

RELATÓRIO DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS BCPREVI

AGOSTO - 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. Neste mês foi deliberado pelo desmonte da posição em LFTs, (Tesouro Selic), que estava em aproximadamente 3,8% da carteira R\$ 30 milhões, sendo que R\$ 11.026.436,88 foi vendido em julho e R\$ 19.374.516,58 foi vendido em agosto. Tal movimento foi para aplicação no fundo BTG Pactual Explorer Institucional FI RF LP, com meta de rentabilidade de CDI mais 3%. Se considerarmos as projeções do relatório Focus, o qual projeta a Selic para o final de 2024 em 9%, e visto que a previsão para inflação “IPCA” no fechamento do ano de 2024, segundo o Copom, está registrando 3,88%, gera uma rentabilidade muito próxima da meta atuarial, em o fundo atingindo seu objetivo, tem-se uma sobra relevante de 3%.

BANCO CENTRAL DO BRASIL

Focus

Relatório de Mercado

A posição ao final de agosto de 2023 ficou em R\$ 218.988.470,53, (27,70%) 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	0,01	0,00	0,55	8,23	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	LFT 010324	0,02	0,00	0,55	8,23	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	LFT 010328	0,13	0,00	0,59	6,53	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	LFT 010329	0,28	0,00	0,59	3,44	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	LFT 010927	0,70	0,00	0,60	8,55	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,000000%)	0,41	0,03	0,67	6,98	1.078.370,26	0,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,260000%)	0,41	0,03	0,69	7,16	1.073.658,53	0,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,612000%)	0,41	0,03	0,72	7,40	6.691.737,96	0,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,880000%)	0,41	0,03	0,75	7,58	1.042.651,14	0,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,050000%)	0,41	0,03	0,68	7,01	2.204.726,64	0,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,330000%)	0,41	0,03	0,70	7,21	2.208.918,76	0,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,450000%)	3,85	0,03	0,71	0,74	10.077.414,16	1,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,713000%)	0,41	0,03	0,73	7,46	2.093.269,32	0,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	0,41	0,03	0,73	7,48	2.154.378,91	0,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,310000%)	0,41	0,04	0,78	7,87	5.218.108,98	0,66

“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%)	3,07	0,04	0,79	7,93	5.241.705,12	0,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,500000%)	3,12	0,04	0,80	6,46	14.202.322,23	1,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,520000%)	3,11	0,04	0,80	5,27	4.102.076,12	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,070000%)	0,41	0,03	0,68	7,03	3.233.311,06	0,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,360000%)	0,41	0,03	0,70	7,23	3.238.506,02	0,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,500000%)	3,83	0,03	0,23	0,23	18.993.010,96	2,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,560000%)	3,87	0,03	0,72	1,26	5.062.406,71	0,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,580000%)	0,41	0,03	0,72	7,37	3.040.525,16	0,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,710000%)	0,41	0,03	0,73	7,46	3.156.955,05	0,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,820000%)	0,41	0,03	0,74	7,54	5.297.347,70	0,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,020000%)	0,41	0,03	0,76	7,67	5.234.410,60	0,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,131000%)	2,98	0,04	0,77	7,75	10.595.088,20	1,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,330000%)	0,41	0,04	0,79	7,88	5.215.532,19	0,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (7,650000%)	3,00	0,04	0,90	2,09	11.979.743,90	1,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,41	0,03	0,69	7,16	691.414,77	0,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,502000%)	0,41	0,03	0,71	7,32	5.009.022,01	0,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,850000%)	0,41	0,03	0,75	7,56	640.493,00	0,08
TESOURO	NTN-B 150840 (5,000000%)	0,41	0,03	0,67	6,98	1.411.495,75	0,18

“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 (5,310000%)	0,41	0,03	0,70	7,19	1.446.156,19	0,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,510000%)	2,79	0,03	0,72	1,25	4.921.343,58	0,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,700000%)	0,41	0,03	0,73	7,46	1.414.025,06	0,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,230000%)	0,41	0,04	0,78	7,81	5.064.173,65	0,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,090000%)	0,41	0,03	0,68	7,04	2.352.035,62	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,350000%)	0,41	0,03	0,70	7,22	2.414.895,01	0,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,500000%)	3,87	0,03	0,23	0,23	9.990.168,47	1,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,580000%)	0,41	0,03	0,72	7,37	2.284.269,45	0,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	0,41	0,03	0,73	7,48	2.359.832,69	0,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,859000%)	0,41	0,03	0,75	7,56	5.144.167,97	0,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,020000%)	0,41	0,03	0,76	7,67	5.087.306,86	0,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,330000%)	0,41	0,04	0,79	7,88	5.060.797,36	0,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,500000%)	5,20	0,04	0,80	6,29	15.992.242,94	2,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,880000%)	0,41	0,03	0,75	7,58	5.149.173,03	0,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,350000%)	0,41	0,04	0,79	7,90	10.119.281,44	1,28
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,38	0,03	0,79	7,88	218.988.470,53	27,70

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”.

“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

VENDA EM: 15/08/2023	LFT - 75211-0	LFT - 90201-0
PUs LFTs:	1.815,5486433	
QDD LFTs:	10.260,00	
(67) - R\$ Totais	18.627.529,08	0,00
Taxas:	SELIC	SELIC

VENDA EM: 16/08/2023	LFT - 75211-0	LFT - 90201-0
PUs LFTs:	13.581,5908220	
QDD LFTs:	55,00	
(67) - R\$ Totais	746.987,50	0,00
Taxas:	SELIC	SELIC

COMPRA EM: 22/08/2023	15/05/2024	15/08/2030	15/05/2035	15/08/2040	15/05/2045	15/08/2050	15/05/2055	15/08/2060
PUs NTN-B:						4.429,9517240	4.511,8363820	
QDD NTN-B:						2.250,00	4.200,00	
(71) - R\$ Totais	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	9.967.391,38	18.949.712,80	
Taxas - IPCA + :						5,50	5,5000	

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.21) TOTAL = 71 + (a.20)	12.086.310,28	6.023.050,79	9.585.173,78	13.917.685,58	46.225.357,14	49.420.007,91	66.324.621,74	19.317.437,70	222.899.644,92
(72) - Alocação possível "ALM novo" (72 = Y - (a.21))	-12.086.310,28	769.438,25	657.468,43	54.977.560,44	63.963.909,59	97.103.684,33	113.838.063,88	-3.037.027,45	316.186.787,19
(73) - Alocação possível "DPIN-2023" (73 = X - a.21)	-12.086.310,28	-2.504.147,35	-4.278.890,82	21.774.049,33	10.859.076,48	26.487.766,34	27.010.102,90	-10.883.240,56	56.378.406,05
LFT	0,00								
								TOTAL + LFTs	222.899.644,92

Destaca-se que os valores da tabela acima estão com seu preço de aquisição, não constando sua valorização até a presente data, por isso a diferença em relação aos "prints" acima. Cabe observação também 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. Tal situação não se trata de incorreção, desenquadramento, ou qualquer transtorno maior, uma vez que tais parâmetros são apenas utilizados como norte trazida pela "ALM" que é revista anualmente.

