oitenta e oito milhões, setecentos e cinquenta e três mil, seiscentos e sessenta e dois reais e noventa e cinco 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)



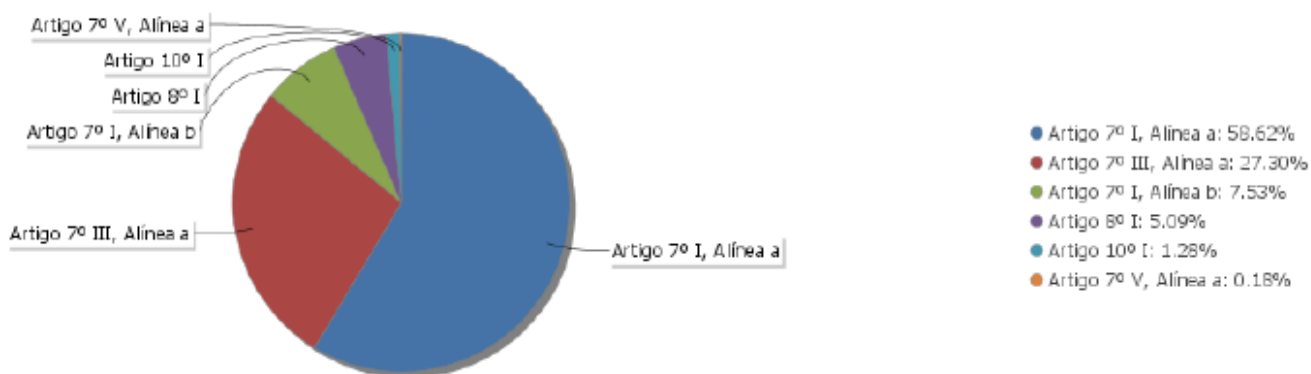


Mês 2024	PATRIMÔNIO
jul/24	R\$ 773.982.744,42
ago/24	R\$ 778.555.301,10
set/24	R\$ 788.753.662,95

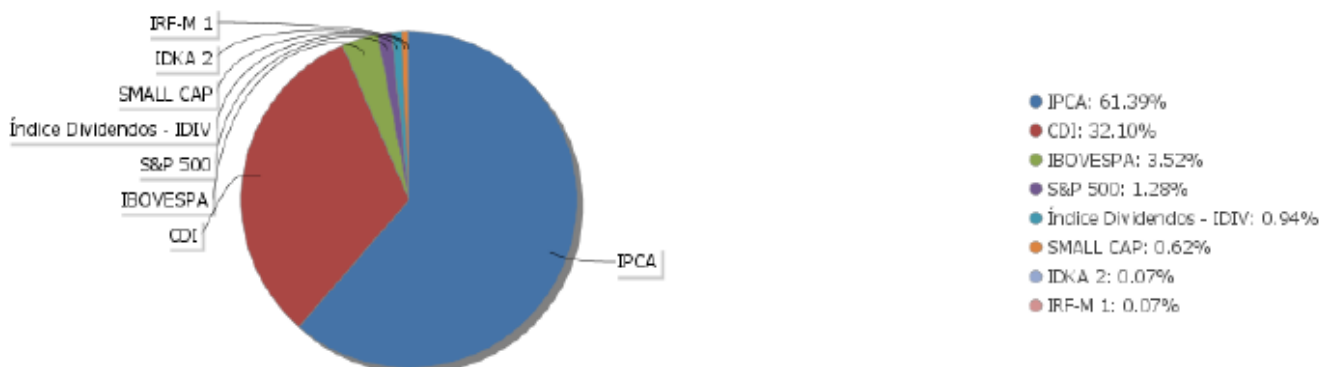
4.1 ESTUDO ALM

O estudo de Asset Liability Management (ALM) foi realizado na data de 28/08/2024, onde foram estudados os patamares de riscos x retorno (fronteira eficiente Markowitz).

4.2 Alocação por Artigo – Resolução CMN.



4.2.1 Alocação por Estratégia



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

4.3.1 Artigo 7º I, Alínea a: até 100% (cem por cento) em títulos de emissão do Tesouro Nacional, registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (Selic);



- 4.3.2 Artigo 7º I, Alínea b: até 100% (cem por cento) em cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa, conforme regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários, constituídos sob a forma de condomínio aberto, cujos regulamentos determinem que seus recursos sejam aplicados exclusivamente em títulos definidos na alínea "a", ou compromissadas lastreadas nesses títulos;
- 4.3.3 Artigo 7º, III, "a" Fundos de Investimento de Renda Fixa - até 60% (sessenta por cento) no somatório dos seguintes ativos: a) cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa, conforme regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários, constituídos sob a forma de condomínio aberto (fundos de renda fixa); cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa constituídos sob a forma de condomínio aberto, conforme regulamentação estabelecida pela CVM (fundos de renda fixa).
- 4.3.4 Artigo 7º, V, "a"- até 5% (cinco por cento) em: a) cotas de classe sênior de fundos de investimento em direitos creditórios (FIDC);
- 4.3.5 Artigo 8º I - No segmento de renda variável, as aplicações dos recursos dos regimes próprios de previdência social subordinam-se ao limite de até 30% (trinta por cento) em cotas de fundos de investimento classificados como ações, constituídos sob a forma de condomínio aberto, conforme regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários (fundos de renda variável);
- 4.3.6 Art. 9º, II - No segmento de investimentos no exterior, as aplicações dos recursos dos regimes próprios de previdência social subordinam-se ao limite de até 10% (dez por cento) no conjunto de: II - cotas de fundos de investimento constituídos no Brasil sob a forma de condomínio aberto com o sufixo "Investimento no Exterior", nos termos da regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários, que invistam, no mínimo, 67% (sessenta e sete por cento) do seu patrimônio líquido em cotas de fundos de investimento constituídos no exterior;
- 4.3.7 Art. 9º, III - No segmento de investimentos no exterior, as aplicações dos recursos dos regimes próprios de previdência social subordinam-se ao limite de até 10% (dez por cento) no conjunto de: III - cotas dos fundos da classe "Ações – BDR Nível I", nos termos da regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários.
- 4.3.8 Art. 10, I - No segmento de investimentos estruturados, as aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social subordinam-se ao limite global de até 15% (quinze por cento), e adicionalmente aos seguintes: I - até 10% (dez por cento) em cotas de fundos de investimento classificados como multimercado (FIM) e em cotas de fundos de investimento em cotas de fundos de investimento classificados como multimercado (FICFIM)

5. RENTABILIDADE DO PLANO PREVIDENCIÁRIO



Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	0,83	1,12	0,91	0,24	0,89	1,26	1,00	0,72	0,57				7,57
IPCA + 5,02%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,80	0,83	0,41	0,85				7,19
p.p. indexador	-0,22	-0,08	0,38	-0,57	0,02	0,85	0,17	0,31	-0,28				0,38
2023	1,75	-0,11	0,98	0,97	1,66	1,53	0,99	0,35	0,50	0,40	1,81	1,45	12,95
IPCA + 5,03%	0,98	1,19	1,18	0,98	0,88	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 + 4,98%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08	0,12	0,98	0,80	1,05	11,04
p.p. indexador	-1,48	-1,65	0,30	-3,13	0,11	-2,81	2,54	0,42	-0,95	1,10	-0,02	-1,15	-7,25
2021	-0,94	-1,45	0,38	1,02	1,49	0,37	-0,80	-0,98	-1,64	-1,55	1,37	1,32	-1,47
IPCA + 5,48%	0,87	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,81	1,88	1,38	1,22	18,05
p.p. indexador	-1,81	-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	0,28	-1,20	-8,82	2,26	2,04	2,80	3,94	-1,32	-1,88	-0,06	3,29	4,43	5,12
IPCA + 5,88%	0,71	0,86	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,88	10,85
p.p. indexador	-0,45	-1,86	-9,40	2,11	1,97	1,86	3,08	-2,04	-2,80	-1,40	1,94	2,58	-5,52
2019	1,51	0,37	0,41	0,94	1,99	2,58	1,16	0,11	1,85	2,11	-0,78	2,17	15,34
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,08	0,84	0,45	0,72	0,82	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	33	47,83
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	52,17
	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	2,31	2,10	0,20	1,18
06 meses	4,76	4,45	0,31	1,12
12 meses	11,55	9,65	1,90	1,23
24 meses	24,89	21,08	3,81	2,03
36 meses	27,52	36,38	-8,86	3,70
48 meses	33,96	58,89	-24,74	4,28
60 meses	35,21	73,36	-38,15	6,89
Desde 31/12/2018	50,67	85,62	-34,95	6,54

No trimestre a carteira de investimentos do plano previdenciário obteve rentabilidade de 2,31%, acima da meta atuarial do trimestre, que é de 2,09%. No acumulado do ano corrente a rentabilidade é de 7,57%, acima da meta atuarial do ano que é de 7,19%.

