


RELATÓRIO DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS BCPREVI

MAIO - 2023

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

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 4,14% da carteira R\$ 31.366.346,86, 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 5,69% e Selic hoje está dada em 12,50%, busca-se o prêmio desta oportunidade.

 BANCO CENTRAL DO BRASIL		Focus Relatório de Mercado																															
Expectativas de Mercado				2 de junho de 2023																													
				▲ Aumento ▼ Diminuição = Estabilidade																													
Mediana - Agregado		2023							2024							2025							2026										
		Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***		Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***		Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***		Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	
IPCA (variação %)		6,02	5,71	5,69	▼ (3)	153	5,49	49		4,16	4,13	4,12	▼ (1)	149	4,10	48		4,00	4,00	4,00	= (10)	125				4,00	4,00	4,00	= (11)	116			
PIB Total (variação % sobre ano anterior)		1,00	1,26	1,68	▲ (4)	110	2,06	39		1,40	1,30	1,28	▼ (1)	101	1,22	37		1,80	1,70	1,70	= (3)	77			1,80	1,80	1,90	▲ (1)	71				
Câmbio (R\$/US\$)		5,20	5,11	5,10	▼ (3)	123	5,10	36		5,25	5,17	5,16	▼ (2)	120	5,11	36		5,25	5,20	5,20	= (3)	82			5,30	5,25	5,25	= (1)	77				
Selic (% a.a.)		12,50	12,50	12,50	= (7)	144	12,50	43		10,00	10,00	10,00	= (16)	138	10,00	42		9,00	9,00	9,00	= (17)	110			9,00	9,00	9,00	= (1)	102				
IGP-M (variação %)		2,14	0,67	-0,08	▼ (8)	83	-0,11	23		4,14	4,05	4,10	▲ (1)	70	4,10	18		4,00	4,00	4,00	= (15)	59			4,00	4,00	4,00	= (15)	58				
IPCA Administrados (variação %)		10,70	9,44	9,41	▼ (5)	102	9,20	28		4,50	4,50	4,53	▲ (1)	84	4,50	25		4,00	4,00	4,00	= (11)	56			4,00	4,00	4,00	= (14)	51				
Conta corrente (US\$ bilhões)		-47,70	-47,06	-47,53	▼ (1)	30	-49,30	9		-52,25	-52,40	-53,00	▼ (1)	28	-53,00	8		-50,20	-49,85	-50,30	▼ (1)	17			-50,96	-51,00	-52,00	▼ (1)	15				
Balança comercial (US\$ bilhões)		60,00	60,00	58,75	▼ (1)	30	56,00	9		55,00	55,00	55,30	▲ (2)	26	55,00	7		55,00	59,50	60,00	▲ (3)	15			51,58	55,00	56,00	▲ (3)	14				
Investimento direto no país (US\$ bilhões)		80,00	80,00	80,00	= (23)	25	80,00	10		80,00	80,00	80,00	= (18)	23	80,00	9		81,50	82,00	82,00	= (1)	15			85,00	80,00	80,00	= (2)	13				
Dívida líquida do setor público (% do PIB)		60,70	61,00	60,70	▼ (1)	27	61,00	9		64,10	64,50	64,45	▼ (2)	24	64,00	7		67,00	66,75	66,25	▼ (2)	18			67,20	67,85	67,45	▼ (1)	16				
Resultado primário (% do PIB)		-1,00	-1,10	-1,10	= (1)	43	-1,10	15		-0,80	-0,70	-0,70	= (2)	40	-0,84	14		-0,39	-0,21	-0,34	▼ (1)	30			-0,10	-0,20	-0,20	= (1)	27				
Resultado nominal (% do PIB)		-7,80	-7,85	-7,93	▼ (2)	26	-7,80	9		-7,00	-7,00	-7,00	= (6)	24	-7,05	8		-6,00	-6,05	-6,20	▼ (2)	16			-5,75	-5,50	-5,65	▼ (1)	14				
* 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																																	
<div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div></div>																																	

* 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

— 2023 — 2024 — 2025 — 2026

“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 maio de 2023 ficou em R\$ 188.733.908,25, (24,86%) 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	0,02	0,05	1,12	5,37	9.243.289,26	1,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,780000%)	0,48	0,00	0,59	5,25	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (8,145000%)	0,49	0,00	0,68	6,09	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	LFT 010324	0,02	0,05	1,12	5,37	279.293,91	0,04
TESOURO NACIONAL	LFT 010328	0,12	0,05	1,23	3,54	725.748,95	0,10
TESOURO NACIONAL	LFT 010329	0,39	0,05	0,54	0,54	19.677.784,13	2,59
TESOURO NACIONAL	LFT 010927	0,70	0,05	1,24	5,52	1.440.230,61	0,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,000000%)	0,47	0,04	0,99	5,42	1.062.595,90	0,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,260000%)	0,47	0,04	1,01	5,52	1.057.276,98	0,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,612000%)	0,47	0,04	1,04	5,67	6.583.969,08	0,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,880000%)	0,47	0,04	1,06	5,78	1.025.189,75	0,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,050000%)	0,47	0,04	1,00	5,44	2.172.209,36	0,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,330000%)	0,47	0,04	1,02	5,55	2.174.843,99	0,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,713000%)	0,47	0,04	1,05	5,71	2.059.049,67	0,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	0,47	0,04	1,05	5,71	2.119.072,60	0,28

“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 (6,310000%)	0,47	0,04	1,10	5,95	5.125.356,57	0,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	3,07	0,04	1,11	5,99	5.147.414,39	0,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,500000%)	3,13	0,04	1,12	4,52	13.943.454,31	1,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,520000%)	3,12	0,04	1,12	3,35	4.027.111,76	0,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,070000%)	0,47	0,04	1,00	5,44	3.185.465,51	0,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,360000%)	0,47	0,04	1,02	5,56	3.188.316,65	0,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,580000%)	0,47	0,04	1,04	5,65	2.991.793,38	0,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,710000%)	0,47	0,04	1,05	5,71	3.105.371,94	0,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,820000%)	0,47	0,04	1,06	5,75	5.209.389,82	0,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,020000%)	0,47	0,04	1,08	5,83	5.144.994,81	0,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,131000%)	2,99	0,04	1,09	5,88	10.411.280,12	1,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,330000%)	0,47	0,04	1,10	5,96	5.122.581,17	0,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,47	0,04	1,01	5,53	700.158,79	0,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,502000%)	0,47	0,04	1,03	5,62	5.071.299,02	0,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,850000%)	0,47	0,04	1,06	5,76	648.255,52	0,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,000000%)	0,47	0,04	0,99	5,42	1.427.797,19	0,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,310000%)	0,47	0,04	1,02	5,54	1.463.017,77	0,19
TESOURO	NTN-B 150840 (5,700000%)	0,47	0,04	1,05	5,70	1.430.746,76	0,19

