

RELATÓRIO DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS BCPREVI

JANEIRO - 2024

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 ao final de janeiro de 2024 possui os seguintes títulos conforme abaixo:

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-F 2033	3,75	0,00	0,00	0,00	2.062.404,92	0,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,000000%)	0,33	0,15	1,03	1,03	1.089.955,21	0,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,260000%)	0,34	0,16	1,05	1,05	1.085.730,11	0,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,612000%)	0,34	0,17	1,08	1,08	6.771.403,65	0,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,880000%)	0,35	0,18	1,10	1,10	1.055.575,60	0,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,050000%)	0,39	0,22	1,03	1,03	2.232.155,79	0,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,330000%)	0,40	0,22	1,05	1,05	2.237.002,43	0,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,450000%)	2,76	0,23	1,06	1,06	10.206.651,99	1,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,713000%)	0,42	0,24	1,09	1,09	2.120.589,71	0,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	0,42	0,24	1,09	1,09	2.182.527,56	0,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,950000%)	2,92	0,24	1,11	1,11	2.011.542,48	0,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,310000%)	0,43	0,25	1,14	1,14	5.288.544,00	0,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,400000%)	0,44	0,25	1,14	1,14	5.312.769,96	0,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,500000%)	0,55	0,26	1,15	1,15	14.395.766,91	1,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,520000%)	0,44	0,26	1,15	1,15	4.158.000,00	0,48

“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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,070000%)	0,45	0,26	1,03	1,03	3.276.798,78	0,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,360000%)	0,46	0,27	1,06	1,06	3.282.412,97	0,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,500000%)	2,75	0,27	1,07	1,07	19.251.325,26	2,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,560000%)	2,78	0,27	1,07	1,07	5.131.334,50	0,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,580000%)	0,47	0,27	1,08	1,08	3.081.941,42	0,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,710000%)	0,47	0,28	1,09	1,09	3.200.052,97	0,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,820000%)	0,47	0,28	1,10	1,10	5.369.774,24	0,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,990000%)	2,94	0,28	1,11	1,11	2.012.903,03	0,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,020000%)	0,48	0,28	1,11	1,11	5.306.138,21	0,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,131000%)	0,48	0,29	1,12	1,12	10.740.386,56	1,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,330000%)	0,49	0,29	1,14	1,14	5.287.114,38	0,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (7,650000%)	3,00	0,05	1,25	1,25	12.550.629,55	1,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,270000%)	0,31	0,12	1,05	1,05	718.381,70	0,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,502000%)	0,31	0,13	1,07	1,07	5.209.253,41	0,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,850000%)	0,31	0,13	1,10	1,10	667.027,42	0,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,000000%)	0,36	0,18	1,03	1,03	1.465.919,16	0,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,310000%)	0,37	0,19	1,05	1,05	1.503.840,87	0,17
TESOURO	NTN-B 150840 (5,450000%)	3,92	0,20	1,06	1,06	10.411.015,93	1,21

“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 (5,510000%)	2,80	0,20	1,07	1,07	5.121.855,68	0,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,700000%)	0,38	0,20	1,09	1,09	1.472.786,05	0,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,721100%)	4,03	0,20	1,09	1,09	3.576.247,83	0,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,920000%)	4,12	0,21	1,10	1,10	5.174.357,96	0,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,230000%)	0,39	0,22	1,13	1,13	5.286.042,82	0,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,090000%)	0,43	0,24	1,03	1,03	2.444.950,38	0,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,350000%)	0,44	0,25	1,06	1,06	2.513.003,47	0,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,500000%)	3,89	0,25	1,07	1,07	10.402.475,90	1,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,580000%)	0,44	0,26	1,08	1,08	2.379.328,49	0,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	0,45	0,26	1,09	1,09	2.459.554,22	0,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,859000%)	0,45	0,26	1,10	1,10	5.364.391,91	0,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,980000%)	4,15	0,27	1,11	1,11	2.069.763,34	0,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,020000%)	0,46	0,27	1,11	1,11	5.308.583,19	0,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,330000%)	0,47	0,28	1,14	1,14	5.287.590,24	0,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,500000%)	5,23	0,28	1,15	1,15	16.720.441,34	1,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,880000%)	0,49	0,29	1,10	1,10	5.371.671,93	0,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,000000%)	4,16	0,30	1,11	1,11	2.069.982,59	0,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,350000%)	0,51	0,30	1,14	1,14	10.576.565,38	1,23
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,44	0,24	1,10	1,10	254.276.463,40	29,48

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

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.24) TOTAL = 80 + (a.23)	12.086.310,28	6.023.050,79	9.585.173,78	32.424.289,25	48.224.689,63	51.417.932,28	68.324.462,58	21.314.856,73	249.400.765,32
(81) - Alocação possível "ALM novo" (81 = Y - (a.24))	-12.086.310,28	1.532.033,42	1.807.413,52	44.205.850,64	74.335.565,42	111.556.027,22	132.065.152,08	-3.206.639,01	350.209.093,02
(82) - Alocação possível "DPIN-2024" (82 = XX - a.24)	-12.086.310,28	-2.891.873,20	-4.863.556,78	-665.202,26	2.569.969,06	16.126.041,46	14.726.295,42	-13.809.970,76	-894.607,33
TÍTULOS MARCADOS A MERCADO							TOTAL + LFTs + NTN-F + NTN-B a mercado		251.370.809,47
LFT	0,00								
NTN-F	1.970.044,15								

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 realizados visto a boa oportunidade de mercado que se deu nessa classe de ativos com a abertura da curva de juros.

1.2. Art.7º, I, Alínea B - 4.963/2021 - Fundos 100% TP Referenciado: neste enquadramento da Resolução o BCPREVI ao término de janeiro de 2024 possui 22 fundos, e um total aplicado de R\$ 270.505.312,83, representando 31,36% 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	0,06	0,04	0,78	0,78	501.491,44	0,06	1.782.449.637,75	0,03
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,30	0,05	0,85	0,85	3.140.803,97	0,36	6.413.203.187,61	0,05
ITAU	ITAU	ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,05	0,04	0,96	0,96	83.490.304,00	9,68	40.259.571.835,64	0,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,26	0,02	1,10	1,10	293.640,65	0,03	194.648.819,70	0,15
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,93	0,04	1,06	1,06	7.432.484,28	0,86	249.959.324,58	2,97
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	0,30	0,04	1,07	1,07	3.698.508,90	0,43	282.901.211,77	1,31
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOUREIRO IPCA GERAL FI RF	4,18	0,20	-0,47	-0,47	3.065.660,89	0,36	440.892.082,92	0,70
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	1,87	0,11	0,66	0,66	4.013.459,25	0,47	1.491.138.811,56	0,27
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	4,17	0,20	-0,47	-0,47	4.218.730,38	0,49	275.374.320,20	1,53
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,17	0,20	-0,48	-0,48	43.856.455,69	5,08	5.251.127.483,30	0,84
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,15	0,20	-0,47	-0,47	4.161.333,76	0,48	5.008.664.499,36	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,86	0,11	0,66	0,66	25.268.252,90	2,93	7.718.818.121,25	0,33
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,51	0,28	-1,51	-1,51	17.571.576,34	2,04	1.616.605.994,98	1,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,42	0,28	-1,46	-1,46	15.957.113,51	1,85	1.446.793.477,31	1,10
BB	BB	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,81	0,12	0,45	0,45	122.083,51	0,01	251.431.992,48	0,05
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,87	0,11	0,66	0,66	19.112.593,93	2,22	5.294.436.148,21	0,36
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	1,26	0,02	1,10	1,10	1.206.850,85	0,14	108.070.585,66	1,12
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,31	0,11	0,66	0,66	12.078.857,61	1,40	5.336.453.186,66	0,23
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	4,35	0,20	-0,57	-0,57	1.426.965,78	0,17	534.300.850,64	0,27
BRAM	BRASESCO	BRASESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,05	0,04	0,95	0,95	12.577.802,86	1,46	10.512.919.193,01	0,12
BANRISUL	BANRISUL	BANRISUL SOBERANO FI RF SIMPLES LONGO	0,06	0,04	0,93	0,93	4.662.632,57	0,54	371.171.570,81	1,26

"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				
		PRAZO								
SAFRA	SAFRA	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,05	0,04	0,95	0,95	2.647.709,76	0,31	5.578.840.271,53	0,05
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	1,91	0,12	0,27	0,27	270.505.312,83	31,36		

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

JANEIRO - 2024										
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%	254.276.463,40	1,10%	11,21%	129,41%	115,69%	113,40%	87,10%	29,43%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	270.505.312,80	0,27%	13,01%	31,76%	134,26%	27,84%	101,09%	31,31%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	131.553.246,88	0,06%	13,47%	-92,94%	139,01%	6,19%	104,66%	15,23%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	380.460,07	-0,25%	-1,94%	-129,41%	-120,02%	-125,77%	-115,07%	0,04%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	105.688.204,72	-5,57%	6,00%	-755,29%	-38,08%	-18,28%	47,51%	12,23%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	8.899.253,66	-2,40%	23,72%	-382,35%	144,79%	49,90%	187,81%	1,03%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	47.773.350,71	3,19%	21,85%	375,29%	225,49%	111,54%	230,00%	5,53%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	21.650.605,21	4,56%	25,21%	536,47%	260,17%	195,20%	199,60%	2,51%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	18.198.450,66	1,63%	26,81%	191,76%	276,68%	41,37%	173,30%	2,11%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	3.007.913,95	-1,45%	-7,47%	-270,59%	-177,09%	-249,48%	-158,04%	0,35%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	2.111.116,32	-0,57%	24,55%	-167,06%	253,35%	-185,07%	135,19%	0,24%
IPCA + 5,02% MÊS	0,88%	Ibov mês	-4,79%	MSCI mês	2,86%	Ifix mês	0,67%	S&P mês	3,94%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,69%	Ibov 12 meses	12,63%	MSCI 12 meses	9,50%	Ifix 12 meses	18,16%	S&P 12 meses	15,47%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		0,97%	12,87%							

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

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	12.217,05	1.507.718,17	-1.020.859,23	0,00	501.491,44	2.415,45	2.415,45
BANRISUL SOBERANO FI RF SIMPLES LONGO PRAZO	4.850.016,46	1.008.723,43	-1.240.245,98	0,00	4.662.632,57	44.138,66	44.138,66
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	3.114.357,95	0,00	0,00	0,00	3.140.803,97	26.446,02	26.446,02
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	44.068.729,05	0,00	0,00	0,00	43.856.455,69	-212.273,36	-212.273,36
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	121.541,75	0,00	0,00	0,00	122.083,51	541,76	541,76
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	18.986.860,96	378,71	0,00	0,00	19.112.593,93	125.354,26	125.354,26
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	17.841.564,02	0,00	0,00	0,00	17.571.576,34	-269.987,68	-269.987,68

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

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

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	290.433,61	0,00	0,00	0,00	293.640,65	3.207,04	3.207,04
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI	1.193.683,77	0,00	0,00	0,00	1.206.850,85	13.167,08	13.167,08
BRAPRESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	12.459.973,71	0,00	0,00	0,00	12.577.802,86	117.829,15	117.829,15
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RF	3.080.240,19	0,00	0,00	0,00	3.065.660,89	-14.579,30	-14.579,30
FI CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.354.274,80	0,00	0,00	0,00	7.432.484,28	78.209,48	78.209,48
FI CAIXA BRASIL 2030 I TP RF	3.659.346,94	0,00	0,00	0,00	3.698.508,90	39.161,96	39.161,96
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.101.606,97	0,00	0,00	0,00	25.268.252,90	166.645,93	166.645,93
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.193.098,08	0,00	0,00	0,00	15.957.113,51	-235.984,57	-235.984,57
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.180.785,05	0,00	0,00	0,00	4.161.333,76	-19.451,29	-19.451,29
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	12.000.247,27	0,00	0,00	0,00	12.078.857,61	78.610,34	78.610,34
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	4.238.521,56	0,00	0,00	0,00	4.218.730,38	-19.791,18	-19.791,18
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	75.296.588,54	13.683.286,19	-6.243.862,89	0,00	83.490.304,00	754.292,16	754.292,16
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	3.987.073,21	0,00	0,00	0,00	4.013.459,25	26.386,04	26.386,04
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	1.435.173,88	0,00	0,00	0,00	1.426.965,78	-8.208,10	-8.208,10
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	2.622.771,40	0,00	0,00	0,00	2.647.709,76	24.938,36	24.938,36
	262.089.106,22	16.200.106,50	-8.504.968,10	0,00	270.505.312,83	721.068,21	

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\$ 131.553.246,88, representando 15,25% 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	8,88	0,23	1,33	1,33	5.167.915,36	0,60	232.072.505,38	2,23
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,12	0,07	0,84	0,84	18.626.733,52	2,16	1.007.936.711,89	1,85
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,52	0,26	-0,56	-0,56	15.898.469,72	1,84	467.744.830,38	3,40
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,05	1,00	1,00	1.030.473,15	0,12	15.073.540.268,85	0,01
BRAM	BRAPRESCO	BRAPRESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,10	0,12	0,41	0,41	4.398.740,28	0,51	203.303.943,56	2,16
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,04	0,97	0,97	135.874,12	0,02	16.400.080.186,89	0,00
BRAM	BRAPRESCO	BRAPRESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	6,54	0,28	-1,50	-1,50	24.757.318,78	2,87	157.509.729,68	15,72
BRAM	BRAPRESCO	BRAPRESCO H FI RF NILO	4,63	0,21	-0,54	-0,54	15.514.483,17	1,80	293.731.685,69	5,28
BRAM	BRAPRESCO	BRAPRESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,87	0,11	0,65	0,65	6.516.563,17	0,76	896.178.545,03	0,73
BRAM	BRAPRESCO	BRAPRESCO FI RF IDKA PRE 2	2,89	0,16	0,70	0,70	4.225.546,41	0,49	319.103.545,80	1,32
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	1,79	0,07	0,87	0,87	14.865.488,28	1,72	663.766.015,15	2,24
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,83	0,12	0,90	0,90	20.415.640,92	2,37	2.392.878.891,76	0,85
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,49	0,17	0,06	0,06	131.553.246,88	15,25		