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

93,63%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,940000%)	0,24	0,04	0,68	2,19	21.449.974,15	2,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,980000%)	0,24	0,05	0,68	2,20	10.952.887,65	1,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (6,080000%)	2,93	0,04	0,89	2,23	20.389.459,21	2,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,350000%)	0,26	0,04	0,71	2,30	15.856.788,67	2,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,400000%)	4,16	0,04	0,71	0,97	20.193.456,57	2,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,703000%)	4,18	0,05	0,27	0,27	20.052.812,49	2,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,090000%)	0,28	0,04	0,89	2,23	5.422.246,11	0,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,220000%)	4,15	0,04	0,70	0,94	10.095.088,36	1,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,221000%)	2,95	0,05	0,70	2,26	20.013.517,71	2,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,350000%)	0,28	0,04	0,71	2,30	15.853.938,18	2,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,708000%)	0,33	0,04	0,66	2,13	11.307.325,39	1,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,070000%)	2,93	0,06	0,89	2,23	40.544.913,20	5,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,560000%)	0,40	0,04	0,65	2,10	17.863.593,34	2,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,821000%)	0,41	0,04	0,67	2,16	20.921.210,30	2,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,850000%)	0,46	0,04	0,65	2,12	963.711,68	0,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,770000%)	0,47	0,04	0,66	2,15	11.347.443,79	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,188000%)	4,19	0,05	0,48	0,48	15.070.385,37	1,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,710000%)	0,53	0,04	0,66	2,13	34.201.087,82	4,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,760000%)	0,53	0,04	0,66	2,15	11.373.886,67	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,781000%)	0,53	0,04	0,66	2,15	11.355.940,65	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,713000%)	0,57	0,04	0,66	2,13	11.413.190,51	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,780000%)	0,58	0,04	0,66	2,15	11.031.678,37	1,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,815000%)	0,58	0,04	0,67	2,16	11.336.268,57	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,916000%)	0,58	0,04	0,67	2,19	4.069.477,48	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,920000%)	0,56	0,02	0,68	2,19	10.899.641,05	1,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,970000%)	0,56	0,03	0,68	2,20	20.880.903,49	2,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,296000%)	4,26	0,05	0,49	0,49	35.171.295,67	4,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,815000%)	0,62	0,04	0,67	2,16	11.340.303,33	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,59	0,02	0,67	2,17	10.966.541,29	1,39
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,36	0,04	0,68	2,21	462.338.926,07	58,62



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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL	0,65	0,02	0,71	2,71	10.760.851,82	1,36	6.153.638.080,30	0,17
FIC FI										
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,04	0,04	0,83	2,63	24.587.003,24	3,12	32.173.775.540,30	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,34	-0,01	0,52	2,18	11.143.124,89	1,41	4.436.237.468,68	0,25
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO	3,11	-0,08	0,07	1,83	579.718,28	0,07	217.007.229,33	0,27
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1 FI	0,41	0,03	0,83	2,47	513.856,76	0,07	636.117.305,20	0,08
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,66	0,01	0,58	2,23	57.927,28	0,01	257.988.671,48	0,02
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,04	0,04	0,83	2,61	11.785.130,08	1,49	7.219.680.253,06	0,16
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,18	0,02	0,74	2,50	59.427.612,15	7,53		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB INSTITUCIONAL FI RF	0,13	0,03	0,83	2,78	21.634.363,48	2,74	2.346.355.369,66	0,92
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,04	0,84	2,73	49.767.476,98	6,31	20.065.228.623,01	0,25
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,10	0,04	0,85	2,70	29.131.852,17	3,69	5.910.577.806,47	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,04	0,86	2,73	67.852.004,78	8,62	19.144.855.193,98	0,35
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,08	0,04	0,86	2,72	35.769.932,15	4,53	6.684.832.943,63	0,54
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REF DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FI	0,08	0,04	0,88	2,75	11.082.679,11	1,41	3.331.476.040,52	0,33
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,16	0,04	0,85	2,73	215.338.108,67	27,30		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	110,39	-5,84	0,45	2,65	1.438.509,39	0,18	56.027.774,26	2,57
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			110,39	-5,84	0,45	2,65	1.438.509,39	0,18		
Renda Fixa			0,35	0,03	0,75	2,41	738.543.156,28	93,63		

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 93,63% da Carteira de Investimentos. (Resolução CMN n.º 4.963/21).



No trimestre avaliado a rentabilidade dos fundos de Investimento em Renda Fixa foi de 2,41%, acima da meta atuarial que foi de 2,09% no trimestre.

6.2 FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL.

RENDA VARIÁVEL										5,09%
Artigo 8º I (Fundos de Ações)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	12,12	-0,29	-1,91	6,75	1.749.420,56	0,22	584.717.081,00	0,30
BRAM	BEM	BRADERCO FIA SELECTION	14,00	-0,67	-2,32	6,55	5.511.464,47	0,70	315.351.858,83	1,75
BRAM	BEM	BRADERCO FIA ACOES MID SMALL CAPS	18,89	-0,65	-5,74	-2,22	4.907.491,36	0,62	522.893.263,26	0,94
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	13,07	-0,68	-3,17	5,99	8.260.339,23	1,05	752.918.243,94	1,10
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,20	-0,45	-1,90	6,80	7.433.035,15	0,94	1.065.953.775,09	0,70
ITAU	ITAU	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12,92	-0,88	-0,97	12,08	4.073.749,39	0,52	1.283.108.308,81	0,32
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	15,98	-0,56	-3,25	5,85	8.188.154,37	1,04	119.670.067,67	6,84
Sub-total Artigo 8º I			12,93	-0,61	-2,82	6,05	40.121.654,53	5,09		
Renda Variável			12,93	-0,61	-2,82	6,05	40.121.654,53	5,09		

Os Fundos de renda variável - AÇÕES que compõem a carteira do CaraguaPrev são compostos por FUNDOS DE AÇÕES - ART. 8º, I e representam 5,09% da Carteira de Investimentos. (Resolução CMN n.º 4.963/21).

No trimestre avaliado a rentabilidade do FUNDO DE AÇÕES foi de 6,05%, acima da meta atuarial que foi de 2,09% no trimestre.

6.3 FUNDOS ESTRUTURADOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS										1,28%
Artigo 10º I (Fundos Multimercados)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,47	0,39	0,89	-4,04	10.088.852,14	1,28	2.032.300.517,82	0,50
Sub-total Artigo 10º I			12,47	0,39	0,89	-4,04	10.088.852,14	1,28		
Investimentos Estruturados			7,24	0,39	0,89	-4,04	10.088.852,14	1,28		
Total			1,23	0,00	0,57	2,31	788.753.662,95	100,00		



CARAGUAPREV

Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba
Estado de São Paulo



Os Investimentos Estruturados, Fundo Multimercado - ART. 10, I, que compõem a carteira do Caraguaprev representa 1,28% da Carteira de Investimentos. (*Resolução CMN n.º 4.963/21*)

No trimestre avaliado a rentabilidade dos INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS foi de -4,04%, abaixo da meta atuarial que foi de 2,09% no trimestre.

7. PERSPECTIVAS

Renda Fixa: Pós-fixados, títulos públicos e privados atrelados ao COI ou à Selic devem continuar apresentando retornos elevados, acima da inflação - diante da subida da taxa Selic, alcançando 12% ao ano no começo de 2025. Títulos de renda fixa atrelados a índices de inflação (os famosos IPCA+) continuam uma excelente proteção para seus investimentos contra a perda do poder de compra ao longo do tempo. Para os pré-fixados, também notamos uma melhora nas taxas em relação aos últimos meses, mas esse tipo de alocação ainda requer atenção! Afinal, o novo ciclo de altas da Selic adiciona risco de desvalorização aos títulos existentes, especialmente caso novas surpresas na inflação se refletiam em uma taxa de juros ainda mais alta do que o projetado hoje por investidores.

