

GRUPO



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE ALBERICO SILVA RODRIGUES  
Acesse em: <https://etc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 8620840-716-4a0e-8248-35c8a10bedd



Instituto de Previdência Social dos Servidores  
do Município do Cabo de Santo Agostinho

**CABOPREV**

Instituto de Previdência Social dos Servidores do Município  
do Cabo de Santo Agostinho

**CONSOLIDADO**

Posição em 31/01/2021

# Sumário



1. Posição de mercado dos ativos (dados qualitativos)	1
1.1. Estatísticas	4
1.2. Tabela de cotização e taxas	5
1.3. Composição por segmento	7
1.4. Composição por índice financeiro	7
1.5. Prazos de liquidação	8
1.6. Composição da carteira por regras	9
1.6.1. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano Previdenciário )	9
1.6.2. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano Financeiro )	10
1.6.3. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano de Taxa de Administração )	11
1.7. Volatilidade da carteira	12
2. Carteira	13
2.1. Posição dos ativos (dados quantitativos)	13
2.2. Rendimentos	19
2.3. Evolução mensal do patrimônio líquido	17
2.4. Rentabilidade x Meta mensal	19
2.5. Rentabilidade x Meta anual	19
2.6. Risco ponderado	11
2.7. Distribuição	21
2.7.1. Distribuição por administradores	21
2.7.2. Distribuição por gestores	21
2.8. Resumo por administrador / gestor	16
2.9. Política de investimentos e enquadramentos	18
2.9.1. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 - Política de Investimentos 2024 ( Plano Previdenciário )	18
2.9.2. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano Financeiro )	18
2.9.3. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano de Taxa de Administração )	20
2.10. Rating de gestores e administradores	11
2.10.1. Administradores	11
2.10.2. Gestores	32
3. Patrimônio, rentabilidade e metas por ano	34
4. Credenciamento de ativos	34
5. Credenciamento de pessoas jurídicas	35
6. Parecer	36

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE ALBERICO SILVA RODRIGUES  
Acesse em: <https://eic.ice.gov.br/ppv/validacao/seam>  
Código do documento: 86426d40-71f6-4a0e-8548-5b5c8a0f6edd

# Sumário



7. Disclaimer .....	8
8. Anexos .....	7
8.1. Conceitos e definições .....	7
8.2. Operações .....	8

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE ALBERICO SILVA RODRIGUES  
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 86420d40-71f6-4a0e-8348-35c8a10bedd



## 1. Posição de mercado dos ativos (dados qualitativos)

Carteira(s)	CNPJ	Nome completo	Artigo	Gestor	Administrador	Classe de risco
<b>FUNDOS DE INVESTIMENTO</b>						
Plano Previdenciário	03.399.411/0001-90	BRANCO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESP LIMITADA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 III a	BANCO BRANCO S.A.	BANCO BRANCO S.A.	Muito baixo
Plano Previdenciário	05.964.067/0001-60	FINACAP MAURITSSTAD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 8 I	FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS LTDA.	Alto
Plano Previdenciário	07.882.792/0001-14	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 8 I	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Muito alto
Plano Previdenciário	11.182.064/0001-77	CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 8 I	CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	BEM - DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS LTDA.	Alto
Plano de Taxa de Administração	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 III a	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Muito baixo
Plano Previdenciário	14.508.605/0001-00	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF - M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Médio
Plano Financeiro Plano de Taxa de Administração Plano Previdenciário	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	18.598.288/0001-03	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Médio
Plano Previdenciário	22.791.074/0001-26	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Médio
Plano Previdenciário	23.948.236/0001-50	TERRA NOVA IMAB FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 III a	VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	Muito baixo
Plano Previdenciário	26.326.285/0001-49	PREMIUM IMA - B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 III a	VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	Muito baixo
Plano Previdenciário	26.326.293/0001-95	TERRA NOVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 10 I	VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	Muito baixo
Plano Previdenciário	26.326.321/0001-74	TERRA NOVA IMA - B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA II	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 III a	VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	Muito baixo
Plano Previdenciário	26.327.862/0001-17	PREMIUM FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 V b	VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	Muito baixo
Plano Previdenciário	34.525.068/0001-06	SUL AMÉRICA SELECTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 8 I	SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	BEM - DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS LTDA.	Alto





Carteira(s)	CNPJ	Nome completo	Artigo	Gestor	Administrador	Classificação
Plano Financeiro Plano Previdenciário	50.803.936/0001-29	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	63.375.216/0001-51	BNB SELEÇÃO CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - RESP LIMITADA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 8 I	BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A	Alto
Títulos públicos						
Plano Previdenciário	60.746.948/0001-12	LF BANCO BRADESCO S.A. 05/05/2022 - 05/05/2027 (IPCA+6,62%)	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 IV	BANCO BRADESCO S.A.	BANCO BRADESCO S.A.	Baixo
Plano Previdenciário	30.306.294/0001-45	LF BANCO BTG PACTUAL S A 14/10/2022 - 14/10/2024 (IPCA+7,41%)	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 IV	BANCO BTG PACTUAL S/A	BANCO BTG PACTUAL S/A	Baixo
Certificados de Recebimento de Fomento						
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 31863885 31/01/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 6,47%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571389 26/08/2022 - 15/08/2040 PCA+ 5,85%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571390 26/08/2022 - 15/08/2030 IPCA+ 5,72%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571392 26/08/2022 - 15/05/2035 IPCA+ 5,86%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571391 26/08/2022 - 15/05/2045 IPCA+ 5,92%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571395 26/08/2022 - 15/08/2060 IPCA+ 5,92%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571394 26/08/2022 - 15/05/2055 IPCA+ 5,92%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501832 03/08/2022 - 15/08/2060 IPCA + 6,28%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501831 03/08/2022 - 15/05/2055 IPCA+ 6,27%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501827 03/08/2022 - 15/08/2050 IPCA+ 6,27%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501828 03/08/2022 - 15/08/2040 IPCA+ 6,23%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571393 26/08/2022 - 15/08/2050 IPCA+ 5,92%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 31554965 23/01/2023 - 15/08/2040 IPCA+ 6,31%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 245018292 03/08/2022 - 15/08/2030 IPCA+ 6,03%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo

Carteira(s)	CNPJ	Nome completo	Artigo	Gestor	Administrador	Classificação
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501830 03/08/2022 - 15/05/2035 IPCA+ 6,21%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501826 03/08/2022 - 15/05/2045 IPCA+ 6,27%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 32388496 13/02/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 6,43%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 33224467 28/02/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 6,38%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 45319679 13/10/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,84%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 43615212 13/09/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,64%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 40068269 12/07/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,56%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 42495937 18/08/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,34%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 41846323 14/08/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,30%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 30065233 19/12/2022 - 15/08/2040 IPCA+ 6,34%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 38432553 13/06/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,62%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 37304255 17/05/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,83%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 36808202 15/05/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,85%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 20/04/2023 - 15/05/2045 - 35829288 IPCA+ 6,1025%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 48979574 14/12/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,69%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 29338981 02/12/2022 - 15/08/2040 IPCA+ 5,91%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 29239159 30/11/2022 - 15/05/2045 - 29239159 IPCA+6,141%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo

#### Ativos ilíquidos

23.948.236/0001-50 - TERRA NOVA IMAB FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA

26.326.285/0001-49 - PREMIUM IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

26.326.293/0001-95 - TERRA NOVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO

26.326.321/0001-74 - TERRA NOVA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA II

26.327.862/0001-17 - PREMIUM FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CREDITO PRIVADO





## 1.1. Estatísticas

Carteira(s)	Nome completo	Índice	Retorno médio mensal	Menor retorno	Maior retorno	Qtde. mês positivo	Qtde. mês negativo	Qtde. mês acima do índice	Qtde. mês abaixo do índice
Plano Previdenciário	BRABESCO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESP LIMITADA	CDI	0,91%	0,85%	1,00%	12	0	12	0
Plano Previdenciário	FINACAP MAURITSSTAD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBOVESPA	-0,32%	-5,73%	6,42%	6	6	0	0
Plano Previdenciário	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	IBOVESPA	-0,87%	-3,85%	4,68%	5	7	0	0
Plano Previdenciário	CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO	IBOVESPA	-0,62%	-5,67%	5,30%	5	7	0	0
Plano de Taxa de Administração	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,79%	0,75%	0,87%	12	0	12	0
Plano Previdenciário	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF - M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M	0,22%	-1,69%	1,48%	8	4	0	0
Plano Financeiro Plano de Taxa de Administração Plano Previdenciário	FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	CDI	0,78%	0,74%	0,84%	12	0	12	0
Plano Previdenciário	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,67%	-2,04%	1,24%	11	1	0	0
Plano Previdenciário	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,67%	-2,06%	1,24%	11	1	0	0
Plano Previdenciário	TERRA NOVA IMAB FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	IMA-B	-6,01%	-58,93%	-0,51%	0	12	0	0
Plano Previdenciário	PREMIUM IMA - B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	IMA-B	-4,80%	-52,44%	-0,07%	0	12	0	0
Plano Previdenciário	TERRA NOVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO	CDI	-32,66%	-399,39%	1,42%	10	2	10	0
Plano Previdenciário	TERRA NOVA IMA - B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA II	IMA-B	-5,49%	-53,24%	-0,51%	0	12	0	0
Plano Previdenciário	PREMIUM FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	CDI	-9,10%	-123,01%	1,92%	10	2	10	0
Plano Previdenciário	SUL AMÉRICA SELECTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBOVESPA	-1,35%	-7,51%	5,67%	6	6	0	0
Plano Previdenciário	BNB SELEÇÃO CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - RESP LIMITADA	IBOVESPA	-0,41%	-3,47%	7,49%	5	7	0	0

\* As estatísticas são baseadas na rentabilidade dos ativos no período de 01/02/2023 a 31/01/2024. As rentabilidades apresentadas referem-se exclusivamente aos ativos pertencentes às classes de **Fundos de Investimentos** e **Fundos de Classes de Investimentos**. Dados de outras classes de investimento não estão incluídos pois são de difícil obtenção de dados, pois muitos desses ativos são comercializados diretamente entre terceiros e suas informações não estão disponíveis na CVM.



## 1.2. Tabela de cotação e taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
03.399.411/0001-90 - BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	0,20%
05.964.067/0001-60 - FINACAP MAURITSSTAD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	0,00%
07.882.792/0001-14 - BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	0,00%
11.182.064/0001-77 - CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	2,00%
13.077.415/0001-05 - BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	1,00%
14.508.605/0001-00 - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	0,20%
14.508.643/0001-55 - FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	0,80%
18.598.288/0001-03 - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D+0		D+0	D+0	0,00%	0,00%
22.791.074/0001-26 - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D+0		D+0	D+0	0,00%	0,00%
23.948.236/0001-50 - TERRA NOVA IMAB FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	0,90%
26.326.285/0001-49 - PREMIUM IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	59.538,78%
26.326.293/0001-95 - TERRA NOVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	0,00%
26.326.321/0001-74 - TERRA NOVA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA II	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	97.427,10%
26.327.862/0001-17 - PREMIUM FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	1,00%
34.525.068/0001-06 - SUL AMÉRICA SELECTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	0,00%
63.375.216/0001-51 - BNB SELEÇÃO CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	2,00%

## Ativos ilíquidos

CNPJ	Nome completo
23.948.236/0001-50	TERRA NOVA IMAB FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA
26.326.285/0001-49	PREMIUM IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA
26.326.293/0001-95	TERRA NOVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO
26.326.321/0001-74	TERRA NOVA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA II





Documento Assinado Digitalmente por: JOSE ALBERICO SILVA RODRIGUES  
Acesse em: <https://etc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 86420d40-71f6-4a0e-8348-35c8a10bedd

CNPJ	Nome completo
26.327.862/0001-17	PREMIUM FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CREDITO PRIVADO



### 1.3. Composição por segmento

Segmento	Saldo	%	VaR 12 meses
Renda Fixa	412.338.358,89	84,33%	0,1212%
Renda Variável	76.094.420,63	15,56%	0,7077%
Investimentos no Exterior	0,00	0,00%	0,0000%
Investimentos Estruturados	223.563,46	0,05%	0,0217%
Fundos Imobiliários	0,00	0,00%	0,0000%
Empréstimos Consignados	0,00	0,00%	0,0000%
Disponibilidade financeira	288.996,86	0,06%	0,0000%
Total geral	488.945.339,84	100,00%	0,1215%

### 1.4. Composição por índice financeiro

Índice	Valor do saldo	%
CDI	20.015.089,30	4,09%
IBOVESPA	76.094.420,63	15,56%
IMA-B	18.228.980,87	3,73%
IRF-M	5.029.462,40	1,03%
IPCA + Taxa	369.288.389,78	75,53%
SCC	288.996,86	0,06%
Total geral	488.945.339,84	100,00%



## 1.5. Prazos de liquidação

Prazo	Renda Fixa	Renda Variável	Investimentos no Exterior	Investimentos Estruturados	Fundos Imobiliários	Empréstimos Consignados	Disponibilidade financeira	Total
Curto prazo	114.895.034,56	76.094.420,63	0	223.563,46	0	0	288.996,86	191.502.015,51
Médio prazo	3.473.070,66	0	0	0	0	0	0	3.473.070,66
Longo prazo	293.970.253,67	0	0	0	0	0	0	293.970.253,67
Total geral	412.338.358,89	76.094.420,63	0,00	223.563,46	0,00	0,00	288.996,86	488.945.339,84

\* Curto prazo: até 60 dias; Médio prazo: entre 60 e 365 dias; Longo prazo: acima de 365 dias;





## 1.6. Composição da carteira por regras

### 1.6.1. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano Previdenciário )

Artigo da resolução	Valor do saldo		Var. L. (meses)
Artigo 7, Inciso I, Alínea a	293.970.253,67	60,86%	0,0000
Artigo 7, Inciso I, Alínea b	9.223.789,70	1,91%	0,0033
Artigo 7, Inciso III, Alínea a	26.768.353,95	5,54%	0,0066
Artigo 7, Inciso IV	75.318.136,11	15,59%	0,0000
Artigo 7, Inciso V, Alínea b	1.145.555,65	0,24%	0,1126
Artigo 8, Inciso I	76.094.420,63	15,75%	0,7163
Artigo 10, Inciso I	223.563,46	0,05%	0,0219
Artigo 26	288.996,86	0,06%	0,0000
Total geral	483.033.070,03	100,00%	0,1076



1.6.2. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano Financeiro )