“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		
NACIONAL							
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,230000%)	0,47	0,04	1,09	5,92	5.125.456,53	0,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,090000%)	0,47	0,04	1,00	5,45	2.377.603,24	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,350000%)	0,47	0,04	1,02	5,56	2.441.843,58	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,580000%)	0,47	0,04	1,04	5,65	2.310.375,87	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	0,47	0,04	1,05	5,71	2.387.236,50	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,859000%)	0,47	0,04	1,06	5,77	5.204.739,41	0,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,020000%)	0,47	0,04	1,08	5,83	5.148.262,38	0,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,330000%)	0,47	0,04	1,10	5,96	5.123.548,38	0,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,500000%)	6,08	0,04	1,12	4,35	16.194.349,98	2,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,880000%)	0,47	0,04	1,06	5,78	5.209.635,67	0,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,350000%)	0,47	0,04	1,10	5,97	10.246.497,04	1,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,43	0,04	1,10	5,80	188.733.908,25	24,86

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”, bem como as compras e vendas realizadas em maio.

COMPRA EM: 16/05/2023	LFT - 75211-0	LFT - 90201-0
PU's LFTs:	13.094,1525550	13.094,1525550
QDD LFTs:	466,00	1.219,00
(57) - R\$ Totais	6.101.875,09	15.961.771,96
Taxas:	SELIC	SELIC

COMPRA EM: 01/06/2023	15/05/2024
PU's NTN-B:	4.125,0205720
QDD NTN-B:	2.930,00
(59) - R\$ Totais	12.086.310,28
Taxas - IPCA + :	7,650

VENDA EM: 29/05/2023	LFT - 75211-0	LFT - 90201-0
PU's LFTs:		13.286,2774800
QDD LFTs:		377,00
(58) - R\$ Totais	0,00	5.008.926,61
Taxas:	SELIC	SELIC

VENDA EM: 31/05	LFT - 75211-0	LFT - 90201-0
PU's LFTs:	13.299,7499760	13.221,8212237
QDD LFTs:	152,00	760,00
(58) - R\$ Totais	2.021.561,996	10.048.584,13
Taxas:	SELIC	SELIC

“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

SALDO EM TÍTULOS PÚBLICOS e LIMITE DE APLICAÇÃO POSSÍVEL SEGUNDO "ALM" e DPIN									
VENCIMENTOS	2.024	8/15/2030	5/15/2035	8/15/2040	5/15/2045	8/15/2050	5/15/2055	15/08/2060	TOTAL
(a.18) TOTAL = 59 + (a.17)	12.086.310,28	6.023.050,79	9.585.173,78	8.920.736,00	36.221.505,82	39.452.616,54	37.375.934,63	19.317.437,70	168.982.765,54
(60) Alocação possível "ALM novo" (60 = Y - (a.18))	-2.097.088,09	1.321.965,52	1.285.450,36	64.529.427,16	65.482.486,77	-9.191.149,31	212.648.420,77	-13.245.557,55	320.733.955,65
(61) Alocação possível "DPIN 2023" (61 = X - a.18)	-12.086.310,28	-2.675.608,85	-4.537.443,87	25.031.889,42	18.081.441,24	32.756.488,22	51.410.977,84	-11.294.203,84	96.687.229,88
LFT	26.787.292,01								
								TOTAL + LFTs	195.770.057,56

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.

Art.7º, I, Alínea B - 4.963/2021 - Fundos 100% TP Referenciado: neste enquadramento da Resolução o BCPREVI ao término de maio de 2023 possui 22 fundos, e um total aplicado de R\$ 248.440.473,02, representando 32,73% 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				
BANRISUL	BANRISUL	BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,07	0,01	0,89	0,89	88,21	0,00	1.537.032.580,71	0,00
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,46	0,02	1,88	6,83	19.398.652,93	2,56	5.928.019.904,28	0,33
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,02	0,05	1,14	5,34	25.224.843,53	3,32	40.509.656.994,14	0,06
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2,23	0,01	-0,01	4,57	281.357,80	0,04	186.506.507,65	0,15

“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

CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,94	0,04	1,09	2,82	7.188.080,68	0,95	241.739.871,88	2,97
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,47	0,04	1,09	5,91	3.574.124,66	0,47	273.386.984,64	1,31
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	5,30	-0,02	2,49	8,65	2.891.861,91	0,38	349.757.517,59	0,83
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,46	0,00	0,56	5,85	3.770.900,86	0,50	1.457.574.277,07	0,26
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,29	-0,02	2,51	8,65	3.977.506,45	0,52	222.800.133,95	1,79
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,26	-0,01	2,58	8,70	25.006.529,22	3,29	5.943.377.738,68	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,34	-0,01	2,53	8,69	3.922.006,90	0,52	3.621.007.048,62	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,45	0,00	0,63	5,91	30.481.320,42	4,02	8.623.099.025,61	0,35
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,27	-0,02	4,12	10,99	12.834.560,77	1,69	856.178.470,48	1,50
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,27	-0,02	3,98	10,82	8.332.774,99	1,10	1.104.911.445,71	0,75
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,39	0,03	1,82	6,81	113.259,68	0,01	181.973.613,36	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,47	0,00	0,61	5,90	45.849.391,49	6,04	5.869.025.714,56	0,78
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2,23	0,01	-0,01	4,56	1.156.525,72	0,15	103.564.090,90	1,12
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,62	0,04	1,81	6,03	11.201.841,27	1,48	5.078.181.389,68	0,22
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	5,20	-0,02	2,69	9,30	1.348.207,42	0,18	396.875.240,45	0,34
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,02	0,05	1,11	5,25	34.868.857,82	4,59	10.734.055.017,35	0,32
BANRISUL	BANRISUL	BANRISUL SOBERANO FI RF SIMPLES LONGO PRAZO	0,04	0,05	1,13	1,13	2.443.574,92	0,32	395.120.852,62	0,62
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,02	0,05	1,11	5,29	4.574.205,37	0,60	5.158.691.701,67	0,09
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,02	0,02	1,49	6,61	248.440.473,02	32,73		