Renda Variável: No Brasil, após um mês de agosto bastante positivo para o mercado de ações brasileiro, setembro retomou parte da aversão ao risco entre investidores, resultando em uma performance negativa para o Ibovespa. O início do ciclo de alta da taxa Selic também impactou a performance da nossa bolsa, mesmo que já amplamente esperado. Afinal, períodos de elevação de juros tendem a impactar as ações por meio de uma série de dinâmicas - dentre as quais:

- i) a desaceleração econômica causada pela alta nos juros pode afetar as margens de lucro de empresas, especialmente em setores mais relacionadas com ciclos econômicos (como o varejo);
- ii) a mudança na precificação do valor justo das ações: quanto maior a taxa de juros, menor o preço justo;
- iii) o aumento do custo de crédito e endividamento de empresas; e
- iv) o aumento do custo de oportunidade de investimentos em ações diante do maior retorno em renda fixa, e potencial migração de investidores.

Diante desses fatores a bolsa brasileira segue em caráter defensivo.

Investimentos Estruturados e Exterior: Assim como nos títulos prefixados brasileiros, os títulos de renda fixa global exigem seletividade e cautela. A maior parte dos ativos de renda fixa global são



prefixados (ou seja, já tem a taxa definida para o vencimento na hora da compra), o que torna a janela atual para o investimento nessa classe menos favorável. Com o provável ciclo de queda dos juros nos Estados Unidos ao longo dos próximos meses, os títulos de renda fixa global vêm incorporando esse movimento de queda em seus rendimentos, oferecendo taxas menores em comparação com o últimos meses. Esse movimento é favorável para quem investiu com taxas mais altas, mas menos favorável para quem busca se expor agora a essa classe, por conta do efeito da marcação a mercado.

8. GERENCIAMENTO DE RISCOS - INDICADORES DE DESEMPENHO E RISCO

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%	Value-At-Risk (R\$): 2.744.969,63	Value-At-Risk: 0,35%
---	--	---------------------------------

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,25	0,05		0,01	-0,40	0,73	738.543.156,28	93,63
Artigo 8º	11,36	5,88		0,29	-0,32	-2,82	40.121.654,53	5,09
Artigo 10º	2,78	7,43		0,05	0,02	0,89	10.088.852,14	1,28
CARAGUATATUBA	0,68	0,35		0,35	-0,39	0,57	788.753.662,95	100,00

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

8.1 Índice de Sharpe

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

8.2 VaR



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

8.3 Volatilidade

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

9. TABELA DE LIQUIDEZ

CARAGUATATUBA

30/09/2024

ANÁLISE DE LIQUIDEZ

Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	298.461.458,74	37,84		298.461.458,74	37,84	
de 31 dias a 365 dias	80.745.599,15	10,24		379.207.057,89	48,08	
acima de 365 dias	409.546.605,06	51,92		788.753.662,95	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, 37,84% da carteira de investimentos do CaraguaPrev possui liquidez de até 30 dias,



que podem ser resgatados e monetizados dentro desse período de tempo.

10. MOVIMENTAÇÕES DO TRIMESTRE

N.º	Data	Origem	Destino	Valor	Motivo
134	01/07/2024	RESGATE TOTAL DO FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP, CNPJ: 10.577.519/0001-90, para aplicação do valor no FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA, CEF, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0.	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP, CNPJ: 10.577.519/0001-90	R\$ 5.612.788,34	RESGATE
135	01/07/2024	APLICAÇÃO no FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70, ref. aos resgates dos FIs CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP e CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP, CEF, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0.	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70	R\$ 5.251.896,55	APLICAÇÃO
136	01/07/2024	APLICAÇÃO no FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70, ref. ao resgate do FI FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO, CNPJ: 45.163.710/0001-70, CEF, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70	R\$ 2.000.000,00	APLICAÇÃO
137	01/07/2024	APLICAÇÃO no FI CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP, CNPJ: 30.036.235/0001-02, referente ao resgate do FUNDO CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP, CNPJ: 03.737.206/0001-97, Caixa Econômica Federal, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP, CNPJ: 30.036.235/0001-02	R\$ 5.000.000,00	APLICAÇÃO
138	01/07/2024	RESGATE DO FI FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO, CNPJ: 45.163.710/0001-70, para aplicação no FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70, CEF, agência 0797, C/C 1000-0	FI FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO, CNPJ: 45.163.710/0001-70	R\$ 2.000.000,00	RESGATE
139	01/07/2024	RESGATE TOTAL do FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP, CNPJ: 10.740.658/0001-93, para aplicação no FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70, CEF, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP, CNPJ: 10.740.658/0001-93	R\$ 210.197,02	RESGATE
140	01/07/2024	RESGATE do FI BRASIL REFERENCIADO DI LP, CNPJ: 03.737.206/0001-97, PARA APLICAÇÃO NO FI CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP, CNPJ: 30.036.235/0001-02, CEF, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0	FUNDO CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 5.000.000,00	RESGATE
141	01/07/2024	Restituição Benefício Previdenciário de Pensionista do Caraguaprev, Banco Itaú, Ag 0248 C/C 04042-0	FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M1	R\$ 400,00	APLICAÇÃO



142	02/07/2024	RESGATE do FI ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO, CNPJ: 05.073.656/0001-58, para aplicação do valor no FI ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI, CNPJ: 00.832.435/0001-00, Banco Itaú, agência 0248, C/C 04042-0	FI ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO, CNPJ: 05.073.656/0001-58	R\$ 190.696,91	RESGATE
143	02/07/2024	RESGATE do BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP, CNPJ: 07.111.384/0001-69, para aplicação do valor no FI BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PÚBLICOS FI LONGO PRAZO, CNPJ: 11.046.645/0001-81, Banco do Brasil, AGÊNCIA 1741-8, C/C 9999-6	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP, CNPJ: 07.111.384/0001-69	R\$ 10.547.822,39	RESGATE
144	02/07/2024	APLICAÇÃO no FI BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PÚBLICOS FI LONGO PRAZO, CNPJ: 11.046.645/0001-81, referente ao resgate do FI BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP, CNPJ: 07.111.384/0001-69, Banco do Brasil, AGÊNCIA 1741-8, C/C 9999-6	FI BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PÚBLICOS FI LONGO PRAZO, CNPJ: 11.046.645/0001-81	R\$ 10.220.192,21	APLICAÇÃO
145	02/07/2024	APLICAÇÃO de no FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70, referente aos resgates dos FIs CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP, CNPJ: 10.740.658/0001-93 e CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP, CNPJ: 10.577.519/0001-90, CEF, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0.	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70	R\$ 571.088,81	APLICAÇÃO
146	02/07/2024	APLICAÇÃO no FI ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI, CNPJ: 00.832.435/0001-00, referente ao resgate do FI ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO, CNPJ: 05.073.656/0001-58, Banco Itaú, agência 0248, C/C 04042-0	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI, CNPJ: 00.832.435/0001-00	R\$ 190.696,91	APLICAÇÃO
147	04/07/2024	APLICAÇÃO no FI BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PÚBLICOS FI LONGO PRAZO, CNPJ: 11.046.645/0001-81, referente ao resgate do FI BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP, CNPJ: 07.111.384/0001-69, Banco do Brasil, AGÊNCIA 1741-8, C/C 9999-6	FI BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PÚBLICOS FI LONGO PRAZO, CNPJ: 11.046.645/0001-81	R\$ 327.630,18	APLICAÇÃO
148	04/07/2024	Resgate para pagamento de Requisição de Pequeno Valor - Processo Judicial	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 3.277,91	RESGATE
149	04/07/2024	Resgate na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 24.000,00	RESGATE
150	05/07/2024	Repasso da compensação previdenciária – COMPREV 05/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 9999-6	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 141.656,11	APLICAÇÃO
151	05/07/2024	Repasso das contribuições previdenciárias da Fundacc referente mês 06/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 69.278,64	APLICAÇÃO