Artigo da resolução	Valor do saldo	%	Var 12 meses
Artigo 7, Inciso I, Alínea b	2.100.640,81	100,00%	0,0168
Artigo 26	0,00	0,00%	0,0000
Total geral	2.100.640,81	100,00%	0,0084



### 1.6.3. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano de Taxa de Administração )

Artigo da resolução	Valor do saldo	%	VSR 12 meses
Artigo 7, Inciso I, Alínea b	272.942,68	7,16%	0,0012
Artigo 7, Inciso III, Alínea a	3.538.686,32	92,84%	0,0197
Total geral	3.811.629,00	100,00%	0,0105





## 1.7. Volatilidade da carteira

Volatilidade	Valor do saldo	
Muito baixo	328.595.047,54	67,20%
Baixo	75.318.136,11	15,40%
Médio	8.937.735,56	1,83%
Alto	67.006.129,32	13,70%
Muito alto	9.088.291,31	1,86%
Total geral	488.945.339,84	100,00%

Tipos de risco: 1 - Muito baixo 2 - Baixo 3 - Médio 4 - Alto 5 - Muito alto



## 2. Carteira

### 2.1. Posição dos ativos (dados quantitativos)

Carteira(s)	CNPJ	Ativo	Valor do saldo	% PL RPPS	% PL Ativo	Rentabilidade mensal	Rentabilidade anual	VaR 12 meses	Volatilidade 12 meses
Fundos de Investimento									
Plano Previdenciário	03.399.411/0001-90	BRABESCO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESP LIMITADA	12.447.646,24	2,55%	0,14%	1,09%	1,09%	0,03%	0,07%
Plano Previdenciário	05.964.067/0001-60	FINACAP MAURITSSTAD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	26.415.095,30	5,40%	6,51%	-5,39%	-5,39%	1,95%	4,10%
Plano Previdenciário	07.882.792/0001-14	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	9.088.291,31	1,86%	0,65%	-6,46%	-6,46%	1,78%	3,74%
Plano Previdenciário	11.182.064/0001-77	CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO	23.949.149,08	4,90%	1,63%	-3,43%	-3,43%	6,83%	14,36%
Plano de Taxa de Administração	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	3.538.686,32	0,72%	0,08%	0,88%	0,88%	0,02%	0,04%
Plano Previdenciário	14.508.605/0001-00	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF - M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	5.029.462,40	1,03%	0,21%	0,67%	0,67%	0,23%	0,49%
Plano Financeiro Plano de Taxa de Administração Plano Previdenciário	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.659.637,63	0,54%	0,29%	0,88%	0,88%	0,02%	0,04%
Plano Previdenciário	18.598.288/0001-03	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	3.399.059,29	0,70%	0,67%	1,11%	1,11%	0,10%	0,21%
Plano Previdenciário	22.791.074/0001-26	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	509.213,87	0,10%	0,21%	1,10%	1,10%	0,10%	0,21%
Plano Previdenciário	23.948.236/0001-50	TERRA NOVA IMAB FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	5.578.987,68	1,14%	40,69%	-0,03%	-0,03%	0,17%	0,37%
Plano Previdenciário	26.326.285/0001-49	PREMIUM IMA - B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	3.826.782,62	0,78%	25,99%	0,31%	0,31%	0,20%	0,43%
Plano Previdenciário	26.326.293/0001-95	TERRA NOVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO	223.563,46	0,05%	61,52%	-4,33%	-4,33%	47,41%	99,85%
Plano Previdenciário	26.326.321/0001-74	TERRA NOVA IMA - B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA II	4.914.937,41	1,01%	23,56%	0,07%	0,07%	0,21%	0,45%
Plano Previdenciário	26.327.862/0001-17	PREMIUM FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	1.145.555,65	0,23%	13,02%	-0,38%	-0,38%	47,48%	99,98%
Plano Previdenciário	34.525.068/0001-06	SUL AMÉRICA SELECTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	10.147.591,15	2,08%	5,96%	-8,43%	-8,43%	10,37%	21,84%



Carteira(s)	CNPJ	Ativo	Valor do saldo	% PL RPPS	% PL Ativo	Rentabilidade mensal	Rentabilidade anual	VaR 12 meses	Volatilidade 12 meses
Plano Financeiro		FDO DE INV EM COTAS DE FDS DE INV CAIXA AUTOMATICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	0,00%	0,00%	-	-	-	-
Plano Previdenciário	50.803.936/0001-29								
Plano Previdenciário	63.375.216/0001-51	BNB SELEÇÃO CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - RESP LIMITADA	6.494.293,79	1,33%	10,67%	-4,37%	-4,37%	1,48%	3,12%
Títulos públicos									
Plano Previdenciário	60.746.948/0001-12	LF BANCO BRADESCO S.A. 05/05/2022 - 05/05/2027 (IPCA+6,62%)	71.845.065,45	14,69%	100,00%	1,10%	1,10%	-	-
Plano Previdenciário	30.306.294/0001-45	LF BANCO BTG PACTUAL S A 14/10/2022 - 14/10/2024 (IPCA+7,41%)	3.473.070,66	0,71%	100,00%	0,96%	0,96%	-	-
Descontos em folha									
Plano Financeiro	00.360.305/0001-04	CEF: Agência: 0559 Conta: 5 - 0	0,00	-	-	-	-	-	-
Plano Previdenciário	00.360.305/0001-04	Caixa Econômica Federal - Agência: 0559 / Conta:006.00071017 - 1	54.875,68	-	-	-	-	-	-
Plano Previdenciário	00.360.305/0001-04	Caixa Econômica Federal - Agência: 0559 / Conta:006.00071046 - 5	19.385,68	-	-	-	-	-	-
Plano Previdenciário	02.332.886/0001-04	Banco Xp S/A - Agência: 0008 / Conta:9846 - 0	1.101,72	-	-	-	-	-	-
Plano Previdenciário	00.360.305/0001-04	Caixa Econômica Federal - Agência: 0559 / Conta:71064 - 3	213.633,78	-	-	-	-	-	-
Compra direta de título público									
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 31863885 31/01/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 6,47%	25.158.506,37	5,15%	100,00%	1,09%	1,09%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571389 26/08/2022 - 15/08/2040 PCA+ 5,85%	8.497.542,06	1,74%	100,00%	1,04%	1,04%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571390 26/08/2022 - 15/08/2030 IPCA+ 5,72%	776.747,46	0,16%	100,00%	1,03%	1,03%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571392 26/08/2022 - 15/05/2035 IPCA+ 5,86%	5.803.495,11	1,19%	100,00%	1,04%	1,04%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571391 26/08/2022 - 15/05/2045 IPCA+ 5,92%	7.080.323,21	1,45%	100,00%	1,05%	1,05%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571395 26/08/2022 - 15/08/2060 IPCA+ 5,92%	5.931.979,38	1,21%	100,00%	1,05%	1,05%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571394 26/08/2022 - 15/05/2055 IPCA+ 5,92%	3.700.103,89	0,76%	100,00%	1,05%	1,05%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501832 03/08/2022 - 15/08/2060 IPCA+ 6,28%	4.019.882,48	0,82%	100,00%	1,08%	1,08%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501831 03/08/2022 - 15/05/2055 IPCA+ 6,27%	3.382.346,77	0,69%	100,00%	1,08%	1,08%	-	-





Categoria(s)	CNPJ	Ativo	Valor do saldo	% PL RPPS	% PL Ativo	Rentabilidade mensal	Rentabilidade anual	VaR 12 meses	Volatilidade 12 meses
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501827 03/08/2022 - 15/08/2050 IPCA+ 6,27%	5.079.228,59	1,04%	100,00%	1,08%	1,08%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501828 03/08/2022 - 15/08/2040 IPCA+ 6,23%	7.835.880,75	1,60%	100,00%	1,07%	1,07%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571393 26/08/2022 - 15/08/2050 IPCA+ 5,92%	5.615.224,42	1,15%	100,00%	1,05%	1,05%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 31554965 23/01/2023 - 15/08/2040 IPCA+ 6,31%	22.491.338,33	4,60%	100,00%	1,08%	1,08%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 245018292 03/08/2022 - 15/08/2030 IPCA+ 6,03%	665.303,22	0,14%	100,00%	1,06%	1,06%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501830 03/08/2022 - 15/05/2035 IPCA+ 6,21%	5.498.882,28	1,12%	100,00%	1,07%	1,07%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501826 03/08/2022 - 15/05/2045 IPCA+ 6,27%	6.750.142,34	1,38%	100,00%	1,08%	1,08%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 32388496 13/02/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 6,43%	5.529.983,82	1,13%	100,00%	1,09%	1,09%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 33224467 28/02/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 6,38%	8.092.820,92	1,66%	100,00%	1,08%	1,08%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 45319679 13/10/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,84%	4.987.175,77	1,02%	100,00%	1,04%	1,04%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 43615212 13/09/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,64%	4.850.420,52	0,99%	100,00%	1,02%	1,02%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 40068269 12/07/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,96%	4.807.291,81	0,98%	100,00%	1,02%	1,02%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 42495937 18/08/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,34%	3.479.940,33	0,71%	100,00%	1,00%	1,00%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 41846323 14/08/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,30%	4.674.895,33	0,96%	100,00%	0,99%	0,99%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 30065233 19/12/2022 - 15/08/2040 IPCA+ 6,34%	7.558.186,06	1,55%	100,00%	1,08%	1,08%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 38432553 13/06/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,62%	4.517.725,31	0,92%	100,00%	1,02%	1,02%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 37304255 17/05/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,83%	3.865.441,54	0,79%	100,00%	1,04%	1,04%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 36808202 15/05/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,85%	4.760.892,63	0,97%	100,00%	1,04%	1,04%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 20/04/2023 - 15/05/2045 - 35829288 IPCA+ 6,1025%	4.515.055,62	0,92%	100,00%	1,06%	1,06%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 48979574 14/12/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,69%	9.355.686,80	1,91%	100,00%	1,03%	1,03%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 29338981 02/12/2022 - 15/08/2040 IPCA+ 5,91%	52.279.567,56	10,69%	100,00%	1,05%	1,05%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 29239159 30/11/2022 - 15/05/2045 - 29239159 IPCA+ 6,141%	52.408.242,99	10,72%	100,00%	1,06%	1,06%	-	-
Total geral			488.945.339,84	99,94%					



## 2.2. Rendimentos

Data do movimento	Saldo anterior	Aplicação/Entrada	Resgate/Saída	Retorno do mês	Saldo final	Rentabilidade do mês
31/01/2024	485.881.635,79	23.272.286,40	19.240.173,05	195.851,46	488.945.339,84	0,05%
Total geral		23.272.286,40	19.240.173,05	195.851,46		



### 2.3. Evolução mensal do patrimônio líquido







## 2.4. Rentabilidade x Meta mensal



\*



## 2.5. Rentabilidade x Meta anual



\*



Mês	Rentabilidade mensal	Rentabilidade acumulada anual
Janeiro	0,05%	0,05%
	*	

2.6. Risco ponderado



Data	Índice	Risco
31/01/2024	1,6472	Baixo





Tipos de risco: 1 - Muito baixo 2 - Baixo 3 - Médio 4 - Alto 5 - Muito alto







## 2.7. Distribuição

### 2.7.1. Distribuição por administradores









CNPJ	Nome	Saldo na carteira	% da carteira	Total ANBIMA sob administração	Valor do investimento em RPPS do administrador	Percentual proporcional do segmento de RPPS sobre o patrimônio do administrador	Máximo permitido no segmento de RPPS
Fundos de Investimento							
62.318.407/0001-19	 S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	6.494.293,79	1,33%	344.096.272.103,99	5.553.893.444,55	1,61%	50,00%
30.822.936/0001-69	 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	12.626.977,63	2,58%	1.555.738.204.000,00	87.248.736.000,00	5,61%	50,00%
00.066.670/0001-00	 BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	60.511.835,53	12,38%	394.342.144.460,00	7.903.114.060,00	2,00%	50,00%
42.066.258/0001-30	 RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	15.689.826,82	3,21%	8.479.318.641,25	49.177.899,41	0,58%	50,00%
60.746.948/0001-12	 BANCO BRADESCO S.A.	84.292.711,69	17,24%	639.073.238.247,08	14.199.324.976,86	2,22%	50,00%
Total		179.615.645,46	36,74%				
Disponibilização em valores							
02.332.886/0001-04	 XP INVESTIMENTOS CCTVM S.A.	1.101,72	0,00%	124.880.485.535,80	3.500.000.000,00	2,80%	50,00%
00.360.305/0001-04	 CAIXA ECONOMICA FEDERAL	11.885.268,33	2,43%	635.264.415.250,00	75.955.723.830,00	11,96%	50,00%



CNPJ	Nome	Saldo na carteira	% da carteira	Total ANBIMA sob administração	Valor do investimento em RPPS do administrador	Percentual proporcional do segmento de RPPS sobre o patrimônio do administrador	Máximo permitido no segmento de RPPS
Total		11.886.370,05	2,43%				
Título privado							
30.306.294/0001-45	 BANCO BTG PACTUAL S/A	3.473.070,66	0,71%	584.813.469.828,62	4.669.789.496,75	0,80%	50,00%
Total		3.473.070,66	0,71%				
Compra direta de título público							
02.952.035/0001-56	 TESOURO NACIONAL	293.970.253,67	60,12%	-	-	-	-
Total		293.970.253,67	60,12%				
Total geral		488.945.339,84	100,00%				







## 2.7.2. Distribuição por gestores

CNPJ	Nome	Saldo na carteira	% da carteira	Total ANBIMA sob gestão	Saldo na carteira sobre o total sob gestão (%)	Máximo permitido na carteira
Fundos de Investimento						
30.822.936/0001-69	 BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	12.626.977,63	2,58%	1.559.153.732.157,70	0,00%	5,00%
60.746.948/0001-12	 BANCO BRADESCO S.A.	84.292.711,69	17,24%	639.073.238.247,08	0,01%	5,00%
07.237.373/0001-20	 BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	6.494.293,79	1,33%	13.224.031.599,14	0,05%	5,00%
12.678.380/0001-05	 VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	15.689.826,82	3,21%	2.655.614.922,09	0,59%	5,00%
10.626.543/0001-72	 CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	23.949.149,08	4,90%	2.371.436.461,29	1,01%	5,00%
21.813.291/0001-07	 SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	10.147.591,15	2,08%	49.373.859.908,62	0,02%	5,00%
42.040.639/0001-40	 CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	11.597.373,19	2,37%	510.382.267.594,85	0,00%	5,00%
01.294.929/0001-33	 FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	26.415.095,30	5,40%	1.081.652.639,31	2,44%	5,00%
Total		191.213.018,65	39,11%			