1.2. Art.7º, I, Alínea B - 4.963/2021 - Fundos 100% TP Referenciado: neste enquadramento da Resolução o BCPREVI ao término de agosto de 2023 possui 22 fundos, e um total aplicado de R\$ 262.218.558,37, representando 33,16% 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

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	2,37	0,02	1,04	10,75	14.995.331,32	1,90	5.967.981.074,09	0,25
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,02	0,05	1,14	8,83	57.348.870,62	7,25	39.669.959.126,67	0,14
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2,04	-0,01	0,90	7,62	281.232,52	0,04	186.423.704,08	0,15
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,93	0,04	0,77	4,64	7.135.622,16	0,90	239.975.656,30	2,97
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,41	0,04	0,78	7,80	3.546.072,72	0,45	271.241.274,75	1,31
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF	4,92	-0,64	-0,41	11,65	2.971.666,17	0,38	420.606.236,67	0,71
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	2,25	-0,24	0,59	8,61	3.869.305,34	0,49	1.461.066.040,32	0,26
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO FICFI	4,91	-0,64	-0,39	11,66	4.087.721,35	0,52	255.486.055,82	1,60
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,89	-0,64	-0,40	11,65	42.659.940,81	5,40	5.260.991.740,78	0,81
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,94	-0,63	-0,37	11,72	4.031.480,40	0,51	5.279.029.725,18	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,24	-0,24	0,60	8,67	30.274.424,16	3,83	8.195.443.440,71	0,37
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,55	-1,00	-1,29	13,97	13.178.462,87	1,67	1.858.783.140,34	0,71
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,51	-0,98	-1,26	13,86	9.550.018,98	1,21	1.532.125.808,15	0,62
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,23	-0,23	0,57	10,28	116.940,06	0,01	226.272.539,89	0,05
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,26	-0,24	0,58	8,63	30.033.752,03	3,80	5.437.581.646,17	0,55
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	2,04	-0,01	0,90	7,60	1.155.941,89	0,15	103.511.810,90	1,12
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,45	-0,19	0,63	9,92	11.612.539,29	1,47	5.643.739.686,42	0,21
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	4,72	-0,65	-0,49	12,10	1.382.805,05	0,17	766.542.442,69	0,18
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,02	0,05	1,13	8,69	17.891.775,69	2,26	10.508.951.085,13	0,17
BANRISUL	BANRISUL	BANRISUL SOBERANO FI RF SIMPLES LONGO PRAZO	0,04	0,05	1,13	4,41	2.582.288,10	0,33	350.912.629,31	0,74
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,02	0,05	1,13	8,74	3.512.366,84	0,44	5.478.324.181,39	0,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,59	-0,27	0,46	9,69	262.218.558,37	33,16		

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

AGOSTO - 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%	218.988.470,53	0,79%	11,04%	116,18%	112,77%	69,30%	81,48%	27,62%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	262.218.586,68	0,46%	12,45%	67,65%	127,17%	40,35%	91,88%	33,08%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	127.400.379,20	0,16%	13,47%	23,53%	137,59%	14,04%	99,41%	16,07%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	403.777,72	0,57%	-1,85%	83,82%	-118,90%	50,00%	-113,65%	0,05%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	97.711.512,95	-7,17%	-0,77%	-1154,41%	-107,87%	-40,86%	-113,56%	12,33%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	7.129.273,96	1,14%	1,49%	167,65%	15,22%	-22,40%	26,23%	0,90%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	40.888.786,99	1,31%	14,33%	192,65%	146,37%	179,45%	225,31%	5,16%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	19.334.162,86	2,90%	14,97%	426,47%	152,91%	-56,97%	263,56%	2,44%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	15.530.088,11	-0,96%	23,14%	-241,18%	236,36%	-148,73%	278,13%	1,96%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	1.051.277,97	-1,53%	-21,22%	-325,00%	-316,75%	-234,21%	-256,61%	0,13%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	2.098.476,91	-0,44%	23,37%	-164,71%	238,71%	-189,80%	293,96%	0,26%
IPCA + 5,02% MÊS	0,68%	Ibov mês	-5,09%	MSCI mês	0,73%	Ifix mês	0,49%	S&P mês	1,97%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,79%	Ibov 12 meses	5,68%	MSCI 12 meses	6,36%	Ifix 12 meses	7,95%	S&P 12 meses	8,32%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses			1,14%	13,55%						

Neste enquadramento, no mês de agosto, 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 SOBERANO FI RF SIMPLES LONGO PRAZO	3.294.947,93	1.950.000,00	-2.697.776,05	0,00	2.582.288,10	35.116,22	137.093,46
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	14.841.123,91	0,00	0,00	0,00	14.995.331,32	154.207,41	1.836.694,61
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	40.837.110,74	2.000.000,00	0,00	0,00	42.659.940,81	-177.169,93	2.655.144,48
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	116.271,74	0,00	0,00	0,00	116.940,06	668,32	10.901,72
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	31.798.244,13	44.860,70	-2.000.000,00	0,00	30.033.752,03	190.647,20	3.758.770,98
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	13.350.317,37	0,00	0,00	0,00	13.178.462,87	-171.854,50	1.615.099,82
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	286.962,62	0,00	-8.287,96	0,00	281.232,52	2.557,86	20.658,10
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	1.179.529,94	0,00	-34.084,44	0,00	1.155.941,89	10.496,39	84.772,94
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	19.673.643,66	22,70	-2.000.000,00	0,00	17.891.775,69	218.109,33	2.761.699,11
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA GERAL FI RF	2.983.915,35	0,00	0,00	0,00	2.971.666,17	-12.249,18	309.987,81
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.259.100,60	0,00	0,00	178.706,00	7.135.622,16	55.227,56	323.557,56
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	3.609.887,54	0,00	0,00	91.514,50	3.546.072,72	27.699,68	264.704,86
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	31.088.801,65	0,00	-1.000.000,00	0,00	30.274.424,16	185.622,51	2.494.341,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.670.946,95	1.000.000,00	0,00	0,00	9.550.018,98	-120.927,97	1.030.826,60
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.046.484,11	0,00	0,00	0,00	4.031.480,40	-15.003,71	422.915,54
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	11.539.758,48	0,00	0,00	0,00	11.612.539,29	72.780,81	1.047.643,68
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	4.103.886,61	0,00	0,00	0,00	4.087.721,35	-16.165,26	426.761,70
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	81.718.366,75	34.794.737,89	-60.053.504,21	0,00	57.348.870,62	889.270,19	3.292.553,97
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	3.846.453,84	0,00	0,00	0,00	3.869.305,34	22.851,50	306.753,47
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	1.389.555,46	0,00	0,00	0,00	1.382.805,05	-6.750,41	149.299,78
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	3.969.367,55	0,00	-500.000,00	0,00	3.512.366,84	42.999,29	385.587,46
	289.604.676,93	39.789.621,29	-68.293.652,66	270.220,50	262.218.558,37	1.388.133,31	

