

RELATÓRIO DE ANÁLISE E COMPLIANCE DOS INVESTIMENTOS

Competência: 12/2023

Fortaleza/CE

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Francisco Robson da Silva Fontoura

Diretor Presidente (Certificado ANBIMA CPA-20 e Habilitado PREVIC)

E-mail: robson.fontoura@ceprevcom.com.br

Wandermon Corrêa Silva

Diretor de Investimentos (Certificado ANBIMA CPA-20 e Habilitado PREVIC)

Coordenador do Comitê de Investimentos

E-mail: wandermon.correa@ceprevcom.com.br

Liano Levy Almir Gonçalves Vieira

Diretor de Administração e Tecnologia da Informação (Certificado ANBIMA CPA-20 e Habilitado PREVIC)

Mandato: 4 anos

Tatiana de Souza Ferreira

Assessora de Controle Interno e Ouvidoria (Certificado ANBIMA CPA-20)

E-mail: tatiana.ferreira@ceprevcom.com.br

Átila Einstein de Oliveira

Participante do PREV-CE, designado pela Diretoria Executiva (Certificado ANBIMA CPA-20; Certificado APIMEC CGRPPS)

E-mail: atila.einstein@pefoce.ce.gov.br

ADMINISTRADOR ESTATUTÁRIO TECNICAMENTE QUALIFICADO (AETQ) E ADMINISTRADOR RESPONSÁVEL PELA GESTÃO DE RISCOS (ARGR)

Wandermon Corrêa Silva

Diretor de Investimentos (Certificado ANBIMA CPA-20 e Habilitado PREVIC)

E-mail: wandermon.correa@ceprevcom.com.br

SUMÁRIO

| | |
|--|---|
| I. INTRODUÇÃO | 4 |
| II. SEGREGAÇÃO DOS RECURSOS GARANTIDORES | 5 |
| III. FONTES DE DADOS E RESULTADOS ANEXOS | 5 |
| IV. CONSIDERAÇÕES FINAIS | 7 |
| ANEXOS | 9 |

I. INTRODUÇÃO

O presente relatório tem por objetivo apresentar informações acerca dos investimentos dos recursos dos planos administrados pela Fundação de Previdência Complementar do Estado do Ceará (CE-Prevcom), na posição de **12/2023**, a seguir:

- Plano de Previdência Complementar dos Servidores do Estado do Ceará (PREV-CE), CNPB nº 2021.0005-83;
- Plano de Previdência Complementar dos Municípios do Estado do Ceará (PREV-CE MUNICÍPIOS), CNPB nº 2021.0005-83; e
- Plano de Gestão Administrativa (PGA).

O processo decisório na gestão dos investimentos é fundamentado na Política de Investimentos de cada plano, na Política de Alçadas da Entidade, nas diretrizes do Comitê de Investimentos e nas deliberações do Conselho Deliberativo.

Considerando a atual fase de estruturação da Entidade e de implantação de seus planos de benefícios, os investimentos dos recursos estão sendo direcionados integralmente para o segmento de renda fixa, a fim de evitar maior volatilidade associada a outros segmentos, conforme diretriz definida nas Políticas de Investimentos aprovadas pelo Conselho Deliberativo.

A CE-Prevcom, na aplicação dos recursos, observa os princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, adequação à natureza de suas obrigações e transparência, considerando os segmentos, modalidades, limites e demais critérios e requisitos estabelecidos na legislação vigente, pertinentes a cada objetivo, em especial à Resolução CMN nº 4.994, de 24 de março de 2022.

II. SEGREGAÇÃO DOS RECURSOS GARANTIDORES

Os recursos são investidos prioritariamente em fundos de investimento não exclusivos, destinados a investidores institucionais e adequados às Entidades Fechadas de Previdência Complementar, conforme previsto nos respectivos regulamentos dos fundos; estando segregados por conta corrente bancária, por meio das quais ficam vinculadas as aplicações em tais fundos de investimento, sendo possível, dessa forma, identificar e acompanhar individualmente a evolução dos recursos garantidores de cada plano.

III. FONTES DE DADOS E RESULTADOS ANEXOS

Os resultados apresentados neste relatório foram obtidos a partir dos extratos dos fundos de investimento onde estão aplicados os recursos garantidores dos planos administrados pela CE-Prevcom, assim como dos extratos bancários das contas correntes, no caso de eventuais disponibilidades em caixa.

Para consolidação dos ativos dos planos, observada a Resolução CMN nº 4.994/2022, os valores por tipo de ativo e por tipo de aplicação foram apurados pela CE-Prevcom a partir dos dados da Composição e Diversificação das Aplicações (CDA) das carteiras dos fundos de investimento, disponibilizados pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM), considerando a participação dos recursos de cada plano sobre o patrimônio líquido total de cada fundo de investimento, permitindo-se obter, de forma proporcional, os valores correspondentes a cada plano no mês de referência.

Desse modo, a partir dos dados acima referidos, foram elaborados os seguintes anexos, contendo a tabulação dos resultados apurados pela CE-Prevcom:

ANEXO I - RENTABILIDADE E INDICADORES: apresenta a rentabilidade das carteiras de investimentos dos planos administrados pela CE-Prevcom, assim como alguns *benchmarks* para efeito de comparação. Os resultados estão dispostos de forma mensal, ao longo do exercício de referência, e também de forma acumulada no ano, nos últimos doze meses e desde o início de funcionamento de cada plano.

ANEXO II – COMPOSIÇÃO DAS CARTEIRAS: para cada plano administrado pela CE-Prevcom, apresenta a composição das carteiras de investimento, considerando:

Anexo II.a - Carteira por Fundo de Investimento e Conta Corrente: apresenta a composição das carteiras de investimentos dos planos administrados pela CE-Prevcom, identificando os valores aplicados em fundos de investimentos, assim



como os valores eventualmente disponíveis em conta corrente.

Anexo II.b - Carteira por Fundo de Investimento e Detalhamento dos Ativos: apresenta a composição das carteiras de investimentos dos planos administrados pela CE-Prevcom, detalhados de acordo com a composição e diversificação dos fundos de investimento onde estão aplicados.

Anexo II.c - Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN Nº 4.994/2022: apresenta a verificação da aderência dos investimentos dos planos às diretrizes de aplicações estabelecidas pela Política de Investimentos vigente e pela Resolução CMN nº 4.994/2022, notadamente quanto aos limites de alocação por segmento e por modalidade de investimento.

ANEXO III - CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS - TÍTULOS PÚBLICOS: apresenta o detalhamento dos **títulos públicos** que fazem parte das carteiras dos fundos de investimento onde estão aplicados os recursos dos planos administrados pela CE-PREVCOM, proporcionalizados de acordo com a participação dos valores investidos pelos planos no patrimônio líquido total dos fundos de investimento.

ANEXO IV - CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS - DEPÓSITOS A PRAZO E OUTROS TÍTULOS DE IF: apresenta o detalhamento dos **ativos financeiros de renda fixa de emissão com obrigação ou coobrigação de instituições financeiras autorizadas a funcionar pelo Banco Central do Brasil** que fazem parte das carteiras dos fundos de investimento onde estão aplicados os recursos dos planos administrados pela CE-PREVCOM, proporcionalizados de acordo com a participação dos valores investidos pelos planos no patrimônio líquido total dos fundos de investimento.

ANEXO V - CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS - TÍTULOS DO AGRONEGÓCIO E DE CRÉDITO PRIVADO: apresenta o detalhamento dos **ativos financeiros de renda fixa de emissão de sociedade por ações de capital aberto, incluídas as companhias securitizadoras** que fazem parte das carteiras dos fundos de investimento onde estão aplicados os recursos dos planos administrados pela CE-PREVCOM, proporcionalizados de acordo com a participação dos valores investidos pelos planos no patrimônio líquido total dos fundos de investimento.

IV. CONSIDERAÇÕES FINAIS

A CE-Prevcom é entidade fechada de previdência complementar (EFPC) multipatrocinada, destinada a gerir planos de benefícios complementares patrocinados pelos entes públicos do Estado do Ceará, abrangendo além do próprio Estado, os seus municípios, e, ainda, empresas públicas e sociedades de economia mista estaduais e municipais, na forma da lei.

A fase atual da CE-Prevcom é a de gradativa estruturação, em todos os sentidos, que permita a operacionalização tanto da Entidade quanto dos planos geridos, focado no ano de 2023, em especial: (i) o PREV-CE, com ingresso de participantes a contar de 08/2021; e (ii) o PREV-CE MUNICÍPIOS, com ingresso de participantes a contar de 03/2022.

A CE-Prevcom segue enfrentando todos os desafios de sua implantação com profissionalismo e governança necessários ao atingimento do principal objetivo nessa fase: firmar a EFPC diante da operação de planos de benefícios para os entes do Estado do Ceará, como um todo.