Disponível em: [https://etce.ice-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam](#)

















CNPJ	Nome	Saldo na carteira	% da carteira	Total ANBIMA sob gestão	Saldo na carteira sobre o total sob gestão (%)	Máximo permitido na carteira
02.332.886/0001-04	 XP INVESTIMENTOS CCTVM S.A.	1.101,72	0,00%	172.603.176.493,74	0,00%	5,00%
00.360.305/0001-04	 CAIXA ECONOMICA FEDERAL	287.895,14	0,06%	512.219.921.710,69	0,00%	5,00%
Total		288.996,86	0,06%			
Título privado						
30.306.294/0001-45	 BANCO BTG PACTUAL S/A	3.473.070,66	0,71%	364.844.908.110,29	0,00%	5,00%
Total		3.473.070,66	0,71%			
Compra direta de título público						
02.952.035/0001-56	 TESOURO NACIONAL	293.970.253,67	60,12%	—	—	—
Total		293.970.253,67	60,12%			
Total geral		488.945.339,84	100,00%			












## 2.8. Resumo por administrador / gestor

Administrador	Gestores	Valor	% Certa
 62.318.407/0001-19 - S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A.	 07.237.373/0001-20 - BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	6.494.293,79	1,33%
 30.822.936/0001-69 - BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	 30.822.936/0001-69 - BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	12.626.977,63	2,58%
 00.066.670/0001-00 - BEM - DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS LTDA.	 10.626.543/0001-72 - CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	23.949.149,08	4,90%
	 21.813.291/0001-07 - SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	10.147.591,15	2,08%
	 01.294.929/0001-33 - FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	26.415.095,30	5,40%
 42.066.258/0001-30 - RJN CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	 12.678.380/0001-05 - VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	15.689.826,82	3,21%
 60.746.948/0001-12 - BANCO BRADESCO S.A.	 60.746.948/0001-12 - BANCO BRADESCO S.A.	84.292.711,69	17,24%
 02.332.886/0001-04 - XP INVESTIMENTOS CCTVM S.A.	 02.332.886/0001-04 - XP INVESTIMENTOS CCTVM S.A.	1.101,72	0,00%



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE ALBERICO SILVA RODRIGUES  
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 86420d40-71f6-4a0e-8348-35c8a10bedd

Administrador	Gestores	Valor	% Carteira
 00.360.305/0001-04 - CAIXA ECONOMICA FEDERAL	 00.360.305/0001-04 - CAIXA ECONOMICA FEDERAL	287.895,14	0,06%
	 42.040.639/0001-40 - CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	11.597.373,19	2,37%
 30.306.294/0001-45 - BANCO BTG PACTUAL S/A	 30.306.294/0001-45 - BANCO BTG PACTUAL S/A	3.473.070,66	0,71%
 02.952.035/0001-56 - TESOURO NACIONAL	 02.952.035/0001-56 - TESOURO NACIONAL	293.970.253,67	60,12%
Total		488.945.339,84	100,00%



## 2.9. Política de investimentos e enquadramentos

### 2.9.1. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 - Política de Investimentos 2024 ( Plano Previdenciário )

Descrição	Artigo	Aplicado \$	Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021	Política de Investimentos 2024			Resultado				
			Limite	Limite inferior	Estratégia alvo	Limite superior	Posição atual da carteira	Diferença do limite superior	Situação	Disponível para aplicar	
Renda Fixa											
FI 100% títulos TN- vigência de 01/11/2010 até 01/04/2018	Artigo 7, Inciso I, Alínea a	293.970.253,67	100,00%	20,00%	60,00%	80,00%	60,86%	19,14%	Enquadrado	92.456.202,35	
Fundo/Classe de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC	Artigo 7, Inciso I, Alínea b	9.223.789,70	100,00%	1,00%	2,00%	30,00%	1,91%	28,09%	Enquadrado	135.686.131,31	
Fundo/Classe de Investimento em Renda Fixa - Geral	Artigo 7, Inciso III, Alínea a	26.768.353,95	60,00%	1,00%	2,00%	20,00%	5,54%	14,46%	Enquadrado	69.838.260,06	
Ativos de Renda Fixa Emitidos por Instituições Financeiras	Artigo 7, Inciso IV	75.318.136,11	20,00%	10,00%	16,00%	20,00%	15,59%	4,41%	Enquadrado	21.288.477,90	
Fundo/Classe de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado	Artigo 7, Inciso V, Alínea b	1.145.555,65	5,00%	1,00%	1,00%	4,00%	0,24%	3,76%	Desenquadrado	18.175.767,15	
Total em renda fixa		406.426.089,08					84,14%				
Renda Variável											
Fundo/Classe de Investimento em Ações	Artigo 8, Inciso I	76.094.420,63	30,00%	8,00%	15,00%	30,00%	15,75%	14,25%	Enquadrado	68.815.500,38	
Total em renda variável		76.094.420,63					15,75%				
Investimentos Estruturados											
Fundo/Classe de Investimento Multimercado FIM	Artigo 10, Inciso I	223.563,46	10,00%	0,00%	1,00%	5,00%	0,05%	4,95%	Enquadrado	23.928.090,04	
Total em investimentos estruturados		223.563,46					0,05%				
Disponibilidade financeira											
Do Segmento de Disponibilidade Financeira	Artigo 26	288.996,86	0,00%				0,06%	-	Enquadrado	-	
Total em disponibilidade financeira		288.996,86					0,06%				
Total		483.033.070,03					100,00%				



## 2.9.2. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano Financeiro )

Descrição	Artigo	Aplicado \$	Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021		Resultado		
			Limite	Posição atual da carteira	Diferença do limite superior	Situação	Disponível para aplicação
Renda Fixa							
Fundo/Classe de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC	Artigo 7, Inciso I, Alínea b	2.100.640,81	100,00%	100,00%	-	Enquadrado	-
Total em renda fixa		2.100.640,81		100,00%			
Disponibilidade financeira							
Do Segmento de Disponibilidade Financeira	Artigo 26	0,00	0,00%	0,00%	-	Enquadrado	0,00
Total em disponibilidade financeira		0,00		0,00%			
Total		2.100.640,81		100,00%			














### 2.9.3. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano de Taxa de Administração )

Descrição	Artigo	Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021			Resultado		
		Aplicado \$	Limite	Posição atual da carteira	Diferença do limite superior	Situação	Disponível para aplicação
Renda Fixa							
Fundo/Classe de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC	Artigo 7, Inciso I, Alínea b	272.942,68	100,00%	7,16%	92,84%	Enquadrado	-
Fundo/Classe de Investimento em Renda Fixa - Geral	Artigo 7, Inciso III, Alínea a	3.538.686,32	60,00%	92,84%	-32,84%	Desenquadrado	-1.251.708,92
Total em renda fixa		3.811.629,00		100,00%			
Total		3.811.629,00		100,00%			



## 2.10. Rating de gestores e administradores

### 2.10.1. Administradores

CNPJ	Nome	Descrição	Nota	Descrição	Data de aprovação	Data de vencimento	Valor em reais
62.318.407/0001-19	 S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A						8.402.502,11
30.822.936/0001-69	 BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	Fitch	Exc.	Excelente	14/11/2024	14/11/2025	6.334.639,31
00.066.670/0001-00	 BEM - DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS LTDA.	Fitch	Exc.	Excelente	31/10/2023	31/10/2025	8.454.938,81
42.066.258/0001-30	 RJI GESTÃO E INVESTIMENTOS RJJ CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	SR	AA-	Bom	29/07/2024	29/07/2025	70.075.141,91
60.746.948/0001-12	 BANCO BRADESCO S.A.	Standard	AMP-1	Muito Forte	08/05/2024	08/05/2025	5.776.910,21
02.332.886/0001-04	 XP INVESTIMENTOS CCTVM S.A.	Moodys	MQ1	Excelente	07/03/2024	07/03/2025	145.777.685,01
00.360.305/0001-04	 CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Fitch	Exc.	Excelente	08/08/2024	08/08/2025	2.332,61
30.306.294/0001-45	 BANCO BTG PACTUAL S/A	Moodys	AAA	Excelente	26/07/2024	26/07/2025	17.064.847,91
02.952.035/0001-56	 TESOURO NACIONAL	TPF - Menor risco mercado	BR	Excelente	01/04/2024	01/04/2025	0,00
							309.882.467,89



## 2.10.2. Gestores

CNPJ	Logo	Nome	Descrição	Nota	Descrição	Data de expiração	Data de vencimento	Valor do saldo
30.822.936/0001-69		BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Fitch	Exc.	Excelente	14/11/2024	14/11/2025	8.402.502,1
60.746.948/0001-12		BANCO BRADESCO S.A.	Standard	AMP-1	Muito Forte	08/05/2024	08/05/2025	8.454.938,8
02.332.886/0001-04		XP INVESTIMENTOS CCTVM S.A.	Moodys	MQ1	Excelente	07/03/2024	07/03/2025	2.332,6
00.360.305/0001-04		CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Fitch	Exc.	Excelente	08/08/2024	08/08/2025	86.832,1
30.306.294/0001-45		BANCO BTG PACTUAL S/A	Moodys	AAA	Excelente	26/07/2024	26/07/2025	0,0
07.237.373/0001-20		BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	Fitch	For	Forte	20/03/2024	20/03/2025	6.334.639,3
12.678.380/0001-05		VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	Austin	QG 2+	Muito bom mas podendo ir para escala de bom	12/09/2024	31/07/2025	5.776.910,2
10.626.543/0001-72		CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	Austin	QG 2-	Muito bom mas podendo ir para escala de bom	06/09/2024	31/08/2025	22.486.020,4
16.500.294/0001-50		MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	Moodys	MQ1	Excelente	14/02/2024	14/02/2025	13.702.346,4
42.040.639/0001-40		CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	Fitch	Exc.	Excelente	08/08/2024	08/08/2025	16.978.015,81
02.328.724/0001-94		MOS GESTÃO DE INVESTIMENTOS LTDA	Moodys	MQ3	Bom	21/12/2023	20/12/2025	8.155.028,44
01.294.929/0001-33		FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	SR	G2Sr	Segurança muito boa	13/12/2024	13/12/2025	25.731.746,54

CNPJ	Nome	Descrição	Nota	Descrição	Data de aprovação	Data de vencimento	Valor do sal
02.952.035/0001-56	 TESOURO NACIONAL	TPF - Menor risco mercado	BR	Excelente	01/04/2024	01/04/2025	309.882.467,8

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE ALBERICO SILVA RODRIGUES  
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 86420d40-71f6-4a0e-8348-35c8a10bedd





### 3. Patrimônio, rentabilidade e metas por ano

### 4. Credenciamento de ativos

Nome completo	Descrição	Data de solicitação	Data de aprovação	Data de vencimento
LF BANCO BRADESCO S.A. 05/05/2022-05/05/2027 (IPCA+6,62%)	Credenciamento definitivo até o vencimento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
BNB SOBERANO CLASSE DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	Atualização do credenciamento	16/01/2023	16/01/2023	15/01/2025
FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	Atualização do credenciamento	02/10/2023	02/10/2023	01/10/2025
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RENDA FIXA CREDITO PRIVADO LONGO PRAZO	Atualização do credenciamento	01/10/2022	01/10/2022	30/09/2024
SOMMA TORINO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO	Atualização do credenciamento	16/01/2023	16/01/2023	15/01/2025
BTG PACTUAL FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES OPORTUNIDADES LISTADAS I	Atualização do credenciamento	04/12/2023	04/12/2023	03/12/2025



## 5. Credenciamento de pessoas jurídicas

Nome	Descrição	Data de validação	Data de expiração	Data de vencimento
TERRA INVESTIMENTOS DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	Credenciamento	27/12/2023	27/12/2023	26/12/2025
AVILA CAPITAL AGENTE AUTONOMO DE INVESTIMENTOS LTDA.	Credenciamento	27/12/2023	27/12/2023	26/12/2025
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS LTDA	Atualização do credenciamento	28/11/2023	28/11/2023	27/11/2025
ARRECIFE AGENTE AUTONOMO DE INVESTIMENTOS S/S LTDA.	Atualização do credenciamento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
BANCO DO BRASIL S.A.	Atualização do credenciamento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	Atualização do credenciamento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	Atualização do credenciamento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
PERFORME AGENTE AUTÔNOMO DE INVESTIMENTOS EIRELI	Atualização do credenciamento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	Atualização do credenciamento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	Atualização do credenciamento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A	Atualização do credenciamento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
XP INVESTIMENTOS CCTVM S.A.	Atualização do credenciamento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Atualização do credenciamento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	Atualização do credenciamento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS	Atualização do credenciamento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
BEM - DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS LTDA.	Atualização do credenciamento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
BANCO BRADESCO S.A.	Atualização do credenciamento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	Atualização do credenciamento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	Atualização do credenciamento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
GENIAL INVESTIMENTOS CORRETORA DE VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	Atualização do credenciamento	02/03/2023	02/03/2023	01/03/2025
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	Atualização do credenciamento	01/01/2023	01/01/2023	31/12/2024
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.	Atualização do credenciamento	16/01/2023	16/01/2023	15/01/2025
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S/A DTVM	Atualização do credenciamento	01/10/2022	01/10/2022	30/09/2024
TESOURO NACIONAL	Credenciamento definitivo	01/01/2023	01/01/2023	01/01/2090



## 6. Parecer

### Parecer NUI CONSULTORIA EMPRESARIAL LTDA

CONSIDERANDO o Programa de Certificação Institucional e Modernização da Gestão dos Regimes Próprios de Previdência Social da União, dos Estados, do Distrito Federal e dos Municípios, criada por meio da Portaria MPS nº 185/2015, bem como as normas da SPREV e Conselho Monetário Nacional;

CONSIDERANDO que para garantir a conformidade com a dimensão 3.2.6 do manual do Pró-Gestão, que trata da Política de Investimentos, é essencial observar uma série de medidas e práticas que visem mitigar riscos e assegurar a boa gestão dos recursos do Regime de Previdência Social (RPPS). Aqui estão alguns pontos-chave a serem considerados:

**Relatórios Mensais:** O RPPS deve elaborar relatórios detalhados e frequentes (mensais) sobre o desempenho dos investimentos. Esses relatórios devem incluir dados sobre a rentabilidade, a performance e as diversas modalidades de operações e os riscos associados;

**Parecer do Comitê de Investimentos:** Cada relatório deve ser acompanhado de um parecer do Comitê de Investimentos. O Comitê é responsável por avaliar e opinar sobre a adequação das estratégias de investimento, a conformidade com a Política de Investimentos e a eficácia das medidas de controle de riscos;

**Aprovação do Conselho Fiscal:** Após o parecer do Comitê de Investimentos, os relatórios devem ser submetidos ao Conselho Fiscal para aprovação. O Conselho Fiscal verifica se os procedimentos e relatórios estão em conformidade com a Política de Investimentos e com as normas regulatórias;

**Acompanhamento da Rentabilidade e Riscos:** É fundamental que os relatórios abordem não apenas a rentabilidade dos investimentos, mas também a gestão dos riscos associados. Isso inclui a avaliação contínua da performance dos investimentos em relação às expectativas e aos benchmarks estabelecidos;

**Aderência à Política de Investimentos:** Os relatórios e pareceres devem confirmar que as alocações de recursos e os processos decisórios estão alinhados com a Política de Investimentos do RPPS. Qualquer desvio ou necessidade de ajuste deve ser claramente identificado e justificado;

**Transparência e Documentação:** Todos os processos, decisões e análises devem ser documentados de forma clara e acessível. Isso assegura transparência e facilita auditorias e revisões futuras;

**Revisão e Atualização da Política de Investimentos:** A Política de Investimentos deve ser revisada periodicamente para garantir que esteja atualizada com as condições de mercado e as necessidades do RPPS.