Estas movimentações foram realizadas principalmente junto aos fundos indexados ao “CDI” para realização das alocações aprovadas em reunião ordinária pelo comitê de investimento para agosto, principalmente para as alocações em renda variável, alongamento dos vencimentos em fundos de índices IMA 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 12 fundos e um total aplicado de R\$ 127.473.604,46, representando 16,12% 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

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	5,33	-0,16	0,82	1,80	5.089.852,61	0,64	228.566.994,72	2,23
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,82	-0,09	0,36	0,36	20.146.184,37	2,55	831.045.474,69	2,42
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,39	-0,68	-0,47	12,05	15.490.847,66	1,96	467.885.245,04	3,31
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,05	1,24	8,97	5.261.214,74	0,67	14.797.589.893,96	0,04
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,39	-0,26	0,48	10,02	4.228.336,59	0,53	183.949.721,27	2,30
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,04	1,16	8,81	129.615,40	0,02	14.734.335.445,36	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	7,60	-1,00	-1,29	14,06	16.088.700,77	2,03	148.401.947,12	10,84
BRAM	BRABESCO	BRABESCO H FI RF NILO	5,66	-0,66	-0,54	12,10	15.091.562,06	1,91	295.577.076,45	5,11
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,25	-0,24	0,58	8,58	6.285.219,87	0,79	980.045.918,76	0,64
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	4,12	-0,23	0,81	11,72	5.948.504,87	0,75	341.938.321,39	1,74
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	1,87	-0,43	0,35	7,18	14.163.242,80	1,79	683.129.636,69	2,07
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,84	-0,15	0,65	8,87	19.550.322,72	2,47	2.919.877.676,62	0,67
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,42	-0,41	0,16	10,02	127.473.604,46	16,12		

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

AGOSTO - 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%	218 988 470,53	0,79%	11,04%	116,18%	112,77%	69,30%	81,48%	27,62%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	262 218 586,68	0,46%	12,45%	67,65%	127,17%	40,35%	91,88%	33,08%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	127 400 379,20	0,16%	13,47%	23,53%	137,59%	14,04%	99,41%	16,07%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	403 777,72	0,57%	-1,85%	83,82%	-118,90%	50,00%	-113,65%	0,05%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	97 711 512,95	-7,17%	-0,77%	-1154,41%	-107,87%	-40,86%	-113,56%	12,33%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	7 129 273,96	1,14%	1,49%	167,65%	15,22%	-22,40%	26,23%	0,90%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	40 888 786,99	1,31%	14,33%	192,65%	146,37%	179,45%	225,31%	5,16%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	19 334 162,86	2,90%	14,97%	426,47%	152,91%	-56,97%	263,56%	2,44%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	15 530 088,11	-0,96%	23,14%	-241,18%	236,36%	-148,73%	278,13%	1,96%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	1 051 277,97	-1,53%	-21,22%	-325,00%	-316,75%	-234,21%	-256,61%	0,13%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	2 098 476,91	-0,44%	23,37%	-164,71%	238,71%	-189,80%	293,96%	0,26%
IPCA + 5,02% MÊS	0,68%	Ibov mês	-5,09%	MSCI mês	0,73%	Ifix mês	0,49%	S&P mês	1,97%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,79%	Ibov 12 meses	5,68%	MSCI 12 meses	6,36%	Ifix 12 meses	7,96%	S&P 12 meses	8,32%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		1,14%	13,55%							

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

“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 III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	184.650,77	42.861,80	-100.000,00	0,00	129.615,40	2.102,83	965.925,25
BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	5.900.762,02	0,00	0,00	0,00	5.948.504,87	47.742,85	624.183,13
BRABESCO H FI RF NILO	15.172.806,51	0,00	0,00	0,00	15.091.562,06	-81.244,45	2.534.346,90
BRABESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	6.249.053,87	0,00	0,00	0,00	6.285.219,87	36.166,00	496.486,40
BRABESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	4.208.261,06	0,00	0,00	0,00	4.228.336,59	20.075,53	385.058,70
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	14.290.002,25	2.000.000,00	0,00	0,00	16.088.700,77	-201.301,48	1.009.675,94
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,00	20.072.959,11	0,00	0,00	20.146.184,37	73.225,26	73.225,26
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.077.772,95	4.421.867,39	-300.925,92	0,00	5.261.214,74	62.500,32	176.632,02
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	14.114.271,69	0,00	0,00	0,00	14.163.242,80	48.971,11	949.408,59
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	19.423.202,18	0,00	0,00	0,00	19.550.322,72	127.120,54	2.360.617,93
ITAU RENDA FIXA IMA-B ATIVO	15.564.557,66	0,00	0,00	0,00	15.490.847,66	-73.710,00	1.666.208,44
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	5.048.575,87	0,00	0,00	0,00	5.089.852,61	41.276,74	89.852,61
	101.233.916,83	26.537.688,30	-400.925,92	0,00	127.473.604,46	102.925,25	

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

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\$ 403.777,72, 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 RI LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	64,87	0,57	0,57	0,26	403.777,72	0,05	22.782.256,47	1,77
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	64,87	0,57	0,57	0,26	403.777,72	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

“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

29/01/2009	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

1.5. Art.8º, I, - 4.963/2021 - Fundos de Ações: neste enquadramento da Resolução, atualmente, o BCPREVI aplica em 15 fundos, totalizando um investimento de R\$ 97.111.512,95, representando 12,33% 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				
TRÍGONO	BEM	TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	21,60	-0,82	2,28	14,49	1.343.419,00	0,17	110.351.322,63	1,22
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	26,13	-2,43	-7,15	10,39	17.022.560,28	2,15	341.072.417,75	4,99
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,58	-1,42	-5,15	5,19	3.874.142,38	0,49	342.756.430,76	1,13
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	31,30	-3,15	-7,69	31,39	6.237.116,20	0,79	224.385.022,05	2,78
CONSTANCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	18,45	-1,76	-4,87	7,93	1.040.755,75	0,13	1.290.669.768,49	0,08
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,26	-1,34	-7,18	2,03	9.546.538,39	1,20	1.370.470.559,17	0,70
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,10	-1,86	-6,95	-2,18	6.495.124,68	0,82	203.369.650,14	3,19
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	27,18	-2,14	-10,34	-1,72	4.684.566,72	0,59	124.360.292,14	3,77
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,28	-2,49	-7,25	7,96	9.041.626,73	1,14	684.787.474,06	1,32
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,06	-0,77	-4,95	-3,99	9.325.167,33	1,18	1.414.031.639,81	0,66
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	22,47	-2,09	-8,94	-1,06	4.139.788,76	0,52	262.165.274,91	1,58
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	20,19	-1,72	-6,32	1,51	13.978.190,23	1,76	452.902.777,24	3,09
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,64	-2,08	-8,99	-1,85	3.192.027,99	0,40	154.290.602,67	2,07
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	30,33	-2,80	-11,77	4,14	6.475.210,58	0,82	239.409.308,66	2,70
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	20,01	-0,92	2,41	11,02	1.315.277,93	0,17	236.728.064,47	0,56
Sub-total Artigo 8º I			21,43	-1,98	-7,17	4,60	97.711.512,95	12,33		

“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 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.

