

RELATÓRIO DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS BCPREVI

FEVEREIRO - 2023

1. Análise de rentabilidade por enquadramento de ativos conforme a Resolução 4.963/2021

1.1. Art.7º, I, Alínea A - 4.963/2021 - (Títulos do Tesouro Nacional): Neste enquadramento da Resolução o BCPREVI iniciou em outubro de 2021 sua exposição em Títulos Públicos Nacional, com intenção de **marcação na curva**, ou seja, com intenção de levar os títulos adquiridos ao vencimento, blindando-se das variações e volatilidade do mercado. Iniciou-se com aquisições de (NTN-Bs) ou “Tesouro IPCA”, distribuindo seus vencimentos conforme estipulado pelo estudo de “ALM” do BCPREVI. Nos meses seguintes foram sendo realizadas novas aquisições e ampliando progressivamente a posição do BCPREVI nestes ativos, visando captar a abertura da curva de juros. Não distante, foi montado posição em LFTs, (Tesouro Selic), aproximadamente 3,55% da carteira R\$ 25.447.350,01, título pós fixado, que remunera a Selic, e visto que a previsão para inflação “IPCA” no fechamento do ano de 2023, segundo o Copom, está registrando 5,36% e Selic hoje está dada em 12,25%, busca-se o prêmio desta oportunidade.

Expectativas de Mercado													6 de janeiro de 2023															
													▲ Aumento ▼ Diminuição = Estabilidade															
Mediana - Agregado	2022					2023					2024					2025												
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***							
IPCA (variação %)	5,79	5,62	5,62	=	(1)	139	5,61	47	5,08	5,31	5,36	▲ (4)	138	5,48	47	3,50	3,65	3,70	▲ (3)	124	3,02	3,25	3,30	▲ (5)	105			
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	3,05	3,04	3,03	▼ (1)	101	3,00	27	0,75	0,80	0,78	▼ (1)	100	0,65	27	1,70	1,50	1,50	=	(2)	80	2,00	1,89	1,90	▲ (1)	68			
Câmbio (R\$/US\$)	5,25	-	-	-	-	-	-	5,25	5,27	5,28	▲ (1)	111	5,28	35	5,24	5,26	5,30	▲ (1)	95	5,23	5,30	5,30	=	(3)	79			
Selic (% a.a.)	-	-	-	-	-	-	-	11,75	12,25	12,25	=	(1)	124	12,38	42	8,50	9,00	9,25	▲ (1)	117	8,00	8,00	8,00	=	(9)	101		
IGP-M (variação %)	5,42	-	-	-	-	-	-	4,54	4,55	4,61	▲ (2)	71	4,74	19	4,02	4,01	4,01	=	(2)	56	3,72	3,72	3,72	=	(6)	50		
IPCA Administrados (variação %)	-3,61	-3,89	-3,89	=	(1)	85	-3,84	21	6,09	6,77	6,79	▲ (6)	84	7,49	21	4,00	4,00	4,00	=	(5)	63	3,03	3,50	3,50	=	(1)	47	
Conta corrente (US\$ bilhões)	-46,61	-51,30	-50,50	▲ (1)	26	-51,00	10	-44,00	-47,10	-46,55	▲ (1)	24	-47,10	9	-45,00	-45,00	-45,00	=	(4)	21	-43,10	-45,00	-45,00	=	(3)	16		
Balança comercial (US\$ bilhões)	55,00	56,90	-	-	-	-	-	60,00	58,00	56,61	▼ (4)	24	58,00	9	54,13	53,00	52,40	▼ (2)	20	59,20	60,00	55,00	▼ (1)	13	13			
Investimento direto no país (US\$ bilhões)	80,00	81,60	84,50	▲ (1)	24	82,93	8	76,00	80,00	80,00	=	(2)	22	75,00	7	80,00	80,00	80,00	=	(8)	20	80,00	80,00	80,00	=	(11)	15	
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	57,30	57,50	57,50	=	(2)	22	58,00	5	61,50	61,95	61,95	=	(1)	22	63,90	5	64,00	64,00	64,50	▲ (1)	21	65,80	66,20	67,60	▲ (1)	17		
Resultado primário (% do PIB)	1,29	1,20	1,20	=	(2)	31	1,30	10	-0,95	-1,20	-1,20	=	(1)	31	-1,15	10	-0,60	-1,00	-1,00	=	(2)	27	-0,45	-0,70	-0,70	=	(1)	20
Resultado nominal (% do PIB)	-5,50	-5,20	-5,20	=	(3)	19	-4,70	5	-8,70	-8,60	-8,50	▲ (1)	19	-7,40	5	-6,50	-6,80	-6,90	▼ (1)	18	-5,90	-6,10	-6,10	=	(2)	13		

* comportamento dos indicadores desde o Foco-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias *** respondentes nos últimos 5 dias úteis

2022

2023

2024

2025

* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias *** respondentes nos últimos 5 dias úteis

— 2022 — 2023 — 2024 — 2025

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

A posição ao final de fevereiro de 2023 ficou em R\$ 174.887.528,31, (24,35%) da carteira.

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	LFT 010923	0,06	0,05	0,92	2,05	18.549.243,99	2,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,780000%)	0,63	0,06	0,95	2,15	8.662.945,30	1,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (8,145000%)	3,01	0,07	1,11	2,50	10.304.051,06	1,43
TESOURO NACIONAL	LFT 010324	0,08	0,05	0,92	2,05	270.505,48	0,04
TESOURO NACIONAL	LFT 010328	0,20	0,06	0,30	0,30	1.763.636,79	0,25
TESOURO NACIONAL	LFT 010927	0,71	0,06	1,03	2,24	4.863.963,75	0,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,000000%)	0,63	0,06	0,90	2,03	1.056.344,82	0,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,260000%)	0,63	0,06	0,92	2,07	1.051.023,61	0,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,612000%)	0,63	0,06	0,94	2,12	6.544.849,64	0,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,880000%)	0,63	0,07	0,96	2,16	1.019.089,86	0,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,050000%)	0,63	0,06	0,90	2,03	2.157.346,98	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,330000%)	0,63	0,06	0,92	2,08	2.160.476,91	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,713000%)	0,63	0,06	0,95	2,13	2.046.174,83	0,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	0,63	0,06	0,95	2,14	2.105.857,10	0,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,310000%)	3,05	0,07	0,99	2,23	5.096.475,36	0,71

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	4,32	0,07	1,00	2,24	5.118.920,07	0,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,500000%)	4,37	0,07	0,80	0,80	3.890.002,28	0,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,070000%)	0,63	0,06	0,90	2,04	3.162.000,61	0,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,360000%)	0,63	0,06	0,92	2,08	3.166.137,95	0,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,580000%)	0,63	0,06	0,94	2,11	2.971.956,45	0,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,710000%)	0,63	0,06	0,95	2,13	3.085.397,01	0,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,820000%)	2,88	0,06	0,96	2,15	5.176.766,44	0,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,020000%)	2,95	0,07	0,97	2,18	5.114.409,09	0,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,131000%)	4,20	0,07	0,98	2,20	10.351.258,45	1,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,330000%)	3,08	0,07	0,99	2,23	5.094.739,17	0,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,63	0,06	0,92	2,07	677.201,55	0,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,502000%)	0,63	0,06	0,93	2,10	4.902.321,68	0,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,850000%)	0,63	0,07	0,96	2,16	626.139,81	0,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,000000%)	0,63	0,06	0,90	2,03	1.381.868,16	0,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,310000%)	0,63	0,06	0,92	2,07	1.414.912,83	0,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,700000%)	0,63	0,06	0,95	2,13	1.382.424,49	0,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,230000%)	0,63	0,07	0,98	2,21	4.946.159,45	0,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,090000%)	0,63	0,06	0,91	2,04	2.300.627,22	0,32
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,350000%)	0,63	0,06	0,92	2,08	2.361.330,15	0,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,580000%)	0,63	0,06	0,94	2,11	2.232.978,32	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	0,63	0,06	0,95	2,14	2.306.445,52	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,859000%)	0,63	0,07	0,96	2,16	5.027.062,66	0,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,020000%)	0,63	0,07	0,97	2,18	4.970.627,85	0,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,330000%)	0,63	0,07	0,99	2,23	4.943.157,71	0,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,500000%)	6,10	0,07	0,64	0,64	5.713.878,37	0,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,880000%)	0,63	0,07	0,96	2,16	5.031.544,12	0,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,350000%)	0,63	0,07	0,99	2,23	9.885.275,42	1,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,59	0,06	0,96	2,16	174.887.528,31	24,35

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

Abaixo segue a posição em títulos públicos segundo seus vencimentos, seus preços de compras, as posições em relação aos objetivos estabelecidos pela Política de Investimentos e “ALM para 2023”.

SALDO EM TÍTULOS PÚBLICOS e LIMITE DE APLICAÇÃO POSSÍVEL SEGUNDO "ALM" e DPIN									
VENCIMENTOS	2.023	8/15/2030	5/15/2035	8/15/2040	5/15/2045	8/15/2050	5/15/2055	15/08/2060	TOTAL
(a.16) TOTAL = 49 + (a.15)	18.536.926,96	6.023.050,79	9.585.173,78	8.920.736,00	22.197.687,01	29.528.449,80	37.375.934,63	19.317.437,70	151.485.396,69
(50) - Alocação possível "ALM novo" (50 = Y - (a.16))	-7.898.803,07	1.799.099,13	1.991.608,10	69.300.763,23	86.113.015,58	2.698.807,88	228.890.048,72	-12.851.127,10	370.043.412,47
(51) - Alocação possível "DPIN-2022" (51 = X - a.16)	-18.536.926,96	-2.458.158,41	-4.209.542,41	27.237.458,19	35.632.789,45	47.371.371,63	57.178.591,94	-10.773.013,10	131.442.570,33
LFT	21.802.717,69								
								TOTAL + LFTs	173.288.114,38

Cabe observação quanto às alocações possíveis segundo a DPIN, sendo que em alguns vencimentos os valores foram ultrapassados, e isso se deu pela contínua compra de Títulos que foram sendo realizadas visto a boa oportunidade de mercado que se deu nessa classe de ativos com a abertura da curva de juros. A Política de Investimentos está sendo regularizada para casamento com a carteira e a atual oportunidade de mercado.

1.2. Art.7º, I, Alínea B - 4.963/2021 - Fundos 100% TP Referenciado: neste enquadramento da Resolução o BCPREVI ao término de fevereiro de 2023 possui 20 fundos, e um total aplicado de R\$ 251.382.751,39, representando 35,00% da carteira, conforme relação abaixo.

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	Ano				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,46	-0,09	0,98	1,63	18.454.753,39	2,57	6.344.349.295,74	0,29
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,06	0,05	0,92	2,05	40.557.574,38	5,65	32.138.441.605,50	0,13
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2,28	0,01	1,34	2,74	276.428,74	0,04	183.239.139,42	0,15
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,98	0,07	-1,94	-0,75	6.938.374,44	0,97	233.342.086,75	2,97
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,63	0,07	0,98	2,21	3.449.303,82	0,48	263.839.361,74	1,31
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	5,59	-0,28	1,27	1,24	2.694.701,03	0,38	396.708.714,76	0,68
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,65	0,01	1,39	2,79	3.661.985,28	0,51	1.143.148.523,66	0,32
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,58	-0,28	1,26	1,24	3.706.391,73	0,52	233.663.337,49	1,59

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,55	-0,28	1,27	1,26	23.293.896,75	3,24	5.703.776.580,01	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,64	-0,28	1,26	1,22	3.652.736,15	0,51	3.236.214.383,57	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,64	0,01	1,39	2,78	29.581.489,93	4,12	7.935.684.977,28	0,37
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,74	-0,56	1,15	-0,12	11.548.953,18	1,61	736.399.019,77	1,57
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,77	-0,56	1,13	-0,16	7.507.412,15	1,05	937.727.381,64	0,80
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,54	-0,07	1,00	1,73	107.869,77	0,02	158.326.770,05	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,66	0,01	1,40	2,79	44.360.651,95	6,18	5.558.874.332,70	0,80
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2,29	0,01	1,34	2,74	1.136.332,70	0,16	101.755.854,51	1,12
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,78	0,05	0,97	2,01	10.777.339,11	1,50	5.085.339.032,83	0,21
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	5,51	-0,29	1,25	1,46	1.251.571,01	0,17	332.788.581,85	0,38
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,07	0,05	0,91	2,02	33.798.460,09	4,71	8.556.510.688,43	0,40
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,07	0,05	0,90	2,02	4.626.525,79	0,64	3.960.124.128,50	0,12
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,41	-0,06	1,07	1,92	251.382.751,39	35,00		

Da tabela abaixo extrai-se os principais dados dos resultados deste mês para este enquadramento.