Essas práticas ajudam a assegurar que a gestão dos recursos do RPPS seja feita de maneira prudente e em conformidade com as melhores práticas e exigências regulamentares, protegendo os interesses dos participantes e beneficiários do plano previdenciário;





CONSIDERANDO que o Comitê de Investimentos e o Conselho Fiscal deste RPPS possui respaldo legal de sua criação conforme normativos do RPPS;

CONSIDERANDO que o Relatório de Gestão de Investimentos desta competência elaborado pela NUI Consultoria Empresarial Ltda, atende todas as exigências, aprovamos o referido relatório.

As análises e sugestões de investimento realizadas pela NUI Consultoria são baseadas em avaliações de mercado e informações disponíveis no momento da análise. No entanto, elas não constituem garantias de retorno, uma vez que a rentabilidade futura não pode ser assegurada, e a performance passada não garante resultados futuros. É importante destacar que as análises estão sujeitas a mudanças devido a variações nos cenários internos e externos, além de fatores imprevistos que podem impactar os resultados esperados. Portanto, os investidores devem considerar essa incerteza ao tomar decisões com base nas recomendações fornecidas;

Este documento tem caráter meramente informativo, o usuário se responsabiliza por eventuais prejuízos na utilização de informações as quais a NUI Consultoria obteve junto a fontes públicas e alguns com instituições constantes deste relatório. Sendo a responsabilidade pelas às informações das fontes dos dados.

Com relação as informações do RPPS, foram obtidas em extratos das instituições e dados e informações que foram encaminhadas pelo RPPS, não sendo de responsabilidade da NUI Consultoria.

Cabo de Santo Agostinho / PE, 28/01/2024

  
GRUPO NUI

José Marcos Alves de Barros  
Consultor de investimentos

## 1. PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

**Tendo em vista os dados apresentados no respectivo relatório administrativo da carteira de investimentos deste RPPS, tais como:**

- a) Ativos/Fundos da carteira de investimentos com seus respectivos riscos;
- b) Evolução/involução da carteira de investimentos durante o ano;
- c) Volumes e prazos das disponibilidades dos recursos investidos;
- d) Volume de recursos investidos por benchmark;
- e) As rentabilidades mensais e acumuladas da carteira de investimentos comparadas com as metas mensais e acumuladas do ano;
- f) O risco da carteira de investimentos e sua evolução/involução;
- g) A distribuição dos recursos da carteira de investimentos com base nos ratings dos gestores e administradores;
- h) Os credenciamentos dos ativos/fundos de investimentos e das instituições;
- i) A adequação da carteira à Política de Investimentos;
- j) Outras considerações;

E ainda do cumprimento da CMN Nº 4.963/2021 e PORTARIA SPREV Nº 1.467/2022, e ainda aos requisitos do Pró-Gestão RPPS e de todas as deliberações e definições deste comitê de investimentos ou conselho deliberativo aprovamos o referido relatório.

As motivações das movimentações dos recursos financeiros constam da Política de Investimentos deste RPPS, no entanto, destacamos algumas motivações:

### **1- Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)**

Para realização da referida operação verificou-se que as instituições da referida compra direta de TPF encontram-se devidamente credenciados/atualizados em conformidade com CMN 4.963/2021 e Portaria 1.467/2022. Esta operação encontra-se em conformidade com a Política de Investimentos deste RPPS, e em consonância com o cenário econômico atual e perspectivas futuras, tanto do mercado interno (em especial o FOCUS BACEN), como do mercado externo. Para a realização da referida operação foram adotados todos os procedimentos com vistas ao maior retorno e menor custo, pelo fato a operação ser marcada pela curva de juros e ser de longo prazo foi produzido o Atestado de Compatibilidade e/ou ALM necessário com vistas a identificar se a compra não afetará o fluxo futuro de pagamento de aposentadorias. A taxa de retorno do ativo irá proporcionar ganho igual ou superior a meta atuarial durante todo o período até o seu vencimento. Operação deliberada/autorizada pelo órgão competente deste RPPS, conforme ata. A opção pela referida operação têm, ainda, como base a segurança e a ótima liquidez desta operação.

### **2- Fundos Renda fixa 100% TP e ETF RF TPF**



Para realização da referida operação verificou-se que as instituições do referido fundo/ativo assim como o mesmo encontram-se devidamente credenciados/atualizados em conformidade com CMN 4.963/2021 e Portaria 1.467/2022. Esta operação encontra-se em conformidade com a Política de Investimentos deste RPPS, e em consonância com o cenário econômico atual e perspectivas futuras, tanto do mercado interno (em especial o FOCUS BACEN), como do mercado externo. Possui taxa de administração coerente com o mercado, e apresentou boa relação riscos/retornos, ao longo do tempo, e que poderá proporcionar no curto prazo o atingimento da meta atuarial, caso o cenário não venha a se alterar de forma significativa. Os indicadores de renda fixa tais como: IMA-B, IMA-B5, IMA-B5+, IRFM, IRF-M1, IRF-M1+, IDKA 2A, CDI, SELIC e outros, podem proporcionar no curto/médio e longo prazo maior conforto no atingimento da meta e menores volatilidades. Operação deliberada/autorizada pelo órgão competente deste RPPS, conforme ata, e tendo como base as análises de fundos/ativos do mesmo segmento e benchmark ou próximos. O fundo/ativo escolhido foi devidamente analisado sob os aspectos qualitativos e quantitativos. A opção pela referida operação têm, ainda, como base a segurança e a ótima liquidez desta operação.

### 3- Renda fixa conforme CVM (7-III-a) e ETF RF CV

Para realização da referida operação verificou-se que as instituições do referido fundo/ativo assim como o mesmo encontram-se devidamente credenciados/atualizados em conformidade com CMN 4.963/2021 e Portaria 1.467/2022. Esta operação encontra-se em conformidade com a Política de Investimentos deste RPPS, e em consonância com o cenário econômico atual e perspectivas futuras, tanto do mercado interno (em especial o FOCUS BACEN), como do mercado externo. Possui taxa de administração coerente com o mercado, e apresentou boa relação riscos/retornos, ao longo do tempo, e que poderá proporcionar no curto prazo o atingimento da meta atuarial, caso o cenário não venha a se alterar de forma significativa. Os indicadores de renda fixa tais como: IMA-B, IMA-B5, IMA-B5+, IRFM, IRF-M1, IRF-M1+, IDKA 2A, CDI, SELIC e outros, podem proporcionar no curto/médio e longo prazo maior conforto no atingimento da meta e menores volatilidades. Operação deliberada/autorizada pelo órgão competente deste RPPS, conforme ata, e tendo como base as análises de fundos/ativos do mesmo segmento e benchmark ou próximos. O fundo/ativo escolhido foi devidamente analisado sob os aspectos qualitativos e quantitativos. A opção pela referida operação têm, ainda, como base a segurança e a ótima liquidez desta operação.

### 4- Ativos financeiros de renda fixa de emissão com obrigação ou coobrigação de instituições financeiras (Lista BACEN)

Para realização da referida operação verificou-se que a instituição bancária consta da lista BACEN divulgada pela SPREV e ainda foram adotadas todas as providências necessárias para a compra direta das Letras Financeiras de Bancos. A instituição financeira encontra-se devidamente credenciada/atualizada em conformidade com CMN 4.963/2021 e Portaria 1.467/2022. Esta operação encontra-se em conformidade com a Política de Investimentos deste RPPS, e em consonância com o cenário econômico atual e perspectivas futuras, tanto do mercado interno (em especial o FOCUS BACEN), como do mercado externo. Para a realização da referida operação foram adotados todos os procedimentos com vistas ao maior retorno e menor risco. Pelo fato da operação ser marcada pela curva de juros e ser de longo prazo foi produzido o Atestado de Compatibilidade e/ou ALM necessário com vistas a identificar se a compra não afetará o fluxo futuro de pagamento de aposentadorias. A taxa de retorno do ativo irá proporcionar ganho igual ou superior a meta atuarial durante todo o período até o seu vencimento. Operação deliberada/autorizada pelo órgão competente deste RPPS, conforme ata. A opção pela referida operação têm, ainda, como base a segurança em razão das análises da instituição e em especial o rating da LF.

### 5- Renda Fixa Crédito Privado

Para realização da referida operação verificou-se que as instituições do referido fundo/ativo assim como o mesmo encontram-se devidamente credenciados/atualizados em conformidade com CMN 4.963/2021 e Portaria 1.467/2022. Esta operação encontra-se em conformidade com a Política de Investimentos deste RPPS, e em consonância com o cenário econômico atual e



perspectivas futuras, tanto do mercado interno (em especial o FOCUS BACEN), como do mercado externo. Possui taxa de administração coerente com o mercado, apresentou boa relação riscos/retornos, ao longo do tempo, e que poderá proporcionar no longo prazo o atingimento da meta atuarial, caso o cenário não venha a se alterar de forma significativa. Os indicadores de renda variável tais como: IBOVESPA, SMALL CAPS, IDIV, IBrX, IBrX50 e outros podem proporcionar no médio e longo prazo bons retornos que podem contribuir no atingimento da meta atuarial, apesar das volatilidades. Operação deliberada/autorizada pelo órgão competente deste RPPS, conforme ata, tendo como base as análises ativos/fundos do mesmo segmento e benchmark. A escolha foi observou diversos aspectos qualitativos e quantitativos. A opção pela operação tem como base a segurança e a liquidez por ser de curto prazo.

## 6- Fundo de Ações CVM e ETF RV CVM

Para realização da referida operação verificou-se que as instituições do referido fundo/ativo assim como o mesmo encontram-se devidamente credenciados/atualizados em conformidade com CMN 4.963/2021 e Portaria 1.467/2022. Esta operação encontra-se em conformidade com a Política de Investimentos deste RPPS, e em consonância com o cenário econômico atual e perspectivas futuras, tanto do mercado interno (em especial o FOCUS BACEN), como do mercado externo. Possui taxa de administração coerente com o mercado, e apresentou boa relação riscos/retornos, ao longo do tempo, e que poderá proporcionar no longo prazo o atingimento da meta atuarial, caso o cenário não venha a se alterar de forma significativa. Os indicadores de renda variável tais como: IBOVESPA, SMALL CAPS, IDIV, IBrX, IBrX50 e outros podem proporcionar no médio e longo prazo bons retornos que podem contribuir no atingimento da meta atuarial, apesar das volatilidades. Operação deliberada/autorizada pelo órgão competente deste RPPS, conforme ata, e tendo como base as análises ativos/fundos do mesmo segmento e benchmark. A escolha foi observou diversos aspectos qualitativos e quantitativos. A opção pela operação têm como base a segurança e a liquidez por ser de curto prazo.

**7- FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa E FIC Aberto - Investimento no Exterior**

Para realização da referida operação verificou-se que as instituições do referido fundo/ativo assim como o mesmo encontram-se devidamente credenciados/atualizados em conformidade com CMN 4.963/2021 e Portaria 1.467/2022. Esta operação encontra-se em conformidade com a Política de Investimentos deste RPPS, e em consonância com cenário econômico atual e perspectivas futuras, tanto do mercado interno (em especial o FOCUS BACEN), como do mercado externo. Possui taxa de administração coerente com o mercado, e apresentou boa relação riscos/retornos, ao longo do tempo, e que poderá proporcionar no longo prazo o atingimento da meta atuarial, caso o cenário não venha a se alterar de forma significativa. O cenário do mercado externo encontra-se propício para investimentos e podem proporcionar no médio e longo prazo bons retornos que podem contribuir no atingimento da meta atuarial, apesar das volatilidades. Operação deliberada/autorizada pelo órgão competente deste RPPS, conforme ata, e tendo como base as análises ativos/fundos do mesmo segmento e benchmark. A escolha foi observou diversos aspectos qualitativos e quantitativos. A opção pela operação têm como base a segurança e a liquidez por ser de curto prazo.

## 8- Fundo de Ações – BDR Nível I

Para realização da referida operação verificou-se que as instituições do referido fundo/ativo assim como o mesmo encontram-se devidamente credenciados/atualizados em conformidade com CMN 4.963/2021 e Portaria 1.467/2022. Esta operação encontra-se em conformidade com a Política de Investimentos deste RPPS, e em consonância com o cenário econômico atual e perspectivas futuras, tanto do mercado interno (em especial o FOCUS BACEN), como do mercado externo. Possui taxa de administração coerente com o mercado, e apresentou boa relação riscos/retornos, ao longo do tempo, e que poderá proporcionar no longo prazo o atingimento da meta atuarial, caso o cenário não venha a se alterar de forma significativa. O cenário do mercado externo encontra-se propício para investimentos e podem proporcionar no médio e longo prazo bons retornos que podem contribuir no atingimento da meta atuarial, apesar das volatilidades. Operação deliberada/autorizada pelo órgão competente deste RPPS, conforme ata, e tendo como base as análises ativos/fundos do mesmo segmento e benchmark. A escolha foi observou diversos aspectos qualitativos e quantitativos. A opção pela operação têm como base a segurança e a liquidez por ser de curto prazo.