AGOSTO - 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%	218 988 470,53	0,79%	11,04%	116,18%	112,77%	69,30%	81,48%	27,62%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	262 218 586,68	0,46%	12,45%	67,65%	127,17%	40,35%	91,88%	33,08%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	127 400 379,20	0,16%	13,47%	23,53%	137,59%	14,04%	99,41%	16,07%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	403 777,72	0,57%	-1,85%	83,82%	-118,90%	50,00%	-113,65%	0,05%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	97 711 512,95	-7,17%	-0,77%	-1154,41%	-107,87%	-40,86%	-113,56%	12,33%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	7 129 273,96	1,14%	1,49%	167,65%	15,22%	-22,40%	26,23%	0,90%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	40 888 786,99	1,31%	14,33%	192,65%	146,37%	179,45%	225,31%	5,16%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	19 334 162,86	2,90%	14,97%	426,47%	152,91%	-56,97%	263,56%	2,44%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	15 530 088,11	-0,96%	23,14%	-241,18%	236,36%	-148,73%	278,13%	1,96%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	1 051 277,97	-1,53%	-21,22%	-325,00%	-316,75%	-234,21%	-256,61%	0,13%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	2 098 476,91	-0,44%	23,37%	-164,71%	238,71%	-189,80%	293,96%	0,26%
IPCA + 5,02% MÊS	0,68%	Ibov mês	-5,09%	MSCI mês	0,73%	Ifix mês	0,49%	S&P mês	1,97%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,79%	Ibov 12 meses	5,68%	MSCI 12 meses	6,36%	Ifix 12 meses	7,95%	S&P 12 meses	8,32%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		1,14%	13,55%							

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	6.874.832,80	0,00	0,00	0,00	6.396.996,85	-477.835,95	-137.541,29
BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	18.228.752,65	100.000,00	0,00	0,00	17.022.560,28	-1.306.192,37	1.531.864,61
BRDESCO F I A SELECTION	14.816.534,66	100.000,00	0,00	0,00	13.978.190,23	-938.344,43	200.502,83
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	10.180.376,17	100.000,00	0,00	0,00	9.546.538,39	-733.837,78	182.916,43
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	887.948,55	200.000,00	0,00	0,00	1.040.755,75	-47.192,80	49.151,16
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	6.654.439,66	100.000,00	0,00	0,00	6.237.116,20	-517.323,46	1.385.632,11
FIA CAIXA CONSUMO	5.118.431,66	100.000,00	0,00	0,00	4.684.566,72	-533.864,94	-80.914,26
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	9.645.152,17	100.000,00	0,00	0,00	9.041.626,73	-703.525,44	637.627,14
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	9.810.514,37	0,00	0,00	0,00	9.325.167,33	-485.347,04	-387.806,10
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	4.686.344,64	100.000,00	-700.000,00	0,00	3.874.142,38	-212.202,26	245.338,57
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	4.546.044,21	0,00	0,00	0,00	4.139.788,76	-406.255,45	-44.355,36
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	3.399.441,40	100.000,00	0,00	0,00	3.192.027,99	-307.413,41	-54.085,43
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	7.231.491,54	0,00	0,00	0,00	6.380.174,22	-851.317,32	244.124,29
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	1.111.793,31	0,00	0,00	0,00	1.137.100,40	25.307,09	129.512,34
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	1.085.256,66	0,00	0,00	0,00	1.111.461,37	26.204,71	104.768,63
	104.277.354,45	1.000.000,00	-700.000,00	0,00	97.108.213,60	-7.469.140,85	

“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

Neste mês foi deliberado pela realização parcial dos lucros apurados no fundo Itaú FOF RPI Ações Ibovespa Ativo FICFI, vide tabela abaixo, em alinhamento com a intenção deste comitê de ser mais ativo no acompanhamento, entradas em períodos de estresse do mercado e realização de lucros em períodos de euforia do mercado.

	VALOR DA COTA EM 27/07/2023							
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	29/12/2017	1 000 000,00	486 896,64	2,05	3,10	1 510 447,83	510 447,83	51,04%
	05/03/2018	1 500 000,00	660 831,38	2,27	3,10	2 050 027,14	550 027,14	36,67%
	01/09/2020	1 000 000,00	349 372,07	2,86	3,10	1 083 819,95	83 819,95	8,38%
	19/11/2020	100 000,00	34 231,78	2,92	3,10	106 193,62	6 193,62	6,19%
	11/03/2021	100 000,00	31 896,22	3,14	3,10	98 948,25	(1 051,75)	-1,05%
	12/04/2021	100 000,00	30 779,75	3,25	3,10	95 484,76	(4 515,24)	-4,52%
	24/05/2021	100 000,00	29 627,55	3,38	3,10	91 910,41	(8 089,59)	-8,09%
	26/07/2021	100 000,00	29 228,41	3,42	3,10	90 672,19	(9 327,81)	-9,33%
	25/08/2021	500 000,00	153 521,82	3,26	3,10	476 254,47	(23 745,53)	-4,75%
	04/10/2021	100 000,00	33 809,35	2,96	3,10	104 883,15	4 883,15	4,88%
	25/10/2021	100 000,00	34 957,73	2,86	3,10	108 445,65	8 445,65	8,45%
	25/11/2021	200 000,00	72 099,40	2,77	3,10	223 666,34	23 666,34	11,83%
	17/12/2021	200 000,00	73 419,93	2,72	3,10	227 762,87	27 762,87	13,88%
	28/01/2022	400 000,00	139 481,93	2,87	3,10	432 700,00	32 700,00	8,18%
	21/03/2022	400 000,00	135 464,32	2,95	3,10	420 236,61	20 236,61	5,06%
	20/04/2022	400 000,00	136 800,96	2,92	3,10	424 383,13	24 383,13	6,10%
	18/05/2022	200 000,00	72 545,14	2,76	3,10	225 049,11	25 049,11	12,52%
	13/07/2022	100 000,00	39 894,50	2,51	3,10	123 760,49	23 760,49	23,76%
	16/09/2022	200 000,00	70 300,05	2,84	3,10	218 084,41	18 084,41	9,04%
	17/10/2022	200 000,00	67 110,96	2,98	3,10	208 191,23	8 191,23	4,10%
	média ponderada	7 000 000,00	2 682 269,91	2,61	3,10	8 320 921,62	1 320 921,62	18,87%
	resgate04/11/2022	3 386 043,21	1 297 468,83	2,61	3,10	4 025 000,02	638 956,81	18,87%
	SALDO	3 613 956,79	1 384 801,08	2,61	3,10	4 299 029,09	685 072,30	18,96%
	13/04/2023	100 000,00	36 418,60	2,75	3,10	113 059,27	13 059,27	13,06%
	17/05/2023	100 000,00	35 378,07	2,83	3,10	109 829,02	9 829,02	9,83%
	SALDO	3 813 956,79	1 456 597,74	2,62	3,10	4 521 917,38	707 960,59	18,56%

1.6 Art.8º, II, - 4.963/2021 - Fundos de Índice de Ações: neste enquadramento da Resolução o BCPREVI tem 3 fundos do qual possui um total investido de R\$ 20.308.576,20, correspondendo à 2,55% da carteira, conforme relação abaixo.