FEVEREIRO - 2023										
Enquadramento	Descrição	Política de Investimento	Total Investido	Rentabilidade (mês)	Rentabilidade acumulada (12 meses)	Meta atuarial (mês)	Meta atuarial (12 meses)	% Benchmark (mês)	% Benchmark (12 meses)	Participação na Carteira
Art. 7º, I, alínea a	Títulos do Tesouro Nacional *	100,00%	174 887 528,31	0,96%	12,25%	80,67%	114,06%	104,35%	94,23%	24,35%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	251 382 751,39	1,07%	9,74%	89,92%	90,69%	116,30%	74,92%	35%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	121 348 946,07	0,97%	10,03%	81,51%	93,39%	105,43%	77,15%	16,90%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	400 891,98	-0,33%	-58,55%	-127,73%	-645,16%	-135,87%	-550,38%	0,06%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	109 848 957,18	-8,06%	-11,44%	-777,31%	-206,52%	-7,61%	-57,58%	15,29%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	30 251 456,79	0,23%	-12,07%	19,33%	-212,38%	-25,00%	-37,94%	4,21%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	16 049 917,72	0,75%	-10,41%	63,03%	-196,93%	-10,01%	-43,39%	2,23%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	11 939 323,12	-1,75%	-0,73%	740,34%	-106,80%	-224,07%	91,15%	1,66%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	358 959,01	0%	-21,11%	0,00%	-296,55%	0,00%	-262,38%	0,05%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	1 770 976,79	0,36%	10,89%	30,25%	101,40%	-80,00%	444,49%	0,25%
IPCA + 5,02 MÊS	1,19%	Ibov mês	-7,49%	MSCI mês	-0,92%	Ifix mês	-0,45%	S&P mês	-0,54%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	10,74%	Ibov 12 meses	-7,26%	MSCI 12 meses	-8,75%	Ifix 12 meses	2,45%	S&P 12 meses	-8,25%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		0,92%	13%							

Neste enquadramento, no mês de fevereiro, houve as seguintes movimentações conforme deliberações deste comitê de investimentos:

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	18.276.242,09	0,00	0,00	0,00	18.454.753,39	178.511,30	296.116,68
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	23.002.378,26	0,00	0,00	0,00	23.293.896,75	291.518,49	289.100,42
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	106.800,30	0,00	0,00	0,00	107.869,77	1.069,47	1.831,43
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	53.418.003,41	44.982,03	-9.705.916,78	0,00	44.360.651,95	603.583,29	1.327.852,07
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	11.417.387,84	0,00	0,00	0,00	11.548.953,18	131.565,34	-14.409,87
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	280.781,75	0,00	-8.089,68	0,00	276.428,74	3.736,67	7.566,36
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	1.154.251,78	0,00	-33.268,92	0,00	1.136.332,70	15.349,84	31.079,31
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	33.494.364,34	0,00	0,00	0,00	33.798.460,09	304.095,75	668.407,21
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	2.661.027,37	0,00	0,00	0,00	2.694.701,03	33.673,66	33.022,67
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.075.289,64	0,00	0,00	0,00	6.938.374,44	-136.915,20	-52.396,16
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	3.519.746,42	0,00	0,00	104.588,00	3.449.303,82	34.145,40	76.421,46
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	29.175.749,27	0,00	0,00	0,00	29.581.489,93	405.740,66	801.406,77
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.423.159,35	0,00	0,00	0,00	7.507.412,15	84.252,80	-11.780,23
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.607.379,40	0,00	0,00	0,00	3.652.736,15	45.356,75	44.171,29
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	10.674.331,80	0,00	0,00	0,00	10.777.339,11	103.007,31	212.443,50
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	3.660.185,61	0,00	0,00	0,00	3.706.391,73	46.206,12	45.432,08
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	38.932.093,16	21.744.027,16	-20.475.498,31	0,00	40.557.574,38	356.952,37	772.512,87
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	3.611.684,90	0,00	0,00	0,00	3.661.985,28	50.300,38	99.433,41
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	1.236.101,49	0,00	0,00	0,00	1.251.571,01	15.469,52	18.065,74
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	4.981.444,21	0,00	-400.000,00	0,00	4.626.525,79	45.081,58	99.746,41
					251.382.751,39	2.612.701,50	

Estas movimentações foram realizadas junto aos fundos indexados ao “CDI” para realização das alocações aprovadas em reunião ordinária pelo comitê de investimento para fevereiro, principalmente para as alocações em renda variável e compra de Títulos Públicos, bem como, para pagamentos das despesas do BCPREVI.

1.3. Art.7º, III, Alínea “a” - 4.963/21 - Fundos de Renda Fixa: neste enquadramento da Resolução o BCPREVI aplica em 11 fundos e um total aplicado de R\$ 121.348.946,07, representando 16,90% da carteira conforme relação abaixo.

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,08	-0,29	1,21	1,14	13.982.883,23	1,95	283.116.559,96	4,94
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	1,84	0,08	0,91	2,41	6.964.512,55	0,97	90.503.027,16	7,70
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,05	0,80	1,90	1.234.726,29	0,17	15.513.886.886,32	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,70	-0,08	1,00	1,65	3.906.664,53	0,54	178.518.880,22	2,19
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,05	0,85	1,99	10.330.782,46	1,44	13.891.144.708,98	0,07
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	8,81	-0,56	1,14	-0,15	7.068.218,14	0,98	114.378.486,51	6,18
BRAM	BRADESCO	BRADESCO H FI RF NILO	6,42	-0,32	1,19	1,03	22.789.338,48	3,17	266.387.801,11	8,55
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,67	0,01	1,39	2,77	5.949.119,25	0,83	917.477.455,94	0,65
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	4,83	-0,10	1,04	1,80	5.420.394,52	0,75	230.085.679,40	2,36
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	1,78	0,05	0,39	0,98	13.343.928,35	1,86	778.203.632,74	1,71
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC	0,76	0,03	0,87	1,91	30.358.378,27	4,23	2.496.061.867,24	1,22
FI										
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,50	-0,11	0,97	1,49	121.348.946,07	16,90		

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

Da tabela abaixo extrai-se os principais dados dos resultados do mês de fevereiro para este enquadramento.

FEVEREIRO - 2023										
Enquadramento	Descrição	Política de Investimento	Total Investido	Rentabilidade (mês)	Rentabilidade acumulada (12 meses)	Meta atuarial (mês)	Meta atuarial (12 meses)	% Benchmark (mês)	% Benchmark (12 meses)	Participação na Carteira
Art. 7º, I, alínea a	Títulos do Tesouro Nacional *	100,00%	174 887 528,31	0,96%	12,25%	80,67%	114,06%	104,35%	94,23%	24,35%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	251 382 751,39	1,07%	9,74%	89,92%	90,69%	116,30%	74,92%	35%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	121 348 946,07	0,97%	10,03%	81,51%	93,39%	105,43%	77,15%	16,90%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	400 891,98	-0,33%	-58,55%	-127,73%	-645,16%	-135,87%	-550,38%	0,06%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	109 848 957,18	-8,06%	-11,44%	-777,31%	-206,52%	-7,61%	-57,58%	15,29%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	30 251 456,79	0,23%	-12,07%	19,33%	-212,38%	-25,00%	-37,94%	4,21%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	16 049 917,72	0,75%	-10,41%	63,03%	-196,93%	-10,01%	-43,39%	2,23%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	11 939 323,12	-1,75%	-0,73%	740,34%	-106,80%	-224,07%	91,15%	1,66%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	358 959,01	0%	-21,11%	0,00%	-296,55%	0,00%	-262,38%	0,05%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	1 770 976,79	0,36%	10,89%	30,25%	101,40%	-80,00%	444,49%	0,25%
IPCA + 5,02 MÊS	1,19%	Ibov mês	-7,49%	MSCI mês	-0,92%	Ifix mês	-0,45%	S&P mês	-0,54%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	10,74%	Ibov 12 meses	-7,26%	MSCI 12 meses	-8,75%	Ifix 12 meses	2,45%	S&P 12 meses	-8,25%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		0,92%	13%							

Neste enquadramento, no mês de fevereiro, ocorreram as seguintes movimentações:

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	6.901.845,95	0,00	0,00	0,00	6.964.512,55	62.666,60	164.133,71
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	10.202.185,30	41.356,30	0,00	0,00	10.330.782,46	87.240,86	200.617,01
BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	5.364.754,08	0,00	0,00	0,00	5.420.394,52	55.640,44	96.072,78
BRABESCO H FI RF NILO	22.520.863,11	0,00	0,00	0,00	22.789.338,48	268.475,37	232.123,32
BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5.867.642,03	0,00	0,00	0,00	5.949.119,25	81.477,22	160.385,78
BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	3.867.887,56	0,00	0,00	0,00	3.906.664,53	38.776,97	63.386,64
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	6.988.631,98	0,00	0,00	0,00	7.068.218,14	79.586,16	-10.806,69
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	712.459,12	516.074,13	-1.125,09	0,00	1.234.726,29	7.318,13	14.831,54
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	13.291.772,18	0,00	0,00	0,00	13.343.928,35	52.156,17	130.094,14
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	30.097.545,59	0,00	0,00	0,00	30.358.378,27	260.832,68	568.673,48
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	13.815.708,56	0,00	0,00	0,00	13.982.883,23	167.174,67	158.244,01
					121.348.946,07	1.161.345,27	

Estas movimentações foram realizadas junto aos fundos indexados ao “CDI” para realização das alocações aprovadas em reunião ordinária pelo comitê de investimento.

1.4. Art.7º, V, Alínea “b” - 4.963/2021 - Fundos RF Crédito Privado: neste enquadramento da Resolução o BCPREVI tem apenas 1 fundo do qual possui um total investido de R\$ 400.891,98, representando 0,06% da carteira, conforme relação abaixo.

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GENIAL	GENIAL	PIATÁ FI RF LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	107,64	-0,33	-0,33	-0,46	400.891,98	0,06	22.619.435,31	1,77
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			107,64	-0,33	-0,33	-0,46	400.891,98	0,06		

Este fundo encontra-se em liquidação e, não houve movimentações neste fundo neste mês. A tabela abaixo demonstra o histórico de movimentação financeira realizada pelo fundo e as recuperações de créditos devolvidas ao BCPREVI.

HISTÓRICO FUNDO PIATÁ		
DATA	DESCRIÇÃO	VALOR
29/01/2009	Aplicação inicial	R\$ 3.000.000,00
22/01/2015	Depósito Judicial parcial	R\$ 223.314,09
10/11/2017	Recuperação parcial	R\$ 708.933,67
16/05/2018	Recuperação parcial	R\$ 518,90
27/05/2019	Crédito em conta ref.ao depósito judicial do dia 22/01/2015. (R\$ 106.466,75 juros).	R\$ 329.780,84
06/12/2019	Recuperação de crédito	R\$ 680.830,01
13/01/2020	Recuperação de crédito	R\$ 93.131,31
11/02/2020	Recuperação de crédito	R\$ 10.174,34
26/03/2020	Recuperação de crédito	R\$ 10.104,07
17/07/2020	Recuperação de crédito	R\$ 28.573,85
10/06/2022	Recuperação de crédito	R\$ 212.910,50

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253
CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

1.5. Art.8º, I, - 4.963/2021 - Fundos de Ações: neste enquadramento da Resolução, atualmente, o BCPREVI aplica em 19 fundos, totalizando um investimento de R\$ 109.848.957,18, representando 15,29% da carteira, conforme relação abaixo.