152	10/07/2024	Resgate na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 64.000,00	RESGATE
153	11/07/2024	Repasse das contribuições previdenciárias de servidor da Prefeitura municipal de Caraguatatuba, cedido para a Prefeitura municipal de São Sebastião - referente ao mês de junho/2024	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 1.530,89	APLICAÇÃO
154	12/07/2024	Repasse do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Prefeitura Municipal, referente ao mês 06/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 1.201.288,58	APLICAÇÃO
155	15/07/2024	Repasse do Aporte para cobertura do déficit atuarial CaraguaPrev 07/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 8.379,03	APLICAÇÃO
156	15/07/2024	RECEBIMENTO DA CORREÇÃO MONETÁRIA E JUROS DO REPASSE DO APORTE PARA COBERTURA DO DÉFICIT ATUARIAL DA PREFEITURA MUNICIPAL REF. A 06/24, QUE FOI EFETUADO EM ATRASO	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 11.834,29	APLICAÇÃO
157	19/07/2024	Repasse Aporte para cobertura do déficit atuarial FUNDACC, referente ao mês 07/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 8.784,78	APLICAÇÃO
158	19/07/2024	Repasse do Aporte para cobertura do déficiti atuarial da Câmara Municipal, ref. mês 06/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 46.721,45	APLICAÇÃO
159	19/07/2024	Repasse do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Prefeitura Municipal, referente ao mês 07/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 1.201.288,58	APLICAÇÃO
160	19/07/2024	Repasse das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal referente ao mês 06/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 4.680.596,80	APLICAÇÃO
161	19/07/2024	Transferência do valor da Taxa de administração correspondente ao mês 07/2024, CEF, Ag 0797, C/C 9999-0	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 837.446,62	APLICAÇÃO
162	25/07/2024	Resgate na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 69.000,00	RESGATE
163	29/07/2024	Resgate para pagamento folha dos ativos na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 248.153,19	RESGATE
164	30/07/2024	Resgate p/ FOLHA DE PAGAMENTO DOS APOSENTADOS E PENSIONISTAS DO CARAGUAPREV REF. 07/2024 na CEF, AG 0797, C/C 1000-0, FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP - CNPJ N° 03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 4.356.719,43	RESGATE
165	30/07/2024	Repasse das contribuições previdenciárias do CaraguaPrev, referente ao mês 07/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 38.262,79	APLICAÇÃO



166	31/07/2024	Resgate p/ FOLHA COMPLEMENTAR DE PENSIONISTAS DO CARAGUAPREV REF. 07/2024 na CEF, AG 0797, C/C 1000-0, FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP - CNPJ Nº 03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 8.714,40	RESGATE
167	31/07/2024	Repasso das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal e Câmara Municipal – aposentados e pensionistas ref. ao mês de 07/2024.	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI, CNPJ: 00.832.435/0001-00	R\$ 2.303,19	APLICAÇÃO
168	01/08/2024	Repasso das contribuições previdenciárias da Câmara Municipal referente mês 07/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 109.256,61	APLICAÇÃO
169	02/08/2024	Restituição Benefício Previdenciário de Pensionista do CaraguaPrev, Banco Itaú, Ag 0248 C/C 04042-0	FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M1	R\$ 400,00	APLICAÇÃO
170	06/08/2024	RESGATE TOTAL DO FI CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP, CNPJ: 30.036.235/0001-02, P/ APLICAÇÃO DO VALOR NO FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0	FI CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP, CNPJ: 30.036.235/0001-02	R\$ 21.141.590,43	RESGATE
171	08/08/2024	RESGATE TOTAL DO FI FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I, CNPJ: 17.502.937/0001-68, PARA APLICAÇÃO DO VALOR NO FI BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ: 13.077.418/0001-49, AGÊNCIA 1741-8, C/C 9999-0	FI FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I, CNPJ: 17.502.937/0001-68	R\$ 24.926.396,48	RESGATE
172	06/08/2024	APLICAÇÃO no Fundo de investimentos FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70, referente ao resgate do FI CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP, CNPJ: 30.036.235/0001-02	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70	R\$ 21.141.590,43	APLICAÇÃO
173	06/08/2024	Repasso das contribuições previdenciárias de servidor da Prefeitura de Caraguatatuba. Cedido para a Câmara de São Sebastião, referente ao mês 07/2024.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 1.418,66	APLICAÇÃO
174	07/08/2024	Repasso da compensação previdenciária – COMPREV 06/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 9999-6	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 242.652,28	APLICAÇÃO
175	09/08/2024	APLICAÇÃO no Fundo de investimentos BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI, referente ao resgate do FI FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I, CNPJ: 17.502.937/0001-68	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 24.926.396,48	APLICAÇÃO
176	09/08/2024	Repasso das contribuições previdenciárias da Fundacc referente mês 07/2024.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 68.428,20	APLICAÇÃO
177	09/08/2024	Resgate na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 67.000,00	RESGATE
178	15/08/2024	VENCIMENTO DE TITULOS PÚBLICOS NTN-B EM 15/08/2024, QUANT. 1.315 TAXA 5,8920%	TITULOS PÚBLICOS NTN-B	R\$ 5.842.646,91	RESGATE



CARAGUAPREV

Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba
Estado de São Paulo



179	15/08/2024	VENCIMENTO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B EM 15/08/2024, QUANT. 5.073 TAXA 6,48%	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B	R\$ 22.539.732,18	RESGATE
180	15/08/2024	VENCIMENTO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B EM 15/08/2024, QUANT. 2.486 TAXA 5,91%.	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B	R\$ 11.045.490,67	RESGATE
181	15/08/2024	VENCIMENTO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B EM 15/08/2024, QUANT. 1.244 TAXA 6,09%.	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B	R\$ 5.527.188,41	RESGATE
182	15/08/2024	VENCIMENTO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B EM 15/08/2024, QUANT. 7.262 TAXA 6,9903%.	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B	R\$ 32.265.628,83	RESGATE
183	15/08/2024	VENCIMENTO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B EM 15/08/2024, QUANT. 1.253 TAXA 6,68%.	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B	R\$ 5.567.176,11	RESGATE
184	15/08/2024	VENCIMENTO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B EM 15/08/2024, QUANT. 4.871 TAXA 6,44%.	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B	R\$ 21.642.230,52	RESGATE
185	15/08/2024	Repasse do Aporte para cobertura do déficit atuarial CaraguaPrev 07/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 8.379,03	APLICAÇÃO
186	15/08/2024	RESGATE PARCIAL NA CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, APLICADO NO FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70, PARA COMPRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS NTN-B	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70	R\$ 30.000.946,56	RESGATE
187	16/08/2024	AQUISIÇÃO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B VENCIMENTO 15/08/2026, QUANT. 4.666 TAXA 6,4010%, R\$ 20.000.338,20, DO RESGATE PARCIAL NA CAIXA, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0, APLICADO NO FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B	R\$ 20.000.338,20	APLICAÇÃO
188	16/08/2024	AQUISIÇÃO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B VENCIMENTO 15/05/2027, QUANT. 2.293 TAXA 6,221%, R\$ 10.000.608,34, DO RESGATE PARCIAL NA CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0, APLICADO NO FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70.	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B	R\$ 10.000.608,34	APLICAÇÃO
189	16/08/2024	APLICAÇÃO no FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70, referente ao recebimento do vencimento de Títulos Públicos Federais NTN' Bs em 15/08/2024 e de juros semestrais NTN' Bs,	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70	R\$ 65.890.579,38	APLICAÇÃO
190	16/08/2024	APLICAÇÃO no FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP, CNPJ: 03.737.206/0001-97, referente ao recebimento do vencimento de Títulos Públicos Federais NTN' Bs em 15/08/2024 e de juros semestrais NTN' Bs	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 43.927.052,92	APLICAÇÃO
191	19/08/2024	Repasse do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Câmara Municipal, ref. mês 08/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 46.721,45	APLICAÇÃO
192	20/08/2024	Repasse do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Prefeitura Municipal, referente ao mês 08/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 1.201.288,58	APLICAÇÃO
193	20/08/2024	Repasse Aporte para cobertura do déficit atuarial FUNDACC, referente ao mês 07/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 8.784,78	APLICAÇÃO