RESUMO POSIÇÕES ABERTAS						
ATIVO	Qdd.	VALOR AQUISIÇÃO	VALOR MERCADO	CUSTOS	RENTAB. LÍQUIDO	%
DIVO11	95.572	R\$ 7.049.467,72	R\$ 7.588.416,80	R\$ 19.792,15	R\$ 519.156,93	7,34%
BOVV11	106.361	R\$ 12.696.082,24	R\$ 12.513.371,65	R\$ 35.382,74	-R\$ 218.093,33	-1,71%
IVVB11	835	R\$ 199.256,05	R\$ 206.787,75	R\$ 706,57	R\$ 6.825,13	3,41%
TOTAL		R\$ 19.944.806,01	R\$ 20.308.576,20	R\$ 55.881,46	R\$ 307.888,73	1,54%

Da tabela acima extrai-se os principais dados dos resultados do mês de agosto para este enquadramento. Cabe relatar que os valores acima divergem do relatório do sistema da LDB “BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

Empresas Ltda, assessoria de investimentos do BCPREVI, pois tal sistema encontra-se com dificuldade de atualização das operações com ETFs. O valor que consta no sistema é de R\$ 7.129.273,96. Se está apurando com a assessoria a pronta resolução deste problema.

1.7. 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\$ 40.888.786,99 representando 5,16 % 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	14,12	-0,43	-1,02	-8,44	626.117,68	0,08	194.005.202,46	0,32
XP	BNP PARIBAS	SYSTEMATICA BLUE TREND DOLAR ADVISORY FIC DE FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,36	1,21	2,74	-15,45	612.791,01	0,08	25.474.878,47	2,41
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,26	2,16	4,36	19,48	11.480.307,43	1,45	182.963.478,44	6,27
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	24,23	0,85	-0,43	31,06	3.737.605,26	0,47	235.828.232,83	1,58
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTEC ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	23,95	-0,16	-6,06	22,48	3.936.255,35	0,50	66.687.535,28	5,90
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	22,56	1,40	4,43	5,15	3.197.029,22	0,40	126.664.775,11	2,52
ITAU	ITAU	ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,51	1,61	2,13	8,85	6.524.855,95	0,82	386.508.306,00	1,69
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	30,05	2,56	1,35	27,77	7.203.019,37	0,91	665.927.943,70	1,08
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	16,55	-0,26	-1,07	19,66	3.570.805,72	0,45	317.439.439,51	1,12
Sub-total Artigo 9º II			19,90	1,46	1,31	18,66	40.888.786,99	5,16		

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

AGOSTO - 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%	218 988 470,53	0,79%	11,04%	116,18%	112,77%	69,30%	81,48%	27,62%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	262 218 586,68	0,46%	12,45%	67,65%	127,17%	40,35%	91,88%	33,08%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	127 400 379,20	0,16%	13,47%	23,53%	137,59%	14,04%	99,41%	16,07%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	403 777,72	0,57%	-1,85%	83,82%	-118,90%	50,00%	-113,65%	0,05%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	97 711 512,95	-7,17%	-0,77%	-1154,41%	-107,87%	-40,86%	-113,56%	12,33%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	7 129 273,96	1,14%	1,49%	167,65%	15,22%	-22,40%	26,23%	0,90%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	40 888 786,99	1,31%	14,33%	192,65%	146,37%	179,45%	225,31%	5,16%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	19 334 162,86	2,90%	14,97%	426,47%	152,91%	-56,97%	263,56%	2,44%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	15 530 088,11	-0,96%	23,14%	-241,18%	236,36%	-148,73%	278,13%	1,96%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	1 051 277,97	-1,53%	-21,22%	-325,00%	-316,75%	-234,21%	-256,61%	0,13%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	2 098 476,91	-0,44%	23,37%	-164,71%	238,71%	-189,80%	293,96%	0,26%
IPCA + 5,02% MÊS		0,68%	Ibov mês	-5,09%	MSCI mês	0,73%	Ifix mês	0,49%	S&P mês	1,97%
IPCA + 5,02% 12 MÊS		9,79%	Ibov 12 meses	5,68%	MSCI 12 meses	6,36%	Ifix 12 meses	7,95%	S&P 12 meses	8,32%
* Referência "CDI" mês e 12 meses		1,14%	13,55%							

“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

Neste enquadramento, no mês de agosto, houve as seguintes movimentações:

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10.699.562,98	300.000,00	0,00	0,00	11.480.307,43	480.744,45	1.723.103,51
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	3.648.391,34	100.000,00	0,00	0,00	3.737.605,26	-10.786,08	797.698,46
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4.079.471,07	100.000,00	0,00	0,00	3.936.255,35	-243.215,72	627.762,73
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	2.669.037,21	400.000,00	0,00	0,00	3.197.029,22	127.992,01	144.415,18
ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	6.287.757,65	100.000,00	0,00	0,00	6.524.855,95	137.098,30	510.815,59
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	7.004.447,98	100.000,00	0,00	0,00	7.203.019,37	98.571,39	1.484.155,92
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	3.406.749,06	200.000,00	0,00	0,00	3.570.805,72	-35.943,34	468.210,22
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	531.759,69	100.000,00	0,00	0,00	626.117,68	-5.642,01	-23.882,32
SYSTEMATICA BLUE TREND DOLAR ADVISORY FIC DE FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	498.069,82	100.000,00	0,00	0,00	612.791,01	14.721,19	-37.208,99
	38.825.246,80	1.500.000,00	0,00	0,00	40.888.786,99	563.540,19	

1.8. 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\$ 19.334.162,86 representando 2,45% da carteira, conforme demonstrado na relação abaixo.

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	22,55	1,65	2,90	20,35	19.334.162,86	2,45	2.114.296.555,90	0,91
Sub-total Artigo 9º III			22,55	1,65	2,90	20,35	19.334.162,86	2,45		