O ano de 2023 foi, portanto, o segundo exercício completo de efetiva operação dos planos previdenciários pela CE-Prevcom.

Nesse contexto, no âmbito da gestão dos investimentos, destacam-se os seguintes resultados acumulados em 2023:

- I. **PREV-CE:** obteve rentabilidade de **12,82%**, correspondendo a uma rentabilidade real de 7,84%, acima da inflação de 4,62%, medida pelo IPCA, e perfazendo o referencial de 98,43% do CDI.
- II. **PREV-CE MUNICÍPIOS:** obteve rentabilidade de **13,32%**, no período, correspondendo a uma rentabilidade real de 8,31%, acima da inflação de 4,62%, medida pelo IPCA, no mesmo período, e atingindo o referencial de 102,23% do CDI.
- III. **PGA:** obteve rentabilidade de **11,65%**, atingindo 252,13% do IPCA, o índice de referência perseguido diretamente pelo plano para honrar suas obrigações, conforme Política de Investimentos.

Cumpram-se destacar as rentabilidades dos planos PREV-CE e PREV-CE MUNICÍPIOS naturalmente próximas. As pequenas diferenças de estratégia de alocação dos recursos no ano de 2023, diante do volume específico de recursos de cada plano, mesmo integralmente no segmento de renda fixa, ensejaram essa pequena diferença de rentabilidade na apuração anual.

A carteira do PREV-CE foi naturalmente mais diversificada entre fundos de renda fixa com objetivo diferentes e com parte dos recursos aplicados, ainda, em fundos de investimentos compostos majoritariamente por títulos públicos federais atrelados à inflação (IPCA), em uma perspectiva de médio e longo prazos. Nesse cenário, a carteira fica mais sujeita a oscilações da marcação a mercado no curto prazo, mesmo diante de um foco no médio e longo prazos, objetivo maior.

A carteira do PREV-CE MUNICÍPIOS, por sua vez, esteve integralmente investida

em fundo de investimento com objetivo de acompanhar diretamente o CDI, em uma perspectiva de curto prazo e aproveitando o bom momento do índice CDI.

Quanto às aplicações realizadas pelo PREV-CE, destacam-se aquelas em Fundos de Vértice, fundos compostos exclusivamente por NTN-B específica e com resgate permitido apenas na data de vencimento do fundo. Embora possam apresentar certa volatilidade até o vencimento, garantirão rentabilidades correspondentes ao Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA), acrescido de uma taxa anual de juros acordada no momento da aplicação, como demonstrado abaixo, com taxas reais garantidas acima de 5,0% a.a. no horizonte aplicado:

- 12/2022 - FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF..... IPCA + 6,92% a.a.
- 05/2023 - FI CAIXA BRASIL 2030 X TP RF..... IPCA + 5,55% a.a.
- 06/2023 - FI CAIXA BRASIL 2030 X TP RF..... IPCA + 5,36% a.a.
- 07/2023 - FI CAIXA BRASIL 2030 X TP RF..... IPCA + 5,20% a.a.
- 08/2023 - FI CAIXA BRASIL 2030 X TP RF..... IPCA + 5,04% a.a.
- 09/2023 - FI CAIXA BRASIL 2030 X TP RF..... IPCA + 5,30% a.a.
- 10/2023 - FI CAIXA BRASIL 2030 X TP RF..... IPCA + 5,57% a.a.
- 11/2023 - FI CAIXA BRASIL 2030 X TP RF..... IPCA + 5,71% a.a.
- 12/2023 - FI CAIXA BRASIL 2030 X TP RF..... IPCA + 5,29% a.a.

Por fim, destaca-se que os ativos dos planos administrados pela CE-Prevcom foram consolidados para fins de verificação dos limites estabelecidos nas respectivas Políticas de Investimentos e na Resolução CMN nº 4.994/2022, apurando-se a conformidade dos investimentos.

Fortaleza/CE, janeiro de 2024.

Wandermon Corrêa

Diretor de Investimentos / AETQ / ARGR
Coordenador do Comitê de Investimentos
ANBIMA CPA-20

Cientes:

Tatiana Ferreira

Assessora de Controle Interno e Ouvidoria
Membro do Comitê de Investimentos
ANBIMA CPA-20

Átila Einstein

Participante do PREV-CE
Membro do Comitê de Investimentos
ANBIMA CPA-20; APIMEC CGRPPS

Liano Levy

Diretor de Administração e TI
Membro do Comitê de Investimentos
ANBIMA CPA-20

Robson Fontoura

Diretor Presidente
Membro do Comitê de Investimentos
ANBIMA CPA-20

ANEXOS

ANEXO I - RENTABILIDADE E INDICADORES

ANEXO II – COMPOSIÇÃO DAS CARTEIRAS

ANEXO III – CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS - TÍTULOS PÚBLICOS

ANEXO IV – CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS - DEPÓSITOS A PRAZO E OUTROS TÍTULOS DE IF

ANEXO V – CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS - TÍTULOS DO AGRONEGÓCIO E DE CRÉDITO PRIVADO

ANEXO I – RENTABILIDADE E INDICADORES

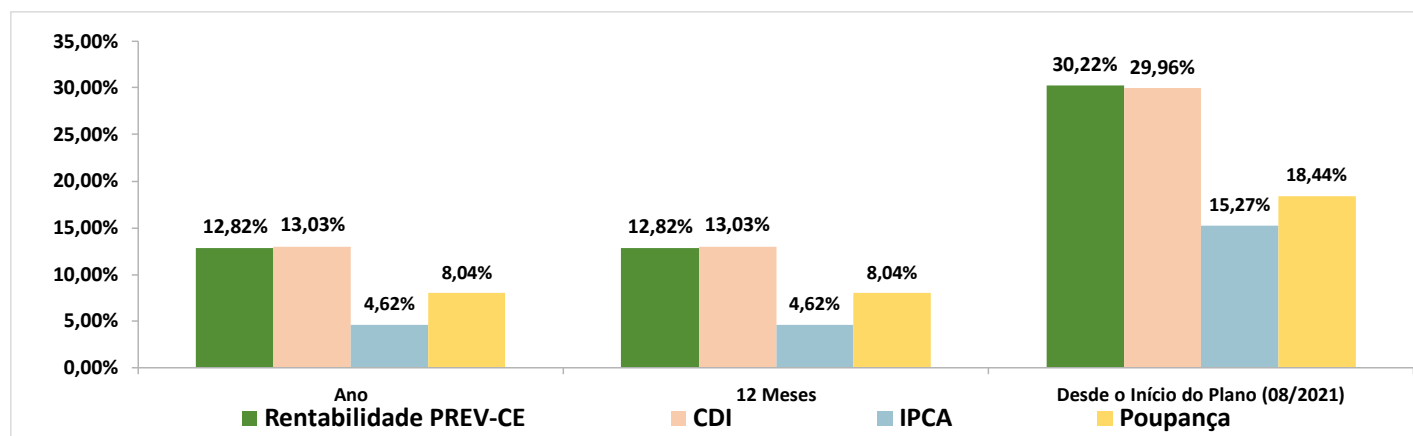
Plano de Previdência Complementar dos Servidores do Estado do Ceará (PREV-CE) Rentabilidade da Carteira de Investimentos - Fase Inicial de Operação Exercício de 2023

| Descrição | Mensal | | | | | | | | | | | | Acumulado | | |
|-----------------------|--------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|----------|-----------------------------------|
| | JAN | FEV | MAR | ABR | MAI | JUN | JUL | AGO | SET | OUT | NOV | DEZ | Ano | 12 Meses | Desde o Início do Plano (08/2021) |
| Rentabilidade PREV-CE | 1,13% | 0,85% | 1,16% | 0,89% | 1,12% | 1,26% | 1,09% | 0,91% | 0,56% | 0,59% | 1,32% | 1,25% | 12,82% | 12,82% | 30,22% |
| CDI | 1,12% | 0,92% | 1,17% | 0,92% | 1,12% | 1,07% | 1,07% | 1,14% | 0,97% | 1,00% | 0,92% | 0,89% | 13,03% | 13,03% | 29,96% |
| IPCA | 0,53% | 0,84% | 0,71% | 0,61% | 0,23% | -0,08% | 0,12% | 0,23% | 0,26% | 0,24% | 0,28% | 0,56% | 4,62% | 4,62% | 15,27% |
| Poupança | 0,71% | 0,58% | 0,74% | 0,58% | 0,72% | 0,68% | 0,66% | 0,72% | 0,61% | 0,61% | 0,58% | 0,57% | 8,04% | 8,04% | 18,44% |

Fontes: CE-Prevcom (Rentabilidade PREV-CE); BACEN (CDI); IBGE (IPCA).