194	20/08/2024	Repasse das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal referente ao mês 07/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 4.668.499,39	APLICAÇÃO
195	20/08/2024	Transferência do valor da Taxa de administração correspondente ao mês 08/2024, CEF, Ag 0797, C/C 9999-0	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 837.446,62	APLICAÇÃO
196	22/08/2024	Resgate na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 107.000,00	RESGATE
197	27/08/2024	Resgate para pagamento folha dos ativos na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 256.849,32	RESGATE
198	28/08/2024	Repasse das contribuições previdenciárias da Câmara Municipal referente mês 08/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 131.980,02	APLICAÇÃO
199	29/08/2024	Repasse das contribuições previdenciárias do CaraguaPrev, referente ao mês 08/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 38.262,79	APLICAÇÃO
200	29/08/2024	Resgate p/ FOLHA DE PAGAMENTO DOS APOSENTADOS E PENSIONISTAS DO CARAGUAPREV REF. 08/2024 na CEF, AG 0797, C/C 1000-0, FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP - CNPJ Nº 03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 4.300.122,32	RESGATE
201	30/08/2024	Repasse das contribuições previdenciárias de servidor da Prefeitura de Caraguatatuba, Cedido para a Prefeitura de São Sebastião, referente ao mês 08/2024.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 861,13	APLICAÇÃO
202	30/08/2024	Repasse das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal e Câmara Municipal – aposentados e pensionistas ref. ao mês de 08/2024.	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI, CNPJ: 00.832.435/0001-00	R\$ 2.303,19	APLICAÇÃO
203	30/08/2024	RESGATE PARCIAL DO FI ITAU ACOES DUNAMIS FIC, CNPJ: 24.571.992/0001-75, PARA APLICAÇÃO DO VALOR NO FI ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI, CNPJ: 00.832.435/0001-00	FI ITAU ACOES DUNAMIS FIC, CNPJ: 24.571.992/0001-75	R\$ 3.500.000,00	RESGATE
204	02/09/2024	Restituição Benefício Previdenciário de Pensionista do CaraguaPrev, Banco Itaú, Ag 0248 C/C 04042-0	FUNDO DE INVESTIMENTOS ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M1	R\$ 400,00	APLICAÇÃO
205	03/09/2024	APLICAÇÃO NO ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI, CNPJ: 00.832.435/0001-00 ref. ao resgate RESGATE PARCIAL DO FI ITAU ACOES DUNAMIS FIC, CNPJ: 24.571.992/0001-75.	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI, CNPJ: 00.832.435/0001-00	R\$ 3.500.000,00	APLICAÇÃO
206	06/09/2024	Aplicação no Banco Itaú, Ag 0248, C/C 04042-0 do recebimento de amortização do FIDC ITÁLIA	ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	R\$ 102.058,53	APLICAÇÃO



207	06/09/2024	Repasse das contribuições previdenciárias da servidora da Prefeitura Municipal de Caraguatatuba, conforme Processo Adm. N.º 409/2024	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 3.298,69	APLICAÇÃO
208	06/09/2024	Repasse da compensação previdenciária – COMPREV 07/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 9999-6	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	R\$ 242.652,28	APLICAÇÃO
209	10/09/2024	Resgate na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 70.000,00	RESGATE
210	12/09/2024	RESGATE PARCIAL NA CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0, APLICADO NO FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI, CNPJ: 03.737.206/0001-97 PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B VENCIMENTO 15/08/2040, QUANT. 3.511 TAXA 6,186%, R\$ 14.998.280,56.	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B	R\$ 14.998.280,56	RESGATE
211	12/09/2024	RESGATE PARCIAL NA CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0, APLICADO NO FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/001-70 PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B VENCIMENTO 15/08/2050, QUANT. 8.340 TAXA 6,296 %, R\$ 35.001.417,11.	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B	R\$ 35.001.417,11	RESGATE
212	13/09/2024	RESGATE PARCIAL DO FI CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS, CNPJ: 15.154.441/0001-15, PARA APLICAÇÃO DO VALOR NO FI CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI , CNPJ: 03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 10.000.000,00	RESGATE
213	13/09/2024	AQUISIÇÃO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B VENCIMENTO 15/08/2040, QUANT. 3.511 TAXA 6,186%, R\$ 14.998.280,56, DO RESGATE PARCIAL NA CAIXA, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0, APLICADO NO FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI, CNPJ: 03.737.206/0001-97.	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B	R\$ 14.998.280,56	APLICAÇÃO
214	13/09/2024	AQUISIÇÃO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B VENCIMENTO 15/08/2050, QUANT. 8.340 TAXA 6,296%, R\$ 35.001.417,11, DO RESGATE PARCIAL NA CAIXA, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0, APLICADO NO FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FIXA - CNPJ: 23.215.008/001-70.	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B	R\$ 35.001.417,11	APLICAÇÃO
215	13/09/2024	Repasse das contribuições previdenciárias da Fundacc referente mês 08/2024.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 68.428,20	APLICAÇÃO
216	18/09/2024	Repasse das contribuições previdenciárias de servidor da Prefeitura de Caraguatatuba, cedido para a Prefeitura de São Sebastião, referente ao mês 08/2024.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 2.200,65	APLICAÇÃO



217	18/09/2024	Aplicação no CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI, CNPJ: 03.737.206/0001-97 ref. ao resgate parcial do FI FIC FIA CAIXA EXOERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS- CNPJ Nº 15.154.441/0001-15.	CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	R\$ 10.000.000,00	APLICAÇÃO
218	18/09/2024	Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial CaraguaPrev 09/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 8.379,03	APLICAÇÃO
219	18/09/2024	Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Câmara Municipal, ref. mês 08/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 46.721,45	APLICAÇÃO
220	19/09/2024	Resgate parcial do FI CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP - CNPJ 03.737.206/0001-97 para aplicação no FI CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP - CNPJ 30.036.235/0001-02.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 10.000.000,00	RESGATE
221	19/09/2024	Aplicação no FI CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP - CNPJ 30.036.235/0001-02 ref. Ao resgate parcial FI CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP - CNPJ 03.737.206/0001-97	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP, CNPJ: 30.036.235/0001-02	R\$ 10.000.000,00	APLICAÇÃO
222	19/09/2024	RESGATE PARCIAL NA CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0, APLICADO NO FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FIXA, CNPJ: 23.215.008/001-70 PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B VENCIMENTO 15/08/2026, QUANT. 4.657 TAXA 6,703 %, R\$ 19.999.414,39.	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B	R\$ 19.999.414,39	RESGATE
223	20/09/2024	AQUISIÇÃO DE TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B VENCIMENTO 15/08/2026, QUANT. 4.657 TAXA 6,703%, R\$ 19.999.414,39, DO RESGATE PARCIAL NA CAIXA, AGÊNCIA 0797, C/C 1000-0, APLICADO NO FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FIXA - CNPJ: 23.215.008/001-70.	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B	R\$ 19.999.414,39	APLICAÇÃO
224	20/09/2024	Transferência do valor da Taxa de administração correspondente ao mês 09/2024, CEF, Ag 0797, C/C 9999-0	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 837.446,62	APLICAÇÃO
225	20/09/2024	Repasso Aporte para cobertura do déficit atuarial FUNDACC, referente ao mês 09/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4.	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 8.784,78	APLICAÇÃO
226	20/09/2024	Repasso do Aporte para cobertura do déficit atuarial da Prefeitura Municipal, referente ao mês 09/2024, Banco do Brasil, Ag 1741-8 C/C 37299-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ 13.077.418/0001-49	R\$ 1.201.288,58	APLICAÇÃO
227	20/09/2024	Repasso das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal referente ao mês 08/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 4.687.049,78	APLICAÇÃO
228	25/09/2024	Resgate na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 292.000,00	RESGATE



229	27/09/2024	Resgate para pagamento folha dos ativos na CEF, Agência 0797, conta corrente 9999-0, para pagamento das despesas administrativas.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 240.817,07	RESGATE
230	27/09/2024	Resgate p/ FOLHA DE PAGAMENTO DOS APOSENTADOS E PENSIONISTAS DO CARAGUAPREV REF. 09/2024 na CEF, AG 0797, C/C 1000-0, FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP - CNPJ Nº 03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 4.364.229,58	RESGATE
231	27/09/2024	Repasso das contribuições previdenciárias da Câmara Municipal referente mês 09/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 104.788,95	APLICAÇÃO
232	27/09/2024	Repasso das contribuições previdenciárias do CaraguaPrev, referente ao mês 09/2024, CEF, Ag 0797 C/C 1000-0	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 38.262,79	APLICAÇÃO
233	27/09/2024	Repasso das contribuições previdenciárias de servidor da Prefeitura de Caraguatatuba. Cedido para a Prefeitura de São Sebastião, referente ao mês 09/2024.	CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97	R\$ 1.530,89	APLICAÇÃO
234	30/09/2024	Repasso das contribuições previdenciárias da Prefeitura Municipal e Câmara Municipal – aposentados e pensionistas ref. ao mês de 08/2024.	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI, CNPJ: 00.832.435/0001-00	R\$ 2.303,19	APLICAÇÃO