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

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

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

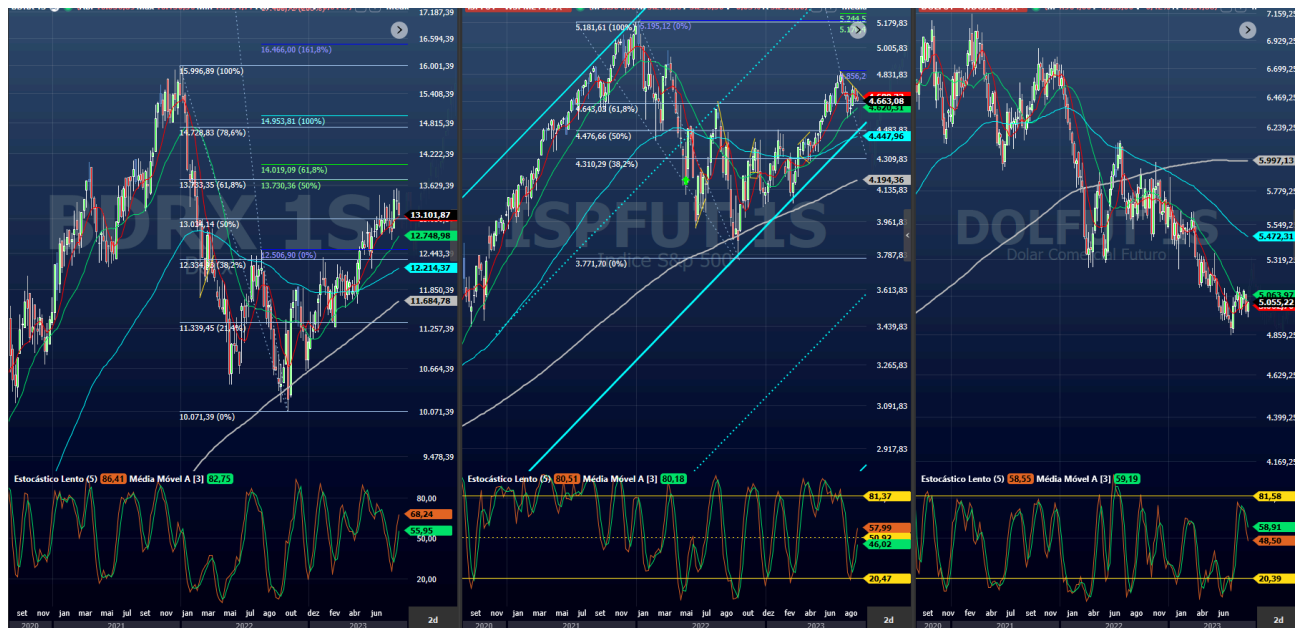
CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

AGOSTO - 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%	218 988 470,53	0,79%	11,04%	116,18%	112,77%	69,30%	81,48%	27,62%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	262 218 586,68	0,46%	12,45%	67,65%	127,17%	40,35%	91,88%	33,08%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	127 400 379,20	0,16%	13,47%	23,53%	137,59%	14,04%	99,41%	16,07%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	403 777,72	0,57%	-1,85%	83,82%	-118,90%	50,00%	-113,65%	0,05%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	97 711 512,95	-7,17%	-0,77%	-1154,41%	-107,87%	-40,86%	-113,56%	12,33%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	7 129 273,96	1,14%	1,49%	167,65%	15,22%	-22,40%	26,23%	0,90%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	40 888 786,99	1,31%	14,33%	192,65%	146,37%	179,45%	225,31%	5,16%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	19 334 162,86	2,90%	14,97%	426,47%	152,91%	-56,97%	263,56%	2,44%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	15 530 088,11	-0,96%	23,14%	-241,18%	236,36%	-148,73%	278,13%	1,96%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	1 051 277,97	-1,53%	-21,22%	-325,00%	-316,75%	-234,21%	-256,61%	0,13%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	2 098 476,91	-0,44%	23,37%	-164,71%	238,71%	-189,80%	293,96%	0,26%
IPCA + 5,02% MÊS	0,68%	Ibov mês	-5,09%	MSCI mês	0,73%	Ifix mês	0,49%	S&P mês	1,97%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,79%	Ibov 12 meses	5,68%	MSCI 12 meses	6,36%	Ifix 12 meses	7,95%	S&P 12 meses	8,32%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		1,14%	13,55%							

Neste enquadramento, no mês de agosto 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	18.485.916,32	300.000,00	0,00	0,00	19.334.162,86	548.246,54	3.162.997,43
	18.485.916,32	300.000,00	0,00	0,00	19.334.162,86	548.246,54	



“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

Nos gráficos acima é possível analisar o comportamento do BDRx, e os componentes que influenciam diretamente em sua performance que são as ações norte-americanas e o câmbio. 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.

1.9 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\$ 15.530.088,11, representando 1,96% 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	18,07	-0,09	-0,96	22,95	15.530.088,11	1,96	583.410.718,64	2,66
Sub-total Artigo 10º I			18,07	-0,09	-0,96	22,95	15.530.088,11	1,96		

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

AGOSTO - 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%	218 988 470,53	0,79%	11,04%	116,18%	112,77%	69,30%	81,48%	27,62%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	262 218 586,68	0,46%	12,45%	67,65%	127,17%	40,35%	91,88%	33,08%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	127 400 379,20	0,16%	13,47%	23,53%	137,59%	14,04%	99,41%	16,07%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	403 777,72	0,57%	-1,85%	83,82%	-118,90%	50,00%	-113,65%	0,05%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	97 711 512,95	-7,17%	-0,77%	-1154,41%	-107,87%	-40,86%	-113,56%	12,33%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	7 129 273,96	1,14%	1,49%	167,65%	15,22%	-22,40%	26,23%	0,90%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	40 888 786,99	1,31%	14,33%	192,65%	146,37%	179,45%	225,31%	5,16%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	19 334 162,86	2,90%	14,97%	426,47%	152,91%	-56,97%	263,56%	2,44%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	15 530 088,11	-0,96%	23,14%	-241,18%	236,36%	-148,73%	278,13%	1,96%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	1 051 277,97	-1,53%	-21,22%	-325,00%	-316,75%	-234,21%	-256,61%	0,13%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	2 098 476,91	-0,44%	23,37%	-164,71%	238,71%	-189,80%	293,96%	0,26%
IPCA + 5,02% MÊS	0,68%	Ibov mês	-5,09%	MSCI mês	0,73%	Ifix mês	0,49%	S&P mês	1,97%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,79%	Ibov 12 meses	5,68%	MSCI 12 meses	6,36%	Ifix 12 meses	7,95%	S&P 12 meses	8,32%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		1,14%	13,55%							

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

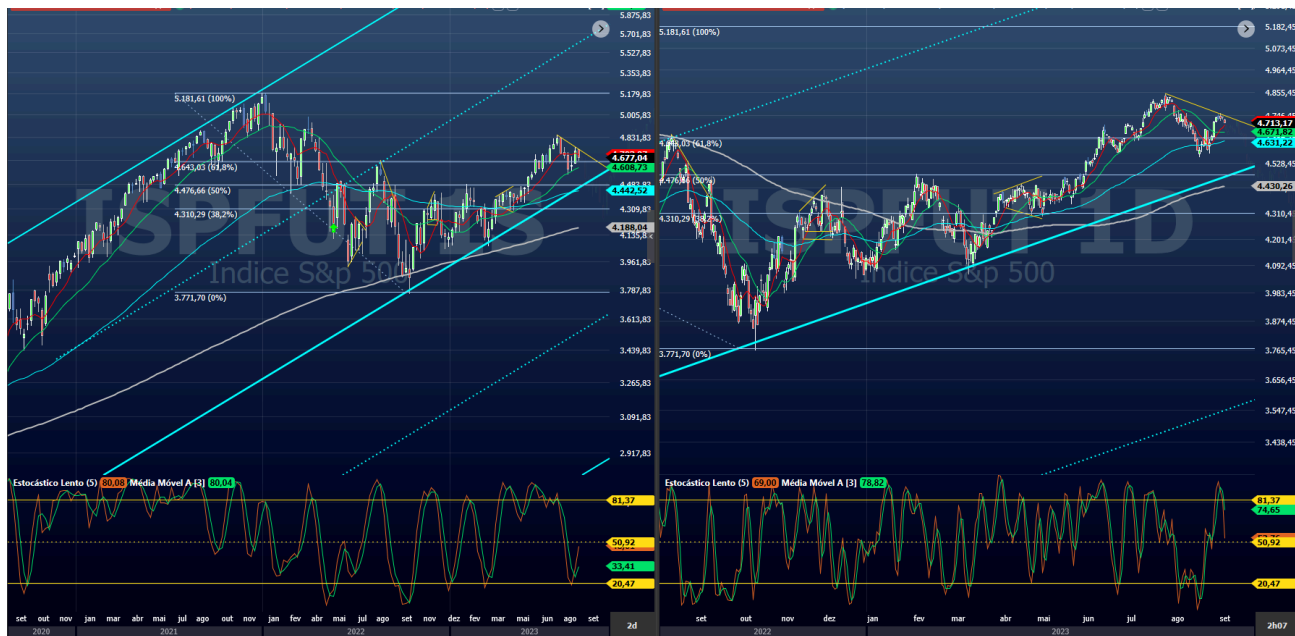
Rua Dinamarca n.º 175 – 1º. Andar – salas 101 e 102 – Fone/fax (47)3360-6253