Nota: Elaboração CE-Prevcom.

RENTABILIDADE E INDICADORES ACUMULADOS



ANEXO I – RENTABILIDADE E INDICADORES

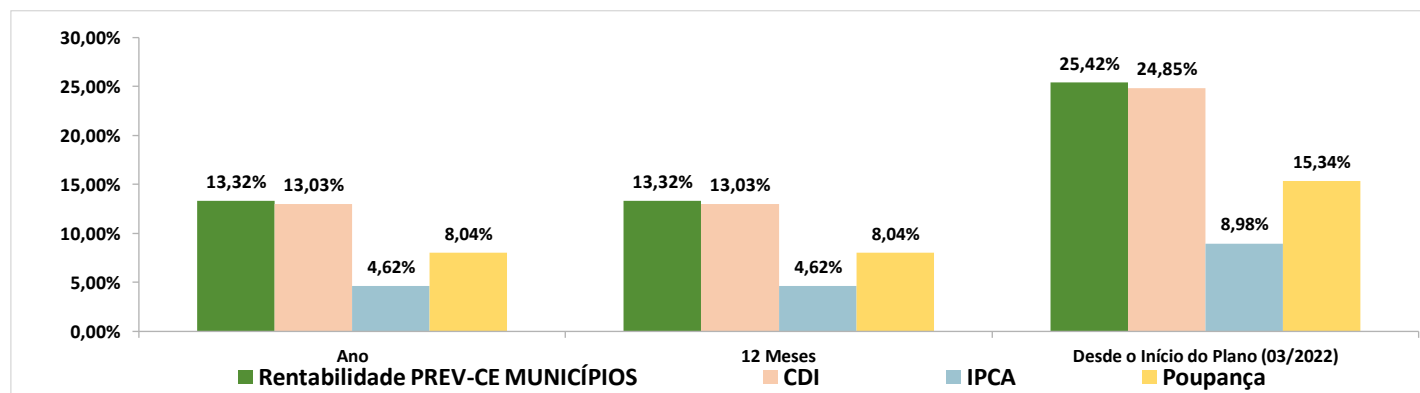
Plano de Previdência Complementar dos Municípios do Estado do Ceará (PREV-CE MUNICÍPIOS) Rentabilidade da Carteira de Investimentos - Fase Inicial de Operação Exercício de 2023

| Descrição | Mensal | | | | | | | | | | | | Acumulado | | |
|---|--------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|----------|-----------------------------------|
| | JAN | FEV | MAR | ABR | MAI | JUN | JUL | AGO | SET | OUT | NOV | DEZ | Ano | 12 Meses | Desde o Início do Plano (03/2022) |
| Rentabilidade PREV-CE MUNICÍPIOS | 1,09% | 0,80% | 1,14% | 0,92% | 1,18% | 1,12% | 1,14% | 1,24% | 1,03% | 1,02% | 0,97% | 0,92% | 13,32% | 13,32% | 25,42% |
| CDI | 1,12% | 0,92% | 1,17% | 0,92% | 1,12% | 1,07% | 1,07% | 1,14% | 0,97% | 1,00% | 0,92% | 0,89% | 13,03% | 13,03% | 24,85% |
| IPCA | 0,53% | 0,84% | 0,71% | 0,61% | 0,23% | -0,08% | 0,12% | 0,23% | 0,26% | 0,24% | 0,28% | 0,56% | 4,62% | 4,62% | 8,98% |
| Poupança | 0,71% | 0,58% | 0,74% | 0,58% | 0,72% | 0,68% | 0,66% | 0,72% | 0,61% | 0,61% | 0,58% | 0,57% | 8,04% | 8,04% | 15,34% |

Fontes: CE-Prevcom (Rentabilidade PREV-CE MUNICÍPIOS); BACEN (CDI e POUPANÇA); IBGE (IPCA).

Notas: (1) Elaboração CE-Prevcom.

RENTABILIDADE E INDICADORES ACUMULADOS

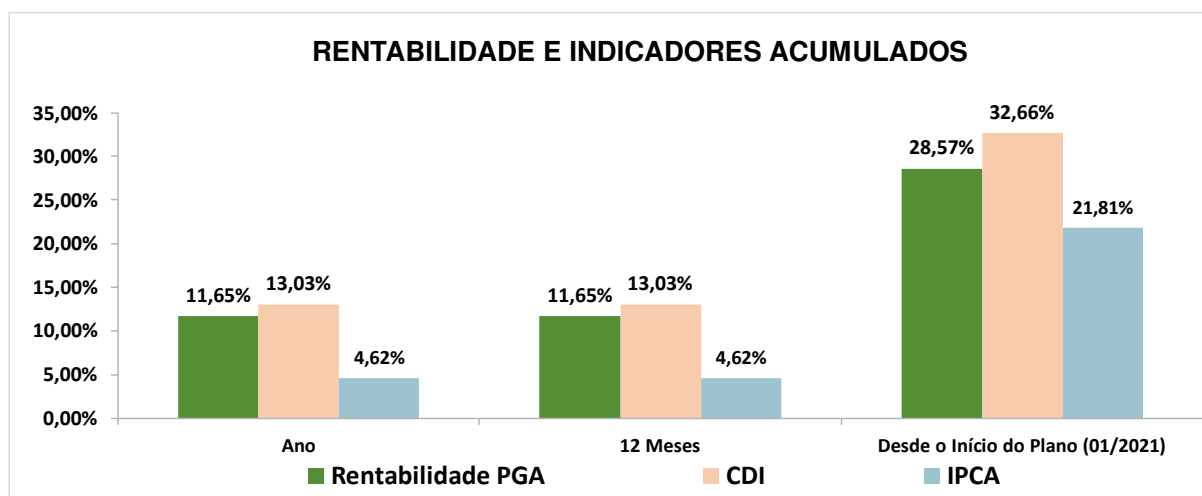


Plano de Gestão Administrativa (PGA)
Rentabilidade da Carteira de Investimentos
Exercício de 2023

| Descrição | Mensal | | | | | | | | | | | | Acumulada | | |
|--------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|---------------|-----------------------------------|
| | JAN | FEV | MAR | ABR | MAI | JUN | JUL | AGO | SET | OUT | NOV | DEZ | Ano | 12 Meses | Desde o Início do Plano (01/2021) |
| Rentabilidade PGA | 1,37% | 1,27% | 1,27% | 0,64% | 0,31% | 1,06% | 1,01% | 0,78% | 0,71% | 0,21% | 1,24% | 1,21% | 11,65% | 11,65% | 28,57% |
| CDI | 1,12% | 0,92% | 1,17% | 0,92% | 1,12% | 1,07% | 1,07% | 1,14% | 0,97% | 1,00% | 0,92% | 0,89% | 13,03% | 13,03% | 32,66% |
| IPCA | 0,53% | 0,84% | 0,71% | 0,61% | 0,23% | -0,08% | 0,12% | 0,23% | 0,26% | 0,24% | 0,28% | 0,56% | 4,62% | 4,62% | 21,81% |

Fontes: CE-Prevcom (Rentabilidade PGA); BACEN (CDI); IBGE (IPCA).

Nota: Elaboração CE-Prevcom.



ANEXO II – COMPOSIÇÃO DAS CARTEIRAS

Investimentos do PREV-CE

Anexo II.a - Carteira por Fundo de Investimento e Conta Corrente

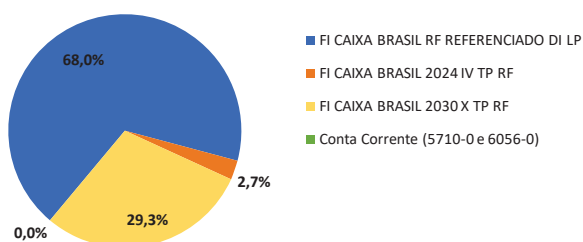
12/2023

| Instituição | Segmento | Fundo de Investimento / Conta Corrente | Valor (R\$) | Participação |
|--------------|-----------------|--|----------------------|----------------|
| CEF | Renda Fixa | FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP | 14.479.585,48 | 67,99% |
| CEF | Renda Fixa | FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF | 573.588,07 | 2,69% |
| CEF | Renda Fixa | FI CAIXA BRASIL 2030 X TP RF | 6.242.676,54 | 29,31% |
| CEF | Disponibilidade | Conta Corrente (5710-0 e 6056-0) | 0,00 | 0,00% |
| TOTAL | | | 21.295.850,09 | 100,00% |

Fonte: Extratos emitidos pela Caixa Econômica Federal.

Notas: (1) Elaboração CE-Prevcom;

(2) Os valores em disponibilidade se referem a ingresso de recursos ocorridos no último dia do mês, antes da correspondente aplicação.