Da tabela abaixo extrai-se os principais dados dos resultados do mês de janeiro 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

JANEIRO - 2024										
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%	254 276 463,40	1,10%	11,21%	129,41%	115,69%	113,40%	87,10%	29,43%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	270 505 312,80	0,27%	13,01%	31,76%	134,26%	27,84%	101,09%	31,31%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	131 553 246,88	0,06%	13,47%	-92,94%	139,01%	6,19%	104,66%	15,23%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	380 460,07	-0,25%	-1,94%	-129,41%	-120,02%	-125,77%	-115,07%	0,04%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	105 688 204,72	-5,57%	6,00%	-755,29%	-38,08%	-16,28%	47,51%	12,23%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	8 899 253,66	-2,40%	23,72%	-382,35%	144,79%	49,90%	187,81%	1,03%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	47 773 350,71	3,19%	21,85%	375,29%	225,49%	111,54%	230,00%	5,53%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	21 650 605,21	4,56%	25,21%	536,47%	260,17%	195,20%	199,60%	2,51%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	18 198 450,66	1,63%	26,81%	191,76%	276,68%	41,37%	173,30%	2,11%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	3 007 913,95	-1,45%	-7,47%	-270,59%	-177,09%	-249,48%	-158,04%	0,35%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	2 111 116,32	-0,57%	24,55%	-167,06%	253,35%	-185,07%	135,19%	0,24%
IPCA + 5,02% MÊS	0,85%	Ibov mês	-4,79%	MSCI mês	2,86%	Ifix mês	0,67%	S&P mês	3,94%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,69%	Ibov 12 meses	12,63%	MSCI 12 meses	9,50%	Ifix 12 meses	18,16%	S&P 12 meses	15,47%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		0,97%	12,87%							

Neste enquadramento, no mês de janeiro de 2024, ocorreram as seguintes movimentações nestes fundos.

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	8,88	0,23	1,33	1,33	5.167.915,36	0,60	232.072.505,38	2,23
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,12	0,07	0,84	0,84	18.626.733,52	2,16	1.007.936.711,89	1,85
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,52	0,26	-0,56	-0,56	15.898.469,72	1,84	467.744.830,38	3,40
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,05	1,00	1,00	1.030.473,15	0,12	15.073.540.268,85	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FI RF IMA GERAL	2,10	0,12	0,41	0,41	4.398.740,28	0,51	203.303.943,56	2,16
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,04	0,97	0,97	135.874,12	0,02	16.400.080.186,89	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5+	6,54	0,28	-1,50	-1,50	24.757.318,78	2,87	157.509.729,68	15,72
BRAM	BRADESCO	BRADESCO H FI RF NILO	4,63	0,21	-0,54	-0,54	15.514.483,17	1,80	293.731.685,69	5,28
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,87	0,11	0,65	0,65	6.516.563,17	0,75	896.178.545,03	0,73
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	2,89	0,16	0,70	0,70	4.225.546,41	0,49	319.103.545,80	1,32
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FC	1,79	0,07	0,87	0,87	14.865.488,28	1,72	663.766.015,15	2,24
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,83	0,12	0,90	0,90	20.415.640,92	2,36	2.392.878.891,76	0,85
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,49	0,17	0,06	0,06	131.553.246,88	15,23		

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\$ 380.460,07, representando 0,04% 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	PIATÁ FI RF LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,60	-0,01	-0,25	-0,25	380.460,07	0,04	21.466.611,27	1,77
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,60	-0,01	-0,25	-0,25	380.460,07	0,04		

“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

Este fundo encontra-se em liquidação e, neste mês, houve as seguintes movimentações neste fundo.

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
PIATÁ FI RI LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	383.180,16	0,00	0,00	1.772,33	380.460,07	-947,76	-947,76
	383.180,16	0,00	0,00	1.772,33	380.460,07	-947,76	-947,76

A tabela abaixo demonstra o histórico de movimentação financeira realizada pelo fundo e as recuperações de créditos devolvidas ao BCPREVI.

HISTÓRICO FUNDO PIATÁ		
DATA	DESCRIÇÃO	VALOR
29/01/2009	Aplicação inicial	R\$ 3.000.000,00
22/01/2015	Depósito Judicial parcial	R\$ 223.314,09
10/11/2017	Recuperação parcial	R\$ 708.933,67
16/05/2018	Recuperação parcial	R\$ 518,90
27/05/2019	Crédito em conta ref.ao depósito judicial do dia 22/01/2015. (R\$ 106.466,75 juros).	R\$ 329.780,84
06/12/2019	Recuperação de crédito	R\$ 680.830,01
13/01/2020	Recuperação de crédito	R\$ 93.131,31
11/02/2020	Recuperação de crédito	R\$ 10.174,34
26/03/2020	Recuperação de crédito	R\$ 10.104,07
17/07/2020	Recuperação de crédito	R\$ 28.573,85
10/06/2022	Recuperação de crédito	R\$ 212.910,50
04/10/2022	Recuperação de crédito	R\$ 173.242,66
20/10/2022	Recuperação de crédito	R\$ 140.241,37

“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

19/09/2023	Recuperação de crédito	R\$ 12.406,34
03/01/2024	Recuperação de crédito	R\$ 1.772,33

1.5. Art.8º, I, - 4.963/2021 - Fundos de Ações: neste enquadramento da Resolução, atualmente, o BCPREVI aplica em 16 fundos, totalizando um investimento de R\$ 105.688.204,72, representando 12,25% 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	TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,16	0,36	-6,91	-6,91	1.466.222,28	0,17	98.781.516,39	1,48
BB	BB	BB AÇÕES SMALL CAPS FIC DE FI	22,87	1,61	-7,07	-7,07	17.456.379,88	2,02	317.202.086,53	5,50
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	15,75	0,70	-4,48	-4,48	4.410.450,50	0,51	350.306.979,43	1,26
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	26,85	1,27	-8,52	-8,52	6.659.369,40	0,77	213.492.036,53	3,12
CONSTANCIA	BEM	CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	14,44	0,91	-3,43	-3,43	1.222.575,63	0,14	1.467.717.616,36	0,08
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,33	0,43	-3,37	-3,37	10.698.263,83	1,24	1.385.702.652,77	0,77
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	16,82	0,51	-4,58	-4,58	7.439.509,32	0,86	186.407.629,54	3,99
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	23,56	0,62	-8,43	-8,43	4.825.550,17	0,56	113.184.227,81	4,26
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	21,62	1,54	-6,59	-6,59	9.331.928,07	1,08	662.400.867,22	1,41
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	14,88	-0,64	-2,29	-2,29	10.577.433,58	1,23	1.251.206.665,79	0,85
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	18,96	1,09	-6,19	-6,19	4.216.147,24	0,49	183.554.894,03	2,30
BRAM	BEM	BRANCO FIA SELECTION	16,22	0,71	-4,28	-4,28	15.050.035,72	1,74	436.141.421,13	3,45
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	18,45	0,56	-1,49	-1,49	228.626,41	0,03	483.893.890,15	0,05
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	19,02	1,09	-6,24	-6,24	3.457.137,53	0,40	147.479.138,82	2,34
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	24,61	2,15	-6,91	-6,91	7.247.229,50	0,84	218.440.862,94	3,32
TRÍGONO	DAYCOVAL	TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	20,50	0,34	-7,81	-7,81	1.401.345,66	0,16	249.514.908,26	0,56
Sub-total Artigo 8º I			18,24	0,90	-5,57	-5,57	105.688.204,72	12,25		

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, sendo que o objetivo é de 17%. 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

JANEIRO - 2024										
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%	254 276 463,40	1,10%	11,21%	129,41%	115,69%	113,40%	87,10%	29,43%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	270 505 312,80	0,27%	13,01%	31,76%	134,26%	27,84%	101,09%	31,31%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	131 553 246,88	0,06%	13,47%	-92,94%	139,01%	6,19%	104,66%	15,23%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	380 460,07	-0,25%	-1,94%	-129,41%	-120,02%	-125,77%	-115,07%	0,04%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	105 688 204,72	-5,57%	6,00%	-755,29%	-38,08%	-16,28%	47,51%	12,23%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	8 899 253,66	-2,40%	23,72%	-382,35%	144,79%	49,90%	187,81%	1,03%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	47 773 350,71	3,19%	21,85%	375,29%	225,49%	111,54%	230,00%	5,53%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	21 650 605,21	4,56%	25,21%	536,47%	260,17%	195,20%	199,60%	2,51%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	18 198 450,66	1,63%	26,81%	191,76%	276,68%	41,37%	173,30%	2,11%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	3 007 913,95	-1,45%	-7,47%	-270,59%	-177,09%	-249,48%	-158,04%	0,35%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	2 111 116,32	-0,57%	24,55%	-167,06%	253,35%	-185,07%	135,19%	0,24%
IPCA + 5,02% MÊS	0,85%	Ibov mês	-4,79%	MSCI mês	2,86%	Ifix mês	0,67%	S&P mês	3,94%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,69%	Ibov 12 meses	12,63%	MSCI 12 meses	9,50%	Ifix 12 meses	18,16%	S&P 12 meses	15,47%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		0,97%	12,87%							

Neste mês de janeiro, não houveram movimentações neste enquadramento.

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

“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

FUNDOS - ART.8º, I, - JANEIRO/2024											
FUNDO	DATA aplicação	Aplicação Inicial	qdo cota	R\$ cota aquisição	valor atual cota	Saldo atual	Rentabilidade				
							R\$ por	% por			
	06/06/2018	300 000,00	436,86	686,72	944,49	412 609,41	112 609,41	37,54%			
	03/01/2019	2 192 653,53	2 621,81	836,31	944,49	2 476 273,43	283 619,90	12,94%			
	04/02/2019	2 000 000,00	2 310,12	865,76	944,49	2 181 879,71	181 879,71	9,09%			
	14/06/2019	4 500 000,00	5 112,28	880,24	944,49	4 828 472,17	328 472,17	7,30%			
	17/09/2020	100 000,00	118,77	842,00	944,49	112 172,39	12 172,39	12,17%			
	19/11/2020	100 000,00	112,04	892,58	944,49	105 615,94	5 615,94	5,82%			
	11/03/2021	100 000,00	106,86	937,52	944,49	100 742,83	742,83	0,74%			
	13/04/2021	100 000,00	102,91	971,74	944,49	97 195,82	(2 804,18)	-2,80%			
	18/05/2021	100 000,00	99,71	1 002,95	944,49	94 171,14	(5 828,86)	-5,83%			
	18/06/2021	100 000,00	94,92	1 053,49	944,49	89 653,67	(10 346,33)	-10,35%			
	23/07/2021	100 000,00	96,47	1 036,64	944,49	91 110,80	(8 889,20)	-8,89%			
	31/08/2021	1 000 000,00	1 024,05	976,52	944,49	967 202,92	(32 797,08)	-3,28%			
	05/10/2021	100 000,00	112,85	886,11	944,49	106 588,01	6 588,01	6,59%			
	26/10/2021	100 000,00	117,83	848,70	944,49	111 286,32	11 286,32	11,29%			
	24/11/2021	200 000,00	237,15	843,34	944,49	223 966,74	23 966,74	11,99%			
	20/12/2021	200 000,00	245,80	813,66	944,49	232 157,59	32 157,59	16,08%			
	28/01/2022	400 000,00	457,71	873,92	944,49	432 296,73	32 296,73	8,07%			
	18/03/2022	400 000,00	458,12	873,13	944,49	432 690,50	32 690,50	8,17%			
	22/04/2022	400 000,00	480,91	873,92	944,49	435 328,99	35 328,99	8,83%			
	19/05/2022	200 000,00	234,89	851,47	944,49	221 846,51	21 846,51	10,92%			
	15/07/2022	100 000,00	132,59	754,22	944,49	125 227,29	25 227,29	25,23%			
	16/09/2022	200 000,00	226,59	882,64	944,49	214 614,56	14 614,56	7,01%			
	17/10/2022	200 000,00	217,06	921,30	944,49	205 033,27	5 033,27	2,52%			
	13/04/2023	100 000,00	119,92	833,91	944,49	113 260,79	13 260,79	13,26%			
	17/05/2023	100 000,00	118,16	846,15	944,49	111 622,32	11 622,32	11,62%			
	29/06/2023	100 000,00	108,33	923,09	944,49	102 316,63	2 316,63	2,32%			
	25/07/2023	100 000,00	105,22	950,37	944,49	99 380,67	(619,33)	-0,62%			
	28/08/2023	100 000,00	110,11	908,15	944,49	104 901,75	4 901,75	4,00%			
	09/10/2023	100 000,00	115,26	867,83	944,49	108 856,29	8 856,29	8,86%			
	31/10/2023	100 000,00	119,46	837,09	944,49	112 829,97	12 829,97	12,83%			
Bradesco Fia Selection	SALDO	13 892 653,53	15 934,58	885,71	944,49	15 050 033,17	1 157 379,64	8,33%	-4,28%	-4,28%	-3,81%