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

Neste mês, houve as seguintes movimentações neste fundo:

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	15.161.262,54	500.000,00	0,00	0,00	15.530.088,11	-131.174,43	2.709.193,73
	15.161.262,54	500.000,00	0,00	0,00	15.530.088,11	-131.174,43	



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 (Qtd.)	Resgate (R\$)	Resgate (Qtd.)	Saldo (R\$)	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	5.116.459660	1.000.000,00	0,000000	0,00	54.728.434900	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	1.537.388,94	0,000000	0,00	52.684.682861	0,000000	0,000000	15.914.896,70
20/12/2021	619.339962	250.000,00	0,000000	0,00	53.504.022790	0,000000	0,000000	16.325.342,72
06/02/2022	0,000000	0,00	22.960.295271	7.000.000,00	30.543.727954	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	1.643.618695	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
27/07/2023	1.442.388064	500.000,00	0,000000	0,00	43.264.572663	0,000000	0,000000	14.997.549,47
22/06/2023	1.483.069724	500.000,00	0,000000	0,00	44.747.642224	0,000000	0,000000	15.086.155,96

“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

1.10 Art.10º, II - 4.963/2022 - Fundos de Participações: O BCPREVI possui 2 fundos no qual totaliza um investimento de R\$ 1.051.277,97, representando 0,13% 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	8,48	-2,39	-2,39	-8,22	689.056,91	0,09	75.842.901,38	0,91
GAVEA	GAVEA	GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	18,26	0,16	0,16	0,97	362.221,06	0,05	6.490.501,10	5,58
Sub-total Artigo 10º II			18,52	-1,53	-1,53	-4,62	1.051.277,97	0,13		

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 agosto para este enquadramento.

AGOSTO - 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	Titulos do Tesouro Nacional *	100,00%	218 988 470,53	0,79%	11,04%	116,18%	112,77%	69,30%	81,48%	27,62%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	262 218 586,68	0,46%	12,45%	67,65%	127,17%	40,35%	91,88%	33,08%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	127 400 379,20	0,16%	13,47%	23,53%	137,59%	14,04%	99,41%	16,07%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	403 777,72	0,57%	-1,85%	83,82%	-118,90%	50,00%	-113,65%	0,05%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	97 711 512,95	-7,17%	-0,77%	-1154,41%	-107,87%	-40,86%	-113,56%	12,33%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	7 129 273,96	1,14%	1,49%	167,65%	15,22%	-22,40%	26,23%	0,90%
Art. 9º,II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	40 888 786,99	1,31%	14,33%	192,65%	146,37%	179,45%	225,31%	5,16%
Art. 9º,III	Ações - BDR Nível I	10,00%	19 334 162,86	2,90%	14,97%	426,47%	152,91%	-56,97%	263,56%	2,44%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	15 530 088,11	-0,96%	23,14%	-241,18%	236,36%	-148,73%	278,13%	1,96%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	1 051 277,97	-1,53%	-21,22%	-325,00%	-316,75%	-234,21%	-256,61%	0,13%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	2 098 476,91	-0,44%	23,37%	-164,71%	238,71%	-189,80%	293,96%	0,26%
IPCA + 5,02% MÊS	0,68%	Ibov mês	-5,09%	MSCI mês	0,73%	Ifix mês	0,49%	S&P mês	1,97%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,79%	Ibov 12 meses	5,68%	MSCI 12 meses	6,36%	Ifix 12 meses	7,95%	S&P 12 meses	8,32%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		1,14%	13,55%							

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 agosto.

“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%	
31/08/2023	Saldo em extrato aplicado	R\$ 362.221,06

Não houveram movimentações neste enquadramento, este mês de agosto de 2023. 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 houve duas chamadas de integralização. Ressalta-se que já consta em reserva este recurso para fazer frente às chamadas futuras, tais recursos encontram-se aplicados junto ao fundo BTG Pactual Explorer Institucional FI Renda Fixa LP.

HISTÓRICO FUNDO BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA		
DATA	DESCRIÇÃO	VALOR
09/05/2023	Aplicação	R\$ 584.090,14
16/06/2023	Aplicação	R\$ 166.666,67

“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

Houve assinatura no Boletim de Subscrição em 29/05/2023, firmando compromisso de investimento junto ao fundo “FIP Pátria Private Equity VII Advisory Multiestratégia” 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 no fundo BTG Pactual Explorer Institucional FI Renda Fixa LP.

1.11 Art.11° - 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\$ 2.098.476,91 representando 0,27% da carteira, conforme relação abaixo.

Artigo 11° (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	11,80	0,26	0,77	18,37	1.523.952,00	0,19	209.521.662,66	0,73
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	25,08	-4,28	-3,82	22,97	520.634,88	0,07	770.545.294,79	0,07
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	3,27	-0,44	-0,44	3,76	53.890,03	0,01	9.265.923,75	0,58
Sub-total Artigo 11°			13,24	-0,92	-0,44	19,05	2.098.476,91	0,27		