ANEXO II – COMPOSIÇÃO DAS CARTEIRAS

Investimentos do PREV-CE

Anexo II.b - Carteira por Fundo de Investimento e Detalhamento dos Ativos
12/2023

| FUNDO DE INVESTIMENTO | | |
|--|--|----------------------|
| TIPO DE ATIVO | | Valor (R\$) |
| TIPO DE APLICAÇÃO | | |
| FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP | | 14.479.585,48 |
| Título público federal | | 8.319.812,30 |
| Operações Compromissadas | | 4.023.384,44 |
| Títulos Públicos | | 4.296.427,86 |
| Letra Financeira | | 3.976.980,97 |
| Depósitos a prazo e outros títulos de IF | | 3.976.980,97 |
| DPGE | | 54.200,90 |
| Depósitos a prazo e outros títulos de IF | | 54.200,90 |
| Debênture simples | | 1.389.400,76 |
| Debêntures | | 1.389.400,76 |
| CDB/ RDB | | 739.790,63 |
| Depósitos a prazo e outros títulos de IF | | 739.790,63 |
| Outros | | -600,07 |
| Disponibilidades | | 10,71 |
| Valores a pagar | | -611,34 |
| Valores a receber | | 0,56 |
| FI CAIXA BRASIL 2030 X TP RF | | 6.242.676,54 |
| Título público federal | | 6.242.051,30 |
| Operações Compromissadas | | 44.325,59 |
| Títulos Públicos | | 6.197.725,70 |
| Outros | | 625,24 |
| Disponibilidades | | 1.451,40 |
| Valores a pagar | | -854,99 |
| Valores a receber | | 28,84 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF | | 573.588,07 |
| Título público federal | | 573.612,59 |
| Operações Compromissadas | | 1.298,10 |
| Títulos Públicos | | 572.314,49 |
| Outros | | -24,52 |
| Disponibilidades | | 1,56 |
| Valores a pagar | | -26,16 |
| Valores a receber | | 0,08 |

Fonte: CVM (arquivos de dados da Composição e Diversificação das Aplicações - CDA)

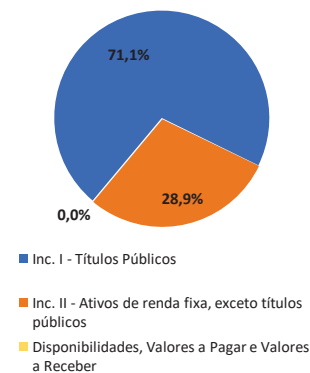
Nota: Elaboração CE-Prevcom.

ANEXO II – COMPOSIÇÃO DAS CARTEIRAS

Investimentos do PREV-CE

Anexo II.c - Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN N° 4.994/2022 12/2023

| SEGMENTO | Valor (R\$) | % Observado |
|---|----------------------|----------------|
| Art. 21 - Renda Fixa | 21.295.850,09 | 100,00% |
| I.a - Títulos da dívida pública mobiliária federal interna | 15.135.476,19 | 71,07% |
| Título público federal | 15.135.476,19 | 71,07% |
| II.a - Ativos financeiros de RF de instituições financeiras autorizadas pelo Bacen | 4.770.972,49 | 22,40% |
| CDB/ RDB | 739.790,63 | 3,47% |
| DPGE | 54.200,90 | 0,25% |
| Letra Financeira | 3.976.980,97 | 18,67% |
| II.b - Ativos financeiros de RF de socied. por ações de capital aberto e cias securitizadoras | 1.389.400,76 | 6,52% |
| Debênture simples | 1.389.400,76 | 6,52% |
| Disponibilidades, Valores a Pagar e Valores a Receber | 0,65 | 0,00% |
| Outros | 0,65 | 0,00% |
| Conta Corrente | 0,00 | 0,00% |
| TOTAL DA CARTEIRA | 21.295.850,09 | 100,00% |



| RES. CMN N° 4.994/2022 | Valor (R\$) | % Observado | Limite Legal | Limite do Plano | Status |
|---|----------------------|----------------|----------------|-----------------|-----------|
| Art.21 - Renda Fixa | 21.295.850,09 | 100,00% | 100,00% | 100,00% | OK |
| Inc. I - Títulos Públicos | 15.135.476,19 | 71,07% | 100,00% | 100,00% | OK |
| Inc. II - Ativos de renda fixa, exceto títulos públicos | 6.160.373,25 | 28,93% | 80,00% | 60,00% | OK |
| Disponibilidades, Valores a Pagar e Valores a Receber | 0,65 | 0,00% | - | - | - |

Fonte: Comissão de Valores Mobiliários - CVM (arquivos de dados da Composição e Diversificação das Aplicações - CDA)

Nota: Elaboração CE-Prevcom.

ANEXO II – COMPOSIÇÃO DAS CARTEIRAS

Investimentos do PREV-CE MUNICÍPIOS Anexo II.a - Carteira por Fundo de Investimento e Conta Corrente 12/2023

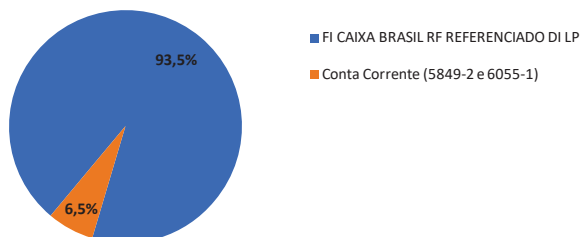
| Instituição | Segmento | Fundo de Investimento / Conta Corrente | Valor (R\$) | Participação |
|--------------|-----------------|--|-------------------|----------------|
| CEF | Renda Fixa | FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP | 750.590,95 | 93,51% |
| CEF | Disponibilidade | Conta Corrente (5849-2 e 6055-1) | 52.118,96 | 6,49% |
| TOTAL | | | 802.709,91 | 100,00% |

Fonte: Extratos emitidos pela Caixa Econômica Federal.

Notas: (1) Elaboração CE-Prevcom;

(2) O recurso em disponibilidade na conta nº 6055-1, na data de 31/12/2023, foi decorrente da circunstância excepcional diante: (i) de recolhimentos pelo Patrocinador efetivados ao longo do dia 28/12/2023; (ii) do tempo hábil e prazos para movimentação e aplicações por parte da Entidade e agente bancário; e (iii) da situação excepcional da não aplicação e movimentação de recursos por parte dos agentes no dia 29/12/2023, por não haver, nesse dia, expediente bancário ao público e sessão de negociação na bolsa, conforme divulgado pela FEBRABAN e pela B3. O recurso em disponibilidade se refere ainda a recolhimentos com vencimento até 15/01/2024, feitos antecipadamente pelo Patrocinador.

O recurso foi aplicado imediatamente no primeiro dia útil do ano de 2024, antes assim do vencimento do prazo máximo que seria para recolhimento, na forma do regulamento.



ANEXO II – COMPOSIÇÃO DAS CARTEIRAS

Investimentos do PREV-CE MUNICÍPIOS

Anexo II.b - Carteira por Fundo de Investimento e Detalhamento dos Ativos

12/2023

| FUNDO DE INVESTIMENTO | |
|--|-------------------|
| TIPO DE ATIVO | Valor (R\$) |
| TIPO DE APLICAÇÃO | |
| FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP | 750.590,95 |
| Título público federal | 431.281,39 |
| Operações Compromissadas | 208.563,70 |
| Títulos Públicos | 222.717,69 |
| Letra Financeira | 206.158,24 |
| Depósitos a prazo e outros títulos de IF | 206.158,24 |
| DPGE | 2.809,66 |
| Depósitos a prazo e outros títulos de IF | 2.809,66 |
| Debênture simples | 72.023,58 |
| Debêntures | 72.023,58 |
| CDB/ RDB | 38.349,17 |
| Depósitos a prazo e outros títulos de IF | 38.349,17 |
| Outros | -31,11 |
| Disponibilidades | 0,56 |
| Valores a pagar | -31,69 |
| Valores a receber | 0,03 |

Fonte: CVM (arquivos de dados da Composição e Diversificação das Aplicações - CDA)

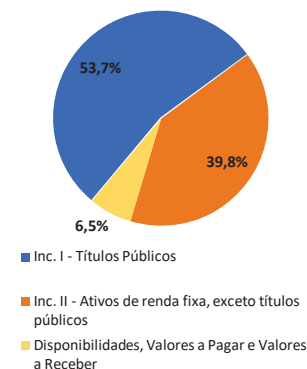
Nota: Elaboração CE-Prevcom.