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

MAIO - 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%	188 733 908,25	1,10%	10,71%	166,67%	118,47%	98,21%	79,45%	24,86%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	248 440 473,02	1,49%	9,77%	225,76%	108,08%	133,04%	72,48%	32,73%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	133 923 228,04	2,03%	11,93%	307,58%	131,97%	181,25%	88,50%	17,64%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	400 696,34	0,57%	-10,07%	86,36%	-211,39%	50,89%	-174,70%	0,05%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	112 790 585,03	7,66%	-5,29%	1160,61%	-158,52%	204,81%	-95,20%	14,86%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	6 066 712,90			0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,80%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	34 990 224,98	3,63%	13,09%	550,00%	144,80%	648,21%	195,37%	4,61%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	17 623 203,63	5,80%	13,81%	878,79%	152,77%	155,08%	-509,59%	2,32%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	13 231 530,92	1,10%	10,35%	166,67%	114,49%	50,93%	115,00%	1,74%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	939 525,83	-0,72%	-17,33%	-209,09%	-291,70%	-164,29%	-228,56%	0,12%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	1 917 040,83	5,76%	18%	872,73%	199,12%	106,08%	263,16%	0,25%
IPCA + 5,02% MÊS	0,66%	Ibov mês	3,74%	MSCI mês	0,56%	Ifix mês	5,43%	S&P mês	2,16%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,04%	Ibov 12 meses	-2,71%	MSCI 12 meses	6,70%	Ifix 12 meses	6,84%	S&P 12 meses	9%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		1,12%	13,48%							

Neste enquadramento, no mês de maio, 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\$)
BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.685,05	1.123.180,23	-1.125.303,28	0,00	88,21	526,21	526,21
BANRISUL SOBERANO FI RF SIMPLES LONGO PRAZO	7.553.570,48	1.618.914,56	-6.759.014,27	0,00	2.443.574,92	30.104,15	30.104,15
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	19.039.905,72	0,00	0,00	0,00	19.398.652,93	358.747,21	1.240.016,22
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	24.378.531,73	0,00	0,00	0,00	25.006.529,22	627.997,49	2.001.732,89
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	111.239,34	0,00	0,00	0,00	113.259,68	2.020,34	7.221,34
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	45.511.135,30	60.135,67	0,00	0,00	45.849.391,49	278.120,52	2.669.194,87
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	12.326.927,16	0,00	0,00	0,00	12.834.560,77	507.633,61	1.271.197,72
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	281.372,75	0,00	0,00	0,00	281.357,80	-14,95	12.495,42
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	1.156.616,11	0,00	0,00	0,00	1.156.525,72	-90,39	51.272,33
BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	34.485.448,90	0,00	0,00	0,00	34.868.857,82	383.408,92	1.738.804,94
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	2.821.536,93	0,00	0,00	0,00	2.891.861,91	70.324,98	230.183,55
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.110.918,72	0,00	0,00	0,00	7.188.080,68	77.161,96	197.310,08
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	3.535.528,10	0,00	0,00	0,00	3.574.124,66	38.596,56	201.242,30
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.290.324,52	0,00	0,00	0,00	30.481.320,42	190.995,90	1.701.237,26
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.013.453,59	0,00	0,00	0,00	8.332.774,99	319.321,40	813.582,61
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.825.063,41	0,00	0,00	0,00	3.922.006,90	96.943,49	313.442,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	11.003.227,12	0,00	0,00	0,00	11.201.841,27	198.614,15	636.945,66
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	3.880.266,40	0,00	0,00	0,00	3.977.506,45	97.240,05	316.546,80
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	23.878.960,49	10.890.656,54	-9.826.050,31	0,00	25.224.843,53	281.276,81	1.530.406,11
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	3.749.841,81	0,00	0,00	0,00	3.770.900,86	21.059,05	208.348,99
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	1.312.841,58	0,00	0,00	0,00	1.348.207,42	35.365,84	114.702,15
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	4.721.826,19	0,00	-200.000,00	0,00	4.574.205,37	52.379,18	247.425,99
					248.440.473,02	3.667.732,48	

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

Art.7º, III, Alínea “a” - 4.963/21 - Fundos de Renda Fixa: neste enquadramento da Resolução o BCPREVI aplica em 12 fundos e um total aplicado de R\$ 133.923.228,04, representando 17,64% 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				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	0,11	0,05	0,05	0,05	5.002.347,22	0,66	224.228.668,39	2,23
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,81	-0,03	2,76	8,93	15.059.118,67	1,98	320.650.657,68	4,70
BB	BB	BB PREV RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V	1,49	0,00	0,56	5,18	0,00	0,00		
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,05	1,18	5,25	1.301.404,11	0,17	15.982.419.153,18	0,01

“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

BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,55	0,02	1,75	6,58	4.096.279,98	0,54	180.011.491,43	2,28
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	1,15	5,29	18.817.948,02	2,48	15.420.425.695,62	0,12
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	8,35	-0,03	4,11	11,03	7.859.739,81	1,04	114.778.715,33	6,85
BRAM	BRABESCO	BRABESCO H FI RF NILO	6,06	-0,00	2,80	8,89	24.563.653,72	3,24	240.976.990,27	10,19
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,48	0,00	0,60	5,85	6.127.209,49	0,81	986.720.175,82	0,62
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	4,55	0,02	2,30	7,41	5.718.625,62	0,75	255.552.080,18	2,24
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	1,54	0,09	1,95	5,05	13.880.595,24	1,83	764.413.554,48	1,82
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,73	0,05	1,49	5,73	31.496.306,16	4,15	2.873.372.304,81	1,10
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,47	0,03	2,03	6,98	133.923.228,04	17,64		

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

MAIO - 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%	188 733 908,25	1,10%	10,71%	166,67%	118,47%	98,21%	79,45%	24,86%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	248 440 473,02	1,49%	9,77%	225,76%	108,08%	133,04%	72,48%	32,73%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	133 923 228,04	2,03%	11,93%	307,58%	131,97%	181,25%	88,50%	17,64%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	400 696,34	0,57%	-10,07%	86,36%	-211,39%	50,89%	-174,70%	0,05%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	112 790 585,03	7,66%	-5,29%	1160,61%	-158,52%	204,81%	-95,20%	14,86%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	6 066 712,90			0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,80%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	34 990 224,98	3,63%	13,09%	550,00%	144,80%	648,21%	195,37%	4,61%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	17 623 203,63	5,80%	13,81%	878,79%	152,77%	155,08%	-509,59%	2,32%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	13 231 530,92	1,10%	10,35%	166,67%	114,49%	50,93%	115,00%	1,74%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	939 525,83	-0,72%	-17,33%	-209,09%	-291,70%	-164,29%	-228,56%	0,12%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	1 917 040,83	5,76%	18%	872,73%	199,12%	106,08%	263,16%	0,25%
IPCA + 5,02% MÊS	0,66%	Ibov mês	3,74%	MSCI mês	0,56%	Ifix mês	5,43%	S&P mês	2,16%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,04%	Ibov 12 meses	-2,71%	MSCI 12 meses	6,70%	Ifix 12 meses	6,84%	S&P 12 meses	9%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		1,12%	13,48%							