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

AGOSTO - 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. 7°, I, alínea a	Títulos do Tesouro Nacional *	100,00%	218 988 470,53	0,79%	11,04%	116,18%	112,77%	69,30%	81,48%	27,62%
Art. 7°, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	262 218 586,68	0,46%	12,45%	67,65%	127,17%	40,35%	91,88%	33,08%
Art. 7°, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	127 400 379,20	0,16%	13,47%	23,53%	137,59%	14,04%	99,41%	16,07%
Art. 7°, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	403 777,72	0,57%	-1,85%	83,82%	-118,90%	50,00%	-113,65%	0,05%
Art. 8°, I	Fundos de Ações	35,00%	97 711 512,95	-7,17%	-0,77%	-1154,41%	-107,87%	-40,86%	-113,56%	12,33%
Art. 8°, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	7 129 273,96	1,14%	1,49%	167,65%	15,22%	-22,40%	26,23%	0,90%
Art. 9°, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	40 888 786,99	1,31%	14,33%	192,65%	146,37%	179,45%	225,31%	5,16%
Art. 9°, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	19 334 162,86	2,90%	14,97%	426,47%	152,91%	-56,97%	263,56%	2,44%
Art. 10°, I	Fundos Multimercados	10,00%	15 530 088,11	-0,96%	23,14%	-241,18%	236,36%	-148,73%	278,13%	1,96%
Art. 10°, II	Fundos de Participações *	5,00%	1 051 277,97	-1,53%	-21,22%	-325,00%	-316,75%	-234,21%	-256,61%	0,13%
Art. 11°	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	2 098 476,91	-0,44%	23,37%	-164,71%	238,71%	-189,80%	293,96%	0,26%
IPCA + 5,02% MÊS	0,68%	Ibov mês	-5,09%	MSCI mês	0,73%	Ífix mês	0,49%	S&P mês	1,97%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,79%	Ibov 12 meses	5,68%	MSCI 12 meses	6,36%	Ífix 12 meses	7,95%	S&P 12 meses	8,32%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		1,14%	13,55%							

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

“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

enquadramento no mês de agosto. 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	-94 823,08	-15,41%	137,65%	-153,06%
FI Imobiliário Rio Bravo renda Conporativa - frutos	R\$ -	27 472,59	446 730,34	72,59%	137,65%	-65,06%
Rentabilidade do ano	R\$ -	-38 296,17	351 907,26	57,18%	137,65%	-80,47%
Bradesco -Rio Bravo The One - cotação ***	R\$ 798 000,00	1 356 220,00	818 658,97	102,59%	137,65%	-35,06%
Bradesco -Rio Bravo The One - frutos	R\$ -	62 472,00	642 992,31	80,58%	137,65%	-57,07%
Rentabilidade do ano	R\$ -	-23 104,00	1 461 651,28	183,16%	137,65%	45,51%
FII Rio Bravo Credito Imobiliário II - cotação ****	R\$ 300 000,00	52 571,26	-216 781,13	-72,26%	137,65%	-209,91%
FII Rio Bravo Credito Imobiliário II - frutos	R\$ -	1 200,38	205 675,80	68,56%	137,65%	-69,09%
Rentabilidade do ano	R\$ -	5 685,75	-11 105,33	-3,70%	137,65%	-141,35%

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\$ 94 823,08	-15,41%	137,65%	-153,06%
FI Imobiliário Rio Bravo renda Conporativa - frutos	R\$ -		R\$ 776 943,57	126,24%	137,65%	-11,41%
Rentabilidade do ano	R\$ -		R\$ 682 120,49	110,83%	137,65%	-26,82%
Bradesco -Rio Bravo The One - cotação	R\$ 798 000,00	R\$ 1 356 220,00	R\$ 818 658,97	102,59%	137,65%	-35,06%
Bradesco -Rio Bravo The One - frutos	R\$ -		R\$ 1 002 157,5	125,58%	137,65%	-12,07%
Rentabilidade do ano	R\$ -		R\$ 1 820 816,5	228,17%	137,65%	90,52%
FII Rio Bravo Credito Imobiliário II - cotação	R\$ 300 000,00	R\$ 52 571,26	-R\$ 216 781,13	-72,26%	137,65%	-209,91%
FII Rio Bravo Credito Imobiliário II - frutos	R\$ -		R\$ 352 874,04	117,62%	137,65%	-20,03%
Rentabilidade do ano	R\$ -		R\$ 136 092,91	45,36%	137,65%	-92,29%

Percebe-se que o fundo que possui posição mais relevante, “Rio Bravo The One”, supera a meta do período em 90,52% desde o início da exposição.

“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

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 agosto de 2023, conforme tabela abaixo, a renda fixa apresentou rentabilidade positiva de (R\$ 3.184.653,95), a meta atuarial do mês foi de 0,68%, (meta = R\$ 4.170.364,72), o resultado ficou inferior a meta do mês em R\$ -985.710,77, “-0,16%”; sendo que no acumulado de doze meses, a meta em reais é de R\$ 50.467.851,48, a rentabilidade está positiva em R\$ 63.285.735,08, gerando excedente de R\$ 12.817.883,60 em relação da meta atuarial neste segmento, sendo que a atual composição da carteira em ativos de renda fixa totaliza um investimento de R\$ 609.011.214,13 sendo 76,82% da carteira total.

RESULTADO – dezembro/2022				META ATUARIAL		CUMPRIMENTO DA META “MÊS”		CUMPRIMENTO DA META “12 MESES”	
APLICADO (R\$)		RENTABILIDADE		%	R\$	%	R\$	%	R\$
		%	R\$						
R. FIXA	609.011.214,13	0,52%	3.184.653,95	0,68	4.170.364,72	-0,16%	-985.710,77	125%	12.817.883,60
R. VARIÁVEL	182.710.612,75	3,48%	-6.479.907,06		1.266.856,95	-4,16%	-7.744.764,01	-27,7%	-4.813.981,67
TOTAL	791.721.826,88	-0,42%	-3.295.253,11		5.435.221,67	-1,10%	-8.730.474,78	111,8%	8.013.901,93

“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

Para o segmento de renda variável o BCPREVI possui um total investido de R\$ 182.710.612,75, “23,18%” da carteira. O rendimento desta classe de ativos para o mês de agosto de 2023, foi negativo de R\$ -6.479.907,06, frustrando a meta atuarial do mês em “-4,16%”, R\$ -7.744.764,01. No acumulado de doze meses, a rentabilidade é positiva de R\$ 12.531.664,78, a meta é de R\$ 17.345.646,45, diferença de R\$ -4.813.981,67, conforme tabela acima.

Ao analisarmos a carteira de investimento de forma conjunta (renda fixa e renda variável) o Instituto está superavitário no cumprimento da meta em 12 meses com 111,80%, da meta atingida, sobrando R\$ 8.003.901,93 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	2,41	1,28	-0,42					9,36
IPCA + 5,02%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33	0,53	0,68					6,66
p.p. indexador	0,69	-1,77	-0,15	0,20	1,87	2,08	0,75	-1,10					2,70
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	31	45,59
Meses abaixo - Meta Atuarial	37	54,41
	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	3,28	1,54	1,74	2,85
06 meses	8,21	4,40	3,81	3,06
12 meses	10,72	9,79	0,93	4,46
24 meses	10,33	25,40	-15,07	5,59
36 meses	18,00	45,17	-27,17	5,88
48 meses	25,02	57,50	-32,48	8,86
60 meses	49,31	72,56	-23,24	8,18
Desde 29/12/2017	53,48	84,55	-31,07	8,00

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

“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

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, inclusive possibilitando a realização de lucros em alguns ativos de renda variável. É possível verificar que a meta atuarial já foi no seu pior momento, em junho de 2022, cerca de 142 milhões, faltando para seu atingimento no auge dos efeitos negativos da pandemia. Hoje, a meta de 12 meses está superada em 11,80%, em valores monetários, superando-a em aproximadamente 8 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, agosto 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