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
TRIGONO	BEM	TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	22,84	-0,10	-4,19	0,83	812.613,93	0,11	101.373.436,17	0,80
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	28,11	-1,21	-10,65	-8,14	13.137.038,48	1,83	274.268.405,14	4,79
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS	19,61	-0,45	-7,40	-3,95	5.974.655,78	0,83	547.789.623,96	1,09
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,69	-0,69	-6,91	-3,78	3.780.293,58	0,53	445.758.167,51	0,85
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	33,37	-1,36	-4,74	0,85	4.388.555,64	0,61	158.135.103,13	2,78
CONSTANCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	19,43	-0,56	-6,16	-2,57	381.554,06	0,05	1.126.523.175,67	0,03
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	22,48	-0,92	-6,29	-1,93	8.692.858,91	1,21	1.337.859.374,92	0,65
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	21,47	-1,14	-7,85	-5,04	5.825.635,56	0,81	213.405.356,36	2,73
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	28,08	-0,95	-9,83	-7,42	3.949.139,16	0,55	126.377.337,99	3,12
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	19,54	-0,42	-6,28	-2,98	3.603.152,44	0,50	871.759.853,34	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,60	-1,05	-10,52	-7,56	7.306.499,58	1,02	517.170.403,48	1,41
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	21,32	-0,73	-7,43	-4,37	16.466.679,48	2,29	438.685.387,05	3,75
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	20,67	-0,76	-6,80	-4,55	9.271.299,41	1,29	1.687.120.867,12	0,55
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	23,56	-1,19	-9,10	-5,25	3.964.418,84	0,55	358.025.193,09	1,11
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS	21,65	-0,74	-7,50	-4,35	1.288.459,09	0,18	309.149.143,99	0,42
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	21,71	-1,04	-7,48	-3,85	12.766.406,48	1,78	420.232.220,21	3,04
ITAU	ITAU	ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	23,29	-1,19	-9,22	-5,51	2.594.869,00	0,36	195.858.750,12	1,32
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	31,17	-2,35	-10,56	-12,09	5.042.810,82	0,70	271.507.156,05	1,86
TRIGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	20,82	0,23	-4,00	-0,77	602.016,94	0,08	204.471.931,28	0,29
Sub-total Artigo 8º I			22,53	-0,99	-8,06	-5,08	109.848.957,18	15,29		

A Política de Investimento do instituto permite até 35% de alocação da carteira em ativos enquadrados neste artigo, não podendo ultrapassar o limite de 40% no somatório dos investimentos em renda variável. Desta forma, observa-se o correto enquadramento neste segmento.

Da tabela abaixo extrai-se os principais dados dos resultados deste mês para este enquadramento.

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

FEVEREIRO - 2023										
Enquadramento	Descrição	Política de Investimento	Total Investido	Rentabilidade (mês)	Rentabilidade acumulada (12 meses)	Meta atuarial (mês)	Meta atuarial (12 meses)	% Benchmark (mês)	% Benchmark (12 meses)	Participação na Carteira
Art. 7º, I, alínea a	Títulos do Tesouro Nacional *	100,00%	174 887 528,31	0,96%	12,25%	80,67%	114,06%	104,35%	94,23%	24,35%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	251 382 751,39	1,07%	9,74%	89,92%	90,69%	116,30%	74,92%	35%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	121 348 946,07	0,97%	10,03%	81,51%	93,39%	105,43%	77,15%	16,90%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	400 891,98	-0,33%	-58,55%	-127,73%	-645,16%	-135,87%	-550,38%	0,06%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	109 848 957,18	-8,06%	-11,44%	-777,31%	-206,52%	-7,61%	-57,58%	15,29%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	30 251 456,79	0,23%	-12,07%	19,33%	-212,38%	-25,00%	-37,94%	4,21%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	16 049 917,72	0,75%	-10,41%	63,03%	-196,93%	-10,01%	-43,39%	2,23%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	11 939 323,12	-1,75%	-0,73%	740,34%	-106,80%	-224,07%	91,15%	1,66%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	358 959,01	0%	-21,11%	0,00%	-296,55%	0,00%	-262,38%	0,05%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	1 770 976,79	0,36%	10,89%	30,25%	101,40%	-80,00%	444,49%	0,25%
IPCA + 5,02 MÊS	1,19%	Ibov mês	-7,49%	MSCI mês	-0,92%	Ifix mês	-0,45%	S&P mês	-0,54%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	10,74%	Ibov 12 meses	-7,26%	MSCI 12 meses	-8,75%	Ifix 12 meses	2,45%	S&P 12 meses	-8,25%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		0,92%	13%							

Abaixo segue tabela de histórico de aplicações nos fundos passivos Ibovespa, aos quais ainda encontram-se com posições abertas.

FUNDOS - ART.8º, I, Alínea A - POSIÇÃO DE FEVEREIRO/2023											
FUNDO	DATA aplicação	Aplicação Inicia	qdd cota	R\$ cota aquisição	valor atual cota	Saldo atual	Rentabilidade				
							R\$ por aplicação	% por aplicação	% Mês	% Ano	% 12 meses
BRADESCO FI EM AÇÕES IBOVESPA PLUS	18/05/2022	1 000 000,00	1 186,23	843,01	833,07	988 208,61	(11 791,39)	-1,18%	-7,50%	3,40%	-4,35
	14/07/2022	100 000,00	131,12	762,65	833,07	109 233,32	9 233,32	9,23%			
	15/09/2022	200 000,00	229,29	872,24	833,07	191 017,16	(8 982,84)	-4,49%			
		1 300 000,00	1 546,64	825,97	833,07	1 288 459,09	(11 540,91)	-0,89%			
FI EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVESPA	27/08/2019	4 000 000,00	1 809 460,22	2,21	2,38	4 302 708,22	302 708,22	7,57%	-7,43%	4,37%	-6,95%
	13/11/2019	2 500 000,00	1 038 388,39	2,41	2,38	2 469 179,60	(30 820,40)	-1,23%			
	30/01/2020	4 000 000,00	1 550 036,13	2,58	2,38	3 685 824,71	(314 175,29)	-7,85%			
	03/03/2020	2 000 000,00	834 359,70	2,40	2,38	1 984 020,58	(15 979,42)	-0,80%			
	14/09/2020	500 000,00	219 745,16	2,28	2,38	522 531,13	22 531,13	4,51%			
	22/02/2021	500 000,00	195 932,37	2,55	2,38	465 906,79	(34 093,21)	-6,82%			
	12/03/2021	500 000,00	193 391,43	2,59	2,38	459 864,70	(40 135,30)	-8,03%			
	25/11/2021	500 000,00	209 093,21	2,39	2,38	497 201,91	(2 798,09)	-0,56%			
	21/12/2021	250 000,00	104 867,97	2,38	2,38	249 365,13	(634,87)	-0,25%			
	28/01/2022	500 000,00	197 315,79	2,53	2,38	469 196,44	(30 803,56)	-6,16%			
	21/03/2022	500 000,00	190 652,17	2,62	2,38	453 351,04	(46 648,96)	-9,33%			
	20/04/2022	250 000,00	96 831,3	2,58	2,38	230 254,74	(19 745,26)	-7,90%			
	23/05/2022	200 000,00	80 239,9	2,49	2,38	190 802,26	(9 197,74)	-4,60%			
	14/07/2022	100 000,00	45 922,4	2,18	2,38	109 198,67	9 198,67	9,20%			
	16/09/2022	200 000,00	80 852,07	2,47	2,38	192 257,81	(7 742,19)	-3,87%			
	17/10/2022	200 000,00	77 806,59	2,57	2,38	185 015,97	(14 984,03)	-7,49%			
	TOTAIS		16 700 000,00	6 924 894,8	2,45	2,38	16 466 679,71	(233 320,29)			
		18 000 000,00				17 755 138,80	(244 861,20)	-1,36%			

As movimentações neste enquadramento da carteira neste mês estão na tabela abaixo, oriundas das deliberações deste comitê:

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	6.321.914,74	0,00	0,00	0,00	5.825.635,56	-496.279,18	-308.902,58
BB AÇÕES DIVIDENDOS	6.451.830,56	0,00	0,00	0,00	5.974.655,78	-477.174,78	-245.720,31

"BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo"

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	14.702.118,04	0,00	0,00	0,00	13.137.038,48	-1.565.079,56	-1.164.151,19
BRADERCO F I A SELECTION	13.799.001,01	0,00	0,00	0,00	12.766.406,48	-1.032.594,53	-511.280,92
BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS	1.392.860,10	0,00	0,00	0,00	1.288.459,09	-104.401,01	-58.615,84
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	9.276.486,54	0,00	0,00	0,00	8.692.858,91	-583.627,63	-170.763,05
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	406.601,77	0,00	0,00	0,00	381.554,06	-25.047,71	-10.050,53
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	17.787.402,32	0,00	0,00	0,00	16.466.679,48	-1.320.722,84	-753.317,77
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	4.606.869,53	0,00	0,00	0,00	4.388.555,64	-218.313,89	37.071,55
FIA CAIXA CONSUMO	4.379.825,39	0,00	0,00	0,00	3.949.139,16	-430.686,23	-316.341,82
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	8.165.142,31	0,00	0,00	0,00	7.306.499,58	-858.642,73	-597.500,01
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.844.765,59	0,00	0,00	0,00	3.603.152,44	-241.613,15	-110.566,01
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	9.947.786,95	0,00	0,00	0,00	9.271.299,41	-676.487,54	-441.674,02
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	4.060.743,50	0,00	0,00	0,00	3.780.293,58	-280.449,92	-148.510,23
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	4.361.477,54	0,00	0,00	0,00	3.964.418,84	-397.058,70	-219.725,28
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.858.372,82	0,00	0,00	0,00	2.594.869,00	-263.503,82	-151.244,42
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	5.637.934,32	0,00	0,00	0,00	5.042.810,22	-595.123,50	-693.239,11
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	639.374,85	200.000,00	0,00	0,00	812.613,93	-26.760,92	5.025,87
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	627.127,51	0,00	0,00	0,00	602.016,94	-25.110,57	-4.675,80
					109.848.957,18	-9.618.678,21	

Importante neste segmento se faz também analisar cada fundo de investimentos baseado em seus aportes históricos, visto a estratégia de longo prazo desde comitê para essa classe de ativo, sendo que realiza aportes fracionados, periódicos e constantes na busca da melhora de seus preços médios em períodos de baixas e realização de lucros em períodos de altas, visto a grande volatilidade da renda variável como um todo, e de forma mais acentuada no Brasil. Assim, abaixo segue a tabela que possibilita tal análise.