Neste enquadramento, no mês de maio, 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	7.112.845,76	0,00	-7.152.967,59	0,00	0,00	40.121,83	352.588,75
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.690.635,56	7.152.967,59	-200.000,00	0,00	18.817.948,02	174.344,87	607.119,67
BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	5.590.260,42	0,00	0,00	0,00	5.718.625,62	128.365,20	394.303,88
BRABESCO H FI RF NILO	23.893.658,23	0,00	0,00	0,00	24.563.653,72	669.995,49	2.006.438,56
BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	6.090.911,99	0,00	0,00	0,00	6.127.209,49	36.297,50	338.476,02
BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	4.025.944,63	0,00	0,00	0,00	4.096.279,98	70.335,35	253.002,09
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	7.549.724,87	0,00	0,00	0,00	7.859.739,81	310.014,94	780.714,98
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.277.894,04	10.028,78	-1.632,10	0,00	1.301.404,11	15.113,39	55.750,60
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	13.615.243,87	0,00	0,00	0,00	13.880.595,24	265.351,37	666.761,03
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	31.032.560,50	0,00	0,00	0,00	31.496.306,16	463.745,66	1.706.601,37
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	14.654.047,71	0,00	0,00	0,00	15.059.118,67	405.070,96	1.234.479,45
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	0,00	5.000.000,00	0,00	0,00	5.002.347,22	2.347,22	2.347,22
					133.923.228,04	2.581.103,78	

“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

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

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\$ 400.696,34, representando 0,05% da carteira, conforme relação abaixo.

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	PIATÃ FI RF LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	75,19	0,57	0,57	-0,51	400.696,34	0,05	22.608.395,89	1,77
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			75,19	0,57	0,57	-0,51	400.696,34	0,05		

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 PIATÃ		
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

“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

17/07/2020	Recuperação de crédito	R\$ 28.573,85
10/06/2022	Recuperação de crédito	R\$ 212.910,50

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\$ 112.790.585,03, representando 14,86% 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	22,82	-0,52	10,50	3,21	928.695,79	0,12	109.040.627,73	0,85
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	27,73	0,90	14,77	5,15	15.577.362,12	2,05	306.948.964,38	5,07
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,29	-0,39	4,71	-0,75	4.101.595,60	0,54	393.973.278,51	1,04
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	32,37	0,58	16,51	24,10	5.622.164,54	0,74	181.299.817,26	3,10
CONSTANCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	18,78	-0,35	6,03	3,40	622.556,73	0,08	1.189.891.343,79	0,05
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	21,32	-0,32	7,44	-2,50	8.848.319,32	1,17	1.350.305.370,46	0,66
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,82	-0,34	2,54	-5,30	6.008.333,53	0,79	204.109.039,01	2,94
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	28,30	0,08	11,99	-1,81	4.401.923,75	0,58	127.113.148,70	3,46
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,66	-0,83	2,30	1,88	3.783.439,26	0,50	889.314.500,47	0,43
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,88	0,65	13,18	4,64	8.486.055,39	1,12	618.934.183,67	1,37
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	20,98	-0,57	3,58	-1,45	16.970.347,83	2,24	410.462.247,08	4,13
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,83	-0,61	0,64	-6,49	9.082.441,07	1,20	1.449.896.602,59	0,63
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	23,05	-0,21	5,24	-3,56	4.035.063,29	0,53	317.640.425,26	1,27
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	21,31	-0,58	3,74	-1,25	1.330.286,09	0,18	300.115.487,76	0,44
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	21,12	-0,03	5,90	-2,26	13.181.765,13	1,74	414.831.621,42	3,18
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	23,07	-0,23	5,00	-4,28	2.832.994,27	0,37	162.469.441,52	1,74
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	31,45	0,36	14,27	1,78	6.055.524,90	0,80	252.813.444,97	2,40
TRIGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	21,48	-0,24	14,35	1,85	921.716,42	0,12	205.007.805,52	0,45
Sub-total Artigo 8º I			22,11	-0,03	7,66	0,45	112.790.585,03	14,86		

A Política de Investimento do instituto permite até 40% de alocação da carteira em ativos enquadrados neste artigo, não podendo ultrapassar o limite de 40% no somatório dos investimentos em renda variável, em razão do pró-gestão nível II. 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

MAIO - 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%	188 733 908,25	1,10%	10,71%	166,67%	118,47%	98,21%	79,45%	24,86%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	248 440 473,02	1,49%	9,77%	225,76%	108,08%	133,04%	72,48%	32,73%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	133 923 228,04	2,03%	11,93%	307,58%	131,97%	181,25%	88,50%	17,64%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	400 696,34	0,57%	-10,07%	86,36%	-211,39%	50,89%	-174,70%	0,05%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	112 790 585,03	7,66%	-5,29%	1160,61%	-158,52%	204,81%	-95,20%	14,86%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	6 066 712,90			0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,80%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	34 990 224,98	3,63%	13,09%	550,00%	144,80%	648,21%	195,37%	4,61%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	17 623 203,63	5,80%	13,81%	878,79%	152,77%	155,08%	-509,59%	2,32%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	13 231 530,92	1,10%	10,35%	166,67%	114,49%	50,93%	115,00%	1,74%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	939 525,83	-0,72%	-17,33%	-209,09%	-291,70%	-164,29%	-228,56%	0,12%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	1 917 040,83	5,76%	18%	872,73%	199,12%	106,08%	263,16%	0,25%
IPCA + 5,02% MÊS	0,66%	Ibov mês	3,74%	MSCI mês	0,56%	Ifix mês	5,43%	S&P mês	2,16%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,04%	Ibov 12 meses	-2,71%	MSCI 12 meses	6,70%	Ifix 12 meses	6,84%	S&P 12 meses	9%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		1,12%	13,48%							