ANEXO II – COMPOSIÇÃO DAS CARTEIRAS

Investimentos do PREV-CE MUNICÍPIOS

Anexo II.c - Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN N° 4.994/2022
12/2023

| SEGMENTO | Valor (R\$) | % Observado |
|---|-------------------|----------------|
| MODALIDADE | | |
| TIPO DE ATIVO | | |
| Art. 21 - Renda Fixa | 802.709,91 | 100,00% |
| I.a - Títulos da dívida pública mobiliária federal interna | 431.281,39 | 53,73% |
| Título público federal | 431.281,39 | 53,73% |
| II.a - Ativos financeiros de RF de instituições financeiras autorizadas pelo Bacen | 247.317,08 | 30,81% |
| CDB/ RDB | 38.349,17 | 4,78% |
| DPGE | 2.809,66 | 0,35% |
| Letra Financeira | 206.158,24 | 25,68% |
| II.b - Ativos financeiros de RF de socied. por ações de capital aberto e cias securitizadoras | 72.023,58 | 8,97% |
| Debênture simples | 72.023,58 | 8,97% |
| Disponibilidades, Valores a Pagar e Valores a Receber | 52.087,85 | 6,49% |
| Outros | -31,11 | 0,00% |
| Conta Corrente | 52.118,96 | 6,49% |
| TOTAL DA CARTEIRA | 802.709,91 | 100,00% |



| RES. CMN N° 4.994/2022 | Valor (R\$) | % Observado | Limite Legal | Limite do Plano | Status |
|---|-------------------|----------------|----------------|-----------------|-----------|
| Art.21 - Renda Fixa | 802.709,91 | 100,00% | 100,00% | 100,00% | OK |
| Inc. I - Títulos Públicos | 431.281,39 | 53,73% | 100,00% | 100,00% | OK |
| Inc. II - Ativos de renda fixa, exceto títulos públicos | 319.340,66 | 39,78% | 80,00% | 60,00% | OK |
| Disponibilidades, Valores a Pagar e Valores a Receber | 52.087,85 | 6,49% | - | - | - |

Fonte: Comissão de Valores Mobiliários - CVM (arquivos de dados da Composição e Diversificação das Aplicações - CDA)

Nota: Elaboração CE-Prevcom.

ANEXO II – COMPOSIÇÃO DAS CARTEIRAS

Investimentos do PGA

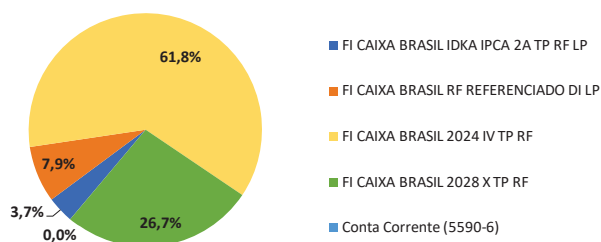
Anexo II.a - Carteira por Fundo de Investimento e Conta Corrente 12/2023

| Instituição | Segmento | Fundo de Investimento / Conta Corrente | Valor (R\$) | Participação |
|--------------|-----------------|--|----------------------|----------------|
| CEF | Renda Fixa | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP | 971.207,48 | 3,70% |
| CEF | Renda Fixa | FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP | 2.061.306,04 | 7,86% |
| CEF | Renda Fixa | FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF | 16.209.502,33 | 61,78% |
| CEF | Renda Fixa | FI CAIXA BRASIL 2028 X TP RF | 6.995.166,56 | 26,66% |
| CEF | Disponibilidade | Conta Corrente (5590-6) | 0,00 | 0,00% |
| TOTAL | | | 26.237.182,41 | 100,00% |

Fonte: Extratos emitidos pela Caixa Econômica Federal.

Notas: (1) Elaboração CE-Prevcom;

(2) Os valores em disponibilidade se referem a ingresso de recursos ocorridos no último dia do mês, antes da correspondente aplicação.



ANEXO II – COMPOSIÇÃO DAS CARTEIRAS

Investimentos do PGA

Anexo II.b - Carteira por Fundo de Investimento e Detalhamento dos Ativos
12/2023

| FUNDO DE INVESTIMENTO | |
|--|----------------------|
| TIPO DE ATIVO | Valor (R\$) |
| TIPO DE APLICAÇÃO | |
| FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP | 2.061.306,04 |
| Título público federal | 1.184.404,03 |
| Operações Compromissadas | 572.766,86 |
| Títulos Públicos | 611.637,17 |
| Letra Financeira | 566.160,88 |
| Depósitos a prazo e outros títulos de IF | 566.160,88 |
| DPGE | 7.716,01 |
| Depósitos a prazo e outros títulos de IF | 7.716,01 |
| Debênture simples | 197.794,35 |
| Debêntures | 197.794,35 |
| CDB/ RDB | 105.316,20 |
| Depósitos a prazo e outros títulos de IF | 105.316,20 |
| Outros | -85,43 |
| Disponibilidades | 1,52 |
| Valores a pagar | -87,03 |
| Valores a receber | 0,08 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP | 971.207,48 |
| Título público federal | 971.250,98 |
| Operações Compromissadas | 72.723,61 |
| Títulos Públicos | 898.527,37 |
| Futuro de DAP:Cupom de DI x IPCA | 0,00 |
| Mercado Futuro - Posições compradas | 0,00 |
| Outros | -43,50 |
| Disponibilidades | 2,07 |
| Valores a pagar | -45,67 |
| Valores a receber | 0,10 |
| FI CAIXA BRASIL 2028 X TP RF | 6.995.166,56 |
| Título público federal | 6.995.063,52 |
| Operações Compromissadas | 53.328,77 |
| Títulos Públicos | 6.941.734,75 |
| Outros | 103,04 |
| Disponibilidades | 524,65 |
| Valores a pagar | -437,82 |
| Valores a receber | 16,21 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF | 16.209.502,33 |
| Título público federal | 16.210.195,24 |
| Operações Compromissadas | 36.684,15 |
| Títulos Públicos | 16.173.511,10 |
| Outros | -692,91 |
| Disponibilidades | 43,99 |
| Valores a pagar | -739,17 |
| Valores a receber | 2,26 |

Fonte: CVM (arquivos de dados da Composição e Diversificação das Aplicações - CDA)

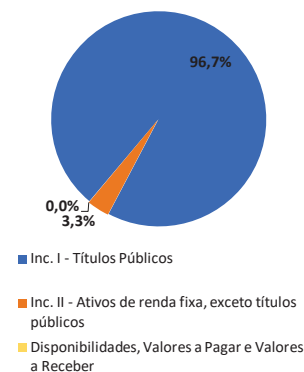
Nota: Elaboração CE-Prevcom.

ANEXO II – COMPOSIÇÃO DAS CARTEIRAS

Investimentos do PGA

Anexo II.c - Compliance dos Investimentos e Enquadramento Legal - Resolução CMN N° 4.994/2022
12/2023

| SEGMENTO | Valor (R\$) | % Observado |
|---|----------------------|----------------|
| MODALIDADE | | |
| TIPO DE ATIVO | | |
| Art. 21 - Renda Fixa | 26.237.182,41 | 100,00% |
| I.a - Títulos da dívida pública mobiliária federal interna | 25.360.913,78 | 96,66% |
| Título público federal | 25.360.913,78 | 96,66% |
| II.a - Ativos financeiros de RF de instituições financeiras autorizadas pelo Bacen | 679.193,09 | 2,59% |
| CDB/ RDB | 105.316,20 | 0,40% |
| DPGE | 7.716,01 | 0,03% |
| Letra Financeira | 566.160,88 | 2,16% |
| II.b - Ativos financeiros de RF de socied. por ações de capital aberto e cias securitizadoras | 197.794,35 | 0,75% |
| Debênture simples | 197.794,35 | 0,75% |
| Disponibilidades, Valores a Pagar e Valores a Receber | -718,81 | 0,00% |
| Outros | -718,81 | 0,00% |
| Conta Corrente | 0,00 | 0,00% |
| Futuro de DAP:Cupom de DI x IPCA | 0,00 | 0,00% |
| TOTAL DA CARTEIRA | 26.237.182,41 | 100,00% |



| RES. CMN N° 4.994/2022 | Valor (R\$) | % Observado | Limite Legal | Limite do Plano | Status |
|---|----------------------|----------------|----------------|-----------------|-----------|
| Art.21 - Renda Fixa | 26.237.182,41 | 100,00% | 100,00% | 100,00% | OK |
| Inc. I - Títulos Públicos | 25.360.913,78 | 96,66% | 100,00% | 100,00% | OK |
| Inc. II - Ativos de renda fixa, exceto títulos públicos | 876.987,44 | 3,34% | 80,00% | 60,00% | OK |
| Disponibilidades, Valores a Pagar e Valores a Receber | -718,81 | 0,00% | - | - | - |

Fonte: Comissão de Valores Mobiliários - CVM (arquivos de dados da Composição e Diversificação das Aplicações - CDA)

Nota: Elaboração CE-Prevcom.