FUNDOS - ART.8º, I, - FEVEREIRO/2023											
FUNDO	DATA aplicação	Aplicação Inicial	qdd cota	R\$ cota aquisição	valor atual cota	Saldo atual	Rentabilidade				
							R\$ por	% por			
Bradesco Fia Selection	06/06/2018	300 000,00	436,86	686,72	843,33	368 417,02	68 417,02	22,81%	-7,48%	-3,85%	-1,59%
	03/01/2019	2 192 653,53	2 621,81	836,31	843,33	2 211 053,05	18 399,52	0,84%			
	04/02/2019	2 000 000,00	2 310,12	865,76	843,33	1 948 190,26	(51 809,74)	-2,59%			
	14/06/2019	4 500 000,00	5 112,26	880,24	843,33	4 311 320,38	(188 679,62)	-4,19%			
	17/09/2020	100 000,00	118,77	842,00	843,33	100 158,21	158,21	0,16%			
	19/11/2020	100 000,00	112,04	892,58	843,33	94 482,56	(5 517,44)	-5,52%			
	11/03/2021	100 000,00	106,66	937,52	843,33	89 952,80	(10 047,20)	-10,05%			
	13/04/2021	100 000,00	102,91	971,74	843,33	86 785,70	(13 214,30)	-13,21%			
	19/05/2021	100 000,00	99,71	1 002,95	843,33	84 084,98	(15 915,02)	-15,92%			
	18/06/2021	100 000,00	94,92	1 053,49	843,33	80 051,35	(19 948,65)	-19,95%			
	23/07/2021	100 000,00	96,47	1 036,64	843,33	81 352,41	(18 647,59)	-18,65%			
	31/08/2021	1 000 000,00	1 024,05	976,52	843,33	863 611,00	(136 389,00)	-13,64%			
	05/10/2021	100 000,00	112,85	886,11	843,33	95 171,94	(4 828,06)	-4,83%			
	26/10/2021	100 000,00	117,83	848,70	843,33	99 367,03	(632,97)	-0,63%			
	24/11/2021	200 000,00	237,15	843,34	843,33	199 996,72	(3,28)	0,00%			
	20/12/2021	200 000,00	245,80	813,66	843,33	207 292,43	7 292,43	3,65%			
	28/01/2022	400 000,00	457,71	873,92	843,33	385 997,53	(14 002,47)	-3,50%			
	18/03/2022	400 000,00	458,12	873,13	843,33	386 347,34	(13 652,66)	-3,41%			
	22/04/2022	400 000,00	460,91	873,92	843,33	388 703,23	(11 296,77)	-2,82%			
	19/05/2022	200 000,00	234,89	851,47	843,33	198 087,50	(1 912,50)	-0,96%			
	15/07/2022	100 000,00	132,59	754,22	843,33	111 814,87	11 814,87	11,81%			
	16/09/2022	200 000,00	226,59	882,64	843,33	191 092,60	(8 907,40)	-4,45%			
	17/10/2022	200 000,00	217,08	921,30	843,33	183 073,25	(16 926,75)	-8,46%			
			13 192 653,53	15 138,09	887,17	843,33	12 766 404,18	(426 249,35)			

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

BB AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	25/10/2017	1 948 762,98	145 639,43	13,38	16,7192	2 434 969,33	486 206,35	24,95%	-7,40%	-3,95%	-4,47%
	02/03/2018	1 250 000,00	84 014,38	14,88	16,7192	1 404 650,12	154 650,12	12,37%			
	22/07/2019	1 800 000,00	98 561,79	18,26	16,7192	1 647 870,48	(152 129,52)	-8,45%			
	28/08/2019	1 647 797,10	94 267,38	17,48	16,7192	1 576 071,63	(71 725,47)	-4,35%			
	29/08/2019	48 999,22	2 740,76	17,88	16,7192	45 823,16	(3 176,06)	-6,48%			
	24/04/2020	1 000 000,00	75 813,97	13,19	16,7192	1 267 546,05	267 546,05	26,75%			
	18/05/2020	900 000,00	66 295,20	13,58	16,7192	1 108 400,14	208 400,14	23,16%			
	28/08/2020	250 000,00	15 173,11	16,48	16,7192	253 681,66	3 681,66	1,47%			
	19/05/2021	1 000 000,00	52 296,24	19,12	16,7192	874 349,36	(125 650,64)	-12,57%			
	05/05/2022	400 000,00	24 159,92	16,56	16,7192	403 933,59	3 933,59	0,98%			
	23/05/2022	200 000,00	11 596,13	17,25	16,7192	193 877,54	(6 122,46)	-3,06%			
	14/07/2022	100 000,00	6 550,00	15,27	16,7192	109 510,59	9 510,59	9,51%			
	16/09/2022	400 000,00	23 529,00	17,00	16,7192	393 385,23	(6 614,77)	-1,65%			
	21/10/2022	400 000,00	21 986,50	18,19	16,7192	367 595,78	(32 404,22)	-8,10%			
	01/11/2022	-6 322 000,00	350 573,10	28,56	16,72	(5 861 288,59)	460 711,41	-7,29%			
	SALDO	5 023 559,30	372 050,71	13,50	16,7192	6 220 376,09	1 196 816,79	23,82%			

BB AÇÕES SMALL CAPS FIC FI	16/08/2019	4 400 000,00	498 469,76	8,83	6,3840	3 182 251,43	(1 217 748,57)	-27,68%	-10,65%	-8,14%	-21,59%
	28/08/2019	2 300 000,00	265 867,50	8,65	6,3840	1 697 309,07	(602 690,93)	-26,20%			
	17/09/2019	1 400 000,00	156 942,72	8,92	6,3840	1 001 928,76	(398 071,24)	-28,43%			
	15/10/2019	1 400 000,00	152 487,25	9,18	6,3840	973 484,87	(426 515,13)	-30,47%			
	14/11/2019	1 400 000,00	149 752,26	9,35	6,3840	956 024,59	(443 975,41)	-31,71%			
	11/12/2019	1 000 000,00	98 573,41	10,14	6,3840	629 296,73	(370 703,27)	-37,07%			
	16/12/2019	1 400 000,00	133 784,13	10,46	6,3840	854 083,37	(545 916,63)	-38,99%			
	24/04/2020	1 000 000,00	153 292,28	6,52	6,3840	978 624,22	(21 375,78)	-2,14%			
	18/05/2020	900 000,00	137 990,94	6,52	6,3840	880 939,86	(19 060,14)	-2,12%			
	28/08/2020	250 000,00	27 685,22	9,03	6,3840	176 743,60	(73 256,40)	-29,30%			
	19/05/2021	1 000 000,00	94 032,85	10,63	6,3840	600 309,60	(399 690,40)	-39,97%			
	20/04/2022	400 000,00	47 042,86	8,50	6,3840	300 323,55	(99 676,45)	-24,92%			
	23/05/2022	200 000,00	25 077,37	7,98	6,3840	160 094,98	(39 905,02)	-19,95%			
	14/07/2022	100 000,00	15 092,52	6,63	6,3840	96 351,26	(3 648,74)	-3,65%			
	16/09/2022	400 000,00	51 669,32	7,74	6,3840	329 859,07	(70 140,93)	-17,54%			
	21/10/2022	400 000,00	50 033,12	7,99	6,3840	319 413,51	(80 586,49)	-20,15%			
		17 950 000,00	2 057 793,53	8,57	6,3840	13 137 038,48	(4 812 961,52)	-26,81%			

BTG PACTUAL ABS INST FI DE AÇÕES	24/10/2017	1 000 000,00	363 336,13	2,75	3,15	1 143 249,27	143 249,27	14,32%	-6,29%	-1,93%	-9,07%
	03/05/2018	500 000,00	174 929,56	2,86	3,15	550 421,70	50 421,70	10,08%			
	01/02/2019	1 000 000,00	280 438,59	3,57	3,15	882 409,41	(117 590,59)	-11,76%			
	21/05/2019	2 000 000,00	569 406,27	3,51	3,15	1 791 655,84	(208 344,16)	-10,42%			
	30/01/2020	1 500 000,00	321 425,06	4,67	3,15	1 011 374,68	(488 625,32)	-32,58%			
	16/09/2020	100 000,00	21 819,76	4,58	3,15	68 656,60	(31 343,40)	-31,34%			
	18/11/2020	100 000,00	21 383,12	4,68	3,15	67 282,69	(32 717,31)	-32,72%			
	10/03/2021	100 000,00	20 480,47	4,88	3,15	64 442,47	(35 557,53)	-35,56%			
	12/04/2021	100 000,00	19 752,27	5,06	3,15	62 151,16	(37 848,84)	-37,85%			
	20/05/2021	100 000,00	20 390,17	4,90	3,15	64 158,35	(35 841,65)	-35,84%			
	21/06/2021	100 000,00	19 184,32	5,21	3,15	60 364,10	(39 635,90)	-39,64%			
	19/07/2021	100 000,00	19 192,23	5,21	3,15	60 388,99	(39 611,01)	-39,61%			
	24/08/2021	900 000,00	191 139,67	4,71	3,15	601 427,35	(298 572,65)	-33,17%			
	04/10/2021	100 000,00	24 442,06	4,09	3,15	76 907,75	(23 092,25)	-23,09%			
	25/10/2021	100 000,00	26 171,79	3,82	3,15	82 350,40	(17 649,60)	-17,65%			
	25/11/2021	200 000,00	55 479,49	3,60	3,15	174 568,08	(25 431,92)	-12,72%			
	20/12/2021	200 000,00	58 878,82	3,40	3,15	185 264,18	(14 735,82)	-7,37%			
	28/01/2022	400 000,00	113 184,04	3,53	3,15	356 137,35	(43 862,65)	-10,97%			
	21/03/2022	400 000,00	112 625,62	3,55	3,15	354 380,27	(45 619,73)	-11,40%			
	20/04/2022	400 000,00	114 626,15	3,49	3,15	360 675,01	(39 324,99)	-9,83%			
	20/05/2022	200 000,00	62 356,78	3,21	3,15	196 207,70	(3 792,30)	-1,90%			
	13/07/2022	100 000,00	33 404,16	2,99	3,15	105 107,32	5 107,32	5,11%			
	16/09/2022	200 000,00	60 117,05	3,33	3,15	189 160,32	(10 839,68)	-5,42%			
	17/10/2022	200 000,00	58 534,53	3,42	3,15	184 180,86	(15 819,14)	-7,91%			
		10 100 000,00	2 762 698,10	3,96	3,15	8 692 921,85	(1 407 078,15)	-13,93%			

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

MOAT CAPITAL FIC FIA	14/08/2019	1 400 000,00	425 185,24	3,29	2,52	1 073 346,80	(326 653,20)	-23,33%	-10,56%	-12,09%	-25,46%
	05/03/2020	2 000 000,00	582 212,80	3,44	2,52	1 469 750,56	(530 249,44)	-26,51%			
	17/09/2020	100 000,00	26 798,84	3,73	2,52	67 651,57	(32 348,43)	-32,35%			
	18/11/2020	100 000,00	25 838,69	3,87	2,52	65 227,76	(34 772,24)	-34,77%			
	11/03/2021	100 000,00	26 304,00	3,80	2,52	66 402,38	(33 597,62)	-33,60%			
	13/04/2021	100 000,00	25 229,43	3,96	2,52	63 689,72	(36 310,28)	-36,31%			
	19/05/2021	100 000,00	25 056,27	3,99	2,52	63 252,58	(36 747,42)	-36,75%			
	23/07/2021	100 000,00	24 866,04	4,02	2,52	62 772,36	(37 227,64)	-37,23%			
	27/08/2021	400 000,00	105 789,13	3,78	2,52	267 056,37	(132 943,63)	-33,24%			
	01/10/2021	100 000,00	27 589,04	3,62	2,52	69 646,37	(30 353,63)	-30,35%			
	22/10/2021	100 000,00	30 320,35	3,30	2,52	76 541,35	(23 458,65)	-23,46%			
	24/11/2021	200 000,00	61 443,01	3,26	2,52	155 108,06	(44 891,94)	-22,45%			
	17/12/2021	200 000,00	58 790,89	3,40	2,52	148 412,99	(51 587,01)	-25,79%			
	28/01/2022	400 000,00	112 345,24	3,56	2,52	283 606,75	(116 393,25)	-29,10%			
	18/03/2022	400 000,00	119 899,49	3,34	2,52	302 676,86	(97 323,14)	-24,33%			
	19/04/2022	400 000,00	114 851,93	3,48	2,52	289 934,69	(110 065,31)	-27,52%			
	20/05/2022	200 000,00	59 330,43	3,37	2,52	149 775,03	(50 224,97)	-25,11%			
	13/07/2022	100 000,00	32 394,47	3,09	2,52	81 777,31	(18 222,69)	-18,22%			
	15/09/2022	200 000,00	57 246,42	3,49	2,52	144 514,11	(55 485,89)	-27,74%			
	14/10/2022	200 000,00	56 118,67	3,56	2,52	141 667,18	(58 332,82)	-29,17%			
		6 900 000,00	1 997 610,39	3,57	2,52	5 042 810,80	(1 857 189,20)	-26,92%			