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	5.763.422,81	100.000,00	0,00	0,00	6.008.333,53	144.910,72	-326.204,61
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	13.297.832,52	300.000,00	0,00	0,00	15.577.362,12	1.979.529,60	776.172,45
BRABESCO F I A SELECTION	12.351.960,18	100.000,00	0,00	0,00	13.181.765,13	729.804,95	-295.922,27
BRABESCO FIA IBOVESPA PLUS	1.282.388,63	0,00	0,00	0,00	1.330.286,09	47.897,46	-16.788,84
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	8.141.586,15	100.000,00	0,00	0,00	8.848.319,32	606.733,17	-215.302,64
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	587.177,08	0,00	0,00	0,00	622.556,73	35.379,65	30.952,14
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	16.383.158,31	0,00	0,00	0,00	16.970.347,83	587.189,52	-249.649,42
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	4.733.890,78	100.000,00	0,00	0,00	5.622.164,54	788.273,76	1.070.680,45
FIA CAIXA CONSUMO	3.837.920,51	100.000,00	0,00	0,00	4.401.923,75	464.003,24	-63.557,23
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.405.205,17	100.000,00	0,00	0,00	8.486.055,39	980.850,22	382.055,80
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.698.196,41	0,00	0,00	0,00	3.783.439,26	85.242,85	69.720,81
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	9.025.126,90	0,00	0,00	0,00	9.082.441,07	57.314,17	-630.532,36
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	3.821.831,58	100.000,00	0,00	0,00	4.101.595,60	179.764,02	-27.208,21
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	3.834.239,71	0,00	0,00	0,00	4.035.063,29	200.823,58	-149.080,83
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.600.844,24	100.000,00	0,00	0,00	2.832.994,27	132.150,03	-113.119,15
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	5.208.362,50	100.000,00	0,00	0,00	6.055.524,90	747.162,40	119.474,97
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	752.775,18	100.000,00	0,00	0,00	928.695,79	75.920,61	21.107,73
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	718.801,24	100.000,00	0,00	0,00	921.716,42	102.915,18	15.023,68
					112.790.585,03	7.945.865,13	

Art.8º, II, - 4.963/2021 - Fundos de Índice de Ações: neste enquadramento da Resolução o BCPREVI possui 3 fundos com um total investido de R\$ 6.066.712,90, correspondendo à 0,80% 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 8º II (Fundos de Índice de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	IT NOW IDIV FUNDO INDICE - DIVO11	0,00	0,00	0,00	0,00	5.621.795,90	0,74	430.398.769,60	1,31
ITAU	ITAU	IT NOW IBOVESPA FUNDO DE INDICE - BOVV11	0,00	0,00	0,00	0,00	193.512,00	0,03	3.228.417.499,81	0,01
ITAU	ITAU	IT NOW S&P500 TRN FUNDO DE INDICE - SPXI11	13,47	0,00	0,00	0,00	251.405,00	0,03	559.677.344,76	0,04
Sub-total Artigo 8º II			0,00	0,00	0,00		6.066.712,90	0,80		

No mês de maio, ocorreram as seguintes aplicações neste enquadramento:

Artigo 8º II (Fundos de Índice de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE INDICE - BOVV11	0,00	193.512,00	0,00	0,00	193.512,00	0,00	0,00
IT NOW IDIV FUNDO INDICE - DIVO11	0,00	5.621.795,90	0,00	0,00	5.621.795,90	0,00	0,00
IT NOW S&P500 TRN FUNDO DE INDICE - SPXI11	0,00	251.405,00	0,00	0,00	251.405,00	0,00	0,00
					6.066.712,90	0,00	

Art.9º, II, - 4.963/2021 - Segmento de Investimentos no Exterior: neste enquadramento da

Resolução o BCPREVI possui 9 fundos os quais totalizam um investimento de R\$ 34.990.224,98 representando 4,61% 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				
XP	BNP PARIBAS	SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	14,41	-1,05	4,47	-7,35	333.968,07	0,04	173.719.664,87	0,19
XP	BNP PARIBAS	SYSTEMATICA BLUE TREND DOLAR ADVISORY FIC DE FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,11	-0,46	5,62	-10,80	326.718,33	0,04	28.057.602,19	1,16
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	27,64	-0,28	5,35	13,70	10.020.950,23	1,32	179.476.313,56	5,58
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	27,73	0,29	3,81	16,47	3.042.802,37	0,40	221.795.564,18	1,37
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	27,09	-1,35	4,29	19,90	3.564.138,75	0,47	68.840.153,06	5,18
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	25,09	-0,68	-1,42	1,00	2.475.921,29	0,33	121.219.144,58	2,04
ITAU	ITAU	ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,40	-0,55	0,72	4,02	5.939.603,77	0,78	344.089.403,83	1,73
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	35,10	-0,36	6,84	21,04	6.528.882,81	0,86	658.978.226,88	0,99
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	18,64	-0,74	-0,26	11,32	2.757.239,36	0,36	318.643.175,62	0,87
Sub-total Artigo 9º II			22,75	-0,47	3,63	12,65	34.990.224,98	4,61		

“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

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

MAIO - 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%	188 733 908,25	1,10%	10,71%	166,67%	118,47%	98,21%	79,45%	24,86%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	248 440 473,02	1,49%	9,77%	225,76%	108,08%	133,04%	72,48%	32,73%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	133 923 228,04	2,03%	11,93%	307,58%	131,97%	181,25%	88,50%	17,64%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	400 696,34	0,57%	-10,07%	86,36%	-211,39%	50,89%	-174,70%	0,05%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	112 790 585,03	7,66%	-5,29%	1160,61%	-158,52%	204,81%	-95,20%	14,86%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	6 066 712,90			0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,80%
Art. 9º,II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	34 990 224,98	3,63%	13,09%	550,00%	144,80%	648,21%	195,37%	4,61%
Art. 9º,III	Ações - BDR Nível I	10,00%	17 623 203,63	5,80%	13,81%	878,79%	152,77%	155,08%	-509,59%	2,32%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	13 231 530,92	1,10%	10,35%	166,67%	114,49%	50,93%	115,00%	1,74%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	939 525,83	-0,72%	-17,33%	-209,09%	-291,70%	-164,29%	-228,56%	0,12%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	1 917 040,83	5,76%	18%	872,73%	199,12%	106,08%	263,16%	0,25%
IPCA + 5,02% MÊS	0,66%	Ibov mês	3,74%	MSCI mês	0,56%	Ifix mês	5,43%	S&P mês	2,16%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,04%	Ibov 12 meses	-2,71%	MSCI 12 meses	6,70%	Ifix 12 meses	6,84%	S&P 12 meses	9%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		1,12%	13,48%							

Neste enquadramento, no mês de maio, houve as seguintes movimentações de aplicações e resgates.