“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

	16/06/2019	4 400 000,00	496 489,78	8,83	8,2633	4 119 003,14	(260 996,86)	-6,39%			
	26/08/2019	2 300 000,00	265 867,50	8,65	8,2633	2 196 941,86	(103 058,14)	-4,48%			
	17/09/2019	1 400 000,00	156 942,72	8,92	8,2633	1 296 064,13	(103 935,87)	-7,37%			
	15/10/2019	1 400 000,00	152 487,25	9,18	8,2633	1 260 047,27	(139 952,73)	-10,00%			
	14/11/2019	1 400 000,00	149 752,28	9,35	8,2633	1 237 447,25	(162 552,75)	-11,61%			
	11/12/2019	1 000 000,00	90 573,41	10,14	8,2633	814 541,30	(185 458,70)	-18,55%			
	16/12/2019	1 400 000,00	133 784,13	10,48	8,2633	1 105 497,84	(294 502,16)	-21,04%			
	24/04/2020	1 000 000,00	153 292,28	6,52	8,2633	1 266 699,49	266 699,49	26,67%			
	18/05/2020	900 000,00	137 990,94	6,52	8,2633	1 140 260,02	240 260,02	26,70%			
	26/08/2020	250 000,00	27 685,22	9,03	8,2633	228 771,19	(21 228,81)	-8,49%			
	19/05/2021	1 000 000,00	94 032,85	10,63	8,2633	777 021,30	(222 978,70)	-22,30%			
	20/04/2022	400 000,00	47 042,86	8,50	8,2633	388 729,08	(11 270,92)	-2,82%			
	23/05/2022	200 000,00	25 077,37	7,98	8,2633	207 221,76	7 221,76	3,61%			
	14/07/2022	100 000,00	15 092,52	6,63	8,2633	124 713,95	24 713,95	24,71%			
	16/09/2022	400 000,00	51 669,32	7,74	8,2633	426 958,90	26 958,90	6,74%			
	21/10/2022	400 000,00	50 033,12	7,99	8,2633	413 438,50	13 438,50	3,38%			
	12/04/2023	200 000,00	30 717,54	6,51	8,2633	253 628,13	53 628,13	26,91%			
	17/05/2023	300 000,00	43 187,21	6,95	8,2633	356 868,67	56 868,67	18,96%			
	28/06/2023	300 000,00	38 900,16	7,71	8,2633	321 443,56	21 443,56	7,15%			
	26/07/2023	289 750,70	35 422,35	8,18	8,2633	292 705,39	2 954,69	1,02%			
	27/07/2023	251,85	30,29	8,32	8,2633	(250,08)	1,77	-0,70%			
	SALDO	19 035 458,85	2 205 950,53	8,63	7,5713	16 702 189,98	-2 337 308,87	-12,28%			
	28/08/2023	100 000,00	12 754,05	7,84	7,5713	96 564,58	(3 435,42)	-3,44%			
	08/10/2023	200 000,00	28 654,73	6,98	7,5713	216 953,25	16 953,25	8,48%			
	11/10/2023	100 000,00	13 804,54	7,24	7,5713	104 518,15	4 518,15	4,52%			
	31/10/2023	299 995,40	44 397,84	6,76	7,5713	336 148,84	36 153,44	12,05%			
	01/11/2023	4,60	0,67	6,86	7,5713	5,08	0,48	10,38%			
BB AÇÕES \$ SMALL CAP \$ FIC FI	SALDO	19 735 458,85	2 305 602,36	7,35	7,5713	17 458 375,87	-2 283 118,98	-11,57%	-7,07%	-7,07%	5,97%

	24/10/2017	1 000 000,00	363 336,13	2,75	3,5907	1 304 628,32	304 628,32	30,46%			
	03/05/2018	500 000,00	174 929,58	2,88	3,5907	628 117,29	128 117,29	25,62%			
	01/02/2019	1 000 000,00	280 438,59	3,57	3,5907	1 008 987,22	6 987,22	0,70%			
	21/05/2019	2 000 000,00	569 408,27	3,51	3,5907	2 044 559,88	44 559,88	2,23%			
	30/01/2020	1 500 000,00	321 425,08	4,87	3,5907	1 154 136,77	(345 863,23)	-23,08%			
	16/09/2020	100 000,00	21 819,76	4,58	3,5907	78 347,93	(21 652,07)	-21,65%			
	18/11/2020	100 000,00	21 383,12	4,88	3,5907	76 780,08	(23 219,92)	-23,22%			
	10/03/2021	100 000,00	20 480,47	4,88	3,5907	73 638,94	(26 461,06)	-26,46%			
	12/04/2021	100 000,00	19 752,27	5,08	3,5907	70 924,20	(29 075,80)	-29,08%			
	20/05/2021	100 000,00	20 390,17	4,90	3,5907	73 214,72	(26 785,28)	-26,78%			
	21/08/2021	100 000,00	19 184,32	5,21	3,5907	88 894,88	(31 115,12)	-31,12%			
	19/07/2021	100 000,00	19 192,23	5,21	3,5907	88 913,29	(31 088,71)	-31,08%			
	24/08/2021	900 000,00	191 139,67	4,71	3,5907	888 322,73	(213 877,27)	-23,74%			
	04/10/2021	100 000,00	24 442,08	4,09	3,5907	87 763,78	(12 236,22)	-12,24%			
	25/10/2021	100 000,00	28 171,79	3,82	3,5907	93 974,69	(6 025,31)	-6,03%			
	25/11/2021	200 000,00	55 479,49	3,80	3,5907	199 209,49	(790,51)	-0,40%			
	20/12/2021	200 000,00	58 878,82	3,40	3,5907	211 415,43	11 415,43	5,71%			
	28/01/2022	400 000,00	113 184,04	3,53	3,5907	405 408,45	6 408,45	1,60%			
	21/03/2022	400 000,00	112 625,82	3,55	3,5907	404 403,35	4 403,35	1,10%			
	20/04/2022	400 000,00	114 628,15	3,49	3,5907	411 586,83	11 586,83	2,90%			
	20/05/2022	200 000,00	82 368,78	3,21	3,5907	223 903,69	23 903,69	11,95%			
	13/07/2022	100 000,00	33 404,16	2,99	3,5907	119 943,90	19 943,90	19,94%			
	16/09/2022	200 000,00	60 117,05	3,33	3,5907	215 891,52	15 891,52	7,93%			
	17/10/2022	200 000,00	58 534,53	3,42	3,5907	210 179,18	10 179,18	5,09%			
	13/04/2023	100 000,00	33 457,54	2,99	3,5907	120 135,55	20 135,55	20,14%			
	17/05/2023	100 000,00	32 384,00	3,09	3,5907	116 208,99	16 208,99	16,21%			
	28/08/2023	100 000,00	29 878,52	3,35	3,5907	107 284,42	7 284,42	7,28%			
	25/07/2023	100 000,00	28 258,18	3,54	3,5907	101 459,08	1 459,08	1,46%			
	22/08/2023	100 000,00	29 801,53	3,38	3,5907	107 007,98	7 007,98	7,01%			
	06/10/2023	100 000,00	31 432,27	3,18	3,5907	112 883,46	12 883,46	12,88%			
	31/10/2023	100 000,00	31 579,48	3,17	3,5907	113 392,02	13 392,02	13,39%			
BTG PACTUAL ABS INST FI DE AÇÕES	SALDO	10 800 000,00	2 979 467,62	3,80	3,5907	10 698 335,63	(101 664,37)	-0,94%	-3,37%	-3,37%	6,94%

“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

	14/08/2019	1 400 000,00	425 185,24	3,29	3,24	1 375 828,52	(24 073,48)	-1,72%			
	05/03/2020	2 000 000,00	582 212,80	3,44	3,24	1 884 077,71	(115 922,29)	-5,80%			
	17/09/2020	100 000,00	26 798,84	3,73	3,24	98 722,75	(13 277,25)	-13,28%			
	18/11/2020	100 000,00	25 838,89	3,87	3,24	83 815,85	(16 384,35)	-19,38%			
	11/03/2021	100 000,00	26 304,00	3,80	3,24	85 121,42	(14 878,58)	-14,88%			
	13/04/2021	100 000,00	25 229,43	3,98	3,24	81 844,04	(18 355,96)	-18,38%			
	19/05/2021	100 000,00	25 059,27	3,99	3,24	81 083,89	(18 916,31)	-18,92%			
	23/07/2021	100 000,00	24 899,04	4,02	3,24	80 488,09	(19 531,91)	-19,53%			
	27/08/2021	400 000,00	105 789,13	3,78	3,24	342 340,36	(57 659,64)	-14,41%			
	01/10/2021	100 000,00	27 589,04	3,82	3,24	89 279,89	(10 720,11)	-10,72%			
	22/10/2021	100 000,00	30 320,35	3,30	3,24	98 118,58	(1 881,42)	-1,88%			
	24/11/2021	200 000,00	61 443,01	3,26	3,24	198 833,49	(1 186,51)	-0,58%			
	17/12/2021	200 000,00	58 790,89	3,40	3,24	190 251,07	(9 748,93)	-4,87%			
	28/01/2022	400 000,00	112 345,24	3,58	3,24	383 558,35	(35 443,65)	-9,11%			
	18/03/2022	400 000,00	119 899,46	3,34	3,24	388 002,39	(11 697,61)	-3,00%			
	19/04/2022	400 000,00	114 851,93	3,48	3,24	371 858,16	(28 331,84)	-7,08%			
	20/05/2022	200 000,00	59 330,43	3,37	3,24	191 997,05	(8 002,95)	-4,00%			
	13/07/2022	100 000,00	32 394,47	3,09	3,24	104 830,57	4 830,57	4,83%			
	15/09/2022	200 000,00	57 248,42	3,48	3,24	185 253,09	(14 746,94)	-7,37%			
	14/10/2022	200 000,00	56 118,57	3,58	3,24	181 803,59	(18 396,41)	-9,20%			
	12/04/2023	100 000,00	38 891,94	2,57	3,24	125 759,71	25 759,71	25,78%			
	16/05/2023	100 000,00	35 583,77	2,81	3,24	115 151,35	15 151,35	15,15%			
	27/08/2023	100 000,00	31 478,25	3,18	3,24	101 885,62	1 885,62	1,87%			
	24/07/2023	100 000,00	30 059,85	3,33	3,24	97 275,59	(2 724,41)	-2,72%			
	21/08/2023	100 000,00	31 781,11	3,15	3,24	102 845,70	2 845,70	2,85%			
	05/10/2023	100 000,00	38 153,35	2,77	3,24	116 994,54	16 994,54	16,99%			
	30/10/2023	100 000,00	37 991,38	2,83	3,24	122 942,52	22 942,52	22,94%			
MOAT CAPITAL FIC FIA	SALDO	7 600 000,00	2 239 520,03	3,40	3,24	7 247 229,46	(352 770,54)	-4,64%	-8,91 %	-8,91%	14,88%

	04/02/2019	1 500 000,00	578 123,95	2,59	2,94	1 898 800,89	198 800,89	13,24%			
	03/02/2020	1 500 000,00	478 031,89	3,15	2,94	1 398 841,00	(101 359,00)	-6,78%			
	17/09/2020	100 000,00	38 584,20	2,73	2,94	107 430,22	7 430,22	7,43%			
	18/11/2020	100 000,00	33 813,80	2,98	2,94	99 349,19	(850,81)	-0,85%			
	11/03/2021	100 000,00	30 764,75	3,25	2,94	90 390,71	(9 609,29)	-9,61%			
	13/04/2021	100 000,00	28 888,81	3,48	2,94	84 878,37	(15 121,63)	-15,12%			
	19/05/2021	100 000,00	28 457,17	3,51	2,94	83 810,75	(16 389,25)	-16,39%			
	26/07/2021	99 978,05	27 638,34	3,58	2,94	82 088,36	(17 891,69)	-17,90%			
	30/08/2021	400 000,00	121 183,07	3,30	2,94	355 992,34	(44 007,66)	-11,00%			
	04/10/2021	100 000,00	33 152,84	3,02	2,94	97 407,20	(2 592,80)	-2,59%			
	25/10/2021	100 000,00	34 840,40	2,87	2,94	102 395,47	2 395,47	2,37%			
	25/11/2021	200 000,00	72 735,13	2,75	2,94	213 704,97	13 704,97	6,85%			
	20/12/2021	200 000,00	74 793,12	2,87	2,94	219 751,81	19 751,81	9,88%			
	28/01/2022	400 000,00	142 760,13	2,80	2,94	419 447,21	19 447,21	4,86%			
	18/03/2022	400 000,00	141 688,90	2,83	2,94	416 000,11	16 000,11	4,00%			
	20/04/2022	400 000,00	143 204,84	2,79	2,94	420 753,24	20 753,24	5,19%			
	20/05/2022	200 000,00	73 577,07	2,72	2,94	216 178,89	16 178,89	8,06%			
	14/07/2022	100 000,00	43 194,37	2,32	2,94	126 910,48	26 910,48	26,91%			
	16/09/2022	200 000,00	75 384,50	2,65	2,94	221 430,37	21 430,37	10,72%			
	17/10/2022	200 000,00	71 471,87	2,80	2,94	209 992,77	9 992,77	5,00%			
	13/04/2023	100 000,00	39 205,83	2,55	2,94	115 191,07	15 191,07	15,19%			
	19/05/2023	100 000,00	38 415,26	2,60	2,94	112 888,87	12 888,87	12,87%			
	28/08/2023	100 000,00	38 848,18	2,71	2,94	108 258,70	8 258,70	8,28%			
	25/07/2023	100 000,00	35 188,16	2,84	2,94	103 387,23	3 387,23	3,38%			
	22/08/2023	100 000,00	37 092,57	2,70	2,94	108 982,84	8 982,84	8,98%			
	08/10/2023	100 000,00	38 354,38	2,81	2,94	112 889,99	12 889,99	12,89%			
	31/10/2023	100 000,00	38 530,88	2,80	2,94	113 207,98	13 207,98	13,21%			
BAHIA AM VAL FC DE FIA	SALDO	7 199 978,05	2 532 059,19	2,87	2,94	7 439 508,43	239 530,38	0,61	-4,58%	-4,58%	5,43%