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 total R\$ 10.547.822,39 (dez milhões e quinhentos e quarenta e sete mil e oitocentos e vinte e dois reais e trinta e nove centavos) do Fundo de investimentos FUNDO BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP, CNPJ: 07.111.384/0001-69, Banco do Brasil, em 02/07/2024, para APLICAÇÃO de R\$ 10.547.822,39 (dez milhões e quinhentos e quarenta e sete mil e oitocentos e vinte e dois reais e trinta e nove centavos), no Fundo de Investimento BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PÚBLICOS FI LONGO PRAZO, CNPJ: 11.046.645/0001-81, Banco do Brasil, sendo R\$ 10.220.192,21 (dez milhões e duzentos e vinte mil e cento e noventa e dois reais e vinte e um centavos) em 02/07/2024 e R\$ 327.630,18 (trezentos e vinte e sete mil e seiscentos e trinta reais e dezoito centavos) em 04/07/2024;
- 2) RESGATE total R\$ 190.696,91 (cento e noventa mil e seiscentos e noventa e seis reais e noventa e um centavos) do Fundo de investimentos ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO, CNPJ: 05.073.656/0001-58, Banco Itaú, em 02/07/2024, para APLICAÇÃO de R\$ 190.696,91 (cento e noventa mil e seiscentos e noventa e seis reais e noventa e um centavos) do Fundo de



- investimentos ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI, CNPJ: 00.832.435/0001-00, Banco Itaú, em 02/07/2024;
- 3) RESGATE total R\$ 210.197,02 (duzentos e dez mil e cento e noventa e sete reais e dois centavos) do Fundo de investimentos FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP, CNPJ: 10.740.658/0001-93, Caixa Econômica Federal, em 01/07/2024 e RESGATE total R\$ 5.612.788,34 (cinco milhões e seiscentos e doze mil e setecentos e oitenta e oito reais e trinta e quatro centavos) do Fundo de investimentos FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP, CNPJ: 10.577.519/0001-90, Caixa Econômica Federal, em 01/07/2024, para APLICAÇÃO de R\$ 5.822.985,36 (cento e noventa mil e seiscentos e noventa e seis reais e noventa e um centavos) do Fundo de investimentos FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70, Caixa Econômica Federal, sendo R\$ 5.251.896,55 (cinco milhões e duzentos e cinquenta e um mil e oitocentos e noventa e seis reais e cinquenta e cinco centavos) em 01/07/2024 e R\$ 571.088,81 (quinhentos e setenta e um mil e oitenta e oito reais e oitenta e um centavos) em 02/07/2024;
- 4) RESGATE R\$ 2.000.000,00 (dois milhões de reais) do Fundo de investimentos FIC FI CAIXA BRASIL IDKA PRE 2A RENDA FIXA LONGO PRAZO, CNPJ: 45.163.710/0001-70, Caixa Econômica Federal, em 01/07/2024, para APLICAÇÃO de R\$ 2.000.000,00 (dois milhões de reais) no Fundo de investimentos FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70, Caixa Econômica Federal, em 01/07/2024;
- 5) RESGATE R\$ 5.000.000,00 (cinco milhões de reais) do Fundo de investimentos FUNDO CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP, CNPJ: 03.737.206/0001-97, Caixa Econômica Federal, em 01/07/2024, para APLICAÇÃO de R\$ 5.000.000,00 (cinco milhões de reais) no Fundo de investimentos CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP, CNPJ: 30.036.235/0001-02, Caixa Econômica Federal, em 01/07/2024;
- 6) RESGATE TOTAL R\$ 21.141.590,43 (vinte e um milhões e cento e quarenta e um mil e quinhentos e noventa reais e quarenta e três centavos) do Fundo de investimentos FUNDO CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP, CNPJ: 30.036.235/0001-02, Caixa Econômica Federal, em 06/08/2024, para APLICAÇÃO de R\$ 21.141.590,43 (vinte e um milhões e cento e quarenta e um mil e quinhentos e noventa reais e quarenta e três centavos) no Fundo de investimentos CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70, Caixa Econômica Federal, em 06/08/2024;



- 7) RESGATE TOTAL R\$ 24.926.396,48 (vinte e quatro milhões e novecentos e vinte e seis mil e trezentos e noventa e seis reais e quarenta e oito centavos) do Fundo de investimentos FUNDO FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I, CNPJ: 17.502.937/0001-68, Caixa Econômica Federal, em 08/08/2024, para APLICAÇÃO de R\$ 24.926.396,48 (vinte e quatro milhões e novecentos e vinte e seis mil e trezentos e noventa e seis reais e quarenta e oito centavos) no Fundo de investimentos BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI, CNPJ: 13.077.418/0001-49, Banco do Brasil, em 09/08/2024;
- 8) RESGATE de R\$ 30.000.946,56 (trinta milhões e novecentos e quarenta e seis reais e cinquenta e seis centavos) do Fundo de Investimento FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70, Caixa Econômica Federal, c/c 1000-0, em 15/08/2024, para COMPRA de R\$ 20.000.338,20 (vinte milhões e trezentos e trinta e oito reais e vinte centavos), em Títulos Públicos Federais NTN-B – 15/08/2026, taxa 6,4010%, quantidade 4.666, em 16/08/2024 e compra de R\$ 10.000.608,34 (dez milhões e seiscentos e oito reais e trinta e quatro centavos), em Títulos Públicos Federais NTN-B – 15/05/2027, taxa 6,2210%, quantidade 2.293, em 16/08/2024.
- 9) RESGATE de R\$ 3.500.000,00 (três milhões e quinhentos mil reais) do Fundo de investimentos ITAU AÇÕES DUNAMIS , CNPJ: 24.571.992/0001-75, Banco Itaú Unibanco, em 30/08/2024, para APLICAÇÃO de R\$ 3.500.000,00 (três milhões e quinhentos mil reais) no Fundo de investimentos ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI FI, CNPJ: 00.832.435/0001-00, Banco Itaú Unibanco, em 03/09/2024.
- 10) RESGATE de R\$ 3.500.000,00 (três milhões e quinhentos mil reais) do Fundo de investimentos ITAU AÇÕES DUNAMIS , CNPJ: 24.571.992/0001-75, Banco Itaú Unibanco, em 30/08/2024, para APLICAÇÃO de R\$ 3.500.000,00 (três milhões e quinhentos mil reais) no Fundo de investimentos ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI FI, CNPJ: 00.832.435/0001-00, Banco Itaú Unibanco, em 03/09/2024;
- 11) RESGATE de R\$ 14.998.280,56 (quatorze milhões e novecentos e noventa e oito mil e duzentos e oitenta reais e cinquenta e seis centavos) do Fundo de Investimento CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP, CNPJ: 03.737.206/0001-97, Caixa Econômica Federal, c/c 1000-0, em 12/09/2024, para COMPRA de R\$ 14.998.280,56 (quatorze milhões e novecentos e noventa e oito mil e duzentos e oitenta reais e cinquenta e seis centavos) em Títulos Públicos Federais NTN-B – 15/08/2040, taxa 6,1860%, quantidade 3.511, em 13/09/2024;
- 12) RESGATE de R\$ 35.001.417,11 (trinta e cinco milhões e um mil e quatrocentos e dezessete reais e onze centavos) do Fundo de Investimento FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ:



- 23.215.008/0001-70, Caixa Econômica Federal, c/c 1000-0, em 12/09/2024, para COMPRA de R\$ 35.001.417,11 (trinta e cinco milhões e um mil e quatrocentos e dezessete reais e onze centavos) em Títulos Públicos Federais NTN-B – 15/08/2050, taxa 6,296%, quantidade 8.340, em 13/09/2024;
- 13) RESGATE de R\$ 10.000.000,00 (dez milhões de reais) do Fundo de investimentos FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS, CNPJ: 15.154.441/0001-15, Caixa Econômica Federal, em 17/09/2024, para APLICAÇÃO de R\$ 10.000.000,00 (dez milhões de reais) do Fundo de investimentos CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP, CNPJ: 03.737.206/0001-97, Caixa Econômica Federal, em 18/09/2024;
- 14) RESGATE de R\$ 10.000.000,00 (dez milhões de reais) do Fundo de investimentos CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP, CNPJ: 03.737.206/0001-97, Caixa Econômica Federal, em 19/09/2024, para APLICAÇÃO de R\$ 10.000.000,00 (dez milhões de reais) do Fundo de investimentos CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP, CNPJ: 30.036.235/0001-02, Caixa Econômica Federal, em 19/09/2024; e
- 15) RESGATE de R\$ 19.999.414,39 (dezenove milhões e novecentos e noventa e nove mil e quatrocentos e quatorze reais e trinta e nove centavos) do Fundo de Investimento FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI, CNPJ: 23.215.008/0001-70, Caixa Econômica Federal, c/c 1000-0, em 19/09/2024, para COMPRA de R\$ 19.999.414,39 (dezenove milhões e novecentos e noventa e nove mil e quatrocentos e quatorze reais e trinta e nove centavos) em Títulos Públicos Federais NTN-B – 15/08/2026, taxa 6,703%, quantidade 4.657, em 20/09/2024.

11. EXECUÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

A tabela abaixo descreve os limites de aplicação por artigo da Resolução CMN conforme aqueles autorizados pela política de investimentos do CaraguaPrev para o exercício corrente, que estabelece os princípios e as diretrizes a serem seguidas na gestão dos recursos correspondentes às reservas técnicas, fundos e provisões, sob a administração deste CaraguaPrev, visando atingir e preservar o equilíbrio financeiro e atuarial e a solvência do plano.

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

A Política Anual de Investimentos traz, em seu contexto principal, os limites de alocação em



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

Essa alocação tem como intuito determinar a alocação estratégica a ser perseguida ao longo do exercício da Política de Investimento que melhor reflita as necessidades do passivo e durante a sua vigência, os seus procedimentos serão alterados gradativamente, de forma a evitar perdas de rentabilidade ou exposição desnecessária a riscos. O horizonte de planejamento utilizado na sua elaboração compreende o período de 12 meses que se estende de janeiro a dezembro de 2024.

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

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

Essa alocação tem como intuito determinar a alocação estratégica a ser perseguida ao longo do exercício da Política de Investimento que melhor reflita as necessidades do passivo e durante a sua vigência, os seus procedimentos serão alterados gradativamente, de forma a evitar perdas de rentabilidade ou exposição desnecessária a riscos. O horizonte de planejamento utilizado na sua elaboração compreende o período de 12 meses que se estende de janeiro a dezembro de 2024.

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

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

Registre-se que no dia 26/09/2024 foi alterada a Política de Investimentos do CaraguaPrev, adequando a tabela do item 14. Alocação Objetivo da Política de Investimentos, sendo aprovado pelo Comitê de Investimentos, Conselho Deliberativo e pelo Responsável Legal do Ente Federativo.



ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA

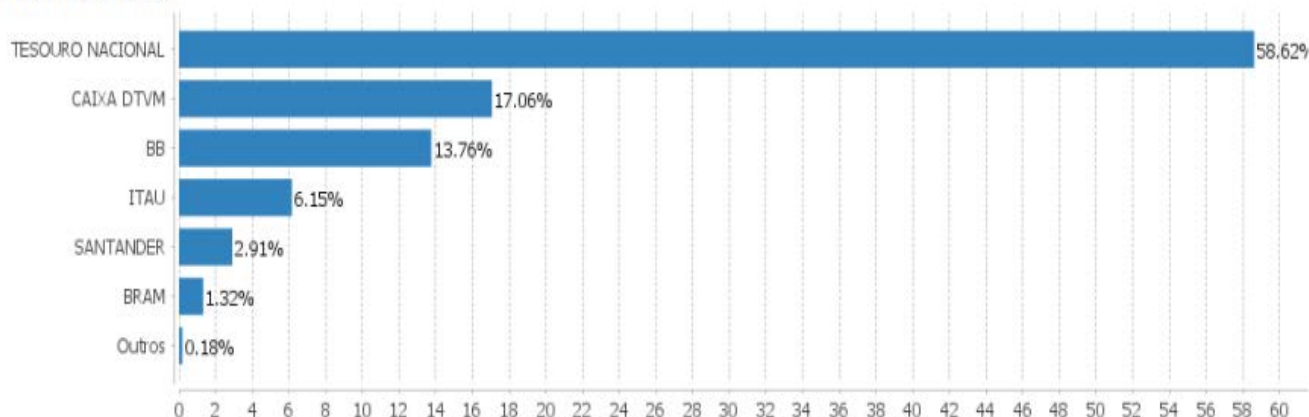
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Pró- Gestão Nível 3 Limite Legal
				Mínimo	Objetivo	Máximo		
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	462.338.926,07	58,62	0,00	58,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	59.427.612,15	7,53	0,00	8,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	215.338.108,67	27,30	0,00	28,20	75,00	0,00	75,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.438.509,39	0,18	0,00	0,20	5,00	0,00	15,00
	Total Renda Fixa	738.543.156,28	93,63					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	40.121.654,53	5,09	0,00	4,00	30,00	0,00	45,00
	Total Renda Variável	40.121.654,53	5,09					45,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	10.088.852,14	1,28	0,00	1,30	15,00	0,00	15,00
	Total Investimentos Estruturados	10.088.852,14	1,28					20,00
Total		788.753.662,95	100,00					

12. RELAÇÃO DE GESTORES DOS RECURSOS

Gestor	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financeiro Mês (R\$)
BB	106.161.452,42	1.507.826,12	0,00	0,00	108.499.116,08	829.837,54
BRAM	10.849.212,90	0,00	0,00	0,00	10.418.955,83	-430.257,07
CAIXA DTVM	202.932.953,34	25.739.707,88	-94.969.457,40	0,00	134.588.726,44	885.522,62
ITAU	44.947.339,61	3.604.761,72	0,00	0,00	48.543.692,67	-8.408,66
SANTANDER	22.732.395,96	0,00	0,00	0,00	22.925.736,47	193.340,51
TESOURO NACIONAL	389.404.189,19	69.999.112,06	0,00	0,00	462.338.926,07	2.935.624,82
VILA RICA	1.527.757,68	0,00	0,00	102.058,53	1.438.509,39	12.810,24



Alocação por Gestor



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

Aplicações em Fundos de Investimentos e Títulos Públicos

SETEMBRO – 2024

FUNDO	CNPJ	VALOR	% RECURSOS
BB PREV RF RETORNO TOTAL	35.292.588/0001-69	10.760.851,82	1,4248
BB RF DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP	11.046.645/0001-80	10.816.818,33	1,4248
BB RF DI TÍTULOS PÚBLICOS FI LP (APORTES 37299-4)	11.046.645/0001-81	13.770.184,91	1,7458
CEF FI BRASIL IDKA2 PRÉ	45.163.710/0001-70	579.718,28	0,0735
CEF FIC BR GESTAO ESTRATEGICA C/C 1000-0	23.215.097/0001-55	11.143.124,69	1,4128
ITAU INSTITUCIONAL RF IRF-M 1	08.703.063/0001-16	513.856,76	0,0651
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	26.507.132/0001-06	57.927,28	0,0073
FIDC FECHADO MULTISSETORIAL ITALIA	13.990.000/0001-28	1.438.509,39	0,1824
CEF FI BRASIL REF DI LP 9999-0 (TX ADMINISTRATIVA)	03.737.206/0001-97	19.478.615,73	2,4695
CEF FI BRASIL REF DI LP 1000-0	03.737.206/0001-97	48.473.389,05	6,1456
CAIXA FI BRASIL MATRIZ RF	23.215.008/0001-70	29.131.652,17	3,6934
SANTANDER DI INSTITUCIONAL PREMIUM	02.224.354/0001-45	11.082.679,11	1,4051
BB INSTITUCIONAL RF	02.296.928/0001-90	21.634.363,48	2,7429
ITAU INSTIT RF DI	00.832.435/0001-00	35.769.932,15	4,5350
BB PREV RF PERFIL	13.077.418/0001-49	41.252.278,31	5,2301
BB PREV RF PERFIL (APORTES 37299-4)	13.077.418/0001-49	8.515.198,67	3,6934
SANTANDER DI TITULOS PUBLICOS PREMIUM	09.577.447/0001-00	11.785.130,08	1,4941