### 9- Fundos Multimercados



Para realização da referida operação verificou-se que as instituições do referido fundo/ativo assim como o mesmo encontram-se devidamente credenciados/atualizados em conformidade com CMN 4.963/2021 e Portaria 1.467/2022. Esta operação encontra-se em conformidade com a Política de Investimentos deste RPPS, e em consonância com o cenário econômico atual e perspectivas futuras, tanto do mercado interno (em especial o FOCUS BACEN), como do mercado externo. Possui taxa de administração coerente com o mercado, e apresentou boa relação riscos/retornos, ao longo do tempo, e que poderá proporcionar no longo prazo o atingimento da meta atuarial, caso o cenário não venha a se alterar de forma significativa. Apesar de tratar-se um ativo/fundo de renda variável, possui características parecidas com os fundos de renda fixa, tanto que em sua maioria o benchmark costuma ser o CDI. Poderá proporcionar no curto, médio e longo prazo bons retornos que podem contribuir no atingimento da meta atuarial, apesar das volatilidades. Operação deliberada/autorizada pelo órgão competente deste RPPS, conforme ata, e tendo como base as análises ativos/fundos do mesmo segmento e benchmark. A escolha foi observou diversos aspectos qualitativos e quantitativos. A opção pela operação têm como base a segurança e a liquidez por ser de curto prazo.

#### ASSINATURAS DO COMITÊ/CONSELHO DELIBERATIVO

## 2. PARECER DO CONSELHO FISCAL

Tendo em vista os dados apresentados no respectivo relatório administrativo da carteira de investimentos deste RPPS e o parecer do comitê de investimentos ou conselho deliberativo, bem como as análises de extratos, dados contábeis, aprovamos o referido relatório.



#### ASSINATURAS DO CONSELHO FISCAL

### 3. ELABORAÇÃO DE RELATÓRIOS SEMESTRAIS DE DILIGÊNCIAS (FUNDOS ILÍQUIDOS/CRÉDITO PRIVADO)

- a) verificação dos ativos que compõem o patrimônio dos fundos de investimentos, incluindo os títulos e valores mobiliários aplicados pelo RPPS, excluídos os títulos públicos;
- b) análise da situação patrimonial, fiscal e comercial das empresas investidas, por meio de Fundos de Investimentos em Participações - FIP;
- c) análise do Relatório de Rating dos ativos no caso de Fundos de Renda Fixa (salvo aqueles que aplicam seus recursos exclusivamente em títulos públicos), Aplicações diretas em Ativos Financeiros de Renda Fixa, Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios (FIDC), Fundos de Renda Fixa – Crédito Privado e Fundos de Debêntures e Infraestrutura;
- d) análise do Relatório de Avaliação de Imóveis no caso de Fundos de Investimentos possuí-los na Carteira; e utilização de metodologia que demonstre a compatibilidade do passivo com o ativo, principalmente do ALM, para os RPPS com mais de 50 milhões de reais aplicados no mercado financeiro.

Os RPPS poderão utilizar as informações prestadas pelas administradoras e gestoras dos fundos de investimentos e demais informações disponíveis na internet de conhecimento público ou outros meios disponíveis no mercado acessíveis pelos RPPS (jornais, revistas, órgãos de regulação e controle, agências de rating, associação de entidades do mercado financeiro e de capitais, softwares, dentre outros).

## 4. CENÁRIOS

### 1. Resumo de Mercado

O mês de janeiro de 2024 apresentou um cenário econômico global influenciado por um processo contínuo de desinflação, impulsionado pela queda dos preços das commodities. No entanto, tensões geopolíticas no Mar Vermelho adicionam riscos inflacionários, especialmente no frete marítimo. As economias desenvolvidas começam a se preparar para uma flexibilização monetária, com cortes de juros projetados para o segundo trimestre, particularmente nos EUA e na Europa. No Brasil, os dados de atividade econômica superaram expectativas, especialmente no mercado de trabalho e no consumo das famílias. A balança comercial brasileira continua a apresentar superávit, reforçando a apreciação do real. Apesar das pressões fiscais, a projeção para o PIB de 2024 foi revisada para cima, com expectativa de crescimento de 1,5% e inflação sob controle, estimada em 3,7%.

### 2. Panorama Brasil

O cenário econômico brasileiro em janeiro é caracterizado por indicadores de atividade econômica acima do esperado, destacando-se o consumo das famílias e a melhoria do mercado de trabalho. A taxa de desemprego encerrou 2023 em 7,6%, e a massa de renda disponível às famílias deve crescer 4,2% este ano. Apesar disso, a indústria e transformação segue estagnada, enquanto o setor extrativo, impulsionado pela exportação de minérios e petróleo, continua em expansão. Em termos fiscais, o déficit público deve atingir 0,6% do PIB em 2024, com expectativas de melhora nas receitas devido a novas medidas de arrecadação. A balança comercial deve renovar máximas históricas com um superávit projetado de US\$ 85,5 bilhões, impulsionado por exportações de produtos agrícolas e petróleo.

### 3. Panorama Internacional

O cenário global aponta para um período de desinflação, apoiado pela queda nos preços das commodities no final de 2023. Nos EUA, o Federal Reserve mantém as taxas de juros entre 5,25% e 5,50%, com expectativa de iniciar cortes a partir de maio, reduzindo as taxas para um intervalo entre 3,75% e 4,00% até o final do ano. Na Europa, o Banco Central Europeu também indica cortes de juros, embora deva manter as taxas elevadas até junho. As economias emergentes, incluindo o Brasil, devem se beneficiar de uma taxa de juros mais baixa nos EUA, o que pode gerar volatilidade nos mercados financeiros devido à incerteza sobre os impactos do mercado de trabalho e das tensões geopolíticas.





#### 4. Impactos nos Mercados de Renda Fixa

O mercado de renda fixa deve continuar a se beneficiar das reduções esperadas na taxa Selic. Com a projeção de que a Selic atinja 9,00% até o final do ano, títulos prefixados e indexados ao IPCA apresentam boas oportunidades de retorno real. Com a inflação controlada e os cortes na Selic, os investidores podem aproveitar a redução das taxas de juros para investir em títulos de longo prazo. Além disso, títulos corporativos de baixo risco de crédito também são atraentes, à medida que as condições de financiamento melhoram com a queda dos juros.

#### 5. Impactos nos Mercados de Renda Variável

O mercado de renda variável é favorecido pela expectativa de cortes na Selic e pela recuperação do consumo interno. Setores como o varejo, construção civil e bancos tendem a se beneficiar da melhora nas condições de crédito e na atividade econômica. Empresas ligadas ao setor de commodities, como mineração e petróleo, também devem destacar, com a continuidade da forte demanda externa por esses produtos. A valorização do real e a estabilização dos preços das commodities reforçam o otimismo do mercado de ações, especialmente para empresas exportadoras.

#### 6. Impactos nos Mercados de Investimentos no Exterior

Os mercados de investimentos no exterior enfrentam uma perspectiva de volatilidade devido às incertezas sobre o ritmo de cortes de juros pelo Federal Reserve. Ativos em mercados emergentes, incluindo o Brasil, podem se beneficiar da desvalorização do dólar, embora tensões geopolíticas e a volatilidade nos títulos do Tesouro dos EUA representem riscos. Investidores internacionais podem buscar diversificação em ativos atrelados a moedas emergentes e em setores que se beneficiam de um cenário global de desinflação e taxas de juros mais baixas, como tecnologia e consumo nos EUA.

### 5. ATA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

#### Ata do Comitê/Conselho Deliberativo

Data:

### 6. ATA DO CONSELHO FISCAL

#### Ata do Conselho Fiscal

Data:



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE ALBERICO SILVA RODRIGUES  
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 86420d40-71f6-4a0e-8348-35c8a10bedd

## 7. Disclaimer

### Esse relatório é parte integrante do software



Versão 1.51.1783 - 27/01/2025 - 28/01/2025 08:45:32

© Todos os direitos reservados. Todos os resultados deste software foram gerados por algoritmos automatizados e integração de dados de origem externa controlada por outras empresas terceirizadas e informadas prestadas pelas próprias instituições. O usuário logado é responsável legalmente pela instituição, o qual é o utilizador principal desta aplicação, se responsabiliza pela conferência e validação de todos os dados gerados a partir deste software. Caso sejam notados problemas ou divergências na utilização ou nos resultados obtidos, acione o suporte o mais breve possível, para que os mesmos sejam verificados e corrigidos, isso evitará quaisquer perdas ou danos financeiros resultantes do uso do software. Questionamentos poderão ser realizados, desde de que apresentados com embasamento, nota técnica e exemplos de formulação. Lembrando também, que este software contém informações confidenciais e/ou privilegiadas. Se você não for a pessoa autorizada a obtê-la, não pode usar, copiar ou divulgar as informações nela contidas ou tomar qualquer ação baseada nelas.



## 8. Anexos

### 8.1. Conceitos e definições

Para disponibilizar conhecimento sobre as expressões técnicas utilizadas neste relatório, descreve-se a seguir os principais conceitos:

**Meta:** é a rentabilidade mínima que um RPPS precisa auferir anualmente para que não haja perdas causadas pelo descasamento entre a taxa de juros + inflação e a rentabilidade alcançada.

**Rentabilidade anual:** retorno sobre um investimento durante um período de um ano completo, expresso como uma porcentagem do valor investido inicialmente.

**Rentabilidade anual acumulada:** retorno sobre um investimento durante um período desde o começo do período selecionado, expresso como uma porcentagem do valor investido inicialmente.

**Rentabilidade mensal:** retorno sobre um investimento de um mês completo, expresso como uma porcentagem do valor investido inicialmente.

**VaR (Value at Risk):** medida que ajuda a entender o máximo de dinheiro que uma carteira de investimentos poderia perder em um determinado período de tempo, com base em certos níveis de confiança.

**Volatilidade:** é uma medida estatística que aponta a frequência e a intensidade das oscilações no preço de um ativo ou derivativo em um período determinado de tempo.





## 8.2. Operações

### Plano de Taxa de Administração

Número da APR	Data da operação	Tipo de operação	Valor	CNPJ do ativo	Nome do ativo	Valor da cota	Quantidade de cotas	% do ativo
-	31/01/2024	Resgate	43.730,76	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.74289352	15943.29480205	4.198.417.498,2
-	31/01/2024	Resgate	3.592,22	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41901600	1484.99224478	908.439.964,5
-	31/01/2024	Resgate	1,50	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41901600	0.62008685	908.439.964,5
-	30/01/2024	Resgate	11.462,42	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41805400	4740.34905755	936.025.591,78
-	29/01/2024	Resgate	35.097,79	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41709500	14520.64978828	1.037.768.012,8
-	29/01/2024	Resgate	50.172,00	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41709500	20757.14856057	1.037.768.012,8
-	26/01/2024	Resgate	1,50	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41613600	0.62082598	1.064.186.708,3
-	24/01/2024	Resgate	216.205,68	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.73752356	78978.56411508	4.233.267.921,3
-	24/01/2024	Resgate	38.283,20	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41421700	15857.39807151	1.073.053.157,3
-	23/01/2024	Resgate	191.829,98	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.73644225	70101.96542609	4.292.422.430,2
-	23/01/2024	Resgate	3.165,13	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41325700	1311.55944021	1.127.112.630,9
-	17/01/2024	Resgate	202.016,64	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.73204560	73943.36317081	4.527.075.231,4
-	16/01/2024	Resgate	19.367,77	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.73096968	7091.90224331	4.313.632.797,7
-	12/01/2024	Resgate	103,90	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.72878784	38.07551414	4.195.246.644,51
-	12/01/2024	Resgate	17.398,89	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.40656000	7229.77611196	1.032.779.170,50
-	12/01/2024	Resgate	3,03	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.40656000	1.25905857	1.032.779.170,50





Número da APR	Data da operação	Tipo de operação	Valor	CNPJ do ativo	Nome do ativo	Valor da cota	Quantidade de cotas	PL do ativo
-	10/01/2024	Resgate	20,73	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.72660021	7.60287479	4.183.424.550,88
-	09/01/2024	Resgate	92,95	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.40369800	38.66958328	1.025.050.059,28
-	04/01/2024	Resgate	2.829,94	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.40083300	1178.73254824	962.981.344,07
-	03/01/2024	Resgate	25.036,10	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.72116060	9200.52274754	3.946.592.299,54
-	02/01/2024	Resgate	0,50	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.39892700	0.20842652	1.000.350.032,00

## Plano Financeiro

Número da APR	Data da operação	Tipo de operação	Valor	CNPJ do ativo	Nome do ativo	Valor da cota	Quantidade de cotas	PL do ativo
-	31/01/2024	Resgate	66.998,56	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41901600	27696.61713689	908.439.964,55
-	31/01/2024	Resgate	3,18	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41901600	1.31458411	908.439.964,55
-	30/01/2024	Resgate	5.846.855,93	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41805400	2418000.56160863	936.025.591,78
-	30/01/2024	Resgate	25,34	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41805400	10.47950128	936.025.591,78
-	29/01/2024	Aplicação	6.729.676,62	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41709500	2784200.29829196	1.037.768.012,87
-	29/01/2024	Resgate	784.607,97	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41709500	324607.83295650	1.037.768.012,87
-	26/01/2024	Resgate	4,50	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41613600	1.86247794	1.064.186.708,38
-	24/01/2024	Resgate	9,00	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41421700	3.72791675	1.073.053.157,30
-	23/01/2024	Resgate	1,59	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41325700	0.65886062	1.127.112.630,93
-	19/01/2024	Resgate	5.045,28	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41134000	2092.31381721	1.207.627.275,03
-	18/01/2024	Aplicação	2.064.738,69	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41038400	856601.55809199	1.032.854.585,69
-	18/01/2024	Resgate	44.145,96	50.803.936/0001-29	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.05291600	41927.33323456	19.021.402.500,77

## Plano Previdenciário

Número da APR	Data da operação	Tipo de operação	Valor	CNPJ do ativo	Nome do ativo	Valor da cota	Quantidade de cotas	PL do ativo
-	31/01/2024	Resgate	4.115,26	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41901600	1701.21239380	908.439.964,55