“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

	15/8/2019	3 000 000,00	1 871 722,15	1,60	2,11	3 958 382,06	958 382,06	31,88%			
	27/8/2019	2 000 000,00	1 282 411,34	1,58	2,11	2 710 703,40	710 703,40	35,54%			
	20/1/2020	7 000 000,00	3 283 152,89	2,13	2,11	8 939 780,45	(80 219,55)	-0,89%			
	17/9/2020	100 000,00	58 718,53	1,70	2,11	124 118,80	24 118,80	24,12%			
	21/07/2021	-2 482 843,79	1 419 275,17	1,75	2,11	(3 000 000,00)	-517 156,21	-20,83%			
	SALDO	9 517 156,21	5 076 729,64	1,89	1,48	7 536 532,07	-2 080 624,14	-21,53%			
	20/04/2022	400 000,00	243 389,28	1,84	1,48	381 313,02	(38 686,98)	-9,87%			
	23/05/2022	200 000,00	129 513,30	1,54	1,48	192 285,73	(7 734,27)	-3,87%			
	14/07/2022	100 000,00	77 358,91	1,29	1,48	114 841,23	14 841,23	14,84%			
	18/09/2022	200 000,00	133 178,81	1,50	1,48	197 704,00	(2 295,00)	-1,15%			
	17/10/2022	200 000,00	131 809,01	1,52	1,48	195 673,77	(4 326,23)	-2,16%			
	13/04/2023	100 000,00	77 594,03	1,29	1,48	115 190,27	15 190,27	15,19%			
	17/05/2023	100 000,00	73 243,85	1,37	1,48	108 732,04	8 732,04	8,73%			
	29/06/2023	100 000,00	65 527,15	1,53	1,48	97 276,89	(2 723,31)	-2,72%			
	25/07/2023	100 000,00	83 898,89	1,57	1,48	94 562,80	(5 437,40)	-5,44%			
	22/08/2023	100 000,00	65 131,22	1,54	1,48	98 888,82	(3 311,08)	-3,31%			
	08/10/2023	100 000,00	73 485,13	1,38	1,48	109 080,82	9 080,82	9,08%			
	31/10/2023	100 000,00	75 503,55	1,32	1,48	112 089,91	12 089,91	12,09%			
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		11 417 156,21	6 286 137,36	1,49	1,48	9 331 928,07	(2 085 228,14)	-18,26%	-8,59 %	-8,59%	5,31%

	21/1/2020	1 500 000,00	603 131,46	2,49	1,42	857 288,04	(642 711,99)	-42,85%			
	31/1/2020	1 500 000,00	624 737,09	2,40	1,42	887 998,18	(612 001,82)	-40,80%			
	2/9/2020	300 000,00	183 560,34	1,83	1,42	280 911,74	(39 088,26)	-13,03%			
	17/11/2020	200 000,00	122 858,39	1,83	1,42	174 627,45	(25 372,55)	-12,69%			
	10/3/2021	100 000,00	66 870,93	1,50	1,42	94 785,73	(5 234,27)	-5,23%			
	12/4/2021	100 000,00	82 954,85	1,55	1,42	89 483,71	(10 518,29)	-10,52%			
	18/5/2021	100 000,00	82 188,90	1,81	1,42	88 384,99	(11 605,01)	-11,81%			
	21/6/2021	100 000,00	59 001,40	1,89	1,42	83 884,30	(16 135,70)	-16,14%			
	18/7/2021	100 000,00	83 137,25	1,58	1,42	89 742,97	(10 257,03)	-10,26%			
	25/8/2021	300 000,00	211 055,21	1,42	1,42	299 992,82	(7,18)	0,00%			
	4/10/2021	100 000,00	81 889,71	1,22	1,42	116 389,19	16 389,19	16,37%			
	25/10/2021	100 000,00	88 975,97	1,12	1,42	128 489,99	28 489,99	28,47%			
	25/11/2021	200 000,00	168 339,40	1,19	1,42	239 278,78	39 278,78	19,84%			
	20/12/2021	200 000,00	175 123,83	1,14	1,42	248 920,14	48 920,14	24,46%			
	28/1/2022	400 000,00	309 880,80	1,29	1,42	440 150,31	40 150,31	10,04%			
	21/3/2022	400 000,00	347 420,96	1,15	1,42	493 822,42	93 822,42	23,46%			
	20/04/2022	400 000,00	329 502,05	1,21	1,42	468 352,55	68 352,55	17,09%			
	23/05/2022	200 000,00	171 959,73	1,16	1,42	244 422,70	44 422,70	22,21%			
	14/07/2022	100 000,00	96 800,34	1,04	1,42	137 307,25	37 307,25	37,31%			
	18/09/2022	200 000,00	163 377,87	1,22	1,42	232 224,20	32 224,20	16,11%			
	17/10/2022	200 000,00	156 437,08	1,28	1,42	222 358,88	22 358,88	11,18%			
	13/04/2023	100 000,00	88 454,56	1,13	1,42	125 728,87	25 728,87	25,73%			
	17/05/2023	100 000,00	82 127,77	1,22	1,42	119 738,00	16 738,00	16,74%			
	29/06/2023	100 000,00	71 536,28	1,40	1,42	101 881,32	1 881,32	1,88%			
	25/07/2023	100 000,00	86 795,05	1,50	1,42	94 942,15	(5 057,85)	-5,06%			
	22/08/2023	100 000,00	65 131,22	1,54	1,42	92 577,19	(7 422,81)	-7,42%			
	08/10/2023	100 000,00	79 435,75	1,26	1,42	112 909,58	12 909,58	12,91%			
	31/10/2023	100 000,00	79 905,78	1,25	1,42	113 577,67	13 577,67	13,58%			
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL		7 500 000,00	4 681 947,76	1,42	1,42	6 654 897,13	(845 102,87)	-11,27%	-8,52%	-8,52%	28,00%

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

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

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

FIA CAIXA AÇÕES CONSUMO	21/1/2020	1 500 000,00	654 636,77	2,29	1,10	721 749,48	(778 260,52)	-51,88%			
	31/1/2020	1 500 000,00	680 375,79	2,20	1,10	750 127,23	(749 872,77)	-49,99%			
	2/9/2020	500 000,00	244 190,82	2,05	1,10	289 225,02	(230 774,98)	-46,15%			
	17/11/2020	100 000,00	49 015,82	2,04	1,10	54 040,55	(45 959,35)	-45,96%			
	10/3/2021	100 000,00	49 336,52	2,20	1,10	54 394,45	(45 805,55)	-45,81%			
	12/4/2021	100 000,00	47 389,57	2,04	1,10	52 225,55	(47 774,15)	-47,77%			
	18/5/2021	100 000,00	48 343,09	2,07	1,10	53 269,17	(48 700,83)	-48,70%			
	21/6/2021	100 000,00	45 088,83	2,22	1,10	49 711,30	(50 288,70)	-50,29%			
	18/7/2021	100 000,00	48 575,84	2,15	1,10	51 360,75	(48 649,25)	-48,66%			
	25/8/2021	400 000,00	193 781,93	2,06	1,10	213 826,21	(198 373,79)	-46,59%			
	4/10/2021	100 000,00	54 982,30	1,82	1,10	60 566,98	(39 403,02)	-39,40%			
	25/10/2021	100 000,00	57 942,83	1,73	1,10	63 883,07	(36 116,93)	-36,12%			
	25/11/2021	200 000,00	121 469,49	1,65	1,10	133 922,42	(98 077,58)	-33,04%			
	20/12/2021	200 000,00	128 247,30	1,58	1,10	141 395,09	(68 804,91)	-29,30%			
	28/1/2022	400 000,00	263 241,81	1,58	1,10	279 203,91	(120 796,09)	-30,20%			
	21/3/2022	400 000,00	264 615,72	1,51	1,10	291 743,98	(108 266,14)	-27,06%			
	20/04/2022	400 000,00	267 085,99	1,50	1,10	294 487,38	(105 632,62)	-26,38%			
	23/05/2022	200 000,00	150 670,26	1,33	1,10	166 116,82	(33 883,18)	-18,94%			
	14/07/2022	100 000,00	81 783,27	1,22	1,10	90 167,81	(8 332,39)	-9,83%			
	16/09/2022	200 000,00	150 008,97	1,33	1,10	165 385,54	(34 614,46)	-17,31%			
	17/10/2022	200 000,00	150 102,19	1,33	1,10	165 460,51	(34 509,49)	-17,25%			
	13/04/2023	100 000,00	97 988,78	1,02	1,10	108 034,49	8 034,49	8,03%			
	17/05/2023	100 000,00	92 991,48	1,08	1,10	102 194,10	2 194,10	2,19%			
	29/06/2023	100 000,00	82 427,18	1,21	1,10	90 877,54	(8 122,48)	-9,12%			
	25/07/2023	100 000,00	81 328,32	1,23	1,10	89 666,02	(10 333,98)	-10,33%			
	22/08/2023	100 000,00	84 939,58	1,18	1,10	93 647,82	(8 352,38)	-8,35%			
	08/10/2023	100 000,00	96 528,21	1,04	1,10	106 421,99	6 421,99	6,42%			
	31/10/2023	100 000,00	102 116,26	0,98	1,10	112 585,11	12 585,11	12,58%			
	SALDO	7 700 000,00	4 376 840,81	1,63	1,10	4 825 550,15	(2 874 449,85)	-37,33%			
ITAU AÇÕES DUNAMIS FC	01/02/2019	2 000 000,00	110 720,69	18,06	23,67	2 620 785,16	620 785,16	31,04%			
	14/06/2019	3 000 000,00	161 104,71	18,62	23,67	3 813 357,89	813 357,89	27,11%			
	19/07/2019	2 000 000,00	99 959,43	20,01	23,67	2 366 045,52	366 045,52	18,30%			
	15/08/2019	1 500 000,00	75 084,94	19,98	23,67	1 777 265,04	277 265,04	18,48%			
	SALDO	8 500 000,00	446 869,76	19,17	23,67	10 577 433,61	2 077 433,61	24,44%			
	-2,29%	-2,29%	6,33%								
ITAU INST PHOENIX FI AÇÕES	23/10/2017	1 000 000,00	60 334,20	16,57	17,40	1 049 516,18	49 516,18	4,95%			
	02/03/2018	1 500 000,00	82 708,92	18,14	17,40	1 438 890,76	(61 309,24)	-4,09%			
	03/04/2018	1 500 000,00	82 015,44	18,29	17,40	1 426 662,37	(73 337,63)	-4,89%			
	29/05/2018	300 000,00	17 319,78	17,32	17,40	301 277,97	1 277,97	0,43%			
SALDO	4 300 000,00	242 376,32	17,58	17,40	4 216 147,26	(83 852,74)	-1,95%	-8,19%	-8,19%	-3,33%	
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	29/12/2017	1 000 000,00	486 896,64	2,05	3,02	1 468 877,57	468 877,57	46,89%			
	05/03/2018	1 500 000,00	680 831,38	2,27	3,02	1 993 606,88	493 606,88	32,91%			
	01/09/2020	1 000 000,00	349 372,07	2,86	3,02	1 053 991,26	53 991,26	5,40%			
	18/11/2020	100 000,00	34 231,78	2,92	3,02	103 270,98	3 270,98	3,27%			
	11/03/2021	100 000,00	31 896,22	3,14	3,02	98 225,02	(3 774,98)	-3,77%			
	12/04/2021	100 000,00	30 779,75	3,25	3,02	92 856,85	(7 143,15)	-7,14%			
	24/05/2021	100 000,00	29 627,55	3,38	3,02	89 380,98	(10 819,14)	-10,82%			
	26/07/2021	100 000,00	29 228,41	3,42	3,02	88 178,73	(11 823,27)	-11,82%			
	25/08/2021	500 000,00	153 521,82	3,28	3,02	463 147,09	(36 852,91)	-7,37%			
	04/10/2021	100 000,00	33 809,35	2,98	3,02	101 998,58	1 998,58	2,00%			
	15/10/2021	100 000,00	34 657,73	2,86	3,02	105 461,03	5 461,03	5,46%			
	25/11/2021	200 000,00	72 099,40	2,77	3,02	217 510,84	17 510,84	8,76%			
	17/12/2021	200 000,00	73 419,93	2,72	3,02	221 494,42	21 494,42	10,75%			
	28/01/2022	400 000,00	139 481,93	2,87	3,02	420 791,32	20 791,32	5,20%			
	21/03/2022	400 000,00	135 484,32	2,95	3,02	408 670,94	8 670,94	2,17%			
	20/04/2022	400 000,00	136 800,98	2,92	3,02	412 703,34	12 703,34	3,18%			
	18/05/2022	200 000,00	72 545,14	2,78	3,02	218 855,35	18 855,35	9,43%			
	13/07/2022	100 000,00	39 894,50	2,51	3,02	120 354,37	20 354,37	20,35%			
	16/09/2022	200 000,00	70 300,05	2,84	3,02	212 082,33	12 082,33	6,04%			
	17/10/2022	200 000,00	67 110,96	2,98	3,02	202 461,43	2 461,43	1,23%			
	04/11/2022	-3 742 821,61	1 297 468,82	2,88	3,02	(3 914 224,71)	-171 409,09	-4,58%			
	SALDO	3 257 178,39	1 384 801,08	2,35	2,98	4 132 711,73	875 533,34	26,88%			
	13/04/2023	100 000,00	36 418,60	2,75	2,98	108 685,33	8 685,33	8,69%			
	17/05/2023	100 000,00	35 378,07	2,83	2,98	105 580,04	5 580,04	5,58%			
	29/06/2023	100 000,00	32 880,88	3,04	2,98	98 087,91	-1 932,09	-1,93%			
	03/08/2023	-815 680,50	224 543,50	2,74	2,98	(570 113,28)	-84 432,78	-8,94%			
	SALDO	2 941 497,89	1 264 915,13	2,33	3,23	4 082 325,10	1 140 827,21	38,78%			
	22/08/2023	100 000,00	33 243,83	3,01	3,23	107 289,51	7 289,51	7,29%			
	25/09/2023	100 000,00	33 690,08	2,97	3,23	108 632,83	8 632,83	8,63%			
	31/10/2023	100 000,00	34 766,34	2,88	3,23	112 203,20	12 203,20	12,20%			
SALDO	3 241 497,89	1 366 585,36	2,80	3,23	4 410 450,63	1 168 952,74	36,06%	-4,48%	-4,48%	10,06%	