BAHIA AM VAL FC DE FIA	04/02/2019	1 500 000,00	578 123,95	2,59	2,57	1 484 702,82	(15 297,18)	-1,02%	-7,85%	-5,04%	-6,97%
	03/02/2020	1 500 000,00	476 031,69	3,15	2,57	1 222 515,69	(277 484,31)	-18,50%			
	17/09/2020	100 000,00	36 564,20	2,73	2,57	93 901,96	(6 098,04)	-6,10%			
	18/11/2020	100 000,00	33 813,80	2,96	2,57	86 838,54	(13 161,46)	-13,16%			
	11/03/2021	100 000,00	30 764,75	3,25	2,57	79 008,16	(20 991,84)	-20,99%			
	13/04/2021	100 000,00	28 888,61	3,46	2,57	74 189,97	(25 810,03)	-25,81%			
	19/05/2021	100 000,00	28 457,17	3,51	2,57	73 081,98	(26 918,02)	-26,92%			
	26/07/2021	99 978,05	27 938,34	3,58	2,57	71 749,55	(28 228,50)	-28,23%			
	30/08/2021	400 000,00	121 163,07	3,30	2,57	311 163,64	(88 836,36)	-22,21%			
	04/10/2021	100 000,00	33 152,84	3,02	2,57	85 141,10	(14 858,90)	-14,86%			
	25/10/2021	100 000,00	34 840,40	2,87	2,57	89 474,99	(10 525,01)	-10,53%			
	25/11/2021	200 000,00	72 735,13	2,75	2,57	186 793,95	(13 206,05)	-6,60%			
	20/12/2021	200 000,00	74 793,12	2,67	2,57	192 079,16	(7 920,84)	-3,96%			
	28/01/2022	400 000,00	142 760,13	2,80	2,57	366 627,89	(33 372,11)	-8,34%			
	18/03/2022	400 000,00	141 586,90	2,83	2,57	363 614,87	(36 385,13)	-9,10%			
	20/04/2022	400 000,00	143 204,64	2,79	2,57	367 769,46	(32 230,54)	-8,06%			
	20/05/2022	200 000,00	73 577,07	2,72	2,57	188 956,16	(11 043,84)	-5,52%			
	14/07/2022	100 000,00	43 194,37	2,32	2,57	110 929,15	10 929,15	10,93%			
	16/09/2022	200 000,00	75 364,50	2,65	2,57	193 546,52	(6 453,48)	-3,23%			
	17/10/2022	200 000,00	71 471,67	2,80	2,57	183 549,21	(16 450,79)	-8,23%			
		6 499 978,05	2 268 426,34	2,94	2,57	5 825 634,80	(674 343,25)	(2,30)			

FIC DE FIE M AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	19/8/2019	2 000 000,00	1 115 902,67	1,79	2,07	2 306 064,76	306 064,76	15,30%	-6,28%	-2,98%	-2,57%
	17/9/2020	100 000,00	54 004,43	1,85	2,07	111 602,66	11 602,66	11,60%			
	18/11/2020	100 000,00	51 053,20	1,96	2,07	105 503,82	5 503,82	5,50%			
	5/5/2022	400 000,00	194 288,88	2,06	2,07	401 507,00	1 507,00	0,38%			
	23/5/2022	200 000,00	91 644,16	2,18	2,07	189 386,92	(10 613,08)	-5,31%			
	18/7/2022	100 000,00	50 896,28	1,96	2,07	105 179,54	5 179,54	5,18%			
	26/9/2022	200 000,00	94 445,00	2,12	2,07	195 174,98	(4 825,02)	-2,41%			
	17/10/2022	200 000,00	91 327,62	2,19	2,07	188 732,77	(11 267,23)	-5,63%			
		3 300 000,00	1 743 562,24	2,01	2,07	3 603 152,44	303 152,44	24,61%			

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	15/8/2019	3 000 000,00	1 871 722,15	1,60	2,11	3 956 362,06	956 362,06	31,88%	-10,52%	-7,56%	-20,59%
	27/8/2019	2 000 000,00	1 282 411,34	1,56	2,11	2 710 703,40	710 703,40	35,54%			
	20/1/2020	7 000 000,00	3 283 152,69	2,13	2,11	6 939 780,45	(60 219,55)	-0,86%			
	17/9/2020	100 000,00	58 718,63	1,70	2,11	124 116,80	24 116,80	24,12%			
	21/07/2021	-2 482 843,79	1 419 275,17	1,75	2,11	(3 000 000,00)	-517 156,21	20,83%			
	SALDO	9 617 156,21	5 076 729,64	1,89	1,26	6 404 228,45	-3 212 927,76	-33,41%			
	20/04/2022	400 000,00	243 386,28	1,64	1,26	307 028,63	(92 971,37)	-23,24%			
	23/05/2022	200 000,00	129 513,30	1,54	1,26	163 379,34	(36 620,66)	-18,31%			
	14/07/2022	100 000,00	77 358,91	1,29	1,26	97 587,25	(2 412,75)	-2,41%			
	16/09/2022	200 000,00	133 176,61	1,50	1,26	168 000,56	(31 999,44)	-16,00%			
	17/10/2022	200 000,00	131 809,01	1,52	1,26	166 275,35	(33 724,65)	-16,86%			
		10 717 156,21	5 791 973,74	1,57	1,26	7 306 499,58	(3 410 656,63)	-31,82%			
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	21/1/2020	1 500 000,00	603 131,46	2,49	1,06	638 022,61	(861 977,39)	-57,47%	-4,74%	0,85%	-11,90%
	31/1/2020	1 500 000,00	624 737,09	2,40	1,06	660 878,13	(839 121,87)	-55,94%			
	2/9/2020	300 000,00	183 560,34	1,63	1,06	194 179,30	(105 820,70)	-35,27%			
	17/11/2020	200 000,00	122 856,39	1,63	1,06	129 963,63	(70 036,37)	-35,02%			
	10/3/2021	100 000,00	66 670,93	1,50	1,06	70 527,85	(29 472,15)	-29,47%			
	12/4/2021	100 000,00	62 954,85	1,55	1,06	66 596,79	(33 403,21)	-33,40%			
	18/5/2021	100 000,00	62 188,90	1,61	1,06	65 786,53	(34 213,47)	-34,21%			
	21/6/2021	100 000,00	59 001,40	1,69	1,06	62 414,63	(37 585,37)	-37,59%			
	16/7/2021	100 000,00	63 137,25	1,58	1,06	66 789,74	(33 210,26)	-33,21%			
	25/8/2021	300 000,00	211 055,21	1,42	1,06	223 264,76	(76 735,24)	-25,58%			
	4/10/2021	100 000,00	81 869,71	1,22	1,06	86 605,87	(13 394,13)	-13,39%			
	25/10/2021	100 000,00	88 975,97	1,12	1,06	94 123,23	(5 876,77)	-5,88%			
	25/11/2021	200 000,00	168 339,40	1,19	1,06	178 077,83	(21 922,17)	-10,96%			
	20/12/2021	200 000,00	175 123,83	1,14	1,06	185 254,75	(14 745,25)	-7,37%			
	28/1/2022	400 000,00	309 660,80	1,29	1,06	327 574,67	(72 425,33)	-18,11%			
	21/3/2022	400 000,00	347 420,96	1,15	1,06	367 519,26	(32 480,74)	-8,12%			
	20/04/2022	400 000,00	329 502,05	1,21	1,06	348 563,74	(61 436,26)	-12,86%			
	23/05/2022	200 000,00	171 959,73	1,16	1,06	181 907,60	(18 092,40)	-9,05%			
	14/07/2022	100 000,00	96 600,34	1,04	1,06	102 188,67	2 188,67	2,19%			
	16/09/2022	200 000,00	163 377,67	1,22	1,06	172 829,06	(27 170,94)	-13,59%			
	17/10/2022	200 000,00	156 437,08	1,28	1,06	165 486,96	(34 513,04)	-17,26%			
		6 800 000,00	4 148 561,36	1,45	1,06	4 388 555,61	(2 411 444,39)	-35,46%			
FIA CAIXA AÇÕES CONSUMO	21/1/2020	1 500 000,00	654 636,77	2,29	1,06	691 461,40	(808 538,60)	-53,90%	-9,83%	-7,42%	-31,32%
	31/1/2020	1 500 000,00	680 375,79	2,20	1,06	718 648,28	(781 351,72)	-52,09%			
	2/9/2020	500 000,00	244 190,82	2,05	1,06	257 927,04	(242 072,96)	-48,41%			
	17/11/2020	100 000,00	49 015,62	2,04	1,06	51 772,85	(48 227,15)	-48,23%			
	10/3/2021	100 000,00	49 336,52	2,20	1,06	52 111,80	(47 888,20)	-47,89%			
	12/4/2021	100 000,00	47 369,57	2,04	1,06	50 034,20	(49 965,80)	-49,97%			
	18/5/2021	100 000,00	48 343,09	2,07	1,06	51 062,48	(48 937,52)	-48,94%			
	21/6/2021	100 000,00	45 088,83	2,22	1,06	47 625,17	(52 374,83)	-52,37%			
	16/7/2021	100 000,00	46 575,84	2,15	1,06	49 195,82	(50 804,18)	-50,80%			
	25/8/2021	400 000,00	193 761,93	2,06	1,06	204 661,43	(195 338,57)	-48,83%			
	4/10/2021	100 000,00	54 962,30	1,82	1,06	58 054,04	(41 945,96)	-41,95%			
	25/10/2021	100 000,00	57 942,83	1,73	1,06	61 202,23	(38 797,77)	-38,80%			
	25/11/2021	200 000,00	121 469,49	1,65	1,06	128 302,39	(71 697,61)	-35,85%			
	20/12/2021	200 000,00	128 247,30	1,56	1,06	135 461,47	(64 538,53)	-32,27%			
	28/1/2022	400 000,00	253 241,81	1,58	1,06	267 487,17	(132 512,83)	-33,13%			
	21/3/2022	400 000,00	264 615,72	1,51	1,06	279 500,88	(120 499,12)	-30,12%			
	20/04/2022	400 000,00	267 085,99	1,50	1,06	282 110,11	(117 889,89)	-29,47%			
	23/05/2022	200 000,00	150 670,26	1,33	1,06	159 145,76	(40 854,24)	-20,43%			
	14/07/2022	100 000,00	81 783,27	1,22	1,06	86 383,74	(13 616,26)	-13,62%			
	16/09/2022	200 000,00	150 006,97	1,33	1,06	158 445,17	(41 554,83)	-20,78%			
	17/10/2022	200 000,00	150 102,19	1,33	1,06	158 545,73	(41 454,27)	-20,73%			
		7 000 000,00	3 738 822,91	1,80	1,06	3 949 139,16	(3 050 860,84)	-43,58%			
ITAU AÇÕES DUNAMIS FC	01/02/2019	2 000 000,00	110 720,69	18,06	20,75	2 297 144,97	297 144,97	14,86%	-6,80%	-4,55%	0,27%
	14/06/2019	3 000 000,00	161 104,71	18,62	20,75	3 342 472,67	342 472,67	11,42%			
	19/07/2019	2 000 000,00	99 959,43	20,01	20,75	2 073 878,91	73 878,91	3,69%			
	15/08/2019	1 500 000,00	75 084,94	19,98	20,75	1 557 802,86	57 802,86	3,85%			
		8 500 000,00	446 869,76	19,17	20,75	9 271 299,41	771 299,41	9,07%			

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

ITAÚ INST PHOENIX FI AÇÕES	23/10/2017	1 000 000,00	60 334,20	16,57	16,36	986 853,96	(13 146,04)	-1,31%	-9,10%	-5,25%	-18,03%
	02/03/2018	1 500 000,00	82 706,92	18,14	16,36	1 352 792,59	(147 207,41)	-9,81%			
	03/04/2018	1 500 000,00	82 015,44	18,29	16,36	1 341 482,36	(158 517,64)	-10,57%			
	29/05/2018	300 000,00	17 319,76	17,32	16,36	283 289,93	(16 710,07)	-5,57%			
		4 300 000,00	242 376,32	17,58	16,36	3 964 418,84	(335 581,16)	-7,80%			

ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	29/12/2017	1 000 000,00	486 896,64	2,05	2,84	1 381 369,06	381 369,06	38,14%	-6,91%	-3,78%	-6,37%
	05/03/2018	1 500 000,00	660 831,38	2,27	2,84	1 874 837,39	374 837,39	24,99%			
	01/09/2020	1 000 000,00	349 372,07	2,86	2,84	991 199,64	(8 800,36)	-0,88%			
	19/11/2020	100 000,00	34 231,78	2,92	2,84	97 118,61	(2 881,39)	-2,88%			
	11/03/2021	100 000,00	31 896,22	3,14	2,84	90 492,41	(9 507,59)	-9,51%			
	12/04/2021	100 000,00	30 779,75	3,25	2,84	87 324,90	(12 675,10)	-12,68%			
	24/05/2021	100 000,00	29 627,55	3,38	2,84	84 055,99	(15 944,01)	-15,94%			
	26/07/2021	100 000,00	29 228,41	3,42	2,84	82 923,59	(17 076,41)	-17,08%			
	25/08/2021	500 000,00	153 521,82	3,26	2,84	435 555,06	(64 444,94)	-12,89%			
	04/10/2021	100 000,00	33 809,35	2,96	2,84	95 920,12	(4 079,88)	-4,08%			
	15/10/2021	100 000,00	34 957,73	2,86	2,84	99 178,18	(821,82)	-0,82%			
	25/11/2021	200 000,00	72 099,40	2,77	2,84	204 552,42	4 552,42	2,28%			
	17/12/2021	200 000,00	73 419,93	2,72	2,84	208 298,87	8 298,87	4,15%			
	28/01/2022	400 000,00	139 481,93	2,87	2,84	395 722,64	(4 277,36)	-1,07%			
	21/03/2022	400 000,00	135 464,32	2,95	2,84	384 324,33	(15 675,67)	-3,92%			
	20/04/2022	400 000,00	136 800,96	2,92	2,84	388 116,50	(11 883,50)	-2,97%			
	18/05/2022	200 000,00	72 545,14	2,76	2,84	205 817,03	5 817,03	2,91%			
	13/07/2022	100 000,00	39 894,50	2,51	2,84	113 184,25	13 184,25	13,18%			
	16/09/2022	200 000,00	70 300,05	2,84	2,84	199 447,51	(552,49)	-0,28%			
	17/10/2022	200 000,00	67 110,96	2,98	2,84	190 399,77	(9 600,23)	-4,80%			
	04/11/2022	-4 025 000,00	1 297 468,82	2,82	2,84	(3 681 034,44)	343 965,56	-8,55%			
	SALDO	2 975 000,00	1 384 801,08	2,15	2,84	3 928 803,83	953 803,83	32,06%			

ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI II	11/10/2021	819 889,32	31 608,50	25,94	19,14	605 014,26	(214 875,06)	-26,21%	-9,22%	-5,51%	-18,76%
	11/10/2021	100 000,00	4 177,55	23,94	19,14	79 961,99	(20 038,01)	-20,04%			
	24/11/2021	200 000,00	8 661,12	23,09	19,14	165 781,30	(34 218,70)	-17,11%			
	17/12/2021	200 000,00	8 754,35	22,85	19,14	167 565,91	(32 434,09)	-16,22%			
	27/01/2022	400 000,00	17 304,35	23,23	19,14	331 220,34	(68 779,66)	-17,19%			
	18/03/2022	400 000,00	16 579,12	24,13	19,14	317 338,78	(82 661,22)	-20,67%			
	19/04/2022	400 000,00	16 752,23	22,87	19,14	320 652,27	(79 347,73)	-19,84%			
	18/05/2022	200 000,00	9 181,37	21,78	19,14	175 739,40	(24 260,60)	-12,13%			
	13/07/2022	100 000,00	4 983,28	20,07	19,14	95 384,39	(4 615,61)	-4,62%			
	15/09/2022	200 000,00	8 755,90	22,84	19,14	167 595,64	(32 404,36)	-16,20%			
	14/10/2022	200 000,00	8 809,14	22,70	19,14	168 614,71	(31 385,29)	-15,69%			
		3 219 889,32	135 566,91	23,04	19,14	2 594 869,00	(625 020,32)	-19,41%			
TRIGONOS DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	10/10/2022	200 000,00	184 702,77	1,08	1,10	203 634,93	3 634,93	1,82%	-4,19%	0,83%	20,35%
	18/10/2022	200 000,00	179 467,84	1,11	1,10	197 863,42	(2 136,58)	-1,07%			
	15/12/2022	200 000,00	186 929,32	1,07	1,10	206 089,71	6 089,71	3,04%			
	28/02/2023	200 000,00	179 917,53	1,11	1,10	198 359,21	(1 640,79)	-0,82%			
	SALDO	800 000,00	731 017,46	1,09	1,1025	805 947,26	5 947,26	0,74%			
TRIGONOS FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC DE FIA	11/10/2022	200 000,00	104 439,29	1,91	1,90	198 480,05	(1 519,95)	-0,76%	-4%	-0,77%	10,98%
	19/10/2022	200 000,00	102 584,07	1,95	1,90	194 954,34	(5 045,66)	-2,52%			
	16/12/2022	200 000,00	111 559,59	1,79	1,90	212 011,73	12 011,73	6,01%			
	28/02/2023	200 000,00	105 206,91	1,90	1,90	199 938,86	(61,14)	-0,03%			
	SALDO	800 000,00	423 789,86	1,89	1,90	805 384,98	5 384,98	0,67%			
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	07/11/2022	200 000,00	49 046,51	4,08	3,67	180 171,38	(19 828,62)	-9,91%	-6,16%	-2,57%	-3,32%
	16/12/2022	200 000,00	57 556,65	3,47	3,67	211 433,21	11 433,21	5,72%			
	SALDO	400 000,00	106 603,15	3,75	3,6735	391 604,59	(8 395,41)	-2,10%			
TOTAIS		108 478 236,41				92 694 860,89	(15 783 375,52)	(3,51)			

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

1.6 Art.9º, II, - 4.963/2021 - Segmento de Investimentos no Exterior: neste enquadramento da Resolução o BCPREVI possui 7 fundos os quais totalizam um investimento de R\$ 30.251.456,79 representando 4,21% da carteira, conforme relação abaixo.

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	32,40	0,67	1,01	6,20	8.662.957,11	1,21	159.529.125,59	5,43
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	32,31	-0,17	-3,03	8,58	2.540.733,29	0,35	220.200.259,80	1,15
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTEC ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	31,56	0,28	-0,86	12,03	3.034.245,64	0,42	69.754.930,67	4,35
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	26,48	-0,33	-0,25	-0,60	2.139.802,36	0,30	119.295.785,05	1,79
ITAU	ITAU	ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	23,71	0,56	0,93	3,47	5.705.220,91	0,79	392.278.714,22	1,45
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	39,18	1,41	1,39	12,55	5.873.791,36	0,82	590.852.345,79	0,99
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	23,05	-0,23	-1,64	4,18	2.294.706,12	0,32	365.742.430,63	0,63
Sub-total Artigo 9º II			25,47	0,54	0,23	6,92	30.251.456,79	4,21		

Da tabela abaixo extrai-se os principais dados dos resultados do mês de fevereiro para este enquadramento.

FEVEREIRO - 2023										
Enquadramento	Descrição	Política de Investimento	Total Investido	Rentabilidade (mês)	Rentabilidade acumulada (12 meses)	Meta atuarial (mês)	Meta atuarial (12 meses)	% Benchmark (mês)	% Benchmark (12 meses)	Participação na Carteira
Art. 7º, I, alínea a	Títulos do Tesouro Nacional *	100,00%	174.887.528,31	0,96%	12,25%	80,67%	114,06%	104,35%	94,23%	24,35%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	251.382.751,39	1,07%	9,74%	89,92%	90,69%	116,30%	74,92%	35%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	121.348.946,07	0,97%	10,03%	81,51%	93,39%	105,43%	77,15%	16,90%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	400.891,98	-0,33%	-58,55%	-127,73%	-645,16%	-135,87%	-550,38%	0,06%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	109.848.957,18	-8,06%	-11,44%	-777,31%	-206,52%	-7,61%	-57,58%	15,29%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	30.251.456,79	0,23%	-12,07%	19,33%	-212,38%	125,00%	-37,94%	4,21%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	16.049.917,72	0,75%	-10,41%	63,03%	-196,93%	110,01%	-43,39%	2,23%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	11.939.323,12	-1,75%	-0,73%	740,34%	-106,80%	-224,07%	91,15%	1,66%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	358.959,01	0%	-21,11%	0,00%	-296,55%	0,00%	-262,38%	0,05%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	1.770.976,79	0,36%	10,89%	30,25%	101,40%	-80,00%	444,49%	0,25%
IPCA + 5,02 MÊS		1,19%	Ibov mês	-7,49%	MSCI mês	-0,92%	Ifix mês	-0,45%	S&P mês	-0,54%
IPCA + 5,02% 12 MÊS		10,74%	Ibov 12 meses	-7,26%	MSCI 12 meses	-8,75%	Ifix 12 meses	2,45%	S&P 12 meses	-8,26%
* Referência "CDI" mês e 12 meses		0,92%	13%							

Neste enquadramento, no mês de fevereiro, não houve movimentações de aplicações e resgates.

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

1.7. Art.9º-A, III, - 4.604 – Ações – BDR Nível I: neste enquadramento da Resolução, o BCPREVI possui 1 fundo alocado, totalizando um investimento de R\$ 16.049.917,72 representando 2,23% da carteira, conforme demonstrado na relação abaixo.

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	26,14	0,39	0,75	5,10	16.049.917,72	2,23	1.983.611.681,32	0,81
Sub-total Artigo 9º III			26,14	0,39	0,75	5,10	16.049.917,72	2,23		

Na tabela abaixo apresenta-se a posição em carteira, sua rentabilidade mês e doze meses, e em comparação ao seu *benchmark* e meta atuarial.

FEVEREIRO - 2023										
Enquadramento	Descrição	Política de Investimento	Total Investido	Rentabilidade (mês)	Rentabilidade acumulada (12 meses)	Meta atuarial (mês)	Meta atuarial (12 meses)	% Benchmark (mês)	% Benchmark (12mês)	Participação na Carteira
Art. 7º, I, alínea a	Títulos do Tesouro Nacional *	100,00%	174 887 528,31	0,96%	12,25%	80,67%	114,06%	104,35%	94,23%	24,35%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	251 382 751,39	1,07%	9,74%	89,92%	90,69%	116,30%	74,92%	35%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	121 348 946,07	0,97%	10,03%	81,51%	93,39%	105,43%	77,15%	16,90%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	400 891,98	-0,33%	-58,55%	-127,73%	-645,16%	-135,87%	-550,38%	0,06%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	109 848 957,18	-8,06%	-11,44%	-777,31%	-206,52%	-7,61%	-57,58%	15,29%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	30 251 456,79	0,23%	-12,07%	19,33%	-212,38%	125,00%	-37,94%	4,21%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	16 049 917,72	0,75%	-10,41%	63,03%	-196,93%	110,01%	-43,39%	2,23%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	11 939 323,12	-1,75%	-0,73%	740,34%	-106,80%	-224,07%	91,15%	1,66%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	358 959,01	0%	-21,11%	0,00%	-296,55%	0,00%	-262,38%	0,05%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	1 770 976,79	0,36%	10,89%	30,25%	101,40%	-80,00%	444,49%	0,25%
IPCA + 5,02 MÊS	1,19%	Ibov mês	-7,49%	MSCI mês	-0,92%	Ifix mês	-0,45%	S&P mês	-0,54%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	10,74%	Ibov 12 meses	-7,26%	MSCI 12 meses	-8,75%	Ifix 12 meses	2,45%	S&P 12 meses	-8,25%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		0,92%	13%							

Não houve movimentação, aplicações ou resgates, neste fundo, neste mês de fevereiro de 2023. Este ativo é utilizado como ferramenta de “hedge” proteção quanto às variações do câmbio e evitar que a carteira venha a sofrer demasiadamente com a volatilidade do dólar.

1.8 Art.10º, I - 4.963/2021 - Fundos Multimercados: Neste enquadramento da Resolução o BCPREVI aplica em apenas 1 fundo o qual possui um total aplicado de R\$ 11.939.323,12, representando 1,66% da carteira, conforme relação abaixo. A Política de Investimento do instituto permite a alocação nesta classe de ativos de até 10% da carteira, não podendo exceder ao limite de 40% no somatório das aplicações em renda variável. Desta forma, evidencia-se o correto enquadramento neste segmento.