ANEXO III – CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS – TÍTULOS PÚBLICOS

Os ativos abaixo relacionados fazem parte das carteiras dos fundos de investimento onde estão aplicados os recursos dos planos administrados pela CE-PREVCOM. Os valores foram proporcionalizados de acordo com a participação dos recursos investidos pelos planos no patrimônio líquido total dos fundos de investimento.

| CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS – Títulos Públicos | | | | | |
|---|--------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------------|-----------------|
| PLANO | Tipo de Aplicação | Tipo de Ativo | Tipo de Título Público | Data de Vencimento | Valor Investido |
| PGA | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2024 | 160.872,68 |
| PGA | Títulos Públicos | Título público federal | NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE B | 15/08/2024 | 16.173.511,10 |
| PGA | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/09/2024 | 13.617,77 |
| PGA | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2025 | 11.964,21 |
| PGA | Títulos Públicos | Título público federal | NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE B | 15/05/2025 | 332.271,54 |
| PGA | Operações Compromissadas | Título público federal | LETRAS DO TESOURO NACIONAL | 01/07/2025 | 72.723,61 |
| PGA | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/09/2025 | 12.604,57 |
| PGA | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2026 | 50.209,00 |
| PGA | Operações Compromissadas | Título público federal | LETRAS DO TESOURO NACIONAL | 01/07/2026 | 662.779,77 |
| PGA | Títulos Públicos | Título público federal | NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE B | 15/08/2026 | 558.089,05 |
| PGA | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/09/2026 | 79.743,35 |
| PGA | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2027 | 117.285,58 |
| PGA | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/09/2027 | 112.011,00 |
| PGA | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2028 | 5.289,42 |
| PGA | Títulos Públicos | Título público federal | NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE B | 15/08/2028 | 6.941.734,75 |
| PGA | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/09/2028 | 33.915,92 |
| PGA | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2029 | 22.290,47 |
| PREV-CE | Títulos Públicos | Título público | LETRAS FINANCEIRAS | 01/03/2024 | 1.130.045,57 |



| CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS – Títulos Públicos | | | | | |
|---|--------------------------|------------------------|-----------------------------------|--------------------|-----------------|
| PLANO | Tipo de Aplicação | Tipo de Ativo | Tipo de Título Público | Data de Vencimento | Valor Investido |
| | | federal | DO TESOURO | | |
| PREV-CE | Títulos Públicos | Título público federal | NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE B | 15/08/2024 | 572.314,49 |
| PREV-CE | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/09/2024 | 95.657,61 |
| PREV-CE | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2025 | 84.042,23 |
| PREV-CE | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/09/2025 | 86.675,55 |
| PREV-CE | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2026 | 352.691,67 |
| PREV-CE | Operações Compromissadas | Título público federal | LETRAS DO TESOURO NACIONAL | 01/07/2026 | 4.069.008,14 |
| PREV-CE | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/09/2026 | 560.154,87 |
| PREV-CE | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2027 | 823.869,21 |
| PREV-CE | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/09/2027 | 786.818,07 |
| PREV-CE | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2028 | 37.155,35 |
| PREV-CE | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/09/2028 | 238.241,38 |
| PREV-CE | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2029 | 101.076,35 |
| PREV-CE | Títulos Públicos | Título público federal | NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE B | 15/08/2030 | 6.197.725,70 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2024 | 58.579,16 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/09/2024 | 4.958,69 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2025 | 4.356,57 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/09/2025 | 4.493,08 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2026 | 18.282,79 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | Operações Compromissadas | Título público federal | LETRAS DO TESOURO NACIONAL | 01/07/2026 | 208.563,70 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/09/2026 | 29.037,24 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2027 | 42.707,63 |

| CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS – Títulos Públicos | | | | | |
|--|--------------------------|---------------------------|----------------------------------|---------------------------|------------------------|
| PLANO | Tipo de Aplicação | Tipo de Ativo | Tipo de Título Público | Data de Vencimento | Valor Investido |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/09/2027 | 40.786,98 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2028 | 1.926,05 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/09/2028 | 12.349,93 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | Títulos Públicos | Título público federal | LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO | 01/03/2029 | 5.239,58 |

ANEXO IV – CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS - DEPÓSITOS A PRAZO E OUTROS TÍTULOS DE IF

Os ativos abaixo relacionados fazem parte das carteiras dos fundos de investimento onde estão aplicados os recursos dos planos administrados pela CE-PREVCOM. Os valores foram proporcionalizados de acordo com a participação dos recursos investidos pelos planos no patrimônio líquido total dos fundos de investimento.

| CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS - Depósitos a Prazo e Outros Títulos de IF | | | | | |
|---|----------------------------------|------------------------|---------------|------------------|-----------------|
| Plano | Emissor | Agência Classificadora | Grau de Risco | Tipo de Ativo | Valor Investido |
| PGA | BCO BRADESCO S.A. | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 147.509,60 |
| PGA | BANCO ITAU S.A. | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 142.621,41 |
| PGA | BCO SANTANDER (BRASIL) S.A. | S&P | BRAAA | Letra Financeira | 95.469,18 |
| PGA | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | FITCH | AA(BRA | CDB/ RDB | 76.063,97 |
| PGA | BANCO SAFRA S.A. | S&P | BRAAA | Letra Financeira | 33.611,80 |
| PGA | BANCO CITIBANK S.A. | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 30.219,48 |
| PGA | BCO DAYCOVAL S.A. | FITCH | AA(BRA | Letra Financeira | 21.283,96 |
| PGA | BCO ABC BRASIL S.A. | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 18.217,17 |
| PGA | BANCO VOLKSWAGEN S.A. | S&P | BRAAA | Letra Financeira | 12.368,28 |
| PGA | BANCO VOTORANTIM S.A. | MOODY'S | BA2.BR | Letra Financeira | 11.622,78 |
| PGA | BANCO GMAC SA | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 11.279,12 |
| PGA | BANCO COOPERATIVO SICREDI S/A | | | CDB/ RDB | 11.019,95 |
| PGA | BANCO RCI BRASIL SA | | | Letra Financeira | 8.594,56 |
| PGA | BANCO MERCEDES BENZ DO BRASIL SA | FITCH | AAA(BR | CDB/ RDB | 8.556,58 |
| PGA | BCO ALFA DE INVESTIMENTO S.A. | FITCH | AA(BRA | CDB/ RDB | 8.085,21 |
| PGA | BCO BTG PACTUAL S.A. | FITCH | AA(BRA | Letra Financeira | 6.978,51 |
| PGA | BANCO CNH INDUSTRIAL CAPITAL S/A | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 5.581,15 |
| PGA | ITAU UNIBANCO HOLDING S.A. | | | Letra Financeira | 5.400,32 |
| PGA | BANCO TOYOTA DO BRASIL S.A | S&P | BRAAA | Letra Financeira | 5.329,34 |
| PGA | BCO MERCANTIL DO BRASIL S.A. | FITCH | BBB-(B | DPGE | 5.079,30 |

**CE-PREVCOM**FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
COMPLEMENTAR DO ESTADO DO CEARÁ**CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS - Depósitos a Prazo e Outros Títulos de IF**

| Plano | Emissor | Agência Classificadora | Grau de Risco | Tipo de Ativo | Valor Investido |
|---------|----------------------------------|------------------------|---------------|------------------|-----------------|
| PGA | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | FITCH | AA(BRA | Letra Financeira | 4.373,63 |
| PGA | BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. | S&P | BRAAA | Letra Financeira | 3.645,37 |
| PGA | BANCO AGIBANK S.A | | | DPGE | 1.622,52 |
| PGA | BANCO VOLKSWAGEN S.A. | S&P | BRAAA | CDB/ RDB | 1.590,49 |
| PGA | BANCO JOHN DEERE S.A. | | | Letra Financeira | 1.189,83 |
| PGA | BANCO FIBRA S.A. | S&P | BRBBB- | DPGE | 1.014,20 |
| PGA | BANCO BBM S/A | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 865,38 |
| PREV-CE | BCO BRADESCO S.A. | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 1.036.176,96 |
| PREV-CE | BANCO ITAU S.A. | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 1.001.840,04 |
| PREV-CE | BCO SANTANDER (BRASIL) S.A. | S&P | BRAAA | Letra Financeira | 670.620,53 |
| PREV-CE | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | FITCH | AA(BRA | CDB/ RDB | 534.309,19 |
| PREV-CE | BANCO SAFRA S.A. | S&P | BRAAA | Letra Financeira | 236.105,14 |
| PREV-CE | BANCO CITIBANK S.A. | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 212.275,85 |
| PREV-CE | BCO DAYCOVAL S.A. | FITCH | AA(BRA | Letra Financeira | 149.508,60 |
| PREV-CE | BCO ABC BRASIL S.A. | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 127.966,02 |
| PREV-CE | BANCO VOLKSWAGEN S.A. | S&P | BRAAA | Letra Financeira | 86.880,64 |
| PREV-CE | BANCO VOTORANTIM S.A. | MOODY'S | BA2.BR | Letra Financeira | 81.643,91 |
| PREV-CE | BANCO GMAC SA | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 79.229,87 |
| PREV-CE | BANCO COOPERATIVO SICREDI S/A | | | CDB/ RDB | 77.409,34 |
| PREV-CE | BANCO RCI BRASIL SA | | | Letra Financeira | 60.372,24 |
| PREV-CE | BANCO MERCEDES BENZ DO BRASIL SA | FITCH | AAA(BR | CDB/ RDB | 60.105,47 |
| PREV-CE | BCO ALFA DE INVESTIMENTO S.A. | FITCH | AA(BRA | CDB/ RDB | 56.794,30 |
| PREV-CE | BCO BTG PACTUAL S.A. | FITCH | AA(BRA | Letra Financeira | 49.020,37 |
| PREV-CE | BANCO CNH INDUSTRIAL CAPITAL S/A | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 39.204,64 |
| PREV-CE | ITAU UNIBANCO HOLDING S.A. | | | Letra | 37.934,37 |



| CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS - Depósitos a Prazo e Outros Títulos de IF | | | | | |
|---|----------------------------------|------------------------|---------------|------------------|-----------------|
| Plano | Emissor | Agência Classificadora | Grau de Risco | Tipo de Ativo | Valor Investido |
| | | | | Financeira | |
| PREV-CE | BANCO TOYOTA DO BRASIL S.A | S&P | BRAAA | Letra Financeira | 37.435,79 |
| PREV-CE | BCO MERCANTIL DO BRASIL S.A. | FITCH | BBB-(B | DPGE | 35.679,38 |
| PREV-CE | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | FITCH | AA(BRA | Letra Financeira | 30.722,44 |
| PREV-CE | BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. | S&P | BRAAA | Letra Financeira | 25.606,78 |
| PREV-CE | BANCO AGIBANK S.A | | | DPGE | 11.397,33 |
| PREV-CE | BANCO VOLKSWAGEN S.A. | S&P | BRAAA | CDB/ RDB | 11.172,33 |
| PREV-CE | BANCO JOHN DEERE S.A. | | | Letra Financeira | 8.357,94 |
| PREV-CE | BANCO FIBRA S.A. | S&P | BRBBB- | DPGE | 7.124,19 |
| PREV-CE | BANCO BBM S/A | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 6.078,84 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BCO BRADESCO S.A. | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 53.713,21 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BANCO ITAU S.A. | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 51.933,26 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BCO SANTANDER (BRASIL) S.A. | S&P | BRAAA | Letra Financeira | 34.763,54 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | FITCH | AA(BRA | CDB/ RDB | 27.697,45 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BANCO SAFRA S.A. | S&P | BRAAA | Letra Financeira | 12.239,19 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BANCO CITIBANK S.A. | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 11.003,93 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BCO DAYCOVAL S.A. | FITCH | AA(BRA | Letra Financeira | 7.750,21 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BCO ABC BRASIL S.A. | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 6.633,49 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BANCO VOLKSWAGEN S.A. | S&P | BRAAA | Letra Financeira | 4.503,71 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BANCO VOTORANTIM S.A. | MOODY'S | BA2.BR | Letra Financeira | 4.232,25 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BANCO GMAC SA | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 4.107,11 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BANCO COOPERATIVO SICREDI S/A | | | CDB/ RDB | 4.012,74 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BANCO RCI BRASIL SA | | | Letra Financeira | 3.129,57 |
| PREV-CE | BANCO MERCEDES BENZ DO BRASIL SA | FITCH | AAA(BR | CDB/ RDB | 3.115,74 |



| CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS - Depósitos a Prazo e Outros Títulos de IF | | | | | |
|--|----------------------------------|-------------------------------|----------------------|----------------------|------------------------|
| Plano | Emissor | Agência Classificadora | Grau de Risco | Tipo de Ativo | Valor Investido |
| MUNICÍPIOS | | | | | |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BCO ALFA DE INVESTIMENTO S.A. | FITCH | AA(BRA | CDB/ RDB | 2.944,10 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BCO BTG PACTUAL S.A. | FITCH | AA(BRA | Letra Financeira | 2.541,11 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BANCO CNH INDUSTRIAL CAPITAL S/A | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 2.032,29 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | ITAU UNIBANCO HOLDING S.A. | | | Letra Financeira | 1.966,44 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BANCO TOYOTA DO BRASIL S.A | S&P | BRAAA | Letra Financeira | 1.940,59 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BCO MERCANTIL DO BRASIL S.A. | FITCH | BBB-(B | DPGE | 1.849,54 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | FITCH | AA(BRA | Letra Financeira | 1.592,59 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. | S&P | BRAAA | Letra Financeira | 1.327,40 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BANCO AGIBANK S.A | | | DPGE | 590,81 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BANCO VOLKSWAGEN S.A. | S&P | BRAAA | CDB/ RDB | 579,15 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BANCO JOHN DEERE S.A. | | | Letra Financeira | 433,26 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BANCO FIBRA S.A. | S&P | BRBBB- | DPGE | 369,30 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BANCO BBM S/A | FITCH | AAA(BR | Letra Financeira | 315,11 |

ANEXO V – CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS - TÍTULOS DO AGRONEGÓCIO E DE CRÉDITO PRIVADO

Os ativos abaixo relacionados fazem parte das carteiras dos fundos de investimento onde estão aplicados os recursos dos planos administrados pela CE-PREVCOM. Os valores foram proporcionalizados de acordo com a participação dos recursos investidos pelos planos no patrimônio líquido total dos fundos de investimento.

| CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS - Títulos do Agronegócio e de Crédito Privado | | | |
|--|--|-------------------|-----------------|
| Plano | Emissor | Tipo de Ativo | Valor Investido |
| PGA | B3 S.A. - BRASIL, BOLSA, BALCÃO | Debênture simples | 21.715,39 |
| PGA | PETROLEO BRASILEIRO S.A. PETROBRAS | Debênture simples | 20.617,01 |
| PGA | TIM BRASIL SERVICOS E PARTICIPACOES S.A | Debênture simples | 11.361,89 |
| PGA | HAPVIDA PARTICIPAÇÕES E INVESTIMENTOS S.A. | Debênture simples | 9.282,73 |
| PGA | CCR S.A. | Debênture simples | 9.097,43 |
| PGA | COPEL GERACAO E TRANSMISSAO S.A. | Debênture simples | 8.678,10 |
| PGA | COSAN S.A. INDUSTRIA E COMERCIO | Debênture simples | 8.499,59 |
| PGA | VIBRA ENERGIA S.A. | Debênture simples | 8.463,38 |
| PGA | CIELO S.A. | Debênture simples | 8.428,61 |
| PGA | NOVA TRANSPORTADORA DO SUDESTE S.A. ç NT | Debênture simples | 8.246,25 |
| PGA | LOCALIZA RENT A CAR S.A. | Debênture simples | 8.153,47 |
| PGA | CONC SIST ANHANG-BANDEIRANT S.A. AUTOBAN | Debênture simples | 8.121,59 |
| PGA | CIA ENERGETICA DO RIO GDE NORTE - COSERN | Debênture simples | 7.682,85 |
| PGA | SENDAS DISTRIBUIDORA S.A. | Debênture simples | 7.050,91 |
| PGA | CIA SANEAMENTO BASICO EST SAO PAULO | Debênture simples | 5.707,49 |
| PGA | CIA SIDERURGICA NACIONAL | Debênture simples | 4.795,68 |
| PGA | DIAGNOSTICOS DA AMERICA S.A. | Debênture simples | 4.236,79 |
| PGA | CIA PAULISTA DE FORCA E LUZ | Debênture simples | 4.158,64 |
| PGA | TELEFÔNICA BRASIL S.A | Debênture simples | 4.000,69 |
| PGA | LOJAS RENNER S.A. | Debênture simples | 3.604,29 |
| PGA | TUPY S.A. | Debênture simples | 3.559,64 |
| PGA | CIA PARANAENSE DE ENERGIA - COPEL | Debênture simples | 3.417,41 |
| PGA | MOVIDA PARTICIPACOES SA | Debênture simples | 2.495,92 |
| PGA | INTERVIAS | Debênture simples | 2.448,89 |
| PGA | VAMOS LOCAÇÃO DE CAMINHÕES, MÁQUINAS E E | Debênture simples | 2.370,75 |
| PGA | TOTAL FLEET S/A | Debênture simples | 2.258,67 |
| PGA | CIA ENERGETICA DE PERNAMBUCO - CELPE | Debênture simples | 2.193,63 |
| PGA | NATURA COSMETICOS S.A. | Debênture simples | 1.933,22 |
| PGA | ENERGISA S.A. | Debênture simples | 1.434,48 |
| PGA | USINAS SID DE MINAS GERAIS S.A.-USIMINAS | Debênture simples | 1.405,32 |
| PGA | BR MALLS PARTICIPACOES S.A. | Debênture simples | 820,42 |
| PGA | MRS LOGISTICA S.A. | Debênture simples | 779,78 |
| PGA | CENTRAIS ELET DO PARA S.A. - CELPA | Debênture simples | 495,37 |



| CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS - Títulos do Agronegócio e de Crédito Privado | | | |
|---|--|----------------------|------------------------|
| Plano | Emissor | Tipo de Ativo | Valor Investido |
| PGA | CIA SANEAMENTO DE MINAS GERAIS-COPASA MG | Debênture simples | 217,11 |
| PGA | ESTACIO PARTICIPACOES S.A. | Debênture simples | 60,96 |
| PREV-CE | B3 S.A. - BRASIL, BOLSA, BALCÃO | Debênture simples | 152.539,11 |
| PREV-CE | PETROLEO BRASILEIRO S.A. PETROBRAS | Debênture simples | 144.823,57 |
| PREV-CE | TIM BRASIL SERVICOS E PARTICIPACOES S.A | Debênture simples | 79.811,24 |
| PREV-CE | HAPVIDA PARTICIPAÇÕES E INVESTIMENTOS S.A. | Debênture simples | 65.206,31 |
| PREV-CE | CCR S.A. | Debênture simples | 63.904,66 |
| PREV-CE | COPEL GERACAO E TRANSMISSAO S.A. | Debênture simples | 60.959,07 |
| PREV-CE | COSAN S.A. INDUSTRIA E COMERCIO | Debênture simples | 59.705,12 |
| PREV-CE | VIBRA ENERGIA S.A. | Debênture simples | 59.450,76 |
| PREV-CE | CIELO S.A. | Debênture simples | 59.206,54 |
| PREV-CE | NOVA TRANSPORTADORA DO SUDESTE S.A. ç NT | Debênture simples | 57.925,52 |
| PREV-CE | LOCALIZA RENT A CAR S.A. | Debênture simples | 57.273,81 |
| PREV-CE | CONC SIST ANHANG-BANDEIRANT S.A. AUTOBAN | Debênture simples | 57.049,89 |
| PREV-CE | CIA ENERGETICA DO RIO GDE NORTE - COSERN | Debênture simples | 53.967,98 |
| PREV-CE | SENDAS DISTRIBUIDORA S.A. | Debênture simples | 49.528,91 |
| PREV-CE | CIA SANEAMENTO BASICO EST SAO PAULO | Debênture simples | 40.092,09 |
| PREV-CE | CIA SIDERURGICA NACIONAL | Debênture simples | 33.687,15 |
| PREV-CE | DIAGNOSTICOS DA AMERICA S.A. | Debênture simples | 29.761,18 |
| PREV-CE | CIA PAULISTA DE FORCA E LUZ | Debênture simples | 29.212,23 |
| PREV-CE | TELEFÔNICA BRASIL S.A | Debênture simples | 28.102,74 |
| PREV-CE | LOJAS RENNER S.A. | Debênture simples | 25.318,22 |
| PREV-CE | TUPY S.A. | Debênture simples | 25.004,59 |
| PREV-CE | CIA PARANAENSE DE ENERGIA - COPEL | Debênture simples | 24.005,49 |
| PREV-CE | MOVIDA PARTICIPACOES SA | Debênture simples | 17.532,53 |
| PREV-CE | INTERVIAS | Debênture simples | 17.202,15 |
| PREV-CE | VAMOS LOCAÇÃO DE CAMINHÕES, MÁQUINAS E E | Debênture simples | 16.653,24 |
| PREV-CE | TOTAL FLEET S/A | Debênture simples | 15.865,94 |
| PREV-CE | CIA ENERGETICA DE PERNAMBUCO - CELPE | Debênture simples | 15.409,10 |
| PREV-CE | NATURA COSMETICOS S.A. | Debênture simples | 13.579,88 |
| PREV-CE | ENERGISA S.A. | Debênture simples | 10.076,44 |
| PREV-CE | USINAS SID DE MINAS GERAIS S.A.-USIMINAS | Debênture simples | 9.871,61 |
| PREV-CE | BR MALLS PARTICIPACOES S.A. | Debênture simples | 5.763,04 |
| PREV-CE | MRS LOGISTICA S.A. | Debênture simples | 5.477,58 |
| PREV-CE | CENTRAIS ELET DO PARA S.A. - CELPA | Debênture simples | 3.479,74 |
| PREV-CE | CIA SANEAMENTO DE MINAS GERAIS-COPASA MG | Debênture simples | 1.525,08 |
| PREV-CE | ESTACIO PARTICIPACOES S.A. | Debênture simples | 428,22 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | B3 S.A. - BRASIL, BOLSA, BALCÃO | Debênture simples | 7.907,30 |
| PREV-CE | PETROLEO BRASILEIRO S.A. PETROBRAS | Debênture simples | 7.507,35 |



| CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS - Títulos do Agronegócio e de Crédito Privado | | | |
|---|--|----------------------|------------------------|
| Plano | Emissor | Tipo de Ativo | Valor Investido |
| MUNICÍPIOS | | | |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | TIM BRASIL SERVICOS E PARTICIPACOES S.A | Debênture simples | 4.137,25 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | HAPVIDA PARTICIPAÇÕES E INVESTIMENTOS S.A. | Debênture simples | 3.380,16 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | CCR S.A. | Debênture simples | 3.312,68 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | COPEL GERACAO E TRANSMISSAO S.A. | Debênture simples | 3.159,99 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | COSAN S.A. INDUSTRIA E COMERCIO | Debênture simples | 3.094,99 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | VIBRA ENERGIA S.A. | Debênture simples | 3.081,80 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | CIELO S.A. | Debênture simples | 3.069,14 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | NOVA TRANSPORTADORA DO SUDESTE S.A. ç NT | Debênture simples | 3.002,74 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | LOCALIZA RENT A CAR S.A. | Debênture simples | 2.968,95 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | CONC SIST ANHANG-BANDEIRANT S.A. AUTOBAN | Debênture simples | 2.957,35 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | CIA ENERGETICA DO RIO GDE NORTE - COSERN | Debênture simples | 2.797,59 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | SENDAS DISTRIBUIDORA S.A. | Debênture simples | 2.567,47 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | CIA SANEAMENTO BASICO EST SAO PAULO | Debênture simples | 2.078,29 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | CIA SIDERURGICA NACIONAL | Debênture simples | 1.746,27 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | DIAGNOSTICOS DA AMERICA S.A. | Debênture simples | 1.542,76 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | CIA PAULISTA DE FORCA E LUZ | Debênture simples | 1.514,30 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | TELEFÔNICA BRASIL S.A | Debênture simples | 1.456,79 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | LOJAS RENNER S.A. | Debênture simples | 1.312,44 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | TUPY S.A. | Debênture simples | 1.296,18 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | CIA PARANAENSE DE ENERGIA - COPEL | Debênture simples | 1.244,39 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | MOVIDA PARTICIPACOES SA | Debênture simples | 908,85 |



| CONSOLIDAÇÃO DE ATIVOS - Títulos do Agronegócio e de Crédito Privado | | | |
|---|--|----------------------|------------------------|
| Plano | Emissor | Tipo de Ativo | Valor Investido |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | INTERVIAS | Debênture simples | 891,72 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | VAMOS LOCAÇÃO DE CAMINHÕES, MÁQUINAS E E | Debênture simples | 863,27 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | TOTAL FLEET S/A | Debênture simples | 822,46 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | CIA ENERGETICA DE PERNAMBUCO - CELPE | Debênture simples | 798,78 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | NATURA COSMETICOS S.A. | Debênture simples | 703,95 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | ENERGISA S.A. | Debênture simples | 522,34 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | USINAS SID DE MINAS GERAIS S.A.-USIMINAS | Debênture simples | 511,72 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | BR MALLS PARTICIPACOES S.A. | Debênture simples | 298,74 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | MRS LOGISTICA S.A. | Debênture simples | 283,95 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | CENTRAIS ELET DO PARA S.A. - CELPA | Debênture simples | 180,38 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | CIA SANEAMENTO DE MINAS GERAIS-COPASA MG | Debênture simples | 79,06 |
| PREV-CE MUNICÍPIOS | ESTACIO PARTICIPACOES S.A. | Debênture simples | 22,20 |