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

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

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI II	11/10/2021	819 889,32	31 808,50	25,94	20,20	638 584,38	(181 304,94)	-22,11%			
	11/10/2021	100 000,00	4 177,55	23,94	20,20	84 398,80	(15 801,20)	-15,60%			
	24/11/2021	200 000,00	8 861,12	23,09	20,20	174 979,93	(25 020,07)	-12,51%			
	17/12/2021	200 000,00	8 754,35	22,85	20,20	178 863,55	(23 136,45)	-11,57%			
	27/01/2022	400 000,00	17 304,35	23,23	20,20	349 566,59	(60 401,41)	-12,80%			
	18/03/2022	400 000,00	16 579,12	24,13	20,20	334 946,79	(65 053,21)	-16,28%			
	19/04/2022	400 000,00	16 752,23	22,87	20,20	338 444,14	(61 555,86)	-15,39%			
	18/05/2022	200 000,00	9 181,37	21,78	20,20	185 490,56	(14 509,44)	-7,25%			
	13/07/2022	100 000,00	4 983,28	20,07	20,20	100 676,93	676,93	0,68%			
	15/09/2022	200 000,00	8 755,90	22,84	20,20	178 894,94	(23 105,06)	-11,55%			
	14/10/2022	200 000,00	8 809,14	22,70	20,20	177 970,55	(22 029,45)	-11,01%			
	12/04/2023	100 000,00	5 267,97	18,98	20,20	106 428,50	6 428,50	6,43%			
	18/05/2023	100 000,00	5 271,81	18,97	20,20	106 502,03	6 502,03	6,50%			
	28/06/2023	100 000,00	4 924,80	20,31	20,20	99 491,26	(508,74)	-0,51%			
	24/07/2023	100 000,00	4 578,82	21,84	20,20	92 506,65	(7 494,35)	-7,49%			
	21/08/2023	100 000,00	4 937,77	20,25	20,20	99 757,48	(242,52)	-0,24%			
	21/09/2023	100 000,00	5 068,69	19,73	20,20	102 402,41	2 402,41	2,40%			
	30/10/2023	100 000,00	5 504,21	18,17	20,20	111 201,16	11 201,16	11,20%			
	SALDO	3 919 889,32	171 120,59	21,76	20,20	3 457 137,65	(462 751,67)	-11,81%			
								-8,24%			
								-6,24 %			
								-4,18%			

TRIGONOS DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	10/10/2022	200 000,00	184 702,77	1,08	1,20	221 256,83	21 256,83	10,63%			
	18/10/2022	200 000,00	179 467,84	1,11	1,20	214 985,67	14 985,67	7,49%			
	15/12/2022	200 000,00	186 929,32	1,07	1,20	223 923,83	23 923,83	11,96%			
	28/02/2023	200 000,00	179 917,53	1,11	1,20	215 524,38	15 524,38	7,78%			
	29/05/2023	100 000,00	85 119,85	1,17	1,20	101 985,81	1 985,81	1,97%			
	27/06/2023	100 000,00	84 701,74	1,18	1,20	101 464,76	1 464,76	1,46%			
	18/08/2023	100 000,00	82 433,17	1,21	1,20	98 747,22	(1 252,78)	-1,25%			
	25/08/2023	100 000,00	81 017,53	1,23	1,20	97 051,42	(2 948,58)	-2,95%			
	05/10/2023	100 000,00	78 128,22	1,28	1,20	93 590,30	(6 409,70)	-6,41%			
	30/10/2023	100 000,00	81 569,38	1,23	1,20	97 712,48	(2 287,52)	-2,29%			
	SALDO	1 400 000,00	1 223 987,36	1,14	1,20	1 466 222,29	66 222,29	4,73%			
								-5,91%			
								-5,91 %			
								3,25%			

TRIGONOS FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC DE FIA	11/10/2022	200 000,00	104 439,29	1,91	1,95	203 475,21	3 475,21	1,74%			
	19/10/2022	200 000,00	102 584,07	1,95	1,95	199 880,76	(139,24)	-0,07%			
	16/12/2022	200 000,00	111 559,59	1,79	1,95	217 347,44	17 347,44	8,67%			
	01/03/2023	200 000,00	105 209,91	1,90	1,95	204 970,73	4 970,73	2,49%			
	30/05/2023	100 000,00	51 434,70	1,94	1,95	100 208,33	208,33	0,21%			
	28/06/2023	100 000,00	50 464,72	1,98	1,95	98 318,56	(1 681,44)	-1,68%			
	21/08/2023	100 000,00	48 800,67	2,08	1,95	94 887,29	(5 312,71)	-5,31%			
	28/08/2023	100 000,00	47 798,50	2,09	1,95	93 124,05	(6 875,95)	-6,88%			
	08/10/2023	100 000,00	47 501,13	2,11	1,95	92 544,70	(7 455,30)	-7,46%			
	31/10/2023	100 000,00	49 689,69	2,01	1,95	98 808,59	(3 191,41)	-3,19%			
	SALDO	1 400 000,00	719 279,47	1,95	1,95	1 401 345,64	1 345,64	0,10%			
								-7,81%			
								-7,81 %			
								-1,03%			

CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	07/11/2022	200 000,00	49 046,51	4,08	4,2424	208 076,58	8 076,58	4,04%			
	16/12/2022	200 000,00	57 556,65	3,47	4,2424	244 180,28	44 180,28	22,09%			
	04/04/2023	200 000,00	57 297,13	3,49	4,2424	243 079,28	43 079,28	21,54%			
	15/06/2023	100 000,00	24 633,82	4,08	4,2424	104 507,38	4 507,38	4,51%			
	11/07/2023	100 000,00	24 518,00	4,08	4,2424	104 015,99	4 015,99	4,02%			
	28/08/2023	100 000,00	24 816,82	4,03	4,2424	105 291,39	5 291,39	5,29%			
	29/08/2023	100 000,00	24 623,73	4,06	4,2424	104 464,55	4 464,55	4,46%			
	10/10/2023	100 000,00	25 683,42	3,89	4,2424	108 960,21	8 960,21	8,96%			
	SALDO	1 100 000,00	288 177,87	3,90	4,2424	1 222 575,62	122 575,62	11,14%			
								-3,43%			

GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	31/10/2023	200 000,00	34 248,14	5,84	6,68	228 626,41	28 626,41	14,31%			
	SALDO	200 000,00	34 248,14	5,84	6,68	228 626,41	28 626,41	14,31%			
								-1,49%			
								-1,49			
								40,63%			

TOTAIS		109 910 673,85				105 683 801,05	(4 226 872,80)	-3,85%			
---------------	--	-----------------------	--	--	--	-----------------------	-----------------------	---------------	--	--	--

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\$ 25.210.259,97, correspondendo à 2,92% 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

RESUMO POSIÇÕES ABERTAS						
ATIVO	Qdd.	VALOR AQUISIÇÃO	VALOR MERCADO	CUSTOS	RENTAB. LÍQUIDO	%
DIVO11	107.972	R\$ 8.046.307,52	R\$ 9.598.710,80	R\$ 22.595,89	R\$ 1.529.807,39	18,96%
BOVV11	114.413	R\$ 13.643.312,70	R\$ 14.879.410,65	R\$ 38.047,58	R\$ 1.198.050,37	8,76%
IVVB11	2.746	R\$ 695.827,49	R\$ 732.138,52	R\$ 1.986,09	R\$ 34.324,94	4,92%
TOTAL		R\$ 22.385.447,71	R\$ 25.210.259,97	R\$ 62.629,56	R\$ 2.762.182,70	12,30%

Da tabela acima extrai-se os principais dados dos resultados do mês de janeiro para este enquadramento. Cabe relatar que os valores acima divergem do relatório do sistema da LDB 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\$ 8.899.253,66. 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\$ 47.773.350,71 representando 5,54% 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	14,80	-0,33	-0,93	-0,93	841.737,06	0,10	153.990.304,71	0,55
XP	BNP PARIBAS	SYSTEMATICA BLUE TREND DOLAR ADVISORY FIC DE FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,89	-0,47	0,67	0,67	812.496,53	0,09	22.424.160,22	3,62
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	ACCESS USA COMPANIES FIA - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,74	-2,68	4,27	4,27	13.397.615,87	1,55	203.175.265,74	6,59
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	17,26	-1,79	2,38	2,38	4.392.768,66	0,51	244.319.238,90	1,80
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTEC ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,20	-1,78	0,17	0,17	4.482.737,27	0,52	66.148.453,25	6,78
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	13,57	-0,01	4,76	4,76	3.823.858,38	0,44	58.127.860,80	6,58
ITAU	ITAU	ITAÚ WORLD EQUITIES FIC DE FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,67	-0,68	3,17	3,17	7.283.715,96	0,84	414.371.311,35	1,76
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,20	-1,16	4,04	4,04	8.334.380,19	0,97	709.646.976,36	1,17
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	12,15	-1,34	2,30	2,30	4.404.040,79	0,51	365.612.602,32	1,20
Sub-total Artigo 9º II			12,41	-1,53	3,19	3,19	47.773.350,71	5,54		

“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

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

JANEIRO - 2024										
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%	254 276 463,40	1,10%	11,21%	129,41%	115,69%	113,40%	87,10%	29,43%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	270 505 312,80	0,27%	13,01%	31,76%	134,26%	27,84%	101,09%	31,31%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	131 553 246,88	0,06%	13,47%	-92,94%	139,01%	6,19%	104,66%	15,23%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	380 460,07	-0,25%	-1,94%	-129,41%	-120,02%	-125,77%	-115,07%	0,04%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	105 688 204,72	-5,57%	6,00%	-755,29%	-38,08%	-16,28%	47,51%	12,23%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	8 899 253,66	-2,40%	23,72%	-382,35%	144,79%	49,90%	187,81%	1,03%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	47 773 350,71	3,19%	21,85%	375,29%	225,49%	111,54%	230,00%	5,53%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	21 650 605,21	4,56%	25,21%	536,47%	260,17%	195,20%	199,60%	2,51%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	18 198 450,66	1,63%	26,81%	191,76%	276,68%	41,37%	173,30%	2,11%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	3 007 913,95	-1,45%	-7,47%	-270,59%	-177,09%	-249,48%	-158,04%	0,35%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	2 111 116,32	-0,57%	24,55%	-167,06%	253,35%	-185,07%	135,19%	0,24%
IPCA + 5,02% MÊS	0,85%	Ibov mês	-4,79%	MSCI mês	2,86%	Ifix mês	0,67%	S&P mês	3,94%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,69%	Ibov 12 meses	12,63%	MSCI 12 meses	9,50%	Ifix 12 meses	18,16%	S&P 12 meses	15,47%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		0,97%	12,87%							

Neste enquadramento, no mês de janeiro, não ocorreram movimentações.

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\$ 21.650.605,21 representando 2,51% da carteira, conforme demonstrado na relação abaixo.

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,62	-1,12	4,56	4,56	21.650.605,21	2,51	2.108.221.544,73	1,03
Sub-total Artigo 9º III			14,62	-1,12	4,56	4,56	21.650.605,21	2,51		

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

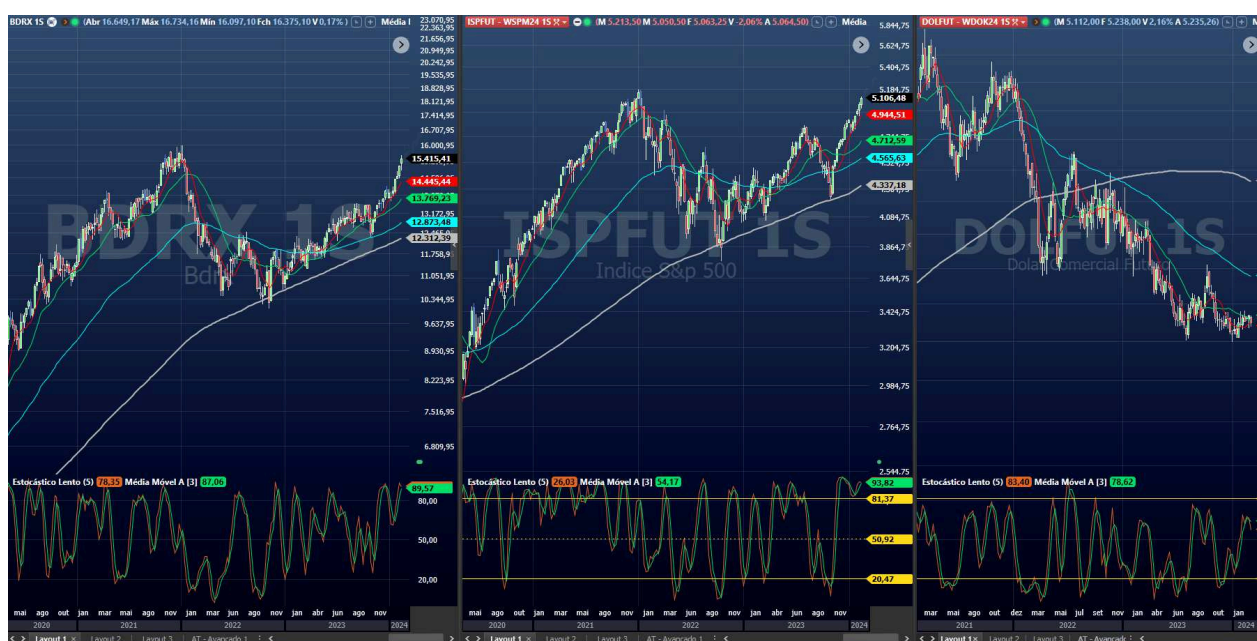
“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

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

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

JANEIRO - 2024										
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%	254 276 463,40	1,10%	11,21%	129,41%	115,69%	113,40%	87,10%	29,43%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	270 505 312,80	0,27%	13,01%	31,76%	134,26%	27,84%	101,09%	31,31%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	131 553 246,88	0,06%	13,47%	-92,94%	139,01%	6,19%	104,66%	15,23%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	380 460,07	-0,25%	-1,94%	-129,41%	-120,02%	-125,77%	-115,07%	0,04%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	105 688 204,72	-5,57%	6,00%	-755,29%	-38,08%	-16,28%	47,51%	12,23%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	8 899 253,66	-2,40%	23,72%	-382,35%	144,79%	49,90%	187,81%	1,03%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	47 773 350,71	3,19%	21,85%	375,29%	225,49%	111,54%	230,00%	5,53%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	21 650 605,21	4,56%	25,21%	536,47%	260,17%	195,20%	199,60%	2,51%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	18 198 450,66	1,63%	26,81%	191,76%	276,68%	41,37%	173,30%	2,11%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	3 007 913,95	-1,45%	-7,47%	-270,59%	-177,09%	-249,48%	-158,04%	0,35%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	2 111 116,32	-0,57%	24,55%	-167,06%	253,35%	-185,07%	135,19%	0,24%
IPCA + 5,02% MÊS	0,85%	Ibov mês	-4,79%	MSCI mês	2,86%	Ifix mês	0,67%	S&P mês	3,94%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,69%	Ibov 12 meses	12,63%	MSCI 12 meses	9,50%	Ifix 12 meses	18,16%	S&P 12 meses	15,47%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		0,97%	12,87%							

Neste enquadramento, no mês de janeiro de 2024, não houveram movimentações.