BB DIVIDENDOS FIC FIA	05.100.191/0001-87	1.749.420,56	0,2218
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS 9999-0	15.154.441/0001-15	7.433.035,15	0,9424
FIC AÇÕES EXPERT VINCI VALOR RPPS	14.507.699/0001-95	8.260.339,23	1,0473
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	24.571.992/0001-75	4.073.749,39	0,5165
ITAU ACOES MOMENTO 30 II FIC	42.318.981/0001-60	8.186.154,37	1,0379
BRADERCO FIA SELECTION	03.660.879/0001-96	5.511.464,47	0,6988
BRADERCO FIA SMALL CAP PLUS	06.988.623/0001-09	4.907.491,36	0,6222
CAIXA FI INDEXA BOLSA AMERICANA	30.036.235/0001-02	10.088.852,14	1,2791
Total em Bancos R\$		326.414.736,88	41,3836

TITULOS PUBLICOS FEDERAIS		VALOR INVESTIDO	% RECURSOS
NTN-B - 15/05/2025 (5,9752%) - 2.476	2025	10.952.887,65	1,3886
NTN-B - 15/05/2025 (6,08%) - 4.612	2025	20.389.459,21	2,5850
NTN-B - 15/05/2025 (5,940%) - 4.848	2025	21.449.974,15	2,7195
NTN-B - 15/08/2026 (6,353%) - 3.661	2026	15.856.788,67	2,0104
NTN-B - 15/08/2026 (6,400%) - 4.666	2026	20.193.455,57	2,5602
NTN-B - 15/08/2026 (6,700%) - 4.657	2026	20.052.812,49	2,5423
NTN-B - 15/05/2027 (6,22%) - 2.293	2027	10.095.068,36	1,2799
NTN-B - 15/05/2027 (6,09%) - 1.228	2027	5.422.246,11	0,6874
NTN-B - 15/08/2028 (6,353%) - 3.678	2028	15.853.938,18	2,0100
NTN-B - 15/08/2028 (6,22%) - 4.623	2028	20.013.517,71	2,5374
NTN-B - 15/05/2030 (5,708%) - 2.555	2030	11.307.325,39	1,4336
NTN-B - 15/08/2032 (6,07%) - 9.326 APORTES EQUAC DEFICIT	2032	40.544.913,20	5,1404
NTN-B - 15/05/2035 (5,56%) - 3.900	2035	17.863.593,34	2,2648
NTN-B - 15/05/2035 (5,821%) - 4.657	2035	20.921.210,30	2,6524
NTN-B - 15/08/2040 (5,65%) - 213	2040	963.711,68	0,1222
NTN-B - 15/08/2040 (5,77%) - 2.538	2040	11.347.443,79	1,4387
NTN-B - 15/08/2040 (6,19%) - 3.511	2040	15.070.385,37	1,9107
NTN-B - 15/05/2045 (5,781%) - 2.496	2045	11.355.940,65	1,4397
NTN-B - 15/05/2045 (5,76%) - 2.494	2045	11.373.866,67	1,4420
NTN-B - 15/05/2045 (5,71%) - 7.457	2045	34.201.087,82	4,3361
NTN-B - 15/08/2050 (5,916%) - 920	2050	4.069.477,48	0,5159
NTN-B - 15/08/2050 (5,780%) - 2.451	2050	11.031.678,37	1,3986
NTN-B - 15/08/2050 (5,922%) - 2.466	2050	10.899.641,05	1,3819
NTN-B - 15/08/2050 (5,713%) - 2.514	2050	11.413.190,51	1,4470
NTN-B - 15/08/2050 (5,815%) - 2.530	2050	11.336.268,57	1,4372
NTN-B - 15/08/2050 (5,9715%) - 4.754	2050	20.880.903,49	2,6473
NTN-B - 15/08/2050 (6,300%) - 8.340	2050	35.171.295,67	4,4591



NTN-B - 15/05/2055 (5,852%) - 2.420	2055	10.966.541,29	1,3904
NTN-B - 15/05/2055 (5,815%) - 2.490	2055	11.340.303,33	1,4377
Total Títulos Públicos		462.338.926,07	58,6164
Total Geral		788.753.662,95	100,0000

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

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	Atribuição Desemp. (%)	No Trimestre(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,68 81,57	2,21 84,05	2,21 84,05	4,79 91,68	10,70 96,76	2.935.624,82	0,38	9.757.714,06
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,74 89,11	2,50 95,11	2,50 95,11	3,56 68,07	9,03 81,66	438.543,90	0,06	1.445.449,42
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,85 101,81	2,73 103,62	2,73 103,62	5,34 102,09	11,24 101,66	2.101.489,77	0,27	5.443.794,79
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,45 53,73	2,65 100,57	2,65 100,57	4,64 88,71	247,78 2.241,36	12.810,24	0,00	45.530,42
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,82 0,26	6,05 -0,34	6,05 -0,34	0,52 -2,38	9,70 -3,38	-1.158.850,87	-0,15	3.421.707,83
Artigo 9º III % do CDI	0,00 0,00	-5,97 -226,80	-5,97 -226,80	14,10 269,62	41,22 372,88	0,00	0,00	-1.582.148,80
Artigo 10º I % do CDI	0,89 106,51	-4,04 -153,47	-4,04 -153,47	2,41 46,12	12,11 109,50	88.852,14	0,01	-1.008.468,35
Artigo 7º	0,75		2,41	4,80	10,79	5.488.468,73	0,71	0,00
Artigo 8º	-2,82		6,05	0,52	9,70	-1.158.850,87	-0,15	0,00
Artigo 9º						0,00	0,00	0,00
Artigo 10º	0,89		-4,04	2,41	12,11	88.852,14	0,01	0,00
CARAGUATATUBA (Total)						4.418.470,00	0,57	17.523.579,37

15. PRÓ GESTÃO – NÍVEL III



CARAGUAPREV

Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba
Estado de São Paulo



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 3º trimestre de 2024, os membros do Comitê de Investimentos, observaram as regras de segurança, solvência, liquidez, rentabilidade, proteção, prudência financeira e analisaram e atestaram a conformidade do relatório de investimentos do mês quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos, a evolução da execução do orçamento do RPPS, os dados atualizados dos fluxos de caixa e dos investimentos, com visão de curto e longo prazo, e entendem que as peças pertinentes representam adequadamente a posição das aplicações financeiras e de tesouraria do Instituto, bem assim, a posição patrimonial e econômico-financeira da Autarquia, recebendo a aprovação deste Comitê.

COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV

Caraguatatuba/SP, 31 de outubro 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 **3º TRIMESTRE de 2024**, analisaram e atestaram a conformidade do relatório de investimentos do mês quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos, a evolução da execução do orçamento do RPPS, os dados atualizados dos fluxos de caixa e dos investimentos, com visão de curto e longo prazo, conforme relatório da análise dos investimentos disponibilizado a todos os conselheiros e segurados do CaraguaPrev no site do Instituto e entendem que as peças pertinentes representam adequadamente a posição das aplicações financeiras e de tesouraria do Instituto, bem assim, a posição patrimonial e econômico-financeira da Autarquia, recebendo a aprovação deste Conselho.

Caraguatatuba/SP, 31 de outubro 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 Moraes
Membro do Conselho Fiscal





CARAGUAPREV

Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba
Estado de São Paulo



PARECER DO CONSELHO DELIBERATIVO

Os membros do Conselho Deliberativo do Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba – Caraguaprev, em reunião realizada nesta data, cumprindo o que determina o artigo 71, inciso VI, da Lei Complementar nº 59, de 05 de novembro de 2015, tendo examinado as Demonstrações Financeiras e Contábeis referentes ao **3º TRIMESTRE de 2024**, analisaram e atestaram a conformidade do relatório de investimentos do mês quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos, a evolução da execução do orçamento do RPPS, os dados atualizados dos fluxos de caixa e dos investimentos, com visão de curto e longo prazo, conforme relatório da análise dos investimentos disponibilizado a todos os conselheiros e segurados do Caraguaprev no site do Instituto e entendem que as peças pertinentes representam adequadamente a posição das aplicações financeiras e de tesouraria do Instituto, bem assim, a posição patrimonial e econômico-financeira da Autarquia, recebendo a aprovação deste Conselho.

Caraguatatuba/SP, 31 de outubro 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