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9.212.854,75	300.000,00	0,00	0,00	10.020.950,23
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	2.832.542,32	100.000,00	0,00	0,00	3.042.802,37
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3.319.040,52	100.000,00	0,00	0,00	3.564.138,75
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	2.308.641,04	200.000,00	0,00	0,00	2.475.921,29
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5.795.446,71	100.000,00	0,00	0,00	5.939.603,77
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	6.013.468,12	100.000,00	0,00	0,00	6.528.882,81
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	2.565.587,67	200.000,00	0,00	0,00	2.757.239,36
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	221.717,04	100.000,00	0,00	0,00	333.968,07
SYSTEMATICA BLUE TREND DOLAR ADVISORY FIC DE FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	211.120,14	100.000,00	0,00	0,00	326.718,33
	32.480.418,31	1.300.000,00	0,00	0,00	34.990.224,98

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\$ 17.623.203,63 representando 2,32% da carteira, conforme demonstrado na 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 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatild. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	24,59	0,03	5,80	14,00	17.623.203,63	2,32	2.053.133.646,70	0,86
Sub-total Artigo 9º III			24,59	0,03	5,80	14,00	17.623.203,63	2,32		

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

MAIO - 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%	188 733 908,26	1,10%	10,71%	166,67%	118,47%	98,21%	79,45%	24,86%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	248 440 473,02	1,49%	9,77%	225,76%	108,08%	133,04%	72,48%	32,73%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	133 923 228,04	2,03%	11,93%	307,58%	131,97%	181,26%	88,50%	17,64%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	400 898,34	0,57%	-10,07%	88,36%	-211,39%	50,89%	-174,70%	0,05%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	112 790 585,03	7,86%	-5,29%	1160,61%	-158,52%	204,81%	-95,20%	14,88%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	6 066 712,90			0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,80%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	34 990 224,98	3,63%	13,09%	550,00%	144,80%	648,21%	195,37%	4,61%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	17 623 203,63	5,80%	13,81%	878,79%	152,77%	155,08%	809,59%	2,32%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	13 231 530,92	1,10%	10,35%	166,67%	114,46%	50,93%	115,00%	1,74%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	939 525,83	-0,72%	-17,33%	-200,09%	-291,70%	-164,29%	-228,56%	0,12%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	1 917 040,83	5,76%	18%	872,73%	199,12%	106,08%	283,16%	0,25%
IPCA + 5,02% MÊS	0,66%	Ibov mês	3,74%	MSCI mês	0,56%	Ifix mês	5,43%	S&P mês	2,16%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,04%	Ibov 12 meses	-2,71%	MSCI 12 meses	6,70%	Ifix 12 meses	6,84%	S&P 12 meses	9%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		1,12%	13,48%							

Neste enquadramento, no mês de maio de 2023, ocorreram as seguintes movimentações:

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	16.556.915,09	100.000,00	0,00	0,00	17.623.203,63	966.288,54	2.152.038,20
					17.623.203,63	966.288,54	

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.

“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

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\$ 13.231.530,92, representando 1,74% 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.

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	20,76	-0,46	1,10	12,08	13.231.530,92	1,74	537.949.934,94	2,46
Sub-total Artigo 10º I			20,76	-0,46	1,10	12,08	13.231.530,92	1,74		

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

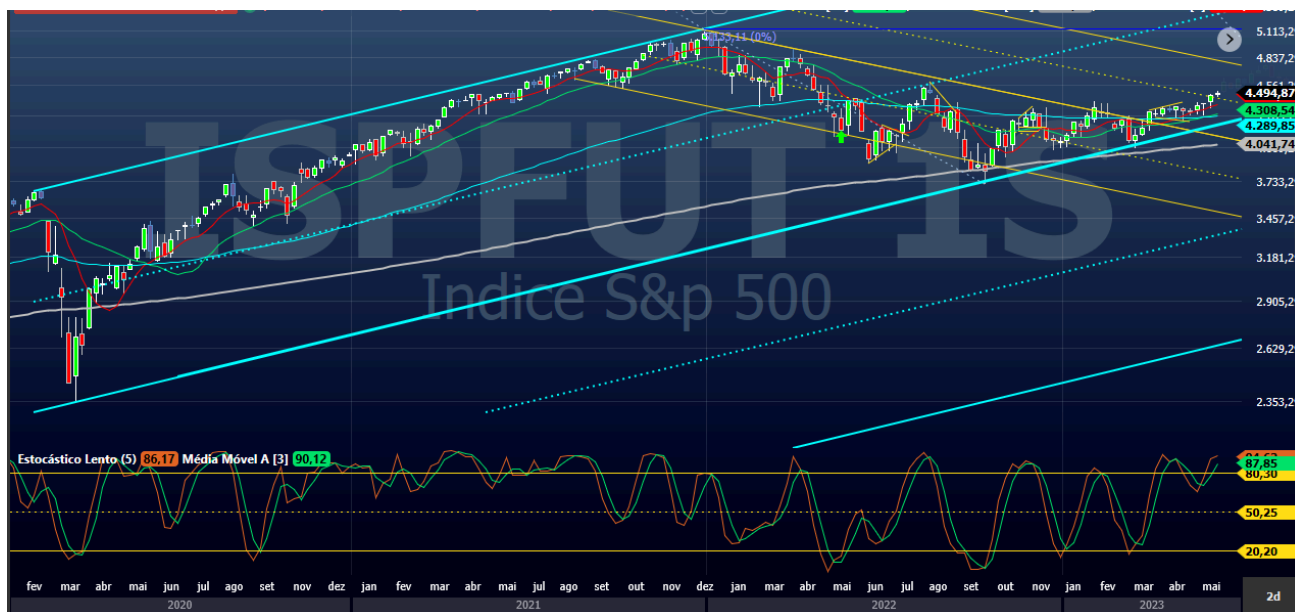
MAIO - 2023										
Enquadramento	Descrição	Política de Investimento	Total Investido	Rentabilidade (mês)	Rentabilidade acumulada (12 meses)	Meta atuarial (mês)	Meta atuarial (12 meses)	% Benchmark (mês)	% Benchmark (12mês)	Participação na Carteira
Art. 7º, I, alínea a	Títulos do Tesouro Nacional *	100,00%	188 733 908,25	1,10%	10,71%	166,67%	118,47%	98,21%	79,45%	24,86%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	248 440 473,02	1,49%	9,77%	225,76%	108,08%	133,04%	72,48%	32,73%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	133 923 228,04	2,03%	11,93%	307,58%	131,97%	181,25%	88,50%	17,64%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	400 696,34	0,57%	-10,07%	86,36%	-211,39%	50,89%	-174,70%	0,05%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	112 790 585,03	7,66%	-5,29%	1160,61%	-158,52%	204,81%	-95,20%	14,86%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	6 066 712,90			0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,80%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	34 990 224,98	3,63%	13,09%	550,00%	144,80%	648,21%	195,37%	4,61%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	17 623 203,63	5,80%	13,81%	878,79%	152,77%	155,08%	-509,59%	2,32%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	13 231 530,92	1,10%	10,35%	166,67%	114,49%	50,93%	115,00%	1,74%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	939 525,83	-0,72%	-17,33%	-209,09%	-291,70%	-164,29%	-228,56%	0,12%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	1 917 040,83	5,76%	18%	872,73%	199,12%	106,08%	263,16%	0,25%
IPCA + 5,02% MÊS	0,66%	Ibov mês	3,74%	MSCI mês	0,56%	Ifix mês	5,43%	S&P mês	2,16%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,04%	Ibov 12 meses	-2,71%	MSCI 12 meses	6,70%	Ifix 12 meses	6,84%	S&P 12 meses	9%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses	1,12%		13,48%							