Número da AFR	Data da operação	Tipo de operação	Valor	CNPJ do ativo	Nome do ativo	Valor de entrada	Quantidade de cotas	PL do ativo
-	30/01/2024	Aplicação	179.911,07	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO'S DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41805400	74403.24740473	936.025.591,78
-	30/01/2024	Resgate	224.432,53	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO'S DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41805400	92815.35069109	936.025.591,78
-	30/01/2024	Resgate	175.806,58	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO'S DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41805400	72705.81219443	936.025.591,78
-	26/01/2024	Resgate	4,50	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO'S DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41613600	1.86247794	1.064.186.708,33
-	24/01/2024	Aplicação	3.753,06	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO'S DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41421700	1554.56613884	1.073.053.157,33
-	22/01/2024	Aplicação	3.000.000,00	05.964.067/0001-60	FINACAP MAURITSSTAD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	13.73863630	218362.28388985	399.104.481,86
-	19/01/2024	Resgate	3.000.000,00	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO'S DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41134000	1244121.52579064	1.207.627.275,00
-	18/01/2024	Aplicação	395.146,62	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO'S DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41038400	163935.13232746	1.032.854.585,66
-	18/01/2024	Aplicação	2.500.000,00	03.399.411/0001-90	BRABESCO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESP LIMITADA	16.65543290	150101.17209262	10.432.240.516,00
-	18/01/2024	Aplicação	5.000.000,00	14.508.605/0001-00	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2.91575000	1714824.65917860	2.374.266.030,40
-	18/01/2024	Resgate	399.251,11	50.803.936/0001-29	FDO DE INV EM COTAS DE FDO'S DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.05291600	0.01452207	19.021.402.500,77
-	18/01/2024	Resgate	399.251,11	50.803.936/0001-29	FDO DE INV EM COTAS DE FDO'S DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.05291600	379186.09841621	19.021.402.500,77
-	18/01/2024	Resgate	7.500.000,00	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO'S DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.41038400	3111537.41478536	1.032.854.585,66
-	17/01/2024	Aplicação	300.000,00	50.803.936/0001-29	FDO DE INV EM COTAS DE FDO'S DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.05259100	285010.98717356	18.728.535.915,55
-	17/01/2024	Resgate	300.000,00	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO'S DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.40942900	124510.82808416	1.045.022.135,77
-	09/01/2024	Aplicação	393,96	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO'S DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.40369800	163.89746133	1.025.050.059,22
-	08/01/2024	Aplicação	2.978,23	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO'S DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.40274500	1239.51147542	1.026.571.805,37
-	04/01/2024	Aplicação	2.365.226,61	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO'S DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.40083300	985169.15170693	962.981.344,07
-	04/01/2024	Resgate	28.428,84	50.803.936/0001-29	FDO DE INV EM COTAS DE FDO'S DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.04968900	27083.10747278	17.396.297.762,22



Número da APR	Data da operação	Tipo de operação	Valor	CNPJ do ativo	Nome do ativo	Valor da cota	Quantidade de cotas	PL do ativo
-	03/01/2024	Resgate	1,59	50.803.936/0001-29	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.04936800	1.51519772	17.542.007.507,5
-	02/01/2024	Aplicação	730.461,52	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.39892700	304495.10135156	1.000.350.032.02
-	02/01/2024	Resgate	18,20	50.803.936/0001-29	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.04904800	17.34906315	18.064.484.617,9
-	02/01/2024	Resgate	4,50	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.39892700	1.87583866	1.000.350.032.02



GRUPO



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE ALBERICO SILVA RODRIGUES  
Acesse em: <https://etc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 8620840-716-4a0e-8248-35c8a10bedd



Instituto de Previdência Social dos Servidores  
do Município do Cabo de Santo Agostinho

**CABOPREV**

Instituto de Previdência Social dos Servidores do Município  
do Cabo de Santo Agostinho

**CONSOLIDADO**

Posição em 29/02/2021

# Sumário



1. Posição de mercado dos ativos (dados qualitativos) .....	1
1.1. Estatísticas .....	4
1.2. Tabela de cotização e taxas .....	5
1.3. Composição por segmento .....	7
1.4. Composição por índice financeiro .....	7
1.5. Prazos de liquidação .....	8
1.6. Composição da carteira por regras .....	9
1.6.1. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano Previdenciário ) .....	9
1.6.2. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano Financeiro ) .....	10
1.6.3. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano de Taxa de Administração ) .....	11
1.7. Volatilidade da carteira .....	12
2. Carteira .....	13
2.1. Posição dos ativos (dados quantitativos) .....	13
2.2. Rendimentos .....	19
2.3. Evolução mensal do patrimônio líquido .....	17
2.4. Rentabilidade x Meta mensal .....	19
2.5. Rentabilidade x Meta anual .....	19
2.6. Risco ponderado .....	11
2.7. Distribuição .....	21
2.7.1. Distribuição por administradores .....	21
2.7.2. Distribuição por gestores .....	21
2.8. Resumo por administrador / gestor .....	16
2.9. Política de investimentos e enquadramentos .....	18
2.9.1. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 - Política de Investimentos 2024 ( Plano Previdenciário ) .....	18
2.9.2. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano Financeiro ) .....	18
2.9.3. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano de Taxa de Administração ) .....	20
2.10. Rating de gestores e administradores .....	11
2.10.1. Administradores .....	11
2.10.2. Gestores .....	32
3. Patrimônio, rentabilidade e metas por ano .....	34
4. Credenciamento de ativos .....	34
5. Credenciamento de pessoas jurídicas .....	35
6. Parecer .....	36

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE ALBERICO SILVA RODRIGUES  
Acesse em: <https://eic.ice.gov.br/pp/validacao/seam/Codigo-do-documento:86426d40-71f6-4a0e-8548-5b5c8a0f6edd>



# Sumário



7. Disclaimer .....	
8. Anexos .....	
8.1. Conceitos e definições .....	
8.2. Operações .....	

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE ALBERICO SILVA RODRIGUES  
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 86420d40-71f6-4a0e-8348-35c8a10bedd



## 1. Posição de mercado dos ativos (dados qualitativos)

Carteira(s)	CNPJ	Nome completo	Artigo	Gestor	Administrador	Classe de risco
<b>FUNDOS DE INVESTIMENTO</b>						
Plano Previdenciário	03.399.411/0001-90	BRANCO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESP LIMITADA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 III a	BANCO BRANCO S.A.	BANCO BRANCO S.A.	Muito baixo
Plano Previdenciário	05.964.067/0001-60	FINACAP MAURITSSTAD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 8 I	FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	BEM - DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS LTDA.	Alto
Plano Previdenciário	07.882.792/0001-14	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 8 I	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Muito alto
Plano Previdenciário	11.182.064/0001-77	CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 8 I	CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	BEM - DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS LTDA.	Alto
Plano de Taxa de Administração	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 III a	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Muito baixo
Plano Previdenciário	14.508.605/0001-00	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF - M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Médio
Plano Financeiro Plano de Taxa de Administração Plano Previdenciário	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	18.598.288/0001-03	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Médio
Plano Previdenciário	22.791.074/0001-26	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Médio
Plano Previdenciário	23.948.236/0001-50	TERRA NOVA IMAB FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 III a	VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	Muito baixo
Plano Previdenciário	26.326.285/0001-49	PREMIUM IMA - B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 III a	VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	Muito baixo
Plano Previdenciário	26.326.293/0001-95	TERRA NOVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 10 I	VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	Muito baixo
Plano Previdenciário	26.326.321/0001-74	TERRA NOVA IMA - B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA II	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 III a	VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	Muito baixo
Plano Previdenciário	26.327.862/0001-17	PREMIUM FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 V b	VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	Muito baixo
Plano Previdenciário	34.525.068/0001-06	SUL AMÉRICA SELECTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 8 I	SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	BEM - DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS LTDA.	Alto



Carteira(s)	CNPJ	Nome completo	Artigo	Gestor	Administrador	Classificação de risco
Plano Previdenciário	63.375.216/0001-51	BNB SELEÇÃO CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - RESP LIMITADA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 8 I	BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	53 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A	Alto
Plano Previdenciário	60.746.948/0001-12	LF BANCO BRADESCO S.A. 05/05/2022 - 05/05/2027 (IPCA+6,62%)	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 IV	BANCO BRADESCO S.A.	BANCO BRADESCO S.A.	Baixo
Plano Previdenciário	30.306.294/0001-45	LF BANCO BTG PACTUAL S A 14/10/2022 - 14/10/2024 (IPCA+7,41%)	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 IV	BANCO BTG PACTUAL S/A	BANCO BTG PACTUAL S/A	Baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 31863885 31/01/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 6,47%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571389 26/08/2022 - 15/08/2040 PCA+ 5,85%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571390 26/08/2022 - 15/08/2030 IPCA+ 5,72%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571392 26/08/2022 - 15/05/2035 IPCA+ 5,86%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571391 26/08/2022 - 15/05/2045 IPCA+ 5,92%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571395 26/08/2022 - 15/08/2060 IPCA+ 5,92%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571394 26/08/2022 - 15/05/2055 IPCA+ 5,92%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501832 03/08/2022 - 15/08/2060 IPCA + 6,28%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501831 03/08/2022 - 15/05/2055 IPCA+ 6,27%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501827 03/08/2022 - 15/08/2050 IPCA+ 6,27%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501828 03/08/2022 - 15/08/2040 IPCA+ 6,23%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571393 26/08/2022 - 15/08/2050 IPCA+ 5,92%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 31554965 23/01/2023 - 15/08/2040 IPCA+ 6,31%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 245018292 03/08/2022 - 15/08/2030 IPCA+ 6,03%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501830 03/08/2022 - 15/05/2035 IPCA+ 6,21%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo



Carteira(s)	CNPJ	Nome completo	Artigo	Gestor	Administrador	Classificação
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501826 03/08/2022 - 15/05/2045 IPCA+ 6,27%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 32388496 13/02/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 6,43%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 33224467 28/02/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 6,38%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 45319679 13/10/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,84%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 43615212 13/09/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,64%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 40068269 12/07/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,56%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 42495937 18/08/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,34%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 41846323 14/08/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,30%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 30065233 19/12/2022 - 15/08/2040 IPCA+ 6,34%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 38432553 13/06/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,62%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 37304255 17/05/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,83%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 36808202 15/05/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,85%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 20/04/2023 - 15/05/2045 - 35829288 IPCA+ 6,1025%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 48979574 14/12/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,69%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 29338981 02/12/2022 - 15/08/2040 IPCA+ 5,91%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 29239159 30/11/2022 - 15/05/2045 - 29239159 IPCA+6,141%	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I a	TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	Muito baixo

#### Ativos ilíquidos

- 23.948.236/0001-50 - TERRA NOVA IMAB FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA
- 26.326.285/0001-49 - PREMIUM IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA
- 26.326.293/0001-95 - TERRA NOVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO
- 26.326.321/0001-74 - TERRA NOVA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA II
- 26.327.862/0001-17 - PREMIUM FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CREDITO PRIVADO





## 1.1. Estatísticas

Carteira(s)	Nome completo	Índice	Retorno médio mensal	Menor retorno	Maior retorno	Qtde. mês positivo	Qtde. mês negativo	Qtde. mês acima do índice	Qtde. mês abaixo do índice
Plano Previdenciário	BRABESCO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESP LIMITADA	CDI	0,91%	0,85%	1,00%	12	0	12	0
Plano Previdenciário	FINACAP MAURITSSTAD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBOVESPA	-0,32%	-5,73%	6,42%	6	6	0	0
Plano Previdenciário	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	IBOVESPA	-0,87%	-3,85%	4,68%	5	7	0	0
Plano Previdenciário	CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO	IBOVESPA	-0,62%	-5,67%	5,30%	5	7	0	0
Plano de Taxa de Administração	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,79%	0,75%	0,87%	12	0	12	0
Plano Previdenciário	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF - M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	IRF-M	0,22%	-1,69%	1,48%	8	4	0	0
Plano Financeiro Plano de Taxa de Administração Plano Previdenciário	FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	CDI	0,78%	0,74%	0,84%	12	0	12	0
Plano Previdenciário	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,67%	-2,04%	1,24%	11	1	0	0
Plano Previdenciário	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	IMA-B	0,67%	-2,06%	1,24%	11	1	0	0
Plano Previdenciário	TERRA NOVA IMAB FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	IMA-B	-6,01%	-58,93%	-0,51%	0	12	0	0
Plano Previdenciário	PREMIUM IMA - B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	IMA-B	-4,80%	-52,44%	-0,07%	0	12	0	0
Plano Previdenciário	TERRA NOVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO	CDI	-32,66%	-399,39%	1,42%	10	2	10	0
Plano Previdenciário	TERRA NOVA IMA - B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA II	IMA-B	-5,49%	-53,24%	-0,51%	0	12	0	0
Plano Previdenciário	PREMIUM FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	CDI	-9,10%	-123,01%	1,92%	10	2	10	0
Plano Previdenciário	SUL AMÉRICA SELECTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	IBOVESPA	-1,35%	-7,51%	5,67%	6	6	0	0
Plano Previdenciário	BNB SELEÇÃO CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - RESP LIMITADA	IBOVESPA	-0,41%	-3,47%	7,49%	5	7	0	0

\* As estatísticas são baseadas na rentabilidade dos ativos no período de 01/03/2023 a 29/02/2024. As rentabilidades apresentadas referem-se exclusivamente aos ativos pertencentes às classes de **Fundos de Investimentos** e **Fundos de Classes de Investimentos**. Dados de outras classes de investimento não estão incluídos pois são de difícil obtenção de dados, pois muitos desses ativos são comercializados diretamente entre terceiros e suas informações não estão disponíveis na CVM.