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. Não houve movimentações neste mês.

“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

1.9. 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\$18.198.450,66, representando 2,11% 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	12,67	-1,62	1,63	1,63	18.198.450,66	2,11	586.766.897,77	3,10
Sub-total Artigo 10º I			12,67	-1,62	1,63	1,63	18.198.450,66	2,11		

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

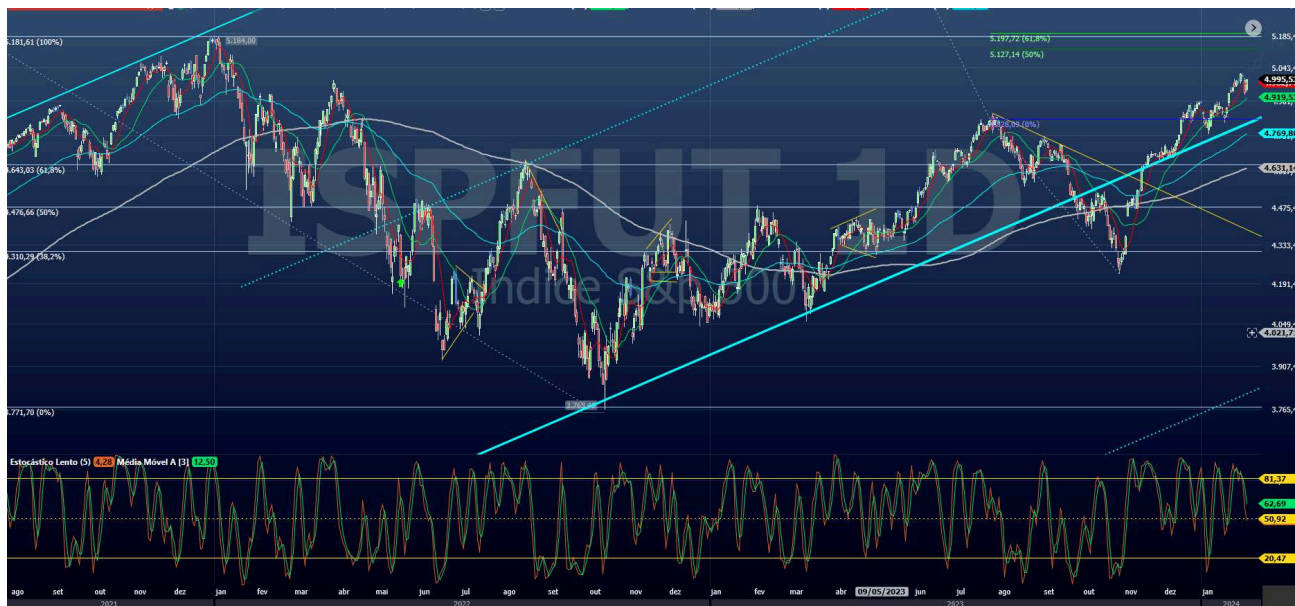
JANEIRO - 2024										
Enquadramento	Descrição	Política de Investimento	Total Investido	Rentabilidade (mês)	Rentabilidade acumulada (12 meses)	Meta atuarial (mês)	Meta atuarial (12 meses)	% Benchmark (mês)	% Benchmark (12mês)	Participação na Carteira
Art. 7º, I, alínea a	Titulos do Tesouro Nacional *	100,00%	254 276 463,40	1,10%	11,21%	129,41%	115,69%	113,40%	87,10%	29,43%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	270 505 312,80	0,27%	13,01%	31,76%	134,26%	27,84%	101,09%	31,31%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	131 553 246,88	0,06%	13,47%	-92,94%	139,01%	6,19%	104,66%	15,23%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	380 460,07	-0,25%	-1,94%	-129,41%	-120,02%	-125,77%	-115,07%	0,04%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	105 688 204,72	-5,57%	6,00%	-755,29%	-38,08%	-16,28%	47,51%	12,23%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	8 899 253,66	-2,40%	23,72%	-382,35%	144,79%	49,90%	187,81%	1,03%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	47 773 350,71	3,19%	21,85%	375,29%	225,49%	111,54%	230,00%	5,53%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	21 650 605,21	4,56%	25,21%	536,47%	260,17%	195,20%	199,60%	2,51%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	18 198 450,66	1,63%	26,81%	191,76%	276,68%	41,37%	173,30%	2,11%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	3 007 913,95	-1,45%	-7,47%	-270,59%	-177,09%	-249,48%	-158,04%	0,35%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	2 111 116,32	-0,57%	24,55%	-167,06%	253,35%	-185,07%	135,19%	0,24%
IPCA + 5,02% MÊS	0,85%	Ibov mês	-4,79%	MSCI mês	2,86%	Ifix mês	0,67%	S&P mês	3,94%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,69%	Ibov 12 meses	12,63%	MSCI 12 meses	9,50%	Ifix 12 meses	18,16%	S&P 12 meses	15,47%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		0,97%	12,87%							

Neste mês de janeiro de 2024, não houve movimentações neste fundo.

“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	9.927,110841	2.000.000,00	0,000000	0,00	49.610,975241	0,000000	0,000000	9.995.046,62
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	9.115,689885	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	12.098.644,49
28/10/2021	5.089,372560	1.537.386,94	0,000000	0,00	52.684,682861	0,000000	0,000000	15.914.898,70
20/12/2021	819,339962	250.000,00	0,000000	0,00	53.504,022790	0,000000	0,000000	16.325.342,72
08/02/2022	0,000000	0,00	22.960,295271	7.000.000,00	30.543,727554	0,000000	0,000000	9.311.992,30
19/05/2022	3.703,212329	1.000.000,00	0,000000	0,00	34.246,938610	0,000000	0,000000	9.247.900,68
15/07/2022	1.843,616695	500.000,00	0,000000	0,00	36.090,558575	0,000000	0,000000	9.787.867,19
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	10.708.593,46
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	43.264,572683	0,000000	0,000000	14.997.549,47
22/08/2023	1.483,089724	500.000,00	0,000000	0,00	44.747,642324	0,000000	0,000000	15.066.155,96
06/10/2023	1.486,501874	500.000,00	0,000000	0,00	46.246,144198	0,000000	0,000000	15.430.782,91
31/10/2023	1.533,701604	500.000,00	0,000000	0,00	47.779,845829	0,000000	0,000000	15.576.643,37

“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 3 fundos no qual totaliza um investimento de R\$ 3.007.913,95, representando 0,35% 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				
PÁTRIA	XP	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	9,20	-1,44	-1,44	-1,44	1.969.240,22	0,23	163.335.990,28	1,21
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	8,44	-2,46	-2,46	-2,46	610.352,90	0,07	121.923.131,43	0,50
GAVEA	GAVEA	GÁVEA INSTITUCIONAL FIC DE FIP	16,80	0,03	0,03	0,03	428.320,83	0,05	7.643.669,49	5,60
Sub-total Artigo 10º II			5,60	-1,45	-1,45	-1,45	3.007.913,95	0,35		

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 janeiro para este enquadramento.

JANEIRO - 2024										
Enquadramento	Descrição	Política de Investimento	Total Investido	Rentabilidade (mês)	Rentabilidade acumulada (12 meses)	Meta atuarial (mês)	Meta atuarial (12 meses)	% Benchmark (mês)	% Benchmark (12 meses)	Participação na Carteira
Art. 7º, I, alínea a	Titulos do Tesouro Nacional *	100,00%	254 276 463,40	1,10%	11,21%	129,41%	115,69%	113,40%	87,10%	29,43%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Titulos Públicos *	100,00%	270 505 312,80	0,27%	13,01%	31,76%	134,26%	27,84%	101,09%	31,31%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	131 553 246,88	0,06%	13,47%	-92,94%	139,01%	6,19%	104,66%	15,23%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	390 460,07	-0,25%	-1,94%	-129,41%	-120,02%	-125,77%	-115,07%	0,04%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	105 688 204,72	-5,57%	6,00%	-755,29%	-38,08%	-16,28%	47,51%	12,23%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	8 899 253,66	-2,40%	23,72%	-382,35%	144,79%	49,90%	187,81%	1,03%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	47 773 350,71	3,19%	21,85%	375,29%	225,49%	111,54%	230,00%	5,53%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nivel I	10,00%	21 650 605,21	4,56%	25,21%	536,47%	260,17%	195,20%	199,60%	2,51%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	18 198 450,66	1,63%	26,81%	191,76%	276,68%	41,37%	173,30%	2,11%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	3 007 913,95	-1,45%	-7,47%	-270,59%	-177,09%	-249,48%	-158,04%	0,35%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	2 111 116,32	-0,57%	24,55%	-167,06%	253,35%	-185,07%	135,19%	0,24%
IPCA + 5,02% MÊS	0,85%	Ibov mês	-4,79%	MSCI mês	2,86%	Ifix mês	0,67%	S&P mês	3,94%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,69%	Ibov 12 meses	12,63%	MSCI 12 meses	9,50%	Ifix 12 meses	18,16%	S&P 12 meses	15,47%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses	0,97%	12,87%								

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 janeiro.

“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 Amortização	R\$ 17.197,17
30/09/2022	Resgate Amortização	R\$ 118.963,39
30/12/2022	Resgate Amortização	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%	
31/03/2023	Saldo em extrato aplicado	R\$ 428.320,83

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 - MULTIESTRATÉGIA		
DATA	DESCRIÇÃO	VALOR
09/05/2023	Aplicação	R\$ 584.090,14
16/06/2023	Aplicação	R\$ 166.666,67

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 até este mês houve duas chamadas de integralização.

“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

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 FIP Pátria Private Equity VII Advisory Multiestratégia		
DATA	DESCRIÇÃO	VALOR
27/09/2023	Aplicação	R\$ 1.491.113,50
01/11/2023	Aplicação	R\$ 550.000,00

1.11. 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\$ 2.111.116,32 representando 0,24% 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	10,60	0,00	0,00	0,00	1.520.456,00	0,18	209.477.967,43	0,73
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FII RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA	23,04	-1,86	-1,30	-1,30	544.626,00	0,06	758.325.511,30	0,07
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII	12,25	-9,69	-9,69	-9,69	46.034,32	0,01	7.915.202,50	0,58
Sub-total Artigo 11º			12,22	-0,72	-0,57	-0,57	2.111.116,32	0,24		

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.