Não houve movimentação: aplicações ou resgates, neste fundo, neste mês de maio 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 (Qtd.)	Aplicação (R\$)	Resgate (Qtd.)	Resgate (R\$)	Saldo (Qtd.)	Proventos (R\$)	Amortização (R\$)	Financeiro
31/12/2018	39.683,864899	6.478.351,38	0,000000	0,00	39.683,864899	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	5.118,459660	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	9.115,669985	2.000.000,00	45.613,764915	0,000000	0,000000	10.007.770,13
23/02/2021	1.981,545345	500.000,00	0,000000	0,00	47.595,310261	0,000000	0,000000	12.009.644,49
28/10/2021	5.089,372560	1.537.388,94	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	40.458,818220	0,000000	0,000000	10.708.593,48
01/03/2023	1.363,366256	400.000,00	0,000000	0,00	41.822,184572	0,000000	0,000000	12.270.271,29

“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

Art.10º, II - 4.963/2022 - Fundos de Participações: O BCPREVI possui 2 fundos no qual totaliza um investimento de R\$ 939.525,83, representando 0,12% 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				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	4,56	-1,21	-1,21	-1,21	577.013,54	0,08	61.989.720,05	0,93
GAVEA	GAVEA	GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	22,02	0,08	0,08	1,05	362.512,29	0,05	6.488.075,74	5,59
Sub-total Artigo 10º II			22,03	-0,72	-0,72	0,25	939.525,83	0,12		

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

MAIO - 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%	188 733 908,25	1,10%	10,71%	166,67%	118,47%	98,21%	79,45%	24,86%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	248 440 473,02	1,49%	9,77%	225,76%	108,08%	133,04%	72,48%	32,73%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	133 923 228,04	2,03%	11,93%	307,58%	131,97%	181,25%	88,50%	17,64%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	400 696,34	0,57%	-10,07%	86,36%	-211,39%	50,89%	-174,70%	0,05%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	112 790 585,03	7,66%	-5,29%	1160,61%	-158,52%	204,81%	-95,20%	14,86%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	6 066 712,90			0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,80%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	34 990 224,98	3,63%	13,09%	550,00%	144,80%	648,21%	195,37%	4,61%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	17 623 203,63	5,80%	13,81%	878,79%	152,77%	155,08%	-509,59%	2,32%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	13 231 530,92	1,10%	10,35%	166,67%	114,49%	50,93%	115,00%	1,74%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	939 525,83	-0,72%	-17,33%	-209,09%	-291,70%	-164,29%	-228,56%	0,12%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	1 917 040,83	5,76%	18%	872,73%	199,12%	106,08%	263,16%	0,25%
IPCA + 5,02% MÊS	0,66%	Ibov mês	3,74%	MSCI mês	0,56%	Ifix mês	5,43%	S&P mês	2,16%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,04%	Ibov 12 meses	-2,71%	MSCI 12 meses	6,70%	Ifix 12 meses	6,84%	S&P 12 meses	9%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		1,12%	13,48%							

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 maio.

“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

“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

29/04/2022	Resgate Armotização	R\$ 178.571,16
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%	
31/05/2023	Saldo em extrato aplicado	R\$ 362.512,29

Neste mês de maio de 2023, houve as seguintes movimentações neste enquadramento:

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	0,00	584.090,14	0,00	0,00	577.013,54	-7.076,60	-7.076,60
GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	362.206,59	0,00	0,00	0,00	362.512,29	305,70	3.781,20
					939.525,83	-6.770,90	

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 até este mês de maio ainda não havia sido chamado a integralizar. Ressalta-se que 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.

“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

HISTÓRICO FUNDO BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA		
DATA	DESCRIÇÃO	VALOR
09/05/2023	Aplicação	R\$ 584.090,14

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\$ 1.917.040,83 representando 0,25% da carteira, conforme relação abaixo.

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FI IMOBILIÁRIO THE ONE	9,89	0,00	3,51	7,36	1.396.348,00	0,18	209.486.468,42	0,67
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	24,64	0,00	13,70	9,31	467.447,67	0,06	769.956.186,61	0,06
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	24,18	0,00	1,34	2,52	53.245,16	0,01	9.155.043,21	0,58
Sub-total Artigo 11º			11,98	0,00	5,76	7,68	1.917.040,83	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 forma, evidencia-se o correto enquadramento neste segmento. Da tabela abaixo extrai-se os principais dados dos resultados deste mês para este enquadramento.

MAIO - 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%	188 733 908,25	1,10%	10,71%	166,67%	118,47%	98,21%	79,45%	24,86%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	248 440 473,02	1,49%	9,77%	225,76%	108,08%	133,04%	72,48%	32,73%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	133 923 228,04	2,03%	11,93%	307,58%	131,97%	181,25%	88,50%	17,64%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	400 696,34	0,57%	-10,07%	86,36%	-211,39%	50,89%	-174,70%	0,05%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	112 790 585,03	7,66%	-5,29%	1160,61%	-158,52%	204,81%	-95,20%	14,86%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	6 066 712,90			0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,80%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	34 990 224,98	3,63%	13,09%	550,00%	144,80%	648,21%	195,37%	4,61%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	17 623 203,63	5,80%	13,81%	878,79%	152,77%	155,08%	-509,59%	2,32%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	13 231 530,92	1,10%	10,35%	166,67%	114,49%	50,93%	115,00%	1,74%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	939 525,83	-0,72%	-17,33%	-209,09%	-291,70%	-164,29%	-228,56%	0,12%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	1 917 040,83	5,76%	18%	872,73%	199,12%	106,08%	263,16%	0,25%
IPCA + 5,02% MÊS	0,66%	Ibov mês	3,74%	MSCI mês	0,56%	Ifix mês	5,43%	S&P mês	2,16%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,04%	Ibov 12 meses	-2,71%	MSCI 12 meses	6,70%	Ifix 12 meses	6,84%	S&P 12 meses	9%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		1,12%	13,48%							