## 1.2. Tabela de cotação e taxas

Fundo	Aplicação		Ressgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
03.399.411/0001-90 - BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	0,20%
05.964.067/0001-60 - FINACAP MAURITSSTAD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	0,00%
07.882.792/0001-14 - BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	0,00%
11.182.064/0001-77 - CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	2,00%
13.077.415/0001-05 - BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	1,00%
14.508.605/0001-00 - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	0,20%
14.508.643/0001-55 - FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	0,80%
18.598.288/0001-03 - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D+0		D+0	D+0	0,00%	0,00%
22.791.074/0001-26 - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D+0		D+0	D+0	0,00%	0,00%
23.948.236/0001-50 - TERRA NOVA IMAB FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	0,90%
26.326.285/0001-49 - PREMIUM IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	59.538,78%
26.326.293/0001-95 - TERRA NOVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	0,00%
26.326.321/0001-74 - TERRA NOVA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA II	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	97.427,10%
26.327.862/0001-17 - PREMIUM FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	1,00%
34.525.068/0001-06 - SUL AMÉRICA SELECTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	0,00%
63.375.216/0001-51 - BNB SELEÇÃO CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	2,00%

## Ativos ilíquidos

CNPJ	Nome completo
23.948.236/0001-50	TERRA NOVA IMAB FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA
26.326.285/0001-49	PREMIUM IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA
26.326.293/0001-95	TERRA NOVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO
26.326.321/0001-74	TERRA NOVA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA II



CNPJ	Nome completo
26.327.862/0001-17	PREMIUM FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CREDITO PRIVADO



### 1.3. Composição por segmento

Segmento	Saldo	%	VaR 12 meses
Renda Fixa	420.384.348,48	84,36%	0,1336%
Renda Variável	77.346.491,14	15,52%	0,7772%
Investimentos no Exterior	0,00	0,00%	0,0000%
Investimentos Estruturados	211.762,30	0,04%	0,0201%
Fundos Imobiliários	0,00	0,00%	0,0000%
Empréstimos Consignados	0,00	0,00%	0,0000%
Disponibilidade financeira	351.780,69	0,07%	0,0000%
Total geral	498.294.382,61	100,00%	0,1330%

### 1.4. Composição por índice financeiro

Índice	Valor do saldo	%
CDI	20.222.106,14	4,06%
IBOVESPA	77.346.491,14	15,52%
IMA-B	18.084.905,18	3,63%
IRF-M	12.776.170,83	2,56%
IPCA + Taxa	369.512.928,63	74,16%
SCC	351.780,69	0,07%
Total geral	498.294.382,61	100,00%





## 1.5. Prazos de liquidação

Prazo	Renda Fixa	Renda Variável	Investimentos no Exterior	Investimentos Estruturados	Fundos Imobiliários	Empréstimos Consignados	Disponibilidade financeira	Total
Curto prazo	123.380.697,34	77.346.491,14	0	211.762,30	0	0	351.780,69	201.290.731,47
Médio prazo	3.515.776,87	0	0	0	0	0	0	3.515.776,87
Longo prazo	293.487.874,27	0	0	0	0	0	0	293.487.874,27
Total geral	420.384.348,48	77.346.491,14	0,00	211.762,30	0,00	0,00	351.780,69	498.294.382,61

\* Curto prazo: até 60 dias; Médio prazo: entre 60 e 365 dias; Longo prazo: acima de 365 dias;



## 1.6. Composição da carteira por regras

### 1.6.1. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano Previdenciário )

Artigo da resolução	Valor do saldo		Var. L. (meses)
Artigo 7, Inciso I, Alínea a	293.487.874,27	59,63%	0,0000
Artigo 7, Inciso I, Alínea b	16.801.906,28	3,41%	0,0183
Artigo 7, Inciso III, Alínea a	26.816.648,97	5,45%	0,0067
Artigo 7, Inciso IV	76.025.054,36	15,45%	0,0000
Artigo 7, Inciso V, Alínea b	1.140.737,51	0,23%	0,1100
Artigo 8, Inciso I	77.346.491,14	15,72%	0,7868
Artigo 10, Inciso I	211.762,30	0,04%	0,0204
Artigo 26	351.780,69	0,07%	0,0000
Total geral	492.182.255,52	100,00%	0,1178



## 1.6.2. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano Financeiro )

Artigo da resolução	Valor do saldo	%	Var 12 meses
Artigo 7, Inciso I, Alínea b	1.967.860,04	100,00%	0,0199%
Artigo 26	0,00	0,00%	0,0000%
Total geral	1.967.860,04	100,00%	0,0100%



### 1.6.3. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano de Taxa de Administração )

Artigo da resolução	Valor do saldo	%	Var 12 meses
Artigo 7, Inciso I, Alínea b	243.301,33	5,87%	0,0012
Artigo 7, Inciso III, Alínea a	3.900.965,72	94,13%	0,0235
Total geral	4.144.267,05	100,00%	0,0123





## 1.7. Volatilidade da carteira

Volatilidade	Valor do saldo	%
Muito baixo	328.319.228,20	65,89%
Baixo	76.025.054,36	15,26%
Médio	16.603.608,91	3,33%
Alto	68.209.721,17	13,69%
Muito alto	9.136.769,97	1,83%
Total geral	498.294.382,61	100,00%

Tipos de risco: 1 - Muito baixo 2 - Baixo 3 - Médio 4 - Alto 5 - Muito alto



## 2. Carteira

### 2.1. Posição dos ativos (dados quantitativos)

Carteira(s)	CNPJ	Ativo	Valor do saldo	% PL RPPS	% PL Ativo	Rentabilidade mensal	Rentabilidade anual	VaR 12 meses	Volatilidade 12 meses
Fundos de Investimento									
Plano Previdenciário	03.399.411/0001-90	BRABESCO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESP LIMITADA	12.559.181,87	2,52%	0,12%	0,90%	1,99%	0,03%	0,07%
Plano Previdenciário	05.964.067/0001-60	FINACAP MAURITSSTAD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	27.150.975,43	5,45%	6,28%	2,79%	-2,75%	2,90%	6,10%
Plano Previdenciário	07.882.792/0001-14	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	9.136.769,97	1,83%	0,66%	0,53%	-5,96%	2,60%	5,47%
Plano Previdenciário	11.182.064/0001-77	CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO	24.140.589,45	4,84%	1,60%	0,80%	-2,66%	6,73%	14,18%
Plano de Taxa de Administração	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	3.900.965,72	0,78%	0,09%	0,73%	1,61%	0,02%	0,05%
Plano Previdenciário	14.508.605/0001-00	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF - M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	12.776.170,83	2,56%	0,53%	0,43%	1,11%	0,31%	0,65%
Plano Financeiro Plano de Taxa de Administração Plano Previdenciário	14.508.643/0001-55	FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	2.409.458,74	0,48%	0,23%	0,73%	1,61%	0,02%	0,04%
Plano Previdenciário	18.598.288/0001-03	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	3.328.815,56	0,67%	0,67%	-2,07%	-0,98%	1,32%	2,78%
Plano Previdenciário	22.791.074/0001-26	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	498.622,52	0,10%	0,21%	-2,08%	-1,00%	1,33%	2,79%
Plano Previdenciário	23.948.236/0001-50	TERRA NOVA IMAB FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	5.550.581,54	1,11%	40,69%	-0,51%	-0,54%	0,18%	0,38%
Plano Previdenciário	26.326.285/0001-49	PREMIUM IMA - B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	3.817.213,31	0,77%	25,99%	-0,25%	0,06%	0,21%	0,44%
Plano Previdenciário	26.326.293/0001-95	TERRA NOVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO	211.762,30	0,04%	61,52%	-5,28%	-9,38%	47,41%	99,85%
Plano Previdenciário	26.326.321/0001-74	TERRA NOVA IMA - B FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA II	4.889.672,25	0,98%	23,56%	-0,51%	-0,45%	0,22%	0,46%
Plano Previdenciário	26.327.862/0001-17	PREMIUM FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	1.140.737,51	0,23%	13,02%	-0,42%	-0,80%	47,48%	99,98%
Plano Previdenciário	34.525.068/0001-06	SUL AMÉRICA SELECTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	10.431.756,87	2,09%	10,32%	2,80%	-5,87%	10,27%	21,62%



Carteira(s)	CNPJ	Ativo	Valor do saldo	% PL RPPS	% PL Ativo	Rentabilidade mensal	Rentabilidade anual	VaR 12 meses	Volatilidade 12 meses
Plano Previdenciário	63.375.216/0001-51	BNB SELEÇÃO CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - RESP LIMITADA	6.486.399,42	1,30%	10,67%	-0,12%	-4,49%	2,34%	4,93%
<b>Títulos governamentais</b>									
Plano Previdenciário	60.746.948/0001-12	LF BANCO BRADESCO S.A. 05/05/2022 - 05/05/2027 (IPCA+6,62%)	72.509.277,49	14,55%	100,00%	0,92%	2,03%	-	-
Plano Previdenciário	30.306.294/0001-45	LF BANCO BTG PACTUAL S A 14/10/2022 - 14/10/2024 (IPCA+7,41%)	3.515.776,87	0,71%	100,00%	1,23%	2,20%	-	-
<b>Outros investimentos</b>									
Plano Financeiro	00.360.305/0001-04	CEF - Agência: 0559 Conta: 5 - 0	0,00	-	-	-	-	-	-
Plano Previdenciário	00.360.305/0001-04	Caixa Econômica Federal - Agência: 0559 / Conta:006.00071017 - 1	55.841,76	-	-	-	-	-	-
Plano Previdenciário	00.360.305/0001-04	Caixa Econômica Federal - Agência: 0559 / Conta:006.00071046 - 5	20.383,62	-	-	-	-	-	-
Plano Previdenciário	02.332.886/0001-04	Banco Xp S/A - Agência: 0008 / Conta:9846 - 0	91.863,14	-	-	-	-	-	-
Plano Previdenciário	00.360.305/0001-04	Caixa Econômica Federal - Agência: 0559 / Conta:71064 - 3	183.692,17	-	-	-	-	-	-
<b>Carteira direta de título público</b>									
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 31863885 31/01/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 6,47%	25.425.163,32	5,10%	100,00%	1,06%	2,16%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571389 26/08/2022 - 15/08/2040 PCA+ 5,85%	8.341.671,29	1,67%	100,00%	1,00%	2,05%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571390 26/08/2022 - 15/08/2030 IPCA+ 5,72%	762.388,29	0,15%	100,00%	0,99%	2,03%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571392 26/08/2022 - 15/05/2035 IPCA+ 5,86%	5.862.483,23	1,18%	100,00%	1,02%	2,07%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571391 26/08/2022 - 15/05/2045 IPCA+ 5,92%	7.152.601,23	1,44%	100,00%	1,02%	2,08%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571395 26/08/2022 - 15/08/2060 IPCA+ 5,92%	5.823.137,49	1,17%	100,00%	1,00%	2,06%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571394 26/08/2022 - 15/05/2055 IPCA+ 5,92%	3.737.872,40	0,75%	100,00%	1,02%	2,08%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501832 03/08/2022 - 15/08/2060 IPCA+ 6,28%	3.941.272,56	0,79%	100,00%	1,03%	2,12%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501831 03/08/2022 - 15/05/2055 IPCA+ 6,27%	3.417.719,34	0,69%	100,00%	1,05%	2,13%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501827 03/08/2022 - 15/08/2050 IPCA+ 6,27%	4.980.596,98	1,00%	100,00%	1,03%	2,11%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501828 03/08/2022 - 15/08/2040 IPCA+ 6,23%	7.685.784,57	1,54%	100,00%	1,02%	2,11%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 25571393 26/08/2022 - 15/08/2050 IPCA+ 5,92%	5.511.918,32	1,11%	100,00%	1,00%	2,06%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 31554965 23/01/2023 - 15/08/2040 IPCA+ 6,31%	22.056.824,67	4,43%	100,00%	1,03%	2,12%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 245018292 03/08/2022 - 15/08/2030 IPCA+ 6,03%	652.850,18	0,13%	100,00%	1,01%	2,08%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501830 03/08/2022 - 15/05/2035 IPCA+ 6,21%	5.556.134,47	1,12%	100,00%	1,04%	2,12%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 24501826 03/08/2022 - 15/05/2045 IPCA+ 6,27%	6.820.711,49	1,37%	100,00%	1,05%	2,13%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 32388496 13/02/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 6,43%	5.588.428,34	1,12%	100,00%	1,06%	2,16%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 33224467 28/02/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 6,38%	8.178.112,33	1,64%	100,00%	1,05%	2,15%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 45319679 13/10/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,84%	5.037.771,22	1,01%	100,00%	1,01%	2,06%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 43615212 13/09/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,64%	4.898.931,73	0,98%	100,00%	1,00%	2,03%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 40068269 12/07/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,56%	4.855.117,15	0,97%	100,00%	0,99%	2,02%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 42495937 18/08/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,34%	3.514.011,87	0,71%	100,00%	0,98%	1,99%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 41846323 14/08/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,30%	4.720.525,70	0,95%	100,00%	0,98%	1,98%	-	-





Carteira(s)	CNPJ	Ativo	Valor do saldo	% PL RPPS	% PL Ativo	Rentabilidade mensal	Rentabilidade anual	VaR 12 meses	Volatilidade 12 meses
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 30065233 19/12/2022 - 15/08/2040 IPCA+ 6,34%	7.411.551,96	1,49%	100,00%	1,03%	2,13%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 38432553 13/06/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,62%	4.562.843,66	0,92%	100,00%	1,00%	2,03%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 37304255 17/05/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,83%	3.904.648,17	0,78%	100,00%	1,01%	2,06%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 36808202 15/05/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,85%	4.809.247,53	0,97%	100,00%	1,02%	2,07%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 20/04/2023 - 15/05/2045 - 35829288 IPCA+ 6,1025%	4.561.731,53	0,92%	100,00%	1,03%	2,11%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 48979574 14/12/2023 - 15/05/2045 IPCA+ 5,69%	9.449.622,56	1,90%	100,00%	1,00%	2,04%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 29338981 02/12/2022 - 15/08/2040 IPCA+ 5,91%	51.314.708,65	10,30%	100,00%	1,00%	2,06%	-	-
Plano Previdenciário	02.952.035/0001-56	NTN - B 29239159 30/11/2022 - 15/05/2045 - 29239159 IPCA+6,141%	52.951.492,04	10,63%	100,00%	1,04%	2,11%	-	-
Total geral			498.294.382,61	99,93%					



## 2.2. Rendimentos

Data do movimento	Saldo anterior	Aplicação/Entrada	Resgate/Saída	Retorno do mês	Saldo final	Rentabilidade do mês
31/01/2024	485.881.635,79	23.272.286,40	19.240.173,05	195.851,46	488.945.339,84	0,05%
29/02/2024	488.945.339,84	26.466.173,27	22.211.863,34	5.111.808,92	498.294.382,61	1,01%
Total geral		49.738.459,67	41.452.036,39	5.307.660,38		

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE ALBERICO SILVA RODRIGUES  
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 86420d40-71f6-4a0e-8348-35c8a10bedd



### 2.3. Evolução mensal do patrimônio líquido





## 2.4. Rentabilidade x Meta mensal



\*



## 2.5. Rentabilidade x Meta anual







Mês	Rentabilidade mensal	Rentabilidade acumulada anual
Janeiro	0,05%	0,05%
Fevereiro	1,01%	1,06%
+		