“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

JANEIRO - 2024										
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%	254 276 463,40	1,10%	11,21%	129,41%	115,69%	113,40%	87,10%	29,43%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	270 505 312,80	0,27%	13,01%	31,76%	134,26%	27,84%	101,09%	31,31%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	131 553 246,88	0,06%	13,47%	-92,94%	139,01%	6,19%	104,66%	15,23%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	380 460,07	-0,25%	-1,94%	-129,41%	-120,02%	-125,77%	-115,07%	0,04%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	105 688 204,72	-5,57%	6,00%	-755,29%	-38,08%	-16,28%	47,51%	12,23%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	8 899 253,66	-2,40%	23,72%	-382,35%	144,79%	49,90%	187,81%	1,03%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	47 773 350,71	3,19%	21,85%	375,29%	225,49%	111,54%	230,00%	5,53%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nivel I	10,00%	21 650 605,21	4,56%	25,21%	536,47%	260,17%	195,20%	199,60%	2,51%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	18 198 450,66	1,63%	26,81%	191,76%	276,68%	41,37%	173,30%	2,11%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	3 007 913,95	-1,45%	-7,47%	-270,59%	-177,09%	-249,48%	-158,04%	0,35%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	2 111 116,32	-0,57%	24,55%	-167,06%	253,35%	-185,07%	135,19%	0,24%
IPCA + 5,02% MÊS	0,85%	Ibov mês	-4,79%	MSCI mês	2,86%	Ifix mês	0,67%	S&P mês	3,94%	100,0%
IPCA + 5,02% 12 MÊS	9,69%	Ibov 12 meses	12,63%	MSCI 12 meses	9,50%	Ifix 12 meses	18,16%	S&P 12 meses	15,47%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		0,97%	12,87%							

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 janeiro. Abaixo segue tabela com a rentabilidade de cotas e dos frutos de aluguel:

Rentabilidade Anual	Rentabilidade Anual					
Fundo Investimentos	R\$ aplic.inicial	Saldo 2024	Rentab.total	Rentab. Total (%)	meta desde a aplicação inicial *	Rentab. X Meta (%)
FI Imobiliário Rio Bravo renda Conporativa - cotação **	R\$ 615 457,96	544 626,00	-70 831,96	-11,51%	141,65%	-153,16%
FI Imobiliário Rio Bravo renda Conporativa - frutos	R\$ -	3 205,71	460 759,63	74,86%	141,65%	-66,79%
Rentabilidade do ano	R\$ -	-7 135,29	389 927,67	63,36%	141,65%	-78,29%
Bradesco -Rio Bravo The One - cotação ***	R\$ 798 000,00	1 535 200,00	829 906,97	104,00%	141,65%	-37,65%
Bradesco -Rio Bravo The One - frutos	R\$ -	0,00	674 000,31	84,46%	141,65%	-57,19%
Rentabilidade do ano	R\$ -	0,00	1 503 907,28	188,46%	141,65%	46,81%
FII Rio Bravo Credito Imobiliário II - cotação ****	R\$ 300 000,00	46 034,32	-224 636,84	-74,88%	141,65%	-216,53%
FII Rio Bravo Credito Imobiliário II - frutos	R\$ -	105,00	206 110,80	68,70%	141,65%	-72,95%
Rentabilidade do ano	R\$ -	-4 834,80	-18 526,04	-6,18%	141,65%	-147,83%

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

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

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

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

Fundo Investimentos	Rentabilidade Anual - com "frutos" simulados com rentabilidade pelo "CDI"					
	R\$ aplic.inicial	Saldo 2024	Rentab.total	Rentab. Total (%)	meta desde a aplicação inicial	Rentab. X Meta (%)
FI Imobiliário Rio Bravo renda Conporativa - cotação	R\$ 615 457,96	R\$ 544 626,00	-R\$ 70 831,96	-11,51%	141,65%	-153,16%
FI Imobiliário Rio Bravo renda Conporativa - frutos	R\$ -		R\$ 829 323,40	134,75%	141,65%	-6,90%
Rentabilidade do ano	R\$ -		R\$ 758 491,44	123,24%	141,65%	-18,41%
Bradesco -Rio Bravo The One - cotação	R\$ 798 000,00	R\$ 1 535 200,00	R\$ 829 906,97	104,00%	141,65%	-37,65%
Bradesco -Rio Bravo The One - frutos	R\$ -		R\$ 1 083 037,9	135,72%	141,65%	-5,93%
Rentabilidade do ano	R\$ -		R\$ 1 912 944,9	239,72%	141,65%	98,07%
FII Rio Bravo Credito Imobiliário II - cotação	R\$ 300 000,00	R\$ 46 034,32	-R\$ 224 636,84	-74,88%	141,65%	-216,53%
FII Rio Bravo Credito Imobiliário II - frutos	R\$ -		R\$ 370 619,06	123,54%	141,65%	-18,11%
Rentabilidade do ano	R\$ -		R\$ 145 982,22	48,66%	141,65%	-92,99%

Percebe-se que o fundo que possui posição mais relevante, "Rio Bravo The One", supera a meta do período em 98,07% 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 janeiro de 2024, conforme tabela abaixo, a renda fixa apresentou rentabilidade positiva de (R\$ 3.563.169,70), a meta atuarial do mês foi de 0,85%, (meta = R\$ 5.486.142,55), o resultado ficou inferior a meta do mês em R\$ -1.922.972,85, "0,30%"; sendo que no acumulado de doze meses, a meta em reais é de R\$ 54.651.809,78, a rentabilidade está positiva em R\$ 69.471.632,95, gerando um excedente de R\$ 14.819.823,17 na persecução da meta atuarial neste segmento, sendo que a atual composição da carteira em ativos de renda fixa totaliza um investimento de R\$ 656.715.483,15 sendo 76% da carteira total.

"BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo"

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

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

RESULTADO – janeiro/2024				META ATUARIAL		CUMPRIMENTO DA META “MÊS”		CUMPRIMENTO DA META “12 MESES”	
APLICADO (R\$)		RENTABILIDADE		%	R\$	%	R\$	%	R\$
		%	R\$						
R. FIXA	656.715.483,15	0,55	3.563.169,70	0,85	5.486.142,55	-0,30	-1.922.972,85	127,12	14.819.823,17
R. VARIÁVEL	207.328.895,23	-1,80	-3.775.170,87		1.781.833,36	-2,65	-5.557.004,23	46,66	7.890.421,06
TOTAL	864.044.378,38	-0,03	-212.001.17		7.267.975,91	-0,88	-7.479.977,08	131,73	22.710.244,24

Para o segmento de renda variável o BCPREVI possui um total investido de R\$ 207.328.895,23, “24%” da carteira. O rendimento desta classe de ativos para o mês de janeiro de 2024, foi negativo de R\$ -3.775.170,87, frustrando a meta atuarial do mês em “-2,65%”, R\$ -5.557.004,23. No acumulado de doze meses, a rentabilidade é positiva de R\$ 24.801.883,03, a meta é de R\$ 16.911.461,97, um excedente de R\$ 7.890.421,06, 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 131,73%, da meta atingida, sobrando R\$ 22.710.244,24 do seu cumprimento.

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

“BALNEÁRIO CAMBORIÚ – Capital Catarinense do Turismo”

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

CEP 88338-315 - Balneário Camboriú – SC

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	-0,03												-0,03
IPCA + 5,01%	0,85												0,85
p.p. indexador	-0,87												-0,87
2023	1,65	-0,57	1,01	1,16	2,53	2,41	1,28	-0,41	-0,31	-0,79	3,27	2,60	14,62
IPCA + 5,02%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33	0,53	0,68	0,65	0,65	0,67	0,95	9,81
p.p. indexador	0,69	-1,77	-0,15	0,20	1,87	2,08	0,75	-1,09	-0,96	-1,44	2,60	1,65	4,81
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	33	45,21
Meses abaixo - Meta Atuarial	40	54,79
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	5,93	2,49	3,44	3,27
06 meses	4,33	4,53	-0,20	3,48
12 meses	12,73	9,69	3,04	3,37
24 meses	17,99	21,69	-3,70	4,98
36 meses	17,48	41,54	-24,06	5,42
48 meses	22,14	56,52	-34,38	8,84
60 meses	42,67	72,88	-30,22	8,17
Desde 29/12/2017	60,81	91,61	-30,80	7,78

Considerando todo o cenário de mercado incerto para curto e médio prazo, principalmente quanto ao cenário de juros local e global, principalmente no mercado americano, este comitê vem tomando decisões visando proteção e rentabilização do patrimônio do BCPREVI no longo prazo, embora a meta atuarial seja dada em curto prazo “anual”: - fazendo Aquisições fracionadas e progressivas em ativos de bolsa brasil considerando seus preços historicamente baixos; - Expondo-se na medida em que a legislação permite em ativos mais seguros no exterior, mirando atualmente na oportunidade percebida no cenário de Renda Fixa americano; - Fazendo movimentos na carteira de renda fixa de forma estratégica, visando no curto e médio prazo manter posição considerável junto à ativos indexados ao CDI, uma vez que estes ativos atualmente, tendem a bater a meta atuarial, mas sem perder a oportunidade, num cenário de longo prazo de captar os ganhos possíveis quando dos juros voltarem a patamares mais baixos, migrando de fundos IMA-B5, para ativos com *durations* mais longas como fundos IMA-B e IMA-B5+.

“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

Cabe destacar que continuamos neste ano, na carteira de renda variável local resgatando ativos com performances ruins na carteira mas que estejam positivas, alguns parciais e outros totais, em momentos de volatilidade do mercado graças ao trabalho deste comitê nas constantes melhoras nos preços médios dos ativos, devido aos constantes, fracionados e progressivos aportes em momentos estratégicos do mercado, e buscando novos ativos com melhores performances, visando dar mais qualidade em nossa carteira de Renda Variável Brasil.

Continuamos adquirindo Títulos Públicos (Tesouro IPCA - NTN-Bs), para marcação na curva, com taxas que superam a meta atuarial e que protegem a carteira da volatilidade do mercado. Não distante, estamos adquirindo (Tesouro Pré Fixado - NTN-Fs), para marcação a mercado, visando no futuro a queda da taxa Selic.

Balneário Camboriú - SC, janeiro de 2024.

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

GUSTAVO MANOEL ESPINDOLA
Membro Comitê Investimentos

NILTO ASSIS COPPI JUNIOR
Membro Comitê Investimentos

MARIA CAROLINA MICHELS FRANCO
Membro Comitê Investimentos

MICHELE KAMINSKI DA SILVA
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



VERIFICAÇÃO DAS ASSINATURAS



Código para verificação: DA14-D032-FAF8-FBB7

Este documento foi assinado digitalmente pelos seguintes signatários nas datas indicadas:



SIDNEI LUIZ RIQUETTA (CPF 043.XXX.XXX-52) em 24/04/2024 18:07:33 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



GUILHERME MACIEL MAFRA (CPF 048.XXX.XXX-63) em 25/04/2024 10:19:42 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



MARIA CAROLINA MICHELS FRANCO (CPF 095.XXX.XXX-02) em 25/04/2024 10:46:23 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



NILTO ASSIS COPPI JUNIOR (CPF 833.XXX.XXX-34) em 25/04/2024 12:27:41 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



MICHELE KAMINSKI DA SILVA (CPF 061.XXX.XXX-73) em 25/04/2024 13:00:31 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



GUSTAVO MANOEL ESPINDOLA (CPF 063.XXX.XXX-82) em 25/04/2024 14:28:57 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



KALINKA FLORIANO PÊTERES (CPF 939.XXX.XXX-68) em 25/04/2024 14:54:53 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



KARINE ALMEIDA GOMES (CPF 004.XXX.XXX-37) em 25/04/2024 18:41:02 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



WANRLEY CORRÊA COSTA (CPF 010.XXX.XXX-57) em 06/05/2024 16:28:32 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



DENISE RONCHI FRANCEZ (CPF 053.XXX.XXX-99) em 16/05/2024 17:08:49 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



FERNANDA ALMEIDA DAWUD (CPF 067.XXX.XXX-03) em 03/07/2024 16:44:05 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



FERNANDA ALMEIDA DAWUD (CPF 067.XXX.XXX-03) em 03/07/2024 16:45:13 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

Para verificar a validade das assinaturas, acesse a Central de Verificação por meio do link:

<https://bc.1doc.com.br/verificacao/DA14-D032-FAF8-FBB7>

RELATÓRIO DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS BCPREVI

FEVEREIRO - 2024

1. ANÁLISE DO CUMPRIMENTO DA META POR SEGMENTO

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

Com base no mês de fevereiro de 2024, conforme tabela abaixo, a renda fixa apresentou rentabilidade positiva de (R\$ 4.916.495,27 - 0,75%), a meta atuarial do mês foi de 1,20%, (meta = R\$ 7.880.585,80), o resultado ficou inferior a meta do mês em R\$ -2.964.090,53, “-0,45%”; sendo que no acumulado de doze meses, a meta em reais é de R\$ 56.091.262,92, a rentabilidade está positiva em R\$ 68.969.936,90, gerando um excedente de R\$ 12.878.673,98 na persecução da meta atuarial neste segmento, sendo que a atual composição da carteira em ativos de renda fixa totaliza um investimento de R\$ 660.318.508,12 sendo 73,39% da carteira total.

RESULTADO				META ATUARIAL		CUMPRIMENTO DA META “MÊS”		CUMPRIMENTO DA META “12 MESES”	
APLICADO (R\$)		RENTABILIDADE		%	R\$	%	R\$	%	R\$
		%	R\$						
R. FIXA	660.318.508,12	0,75	4.916.495,27	1,2	7.880.585,80	-0,45	-2.964.090,53	122,9	12.878.673,98

“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

R. VARIÁVEL	239.436.510,97	3,34	6.924.482,69		2.487.946,74	2,14	4.436.535,95	139,8	24.146.410,63
TOTAL	899.755.019,09	1,34	11.840.977,96		10.368.532,54	0,14	1.472.445,42	150,4	37.025.084,61

Para o segmento de renda variável o BCPREVI possui um total investido de R\$ 239.436.510,97, “26,61%” da carteira. O rendimento desta classe de ativos para o mês de fevereiro de 2024, foi positivo de R\$ 6.924.482,69, superando a meta atuarial do mês em “2,14%”, R\$ 4.436.535,95. No acumulado de doze meses, a rentabilidade é positiva de R\$ 41.416.306,59, a meta é de R\$ 17.269.895,96, um excedente de R\$ 24.146.410,63, 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 150,47%, da meta atingida, sobrando R\$ 37.025.084,61 do 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
2024	-0,12	1,34											1,21
IPCA + 5,01%	0,85	1,20											2,06
p.p. indexador	-0,97	0,14											-0,85
2023	1,65	-0,57	1,01	1,16	2,52	2,30	1,25	-0,33	-0,28	-0,84	3,40	2,72	14,79
IPCA + 5,02%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33	0,53	0,68	0,65	0,65	0,67	0,95	9,81
p.p. indexador	0,69	-1,77	-0,15	0,20	1,86	1,97	0,72	-1,01	-0,93	-1,49	2,73	1,77	4,98
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	34	45,95
Meses abaixo - Meta Atuarial	40	54,05
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	3,97	3,03	0,93	2,86
06 meses	6,30	5,08	1,22	3,59
12 meses	14,96	9,70	5,26	3,35
24 meses	20,11	21,48	-1,38	4,96
36 meses	20,36	41,48	-21,12	5,33
48 meses	26,43	57,36	-30,93	8,74
60 meses	44,23	73,41	-29,17	8,17
Desde 29/12/2017	63,05	93,92	-30,87	7,74

“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, principalmente quanto ao cenário de juros local e global, principalmente no mercado americano, este comitê vem tomando decisões visando proteção e rentabilização do patrimônio do BCPREVI no longo prazo, embora a meta atuarial seja dada em curto prazo “anual”: - fazendo Aquisições fracionadas e progressivas em ativos de bolsa brasil considerando seus preços historicamente baixos; - Expondo-se na medida em que a legislação permite em ativos mais seguros no exterior, mirando atualmente na oportunidade percebida no cenário de Renda Fixa americano; - Fazendo movimentos na carteira de renda fixa de forma estratégica, visando no curto e médio prazo manter posição considerável junto à ativos indexados ao CDI, uma vez que estes ativos atualmente, tendem a bater a meta atuarial, mas sem perder a oportunidade, num cenário de longo prazo de captar os ganhos possíveis quando dos juros voltarem a patamares mais baixos, migrando de fundos IMA-B5, para ativos com *durations* mais longas como fundos IMA-B e IMA-B5+.