“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 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 maio. 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 Conporativa - cotação **	R\$ 615 457,96	413 364,24	-148 010,29	-24,05%	136,02%	-160,07%
FI Imobiliário Rio Bravo renda Conporativa - frutos	R\$ -	27 472,59	438 974,59	71,32%	136,02%	-64,70%
Rentabilidade do ano	R\$ -	-38 296,17	290 964,30	47,28%	136,02%	-88,74%
Bradesco -Rio Bravo The One - cotação ***	R\$ 798 000,00	1 356 220,00	691 054,97	86,60%	136,02%	-49,42%
Bradesco -Rio Bravo The One - frutos	R\$ -	62 472,00	620 040,31	77,70%	136,02%	-58,32%
Rentabilidade do ano	R\$ -	-23 104,00	1 311 095,28	164,30%	136,02%	28,28%
FII Rio Bravo Credito Imobiliário II - cotação ****	R\$ 300 000,00	52 571,26	-217 426,00	-72,48%	136,02%	-208,50%
FII Rio Bravo Credito Imobiliário II - frutos	R\$ -	1 200,38	205 555,80	68,52%	136,02%	-67,50%
Rentabilidade do ano	R\$ -	5 685,75	-11 870,20	-3,96%	136,02%	-139,98%

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.

	Rentabilidade Anual - com "frutos" simulados com rentabilidade pelo "CDI"					
Fundo Investimentos	R\$ aplic.inicial	Saldo 2023	Rentab.total	Rentab. Total (%)	meta desde a aplicação inicial *	Rentab. X Meta (%)
FI Imobiliário Rio Bravo renda Conporativa - cotação	R\$ 615 457,96	R\$ 413 364,24	-R\$ 148 010,29	-24,05%	136,02%	-160,07%
FI Imobiliário Rio Bravo renda Conporativa - frutos	R\$ -		R\$ 745 156,74	121,07%	136,02%	-14,95%
Rentabilidade do ano	R\$ -		R\$ 597 146,45	97,02%	136,02%	-39,00%
Bradesco -Rio Bravo The One - cotação	R\$ 798 000,00	R\$ 1 356 220,00	R\$ 691 054,97	86,60%	136,02%	-49,42%
Bradesco -Rio Bravo The One - frutos	R\$ -		R\$ 948 477,47	118,86%	136,02%	-17,16%
Rentabilidade do ano	R\$ -		R\$ 1 639 532,4	205,46%	136,02%	69,44%
FII Rio Bravo Credito Imobiliário II - cotação	R\$ 300 000,00	R\$ 52 571,26	-R\$ 217 426,00	-72,48%	136,02%	-208,50%
FII Rio Bravo Credito Imobiliário II - frutos	R\$ -		R\$ 341 769,43	113,92%	136,02%	-22,10%
Rentabilidade do ano	R\$ -		R\$ 124 343,43	41,45%	136,02%	-94,57%

“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

Percebe-se que o fundo que possui posição mais relevante, “Rio Bravo The One”, supera a meta do período em 69,44% 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 maio de 2023, conforme tabela abaixo, a renda fixa apresentou rentabilidade positiva de (R\$ 8.460.111,90), a meta atuarial do mês foi de 0,66%, (meta = R\$ 3.824.905,38), o resultado ficou superior a meta do mês em R\$ 4.635.206,52, “0,80%”; sendo que no acumulado de doze meses, a meta em reais é de R\$ 45.083.432,88, a rentabilidade está positiva em R\$ 52.097.330,79, gerando um excedente de R\$ 7.013.897,91 em relação ao atingimento da meta atuarial neste segmento, sendo que a atual composição da carteira em ativos de renda fixa totaliza um investimento de R\$ 571.498.305,65 sendo 75,29% da carteira total.

RESULTADO				META ATUARIAL		CUMPRIMENTO DA META “MÊS”		CUMPRIMENTO DA META “12 MESES”	
APLICADO (R\$)		RENTABILIDADE		%	R\$	%	R\$	%	R\$
		%	R\$						
R. FIXA	571.498.305,65	1,46%	8.460.111,90	0,66	3.824.905,38	0,80%	4.635.206,52	115%	7.013.897,91

“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

R. VARIÁVEL	187.558.824,12	6,18%	10.383.577,81		1.108.793,87	5,52%	9.274.783,94	78,26%	-12.774.321,63
TOTAL	759.057.129,77	5,53%	18.843.689,71		4.933.699,25	4,87%	13.909.990,46	90,62%	-5 760 423,72

Para o segmento de renda variável o BCPREVI possui um total investido de R\$ 187.558.824,12, “24,71%” da carteira. O rendimento desta classe de ativos para o mês de maio de 2023, foi positiva de R\$ 10.383.577,81, superando a meta atuarial do mês em “5,52%”, R\$ 9.274.783,94. No acumulado de doze meses, a rentabilidade é positiva de R\$ 3.548.946,38, a meta é de R\$ 16.323.268,01, diferença de R\$ -12.774.321,63, 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 90,62%, da meta atingida, faltando R\$ -5.760.423,72 para o seu cumprimento.

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

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	1,01	1,16	2,53								5,89
IPCA + 5,02%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66								5,03
p.p. indexador	0,69	-1,77	-0,15	0,20	1,87								0,85
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	29	44,62
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	55,38
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	4,77	2,81	1,96	3,27
06 meses	5,56	6,13	-0,56	3,79
12 meses	7,97	9,04	-1,07	5,23
24 meses	5,22	28,16	-22,94	5,81
36 meses	22,07	46,33	-24,26	6,20
48 meses	26,69	57,91	-31,21	8,93
60 meses	46,32	75,14	-28,81	8,22
Desde 29/12/2017	48,60	81,74	-33,14	8,16

“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

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. Cabe destacar que estes movimentos, embora seu alvo seja para o longo prazo, já vem apresentando bons frutos. É possível verificar que a meta atuarial já foi no seu pior momento, em junho de 2022, cerca de 142 milhões, faltando para atingimento da meta, no auge dos efeitos negativos da pandemia. Hoje, a meta de 12 meses está apenas 9,38% de ser atingida, em valores monetários, apenas R\$ 5,7 milhões, graças ao trabalho deste comitê na busca das melhores informações, na tranquilidade quantos aos estresses de mercado, buscando se posicionar nas oportunidades geradas por estes momentos.

Balneário Camboriú - SC, maio 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

ROSINALVA AP. PEREIRA
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