## 2.6. Risco ponderado









Data	Índice	Risco
31/01/2024	1.6472	Baixo
29/02/2024	1.6870	Baixo

Tipos de risco: 1 - Muito baixo 2 - Baixo 3 - Médio 4 - Alto 5 - Muito alto





## 2.7. Distribuição

### 2.7.1. Distribuição por administradores

CNPJ	Nome	Saldo na carteira	% da carteira	Total ANBIMA sob administração	Valor do investimento em RPPS do administrador	Percentual proporcional do segmento de RPPS sobre o patrimônio do administrador	Máximo permitido no segmento de RPPS
Fundos de Investimento							
62.318.407/0001-19	 S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	6.486.399,42	1,30%	344.096.272.103,99	5.553.893.444,55	1,61%	50,00%
30.822.936/0001-69	 BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	13.037.735,69	2,62%	1.577.964.290.000,00	91.787.521.000,00	5,82%	50,00%
00.066.670/0001-00	 BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	61.723.321,75	12,39%	397.973.446.480,00	8.021.234.440,00	2,02%	50,00%
42.066.258/0001-30	 RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	15.609.966,91	3,13%	8.479.318.641,25	49.177.899,41	0,58%	50,00%
60.746.948/0001-12	 BANCO BRADESCO S.A.	85.068.459,36	17,07%	639.073.238.247,08	14.199.324.976,86	2,22%	50,00%
Total		181.925.883,13	36,51%				
Disponibilização em carteira							
02.332.886/0001-04	 XP INVESTIMENTOS CCTVM S.A.	91.863,14	0,02%	124.880.485.535,80	3.500.000.000,00	2,80%	50,00%
00.360.305/0001-04	 CAIXA ECONOMICA FEDERAL	19.272.985,20	3,87%	641.462.296.390,00	77.109.825.340,00	12,02%	50,00%











CNPJ	Nome	Saldo na carteira	% da carteira	Total ANBIMA sob administração	Valor do investimento em RPPS do administrador	Percentual proporcional do segmento de RPPS sobre o patrimônio do administrador	Máximo permitido no segmento de RPPS
Total		19.364.848,34	3,89%				
Título privado							
30.306.294/0001-45	 BANCO BTG PACTUAL S/A	3.515.776,87	0,71%	613.633.008.044,64	4.888.302.074,69	0,80%	50,00%
Total		3.515.776,87	0,71%				
Compra direta de título público							
02.952.035/0001-56	 TESOURO NACIONAL	293.487.874,27	58,90%	-	-	-	-
Total		293.487.874,27	58,90%				
Total geral		498.294.382,61	100,00%				









## 2.7.2. Distribuição por gestores

CNPJ	Nome	Saldo na carteira	% da carteira	Total ANBIMA sob gestão	Saldo na carteira sobre o total sob gestão (%)	Máximo permitido na carteira
Fundos de Investimento						
30.822.936/0001-69	 BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	13.037.735,69	2,62%	1.584.509.140.842,70	0,00%	5,00%
60.746.948/0001-12	 BANCO BRADESCO S.A.	85.068.459,36	17,07%	639.073.238.247,08	0,01%	5,00%
07.237.373/0001-20	 BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	6.486.399,42	1,30%	13.320.106.609,20	0,05%	5,00%
12.678.380/0001-05	 VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	15.609.966,91	3,13%	2.432.877.175,01	0,64%	5,00%
10.626.543/0001-72	 CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	24.140.589,45	4,84%	2.414.093.592,37	1,00%	5,00%
21.813.291/0001-07	 SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	10.431.756,87	2,09%	50.844.826.294,34	0,02%	5,00%
42.040.639/0001-40	 CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	19.013.067,65	3,82%	515.803.404.496,30	0,00%	5,00%
01.294.929/0001-33	 FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	27.150.975,43	5,45%	1.091.661.633,68	2,49%	5,00%
Total		200.938.950,78	40,33%			















Disponível em: [https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam](#)



CNPJ	Nome	Saldo na carteira	% da carteira	Total ANBIMA sob gestão	Saldo na carteira sobre o total sob gestão (%)	Máximo permitido na carteira
02.332.886/0001-04	 XP INVESTIMENTOS CCTVM S.A.	91.863,14	0,02%	172.603.176.493,74	0,00%	5,00%
00.360.305/0001-04	 CAIXA ECONOMICA FEDERAL	259.917,55	0,05%	512.219.921.710,69	0,00%	5,00%
Total		351.780,69	0,07%			
Título privado						
30.306.294/0001-45	 BANCO BTG PACTUAL S/A	3.515.776,87	0,71%	386.675.766.220,22	0,00%	5,00%
Total		3.515.776,87	0,71%			
Compra direta de título público						
02.952.035/0001-56	 TESOURO NACIONAL	293.487.874,27	58,90%	—	—	—
Total		293.487.874,27	58,90%			
Total geral		498.294.382,61	100,00%			










## 2.8. Resumo por administrador / gestor

Administrador	Gestores	Valor	% Certa
 62.318.407/0001-19 - S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A.	 07.237.373/0001-20 - BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	6.486.399,42	1,30%
 30.822.936/0001-69 - BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	 30.822.936/0001-69 - BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	13.037.735,69	2,62%
 00.066.670/0001-00 - BEM - DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS LTDA.	 10.626.543/0001-72 - CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	24.140.589,45	4,84%
	 21.813.291/0001-07 - SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.	10.431.756,87	2,09%
	 01.294.929/0001-33 - FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	27.150.975,43	5,45%
 42.066.258/0001-30 - RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	 12.678.380/0001-05 - VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	15.609.966,91	3,13%
 60.746.948/0001-12 - BANCO BRADESCO S.A.	 60.746.948/0001-12 - BANCO BRADESCO S.A.	85.068.459,36	17,07%
 02.332.886/0001-04 - XP INVESTIMENTOS CCTVM S.A.	 02.332.886/0001-04 - XP INVESTIMENTOS CCTVM S.A.	91.863,14	0,02%



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE ALBERICO SILVA RODRIGUES  
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 86420d40-71f6-4a0e-8348-35c8a10bedd

Administrador	Gestores	Valor	% Carteira
 00.360.305/0001-04 - CAIXA ECONOMICA FEDERAL	 00.360.305/0001-04 - CAIXA ECONOMICA FEDERAL	259.917,55	0,05%
	 42.040.639/0001-40 - CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	19.013.067,65	3,82%
 30.306.294/0001-45 - BANCO BTG PACTUAL S/A	 30.306.294/0001-45 - BANCO BTG PACTUAL S/A	3.515.776,87	0,71%
 02.952.035/0001-56 - TESOURO NACIONAL	 02.952.035/0001-56 - TESOURO NACIONAL	293.487.874,27	58,90%
Total		498.294.382,61	100,00%





## 2.9. Política de investimentos e enquadramentos

### 2.9.1. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 - Política de Investimentos 2024 ( Plano Previdenciário )

Descrição	Artigo	Aplicado \$	Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021	Política de Investimentos 2024			Resultado				
			Limite	Limite inferior	Estratégia alvo	Limite superior	Posição atual da carteira	Diferença do limite superior	Situação	Disponível para aplicar	
Renda Fixa											
FI 100% títulos TN- vigência de 01/11/2010 até 01/04/2018	Artigo 7, Inciso I, Alínea a	293.487.874,27	100,00%	20,00%	60,00%	80,00%	59,63%	20,37%	Enquadrado	100.257.930,15	
Fundo/Classe de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC	Artigo 7, Inciso I, Alínea b	16.801.906,28	100,00%	1,00%	2,00%	30,00%	3,41%	26,59%	Enquadrado	130.852.770,38	
Fundo/Classe de Investimento em Renda Fixa - Geral	Artigo 7, Inciso III, Alínea a	26.816.648,97	60,00%	1,00%	2,00%	20,00%	5,45%	14,55%	Enquadrado	71.619.802,13	
Ativos de Renda Fixa Emitidos por Instituições Financeiras	Artigo 7, Inciso IV	76.025.054,36	20,00%	10,00%	16,00%	20,00%	15,45%	4,55%	Enquadrado	22.411.396,74	
Fundo/Classe de Investimento em Renda Fixa - Crédito Privado	Artigo 7, Inciso V, Alínea b	1.140.737,51	5,00%	1,00%	1,00%	4,00%	0,23%	3,77%	Desenquadrado	18.546.552,71	
Total em renda fixa		414.272.221,39					84,17%				
Renda Variável											
Fundo/Classe de Investimento em Ações	Artigo 8, Inciso I	77.346.491,14	30,00%	8,00%	15,00%	30,00%	15,72%	14,28%	Enquadrado	70.308.185,52	
Total em renda variável		77.346.491,14					15,72%				
Investimentos Estruturados											
Fundo/Classe de Investimento Multimercado FIM	Artigo 10, Inciso I	211.762,30	10,00%	0,00%	1,00%	5,00%	0,04%	4,96%	Enquadrado	24.397.350,48	
Total em investimentos estruturados		211.762,30					0,04%				
Disponibilidade financeira											
Do Segmento de Disponibilidade Financeira	Artigo 26	351.780,69	0,00%				0,07%	-	Enquadrado	-	
Total em disponibilidade financeira		351.780,69					0,07%				
Total		492.182.255,52					100,00%				



## 2.9.2. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano Financeiro )

Descrição	Artigo	Aplicado \$	Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021		Resultado		
			Limite	Posição atual da carteira	Diferença do limite superior	Situação	Disponível para aplicação
Renda Fixa							
Fundo/Classe de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC	Artigo 7, Inciso I, Alínea b	1.967.860,04	100,00%	100,00%	-	Enquadrado	-
Total em renda fixa		1.967.860,04		100,00%			
Disponibilidade financeira							
Do Segmento de Disponibilidade Financeira	Artigo 26	0,00	0,00%	0,00%	-	Enquadrado	0,00
Total em disponibilidade financeira		0,00		0,00%			
Total		1.967.860,04		100,00%			












### 2.9.3. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 ( Plano de Taxa de Administração )

Descrição	Artigo	Resolução CMN N° 4.963, de 25 de novembro de 2021				Resultado		
		Aplicado \$	Limite	Posição atual da carteira	Diferença do limite superior	Situação	Disponível para aplicação	
Renda Fixa								
Fundo/Classe de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC	Artigo 7, Inciso I, Alínea b	243.301,33	100,00%	5,87%	94,13%	Enquadrado	-	
Fundo/Classe de Investimento em Renda Fixa - Geral	Artigo 7, Inciso III, Alínea a	3.900.965,72	60,00%	94,13%	-34,13%	Desenquadrado	-1.414.405,49	
Total em renda fixa		4.144.267,05		100,00%				
Total		4.144.267,05		100,00%				



## 2.10. Rating de gestores e administradores

### 2.10.1. Administradores

CNPJ	Nome	Descrição	Nota	Descrição	Data de aprovação	Data de vencimento	Valor em reais
62.318.407/0001-19	 S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A						8.402.502,1
30.822.936/0001-69	 BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	Fitch	Exc.	Excelente	14/11/2024	14/11/2025	6.334.639,3
00.066.670/0001-00	 BEM - DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS LTDA.	Fitch	Exc.	Excelente	31/10/2023	31/10/2025	8.454.938,8
42.066.258/0001-30	 RJI GESTÃO E INVESTIMENTOS RJJ CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	SR	AA-	Bom	29/07/2024	29/07/2025	70.075.141,9
60.746.948/0001-12	 BANCO BRADESCO S.A.	Standard	AMP-1	Muito Forte	08/05/2024	08/05/2025	5.776.910,2
02.332.886/0001-04	 XP INVESTIMENTOS CCTVM S.A.	Moodys	MQ1	Excelente	07/03/2024	07/03/2025	145.777.685,0
00.360.305/0001-04	 CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Fitch	Exc.	Excelente	08/08/2024	08/08/2025	2.332,6
30.306.294/0001-45	 BANCO BTG PACTUAL S/A	Moodys	AAA	Excelente	26/07/2024	26/07/2025	17.064.847,9
02.952.035/0001-56	 TESOURO NACIONAL	TPF - Menor risco mercado	BR	Excelente	01/04/2024	01/04/2025	0,0
							309.882.467,89





## 2.10.2. Gestores

CNPJ	Logo	Nome	Descrição	Nota	Descrição	Data de expiração	Data de vencimento	Valor do saldo
30.822.936/0001-69		BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	Fitch	Exc.	Excelente	14/11/2024	14/11/2025	8.402.502,1
60.746.948/0001-12		BANCO BRADESCO S.A.	Standard	AMP-1	Muito Forte	08/05/2024	08/05/2025	8.454.938,8
02.332.886/0001-04		XP INVESTIMENTOS CCTVM S.A.	Moodys	MQ1	Excelente	07/03/2024	07/03/2025	2.332,6
00.360.305/0001-04		CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Fitch	Exc.	Excelente	08/08/2024	08/08/2025	86.832,1
30.306.294/0001-45		BANCO BTG PACTUAL S/A	Moodys	AAA	Excelente	26/07/2024	26/07/2025	0,0
07.237.373/0001-20		BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	Fitch	For	Forte	20/03/2024	20/03/2025	6.334.639,3
12.678.380/0001-05		VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	Austin	QG 2+	Muito bom mas podendo ir para escala de bom	12/09/2024	31/07/2025	5.776.910,2
10.626.543/0001-72		CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	Austin	QG 2-	Muito bom mas podendo ir para escala de bom	06/09/2024	31/08/2025	22.486.020,4
16.500.294/0001-50		MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA	Moodys	MQ1	Excelente	14/02/2024	14/02/2025	13.702.346,4
42.040.639/0001-40		CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	Fitch	Exc.	Excelente	08/08/2024	08/08/2025	16.978.015,81
02.328.724/0001-94		MOS GESTÃO DE INVESTIMENTOS LTDA	Moodys	MQ3	Bom	21/12/2023	20/12/2025	8.155.028,44
01.294.929/0001-33		FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	SR	G2Sr	Segurança muito boa	13/12/2024	13/12/2025	25.731.746,54



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE ALBERICO SILVA RODRIGUES  
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 86420d40-71f6-4a0e-8348-35c8a10bedd

CNPJ	Nome	Descrição	Nota	Descrição	Data de aprovação	Data de vencimento	Valor do saldo
02.952.035/0001-56	 TESOURO NACIONAL	TPF - Menor risco mercado	BR	Excelente	01/04/2024	01/04/2025	309.882.467,8



### 3. Patrimônio, rentabilidade e metas por ano

### 4. Credenciamento de ativos

Nome completo	Descrição	Data de solicitação	Data de aprovação	Data de vencimento
LF BANCO BRADESCO S.A. 05/05/2022-05/05/2027 (IPCA+6,62%)	Credenciamento definitivo até o vencimento	18/08/2023	18/08/2023	17/08/2025
BNB SOBERANO CLASSE DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	Atualização do credenciamento	16/01/2023	16/01/2023	15/01/2025
FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	Atualização do credenciamento	02/10/2023	02/10/2023	01/10/2025
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RENDA FIXA CREDITO PRIVADO LONGO PRAZO	Atualização do credenciamento	01/10/2022	01/10/2022	30/09/2024
SOMMA TORINO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO	Atualização do credenciamento	16/01/2023	16/01/2023	15/01/2025
BTG PACTUAL FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES OPORTUNIDADES LISTADAS I	Atualização do credenciamento	04/12/2023	04/12/2023	03/12/2025