Cabe destacar que continuamos neste ano, na carteira de renda variável local resgatando ativos com performances ruins na carteira mas que estejam positivas desde a sua entrada, alguns parciais e outros totais, em momentos de volatilidade do mercado graças ao trabalho deste comitê nas constantes melhoras nos preços médios dos ativos, devido aos constantes, fracionados e progressivos aportes em momentos estratégicos do mercado, e buscando novos ativos com melhores performances históricas, bem como estratégias mais consistentes e , visando dar mais qualidade em nossa carteira de Renda Variável Brasil.

Continuamos adquirindo Títulos Públicos (Tesouro IPCA - NTN-Bs), para marcação na curva, com taxas que superam a meta atuarial e que protegem a carteira da volatilidade do mercado. Não distante, estamos adquirindo (Tesouro Pré Fixado - NTN-Fs), para marcação a mercado, visando no futuro a queda da taxa Selic.

Balneário Camboriú - SC, fevereiro de 2024.

“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

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

GUSTAVO MANOEL ESPINDOLA
Membro Comitê Investimentos

NILTO ASSIS COPPI JUNIOR
Membro Comitê Investimentos

MARIA CAROLINA MICHELS FRANCO
Membro Comitê Investimentos

MICHELE KAMINSKI DA SILVA
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



VERIFICAÇÃO DAS ASSINATURAS



Código para verificação: 1C1D-5FB9-0A3D-3DF0

Este documento foi assinado digitalmente pelos seguintes signatários nas datas indicadas:

- ✓ SIDNEI LUIZ RIQUETTA (CPF 043.XXX.XXX-52) em 17/06/2024 13:33:17 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ KALINKA FLORIANO PÊTERES (CPF 939.XXX.XXX-68) em 17/06/2024 13:38:41 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ MICHELE KAMINSKI DA SILVA (CPF 061.XXX.XXX-73) em 17/06/2024 13:39:16 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ KARINE ALMEIDA GOMES (CPF 004.XXX.XXX-37) em 17/06/2024 14:34:42 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ GUSTAVO MANOEL ESPINDOLA (CPF 063.XXX.XXX-82) em 17/06/2024 16:31:56 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ NILTO ASSIS COPPI JUNIOR (CPF 833.XXX.XXX-34) em 18/06/2024 13:48:10 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ MARIA CAROLINA MICHELS FRANCO (CPF 095.XXX.XXX-02) em 25/06/2024 10:43:29 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ WANRLEY CORRÊA COSTA (CPF 010.XXX.XXX-57) em 26/06/2024 18:52:58 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



DENISE RONCHI FRANCEZ (CPF 053.XXX.XXX-99) em 03/07/2024 11:58:48 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



GUILHERME MACIEL MAFRA (CPF 048.XXX.XXX-63) em 04/07/2024 11:49:38 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

Para verificar a validade das assinaturas, acesse a Central de Verificação por meio do link:

<https://bc.1doc.com.br/verificacao/1C1D-5FB9-0A3D-3DF0>

RELATÓRIO DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS BCPREVI

MARÇO - 2024

1. 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 março de 2024, conforme tabela abaixo, a renda fixa apresentou rentabilidade positiva de (R\$ 4.331.117,40 - 0,66%), a meta atuarial do mês foi de 0,55%, (meta = R\$ 3.631.751,79), o resultado ficou superior a meta do mês em R\$ 699.365,61, “0,11%”; sendo que no acumulado de doze meses, a meta em reais é de R\$ 53.420.783,36, a rentabilidade está positiva em R\$ 63.986.105,30, gerando um excedente de R\$ 10.565.321,94 na persecução da meta atuarial neste segmento, sendo que a atual composição da carteira em ativos de renda fixa totaliza um investimento de R\$ 696.338.892,63 sendo 76,21% da carteira total.

RESULTADO				META ATUARIAL		CUMPRIMENTO DA META “MÊS”		CUMPRIMENTO DA META “12 MESES”	
APLICADO (R\$)		RENTABILIDADE		%	R\$	%	R\$	%	R\$
		%	R\$						
R. FIXA	696.338.892,63	0,66	4.331.117,40	0,55	3.631.751,79	0,11	699.365,61	119,78	10.565.321,94
R. VARIÁVEL	217.362.395,37	1,26	3.006.105,50		1.316.900,81	0,71	1.689.204,69	178,83	29.738.505,20
TOTAL	913.701.288,00	0,81	7.337.222,90		4.948.652,60	0,26	2.388.570,30	157,54	40.303.827,14

Para o segmento de renda variável o BCPREVI possui um total investido de R\$ 217.362.395,37, “23,79%” da carteira. O rendimento desta classe de ativos para o mês de março de 2024, foi positivo de R\$ 3.006.105,50, superando a meta atuarial do mês em “0,71%”,

R\$ 1.689.204,69. No acumulado de doze meses, a rentabilidade é positiva de R\$ 46.367.776,68, a meta é de R\$ 16.629.271,48, um excedente de R\$ 29.738.505,20, 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 157,54%, da meta atingida, sobrando R\$ 40.303.827,14 do seu cumprimento.

Abaixo segue tabela com evolução da rentabilidade da carteira por enquadramento da Resolução 4.963/2021.

MARÇO - 2024										
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%	264 288 991,37	1,01%	10,73%	183,64%	118,83%	121,69%	86,81%	28,93%
Art. 7º, I, alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos *	100,00%	286 042 458,55	0,47%	11,09%	85,45%	122,81%	56,63%	89,72%	31,31%
Art. 7º, III, alínea a	Fundos de Renda Fixa *	65,00%	145 630 808,17	0,33%	11,18%	60,00%	123,81%	39,76%	90,45%	15,94%
Art. 7º, V, alínea b	Fundos RF Crédito Privado *	5,00%	376 634,54	-0,69%	-2,35%	-225,45%	-126,02%	-183,13%	-119,01%	0,04%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	35,00%	109 773 494,54	0,78%	21,78%	141,82%	241,20%	209,86%	84,62%	12,01%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações	4,50%	27 945 150,70	-1,04%		-289,09%		-46,48%		3,06%
Art. 9º, II	Segmento de Investimentos no Exterior	10,00%	52 747 504,80	2,49%	28,82%	452,73%	319,16%	79,30%	151,05%	5,77%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	10,00%	12 088 939,57	3,48%	32,44%	632,73%	359,25%	590,14%	126,03%	1,32%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	10,00%	9 681 535,93	3,35%	35,53%	609,09%	393,47%	99,41%	137,98%	1,06%
Art. 10º, II	Fundos de Participações *	5,00%	3 184 386,69	2,53%	-6,85%	360,00%	-175,86%	304,82%	-155,42%	0,35%
Art. 11º	Fundo de Investimentos Imobiliários	5,00%	1 941 383,14	-0,80%	26,70%	-245,45%	295,68%	-155,94%	113,91%	0,21%
IPCA + 5,01% MÊS	0,55%	Ibov mês	-0,71%	MSCI mês	3,14%	Ifix mês	1,43%	S&P mês	3,37%	100,0%
IPCA + 5,01% 12 MÊS	9,03%	Ibov 12 meses	25,74%	MSCI 12 meses	19,08%	Ifix 12 meses	23,44%	S&P 12 meses	25,75%	
* Referência "CDI" mês e 12 meses		0,83%	12,36%							

Analisando a performance da carteira por enquadramento, neste mês com exceção dos Título Públicos presentes no art.7º, I, alínea 'a', a carteira de Renda Fixa, não conseguiu atingir a meta por inteira, ficando entre 60 e 85% da meta. Já na carteira de Renda variável, neste mês, veio superar consideravelmente a meta, bem como seus próprios Benchmarks. Destaque para o fundos estruturados e fundos do exterior, dentro dos art. 9º e 10º, ultrapassando a 600% da meta.

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
2024	-0,12	1,34	0,81										2,04
IPCA + 5,01%	0,85	1,20	0,55										2,62
p.p. indexador	-0,97	0,14	0,26										-0,59
2023	1,65	-0,57	1,01	1,16	2,52	2,30	1,25	-0,33	-0,28	-0,84	3,40	2,72	14,79
IPCA + 5,02%	0,96	1,19	1,16	0,66	0,66	0,33	0,53	0,88	0,65	0,65	0,67	0,96	9,81
p.p. indexador	0,69	-1,77	-0,15	0,20	1,86	1,97	0,72	-1,01	-0,93	-1,49	2,73	1,77	4,98
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	35	46,67
Meses abaixo - Meta Atuarial	40	53,33
Rentabilidade		
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	2,04	2,62	-0,59	2,71
06 meses	7,46	4,97	2,49	3,37
12 meses	14,73	9,03	5,70	3,31
24 meses	17,61	19,70	-2,09	4,67
36 meses	20,18	40,27	-20,09	5,19
48 meses	43,19	57,33	-14,14	6,20
60 meses	44,76	72,30	-27,54	8,13
Desde 29/12/2017	64,37	94,98	-30,61	7,70

Considerando todo o cenário de mercado incerto para curto e médio prazo, principalmente quanto ao cenário de juros local e global, principalmente no mercado americano, este comitê vem tomando decisões visando proteção e rentabilização do patrimônio do BCPREVI no longo prazo, embora a meta atuarial seja dada em curto prazo “anual”: - fazendo Aquisições fracionadas e progressivas em ativos de bolsa brasil considerando seus preços historicamente baixos; - Expondo-se na medida em que a legislação permite em ativos mais seguros no exterior, mirando atualmente na oportunidade percebida no cenário de Renda Fixa americano; - Fazendo movimentos na carteira de renda fixa de forma estratégica, visando no curto e médio prazo manter posição considerável junto à ativos indexados ao CDI, uma vez que estes ativos atualmente, tendem a bater a meta atuarial, mas sem perder a oportunidade, num cenário de longo prazo de captar os ganhos possíveis quando dos juros voltarem a patamares mais baixos, migrando de fundos IMA-B5, para ativos com *durations* mais longas como fundos IMA-B e IMA-B5+.

Cabe destacar que continuamos neste ano, na carteira de renda variável local resgatando ativos com performances ruins na carteira mas que estejam positivas desde a sua entrada, alguns parciais e outros totais, em momentos de volatilidade do mercado graças ao trabalho deste comitê nas constantes melhoras nos preços médios dos ativos, devido aos constantes, fracionados e progressivos aportes em momentos estratégicos do mercado, e buscando novos ativos com melhores performances históricas, bem como estratégias mais consistentes e, visando dar mais qualidade em nossa carteira de Renda Variável Brasil.

Continuamos adquirindo Títulos Públicos (Tesouro IPCA - NTN-Bs), para marcação na curva, com taxas que superam a meta atuarial e que protegem a carteira da volatilidade do mercado. Não distante, estamos adquirindo (Tesouro Pré Fixado - NTN-Fs), para marcação a mercado, visando no futuro a queda da taxa Selic.

Balneário Camboriú - SC, março de 2024.

Assinaturas – membros integrantes do Comitê: - Karine Almeida Gomes; - Denise Ronchi Francez; - Sidnei Luiz Riquetta; - Guilherme Maciel Mafra; - Maria Carolina Michels Franco; - Wanrley Correa Costa; - Kalinka Floriano Peters; - Gustavo Manoel Espíndola; - Nilto Assis Coppi Júnior; - Michele Kaminski da Silva.



VERIFICAÇÃO DAS ASSINATURAS



Código para verificação: 171F-7662-DFC9-37C4

Este documento foi assinado digitalmente pelos seguintes signatários nas datas indicadas:



SIDNEI LUIZ RIQUETTA (CPF 043.XXX.XXX-52) em 04/07/2024 16:17:04 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



MARIA CAROLINA MICHELS FRANCO (CPF 095.XXX.XXX-02) em 04/07/2024 16:41:24 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



NILTO ASSIS COPPI JUNIOR (CPF 833.XXX.XXX-34) em 04/07/2024 16:54:48 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



KARINE ALMEIDA GOMES (CPF 004.XXX.XXX-37) em 04/07/2024 17:33:10 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



GUSTAVO MANOEL ESPINDOLA (CPF 063.XXX.XXX-82) em 04/07/2024 17:35:10 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



WANRLEY CORRÊA COSTA (CPF 010.XXX.XXX-57) em 04/07/2024 17:36:27 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



GUILHERME MACIEL MAFRA (CPF 048.XXX.XXX-63) em 04/07/2024 17:37:49 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



KALINKA FLORIANO PÊTERES (CPF 939.XXX.XXX-68) em 04/07/2024 17:38:31 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



DENISE RONCHI FRANCEZ (CPF 053.XXX.XXX-99) em 05/07/2024 10:43:48 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)



MICHELE KAMINSKI DA SILVA (CPF 061.XXX.XXX-73) em 05/07/2024 15:29:43 (GMT-03:00)

Papel: Parte

Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

Para verificar a validade das assinaturas, acesse a Central de Verificação por meio do link:

<https://bc.1doc.com.br/verificacao/171F-7662-DFC9-37C4>