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

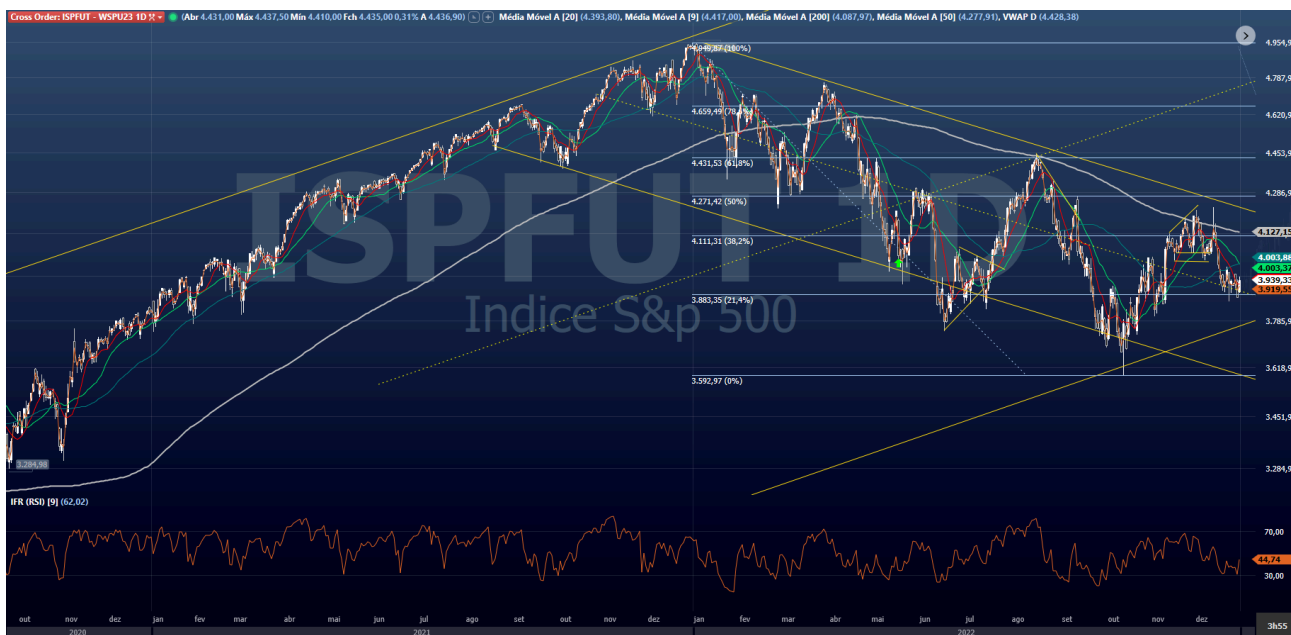
Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SAFRA	SAFRA	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	23,52	-0,11	-1,75	4,54	11.939.323,12	1,66	597.097.746,42	2,00
Sub-total Artigo 10º I			23,52	-0,11	-1,75	4,54	11.939.323,12	1,66		

Da tabela abaixo extraí-se os principais dados dos resultados do mês de fevereiro para este enquadramento.

FEVEREIRO - 2023										
Enquadramento	Descrição	Política de Investimento	Total Investido	Rentabilidade (mês)	Rentabilidade acumulada (12 meses)	Meta atuarial (mês)	Meta atuarial (12 meses)	% Benchmark (mês)	% Benchmark (12mês)	Participação na Carteira
Art. 7º, I, alínea a	Títulos do Tesouro Nacional *	100,00%	174 887 528,31	0,96%	12,25%	80,67%	114,06%	104,35%	94,23%	24,35%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	251 382 751,39	1,07%	9,74%	89,92%	90,69%	116,30%	74,92%	35%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	121 348 946,07	0,97%	10,03%	81,51%	93,39%	105,43%	77,15%	16,90%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	400 891,98	-0,33%	-58,55%	-127,73%	-645,16%	-135,87%	-550,38%	0,06%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	109 848 957,18	-8,06%	-11,44%	-777,31%	-206,52%	-7,61%	-57,58%	15,29%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	30 251 456,79	0,23%	-12,07%	19,33%	-212,38%	125,00%	-37,94%	4,21%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	16 049 917,72	0,75%	-10,41%	63,03%	-196,93%	110,01%	-43,39%	2,23%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	11 939 323,12	-1,75%	-0,73%	-247,06%	-106,80%	-224,07%	91,15%	1,66%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	358 959,01	0%	-21,11%	0,00%	-296,55%	0,00%	-262,38%	0,05%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	1 770 976,79	0,36%	10,89%	30,25%	101,40%	-80,00%	444,49%	0,25%
IPCA + 5,02 MÊS		1,19%	Ibov mês	-7,49%	MSCI mês	-0,92%	Ifix mês	-0,45%	S&P mês	-0,54%
IPCA + 5,02% 12 MÊS		10,74%	Ibov 12 meses	-7,26%	MSCI 12 meses	-8,75%	Ifix 12 meses	2,45%	S&P 12 meses	-8,25%
* Referência "CDI" mês e 12 meses		0,92%	13%							

Não houve movimentação: aplicações ou resgates, neste fundo, neste mês de fevereiro de 2023.



“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

O gráfico acima demonstra a evolução do índice americano “S&P500”, para análise quanto a sua performance, e análise das aplicações e resgates realizados por este Comitê de Investimentos conforme movimentações da tabela abaixo:

SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO

Data	Aplicação (R\$)	Aplicação (R\$)	Resgate (R\$)	Resgate (R\$)	Saldo (R\$)	Proventos (R\$)	Amortização (R\$)	Financeiro
31/12/2018	39.653,864899	6.478.351,38	0,000000	0,00	39.653,864899	0,000000	0,000000	6.478.351,38
03/03/2020	9.927,110341	2.000.000,00	0,000000	0,00	49.610,975241	0,000000	0,000000	9.995.048,62
22/05/2020	5.116,459660	1.000.000,00	0,000000	0,00	54.729,434900	0,000000	0,000000	10.692.559,59
17/09/2020	0,000000	0,00	9.115,669965	2.000.000,00	45.613,764915	0,000000	0,000000	10.007.770,13
23/02/2021	1.981,549345	500.000,00	0,000000	0,00	47.595,310261	0,000000	0,000000	12.009.644,49
28/10/2021	5.089,372560	1.537.386,94	0,000000	0,00	52.684,682861	0,000000	0,000000	15.914.898,70
20/12/2021	819,339962	250.000,00	0,000000	0,00	53.504,022790	0,000000	0,000000	16.325.342,72
08/02/2022	0,000000	0,00	22.960,295271	7.000.000,00	30.543,727554	0,000000	0,000000	9.311.992,30
19/05/2022	3.703,212329	1.000.000,00	0,000000	0,00	34.246,939810	0,000000	0,000000	9.247.900,68
15/07/2022	1.843,618695	500.000,00	0,000000	0,00	36.090,558575	0,000000	0,000000	9.787.967,19
16/09/2022	3.612,627035	1.000.000,00	0,000000	0,00	39.703,185576	0,000000	0,000000	10.990.114,73
17/10/2022	755,632722	200.000,00	0,000000	0,00	40.458,618220	0,000000	0,000000	10.708.593,48

1.9. Art.10º, II - 4.963/2022 - Fundos de Participações: O BCPREVI possui 1 fundo o qual totaliza um investimento de R\$ 358.959,01, representando 0,05% da carteira, conforme relação abaixo.

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GAVEA	GAVEA	GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	24,20	0,00	0,00	0,06	358.959,01	0,05	6.421.643,07	5,59
Sub-total Artigo 10º II			24,20	0,00	0,00	0,06	358.959,01	0,05		

A Política de Investimento do instituto permite a alocação nesta classe de ativos de até 5% da carteira, não podendo, contudo, exceder ao limite de 40% no somatório das aplicações em renda variável. Desta forma, evidencia-se o correto enquadramento neste segmento.

Estes fundos têm a peculiaridade de apresentarem resultados negativos por longos períodos, pois são compostos por projetos que carecem de períodos de desembolsos para agregação de valor. Durante e/ou ao final do projeto estes fundos realizam suas receitas, vendendo suas posições no mercado e obtendo a rentabilidade esperada pelo fundo. Não houve amortização deste investimento no mês de fevereiro.

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

Abaixo é apresentado tabela com o histórico das movimentações neste ativo, suas aplicações e histórico de amortizações, possibilitando a análise da performance do ativo ao longo do tempo:

HISTÓRICO FUNDO FIP GÁVEA		
DATA	DESCRIÇÃO	VALOR
09/02/2015	Aplicação	R\$ 100.000,00
24/08/2015	Aplicação	R\$ 23.988,01
05/02/2016	Aplicação	R\$ 20.989,51
07/10/2016	Aplicação	R\$ 71.964,02
18/10/2016	Aplicação	R\$ 41.979,01
28/11/2016	Aplicação	R\$ 41.979,01
24/01/2017	Aplicação	R\$ 137.931,03
27/06/2017	Aplicação	R\$ 107.946,03
03/10/2017	Aplicação	R\$ 83.958,02
15/02/2018	Aplicação	R\$ 59.970,02
27/09/2018	Aplicação	R\$ 35.982,01
27/02/2019	Aplicação	R\$ 14.992,50
24/10/2019	Aplicação	R\$ 58.170,91
Total aplicado		R\$ 799.850,08
29/11/2019	Resgate Amortização	R\$ 684.522,80
30/06/2020	Resgate Amortização	R\$ 59.523,71
30/04/2021	Resgate Amortização	R\$ 160.714,05
31/05/2021	Resgate Amortização	R\$ 95.237,98
29/04/2022	Resgate Amortização	R\$ 178.571,16

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253
CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

31/08/2022	Resgate Armotização	R\$ 17.197,17
30/09/2022	Resgate Armotização	R\$ 118.963,39
30/12/2022	Resgate Armotização	R\$ 71.428,45
Total Resgatado		R\$ 1.386.158,71
Rentabilidade atual (resgates - aplicações)	73,30%	R\$ 586.308,63
Meta atuarial do período (2015 a 2022)	93,74%	R\$ 749.779,46
Alcance da meta	78,20%	
31/12/2022	Saldo em extrato aplicado	R\$ 358.959,01

Não houve demais movimentações, aplicações ou resgates, neste enquadramento, neste mês, mas houve assinatura no Boletim de Subscrição em 14/06/2022, firmando compromisso de investimento junto ao fundo “FIP BTG Pactual Economia Real II” no valor de R\$ 10.000.000,00 (dez milhões), o qual ainda não houve chamada de integralização, mas já consta em reserva este recurso para fazer frente às chamadas futuras, tais recursos encontram-se em Títulos Públicos - Tesouro Selic - LFT, junto a custodiante do BCprevi, Genial Investimentos.

1.10. Art.11º - 4.963/2021 - Fundo de Investimentos Imobiliários: neste enquadramento da Resolução, o BCPREVI possui 3 fundos em que aplica nos quais totalizam um investimento de R\$ 1.770.976,79 representando 0,25% da carteira, conforme relação abaixo.

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatild. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FI IMOBILIÁRIO THE ONE	7,83	1,00	1,57	0,39	1.327.340,00	0,18	183.590.865,67	0,72
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	17,94	-4,15	-3,56	-9,96	392.061,78	0,05	768.769.144,55	0,05
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	24,27	0,45	0,45	-0,75	51.575,01	0,01	8.867.875,26	0,58
Sub-total Artigo 11º			8,25	-0,20	0,36	-2,13	1.770.976,79	0,25		

A Política de Investimentos do instituto permite a alocação de até 5% da carteira nesta classe ativos, não podendo exceder o limite de 40% do somatório das aplicações em renda variável. Desta

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

forma, evidencia-se o correto enquadramento neste segmento. Da tabela abaixo extrai-se os principais dados dos resultados deste mês para este enquadramento.

FEVEREIRO - 2023										
Enquadramento	Descrição	Política de Investimento	Total Investido	Rentabilidade (mês)	Rentabilidade acumulada (12 meses)	Meta atuarial (mês)	Meta atuarial (12 meses)	% Benchmark (mês)	Benchmark (12mês)	Participação na Carteira
Art. 7º, I, alínea a	Títulos do Tesouro Nacional *	100,00%	174 887 528,31	0,96%	12,25%	80,67%	114,06%	104,35%	94,23%	24,35%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	251 382 751,39	1,07%	9,74%	89,92%	90,69%	116,30%	74,92%	35%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	121 348 946,07	0,97%	10,03%	81,51%	93,39%	105,43%	77,15%	16,90%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	400 891,98	-0,33%	-58,55%	-127,73%	-645,16%	-135,87%	-550,38%	0,06%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	109 848 957,18	-8,06%	-11,44%	-777,31%	-206,52%	-7,61%	-57,58%	15,29%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	30 251 456,79	0,23%	-12,07%	19,33%	-212,38%	125,00%	-37,94%	4,21%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	16 049 917,72	0,75%	-10,41%	63,03%	-196,93%	110,01%	-43,39%	2,23%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	11 939 323,12	-1,75%	-0,73%	-247,06%	-106,80%	-224,07%	91,15%	1,66%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	358 959,01	0%	-21,11%	0,00%	-296,55%	0,00%	-262,38%	0,05%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	1 770 976,79	0,36%	10,89%	30,25%	101,40%	166,67%	444,49%	0,25%
IPCA + 5,02 MÊS	1,19%	Ibov mês	-7,49%	MSCI mês	-0,92%	Ifix mês	-0,45%	S&P mês	-0,54%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	10,74%	Ibov 12 meses	-7,26%	MSCI 12 meses	-8,75%	Ifix 12 meses	2,45%	S&P 12 meses	-8,25%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		0,92%	13%							

O diferencial destes fundos são as parcelas que cabem ao cotista dos rendimentos de aluguéis que são creditados em conta mensalmente e que devem ser considerados quando analisada a rentabilidade destes fundos. Não houve movimentações, aplicações e resgates nos fundos deste enquadramento no mês de fevereiro. Abaixo segue tabela com a rentabilidade de cotas e dos frutos de aluguel:

Rentabilidade Anual	Rentabilidade Anual					
Fundo Investimentos	R\$ aplic.inicial	Saldo 2023	Rentab.total	Rentab. Total (%)	meta desde a aplicação inicial *	Rentab. X Meta (%)
FI Imobiliário Rio Bravo renda Corporativa - cotação **	R\$ 615 457,96	439 595,91	-223 396,18	-36,30%	132,18%	-168,48%
FI Imobiliário Rio Bravo renda Corporativa - frutos	R\$ -	27 472,58	431 425,66	70,10%	132,18%	-62,08%
Rentabilidade do ano	R\$ -	-12 064,50	208 029,48	33,80%	132,18%	-98,38%
Bradesco-Rio Bravo The One - cotação ***	R\$ 798 000,00	1 329 820,00	622 046,97	77,95%	132,18%	-54,23%
Bradesco-Rio Bravo The One - frutos	R\$ -	62 472,00	597 696,31	74,90%	132,18%	-57,28%
Rentabilidade do ano	R\$ -	-23 104,00	1 219 743,28	152,85%	132,18%	20,67%
FII Rio Bravo Credito Imobiliário II - cotação ****	R\$ 300 000,00	51 980,40	-219 096,15	-73,03%	132,18%	-205,21%
FII Rio Bravo Credito Imobiliário II - frutos	R\$ -	1 200,38	205 375,80	68,46%	132,18%	-63,72%
Rentabilidade do ano	R\$ -	5 685,75	-13 720,35	-4,57%	132,18%	-136,75%

Cabe também uma análise simulando uma realocação dos frutos de aluguéis mensalmente, aqui, considerando o “CDI”, como indexador para analisar a viabilidade do investimento e sua contribuição na persecução da meta atuarial.

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

Fundo Investimentos	Rentabilidade Anual - com "frutos" simulados com rentabilidade pelo "CDI"					
	R\$ aplic.inicial	Saldo 2023	Rentab.total	Rentab. Total (%)	meta desde a aplicação inicial	Rentab. X Meta (%)
FI Imobiliário Rio Bravo renda Corporativa - cotação	R\$ 615 457,96	R\$ 439 595,91	-R\$ 223 396,18	-36,30%	132,18%	-168,48%
FI Imobiliário Rio Bravo renda Corporativa - frutos	R\$ -		R\$ 714 352,36	116,07%	132,18%	-16,11%
Rentabilidade do ano	R\$ -		R\$ 490 956,18	79,77%	132,18%	-52,41%
Bradesco -Rio Bravo The One - cotação	R\$ 798 000,00	R\$ 1 329 620,00	R\$ 622 046,97	77,95%	132,18%	-54,23%
Bradesco -Rio Bravo The One - frutos	R\$ -		R\$ 896 802,45	112,38%	132,18%	-19,80%
Rentabilidade do ano	R\$ -		R\$ 1 518 849,4	190,33%	132,18%	58,15%
FII Rio Bravo Credito Imobiliário II - cotação	R\$ 300 000,00	R\$ 51 980,40	-R\$ 219 096,15	-73,03%	132,18%	-205,21%
FII Rio Bravo Credito Imobiliário II - frutos	R\$ -		R\$ 330 853,67	110,28%	132,18%	-21,90%
Rentabilidade do ano	R\$ -		R\$ 111 757,52	37,25%	132,18%	-94,93%

Percebe-se que o fundo que possui posição mais relevante, "Rio Bravo The One", supera a meta do período em 58,15% desde o início da exposição.

2. ANÁLISE DO CUMPRIMENTO DA META POR SEGMENTO

A partir da análise da rentabilidade da carteira do BCPREVI, por segmento (renda fixa e renda variável) é possível verificar o quanto cada segmento contribui para o cumprimento da meta atuarial.

Com base no mês de fevereiro de 2023, conforme tabela abaixo, a renda fixa apresentou rentabilidade positiva de 1%, (R\$ 5.418.191,32), a meta atuarial do mês foi de 1,19%, (meta = R\$ 6.441.132,65), o resultado ficou inferior a meta do mês em R\$ -1.022.941,33, "-0,19%"; sendo que no acumulado de doze meses, a meta em reais é de R\$ 48.910.842,72, a rentabilidade está positiva em R\$ 45.706.555,81, porém, faltando R\$ -3.204.286,91 para atingimento da meta atuarial neste segmento, sendo que a atual composição da carteira em ativos de renda fixa totaliza um investimento de R\$ 548.020.117,75 sendo 76,30% da carteira total.

"BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo"

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

RESULTADO – FEVEREIRO/2023				META ATUARIAL		CUMPRIMENTO DA META “MÊS”		CUMPRIMENTO DA META “12 MESES”	
APLICADO (R\$)		RENTABILIDADE		%	R\$	%	R\$	%	R\$
		%	R\$						
R. FIXA	548.020.117,75	1,00	5.418.191,32	1,19	6.441.132,65	-0,19	-1.022.941,33	93,45	-3.204.286,91
R. VARIÁVEL	170.219.590,61	-5,36	-9.634.687,63		2.138.004,49	-6,55	-11.772.692,12	-176,9	-36.407.297,39
TOTAL	718.239.708,36	-0,57	-4.216.496,31		8.579.137,14	-1,76	-12.795.633,45	43,0	-39.611.584,29

Para o segmento de renda variável o BCPREVI possui um total investido de R\$ 170.219.590,61, “23,70%” da carteira. O rendimento desta classe de ativos para o mês de fevereiro de 2023, foi negativo de R\$ -9.634.687,63, frustrando a meta atuarial do mês em “-6,55%”, R\$ -11.772.692,12. No acumulado de doze meses, a rentabilidade é negativa de R\$ -15.830.001,20, a meta é de R\$ 20.577.296,19, diferença de R\$ -36.407.297,39, conforme tabela acima.

Ao analisarmos a carteira de investimento de forma conjunta (renda fixa e renda variável) o Instituto está deficitário no cumprimento da meta em 12 meses com 43%, da meta atingida, faltando R\$ -39.611.584,29 para o seu cumprimento.

Abaixo segue tabela de rentabilidade mensal comparada às suas metas dos últimos anos.

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253
CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	1,65	-0,57											1,06
IPCA + 5,02%	0,96	1,19											2,17
p.p. indexador	0,69	-1,77											-1,10
2022	-0,23	-0,40	2,95	-2,15	0,65	-2,92	1,89	1,82	-0,16	2,53	-0,79	-0,30	2,73
IPCA + 4,87%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,29	0,07	0,11	0,97	0,79	1,04	10,92
p.p. indexador	-1,17	-1,77	0,91	-3,58	-0,23	-3,99	2,17	1,74	-0,26	1,55	-1,58	-1,34	-8,19
2021	-0,91	-1,04	0,97	1,36	1,87	0,33	-0,89	-0,95	-1,44	-2,26	0,94	1,00	-1,11
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,68	1,37	1,22	16,00
p.p. indexador	-1,59	-2,28	-0,45	0,63	0,60	-0,64	-2,32	-2,29	-3,05	-3,93	-0,43	-0,22	-17,11
2020	0,22	-2,06	-10,98	3,35	2,61	3,33	3,90	-0,48	-1,89	-0,33	4,33	4,11	5,16
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,49	-2,71	-11,55	3,21	2,54	2,59	3,02	-1,20	-3,01	-1,67	2,98	2,26	-5,47
2019	2,76	0,29	0,45	1,18	2,10	3,07	1,36	0,18	2,07	2,37	-0,59	3,02	19,76
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	1,92	-0,61	-0,75	0,12	1,45	2,62	0,64	-0,44	1,63	1,74	-1,57	1,38	9,17
2018	4,20	0,36	1,03	-1,67	-2,24	-0,22	1,97	-0,52	0,71	3,59	1,00	1,28	9,70
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	3,40	-0,38	0,45	-2,38	-3,13	-1,97	1,13	-0,96	-0,21	2,63	0,75	0,67	-0,22

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	27	43,55
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	56,45
Rentabilidade	Mês	
Maior rentabilidade da Carteira	4,33	2020-11
Menor rentabilidade da Carteira	-10,98	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,76	3,23	-2,47	4,22
06 meses	2,32	5,16	-2,84	5,55
12 meses	4,48	10,74	-6,26	6,15
24 meses	4,70	28,97	-24,27	6,07
36 meses	9,98	43,45	-33,47	9,90
48 meses	25,47	58,08	-32,61	8,98
60 meses	35,63	74,08	-38,45	8,31
Desde 29/12/2017	41,84	76,77	-34,94	8,33

Considerando todo o cenário de mercado incerto para curto e médio prazo, este comitê vem tomando decisões visando proteção e rentabilização do patrimônio do BCPREVI no longo prazo fazendo Aquisições fracionadas e progressivas em ativos de bolsa brasil considerando seus preços historicamente baixos; se expondo na medida em que a legislação permite em ativos mais seguros no exterior; Fazendo movimentos na carteira de renda fixa de forma que no longo prazo tenha-se a rentabilidade almejada, visto que, no curto e médio prazo torna-se impossível considerando que todos os ativos disponíveis no mercado local apresentam-se com performances muito aquém do desejado. Cabe destacar que a carteira de renda variável chegou a representar 34,23% da carteira total e finda fevereiro representando 23,70%, devido a desvalorização dos ativos pós pandemia, mas também pelos movimentos de resgates de ativos de renda variável, alguns parciais e outros totais, na medida que foram se tornando positivos na carteira em momentos de volatilidade do mercado, visto o trabalho deste comitê nas constantes melhoras nos preços médios dos

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

ativos, devido aos constantes, fracionados e progressivos aportes em momentos estratégicos do mercado.

Não distante, vem adquirindo Títulos Públicos (Tesouro IPCA - NTN-Bs), para marcação na curva, com taxas que superam a meta atuarial e que protegem a carteira da volatilidade do mercado.

Balneário Camboriú - SC, fevereiro de 2023.

KARINE ALMEIDA GOMES
Presidente BCPREVI

DENISE RONCHI FRANCEZ
Diretor Financeiro - BCPREVI

SIDNEI LUIZ RIQUETTA
Membro Comitê Investimentos

KALINKA FLORIANO PETERS
Membro Comitê Investimentos

GUILHERME MACIEL MAFRA
Membro Comitê Investimentos

MAURINO ADRIANO VIEIRA JUNIOR
Membro Comitê Investimentos

NILTO ASSIS COPPI JUNIOR
Membro Comitê Investimentos

FAGNER ALVES DA SILVA
Membro Comitê Investimentos

GUSTAVO MANOEL ESPINDOLA
Membro Comitê Investimentos

WANRLEY CORREA COSTA
Membro Comitê Investimentos

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253
CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC