

RELATÓRIO DE ANÁLISE E COMPLIANCE DOS INVESTIMENTOS

Consolidação de Dados: 01/2025

Competência: 12/2024

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 CEA, 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)

E-mail: liano.levy@ceprevcom.com.br

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 e 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 CEA, ANBIMA CPA-20 e Habilitado PREVIC)

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

SUMÁRIO

SUMÁRIO	3
I. INTRODUÇÃO.....	4
II. SEGREGAÇÃO DOS RECURSOS GARANTIDORES	4
III. FONTES DE DADOS E RESULTADOS ANEXOS.....	5
IV. CONSIDERAÇÕES FINAIS.....	6
ANEXOS	7

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 **12/2024**, com dados consolidados em 01/2025, 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 funcionamento 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 de extratos e de arquivos de dados dos fundos de investimento onde estão aplicados os recursos garantidores dos planos administrados pela CE-Prevcom, assim como de extratos bancários das contas correntes, no caso de eventuais disponibilidades em caixa.

Para a consolidação dos ativos e avaliação da conformidade dos investimentos dos planos com as diretrizes de alocação definidas pela Política de Investimentos em vigor, bem como de acordo com a Resolução CMN Nº 4.994/2022, a CE-Prevcom conta com serviços de consultoria de investimentos prestados pela I9ADVISORY CONSULTORIA FINANCEIRA, empresa autorizada pela Comissão de Valores Mobiliários (“CVM”) a exercer a atividade de consultoria de valores mobiliários.

Desse modo, para cada plano, foram elaborados os seguintes demonstrativos, em anexo:

- I – DEMONSTRATIVO DE 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.
- II – COMPOSIÇÃO DAS CARTEIRAS:** 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.
- III – 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.
- IV – QUADRO DE OPERAÇÕES:** apresenta o detalhamento dos **títulos públicos e privados** 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.
- V – CONSOLIDADO POR CONTRAPARTE:** apresenta o detalhamento da carteira do plano por produto de investimento e por emissor, indicando o rating dos emissores privados.

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, 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.

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 2025.

Wandermon Corrêa

Diretor de Investimentos / AETQ / ARGR
Coordenador do Comitê de Investimentos
ANBIMA CEA; 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; ICSS Administração



ANEXOS

ANEXO I – DEMONSTRATIVOS DO PREV-CE

I – DEMONSTRATIVO DE RENTABILIDADE E INDICADORES

II – COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

III – COMPLIANCE DOS INVESTIMENTOS E ENQUADRAMENTO LEGAL

IV – QUADRO DE OPERAÇÕES

V – CONSOLIDADO POR CONTRAPARTE

DEMONSTRATIVO DE RENTABILIDADE E INDICADORES

Plano de Previdência Complementar dos Servidores do Estado do Ceará (PREV-CE)

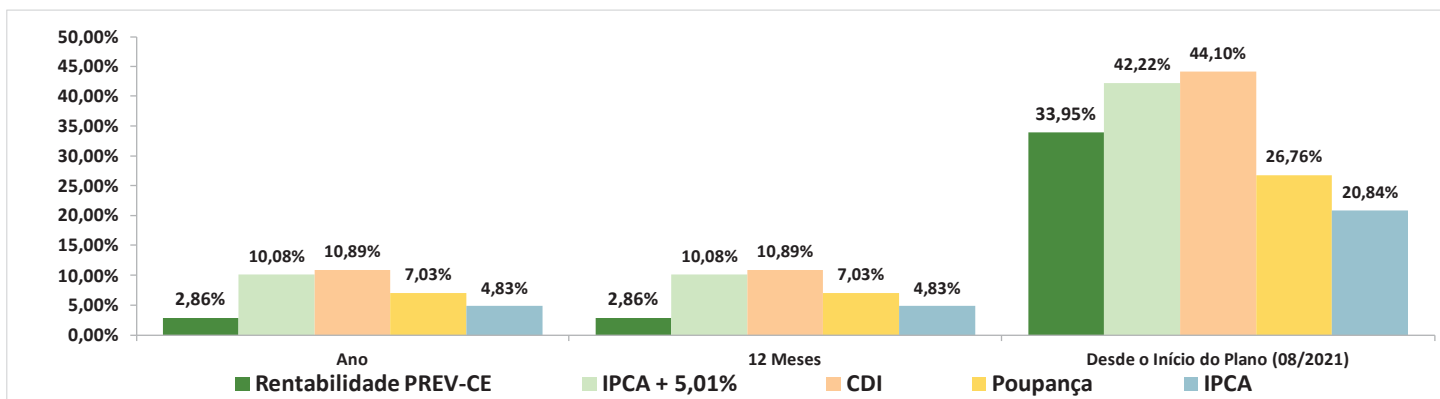
(Variações Mensais sujeitas a oscilações momentâneas de curto prazo)

Descrição	Variações Mensais - 2024 (Resultados de Curto Prazo)												Variações Acumuladas		
	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	0,49%	0,72%	0,39%	-0,47%	1,15%	-0,07%	1,52%	0,74%	-0,09%	-0,13%	0,23%	-1,62%	2,86%	2,86%	33,95%
Índice de Referência (IPCA + 5,01%) ²	0,83%	1,24%	0,57%	0,79%	0,87%	0,62%	0,79%	0,39%	0,85%	0,97%	0,80%	0,93%	10,08%	10,08%	42,22%
IPCA	0,42%	0,83%	0,16%	0,38%	0,46%	0,21%	0,38%	-0,02%	0,44%	0,56%	0,39%	0,52%	4,83%	4,83%	20,84%
Poupança	0,59%	0,51%	0,53%	0,60%	0,59%	0,54%	0,57%	0,57%	0,57%	0,60%	0,57%	0,58%	7,03%	7,03%	26,76%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	0,84%	0,93%	0,79%	0,93%	10,89%	10,89%	44,10%
PREV-CE sobre Índice de Referência ³	59,04%	57,99%	68,56%	-59,51%	132,17%	-11,31%	192,46%	190,66%	-10,59%	-13,40%	28,76%	-174,13%	28,36%	28,36%	80,40%

Fontes: CE-Prevcom (Rentabilidade PREV-CE e Índice de Referência); IBGE (IPCA); Bacen (Poupança e CDI).

Notas: (1) Rentabilidade do plano apurada a valores de mercado, sujeita a oscilações momentâneas de curto prazo. Destaca-se que o plano possui aplicações em fundos compostos por títulos públicos federais que serão mantido até o vencimento, garantido a rentabilidade no longo prazo compatível com o índice de referência adotado (IPCA + 5,01%). (2) Índice de Referência atual definido na Política de Investimentos 2024; (3) Indica o percentual de atingimento da Rentabilidade PREV-CE sobre o Índice de Referência atual.

RENTABILIDADE E INDICADORES ACUMULADOS



COMENTÁRIO: (a) Ao longo do ano de 2024, devido a fatores do cenário macroeconômico externo e interno, os preços dos títulos públicos federais tiveram redução dos seus preços unitários, o que impactou momentaneamente o resultado da rentabilidade mensal dos investimentos do PREV-CE; (b) Por outro lado, os títulos públicos federais passaram a oferecer maiores taxas de juros para remuneração dos ativos; (c) A CE-Prevcom, com foco na rentabilidade dos recursos de seus participantes, acompanhou esse momento de oscilações de curto prazo e aproveitou a oportunidade para realizar mais investimentos em fundos que garantirão rentabilidades reais no médio e longo prazos (IPCA + Taxa de Juros); (d) Em 2024, a CE-Prevcom realizou aplicações com as seguintes rentabilidades garantidas até o ano de 2033: em 01/2024, IPCA + 5,46%a.a.; 02/2024: IPCA + 5,59%a.a.; 03/2024: IPCA + 5,69%a.a.; 04/2024: IPCA + 6,09%a.a.; 05/2024: IPCA + 6,11%a.a.; 06/2024: IPCA + 6,32%a.a.; 07/2024: IPCA + 6,15%a.a.; 08/2024: IPCA + 6,08%a.a.; 09/2024: IPCA + 6,29%a.a. e IPCA + 6,54%a.a.; 11/2024: IPCA + 6,86%a.a. e IPCA + 7,09%a.a.; 12/2024: IPCA + 7,57%a.a.

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

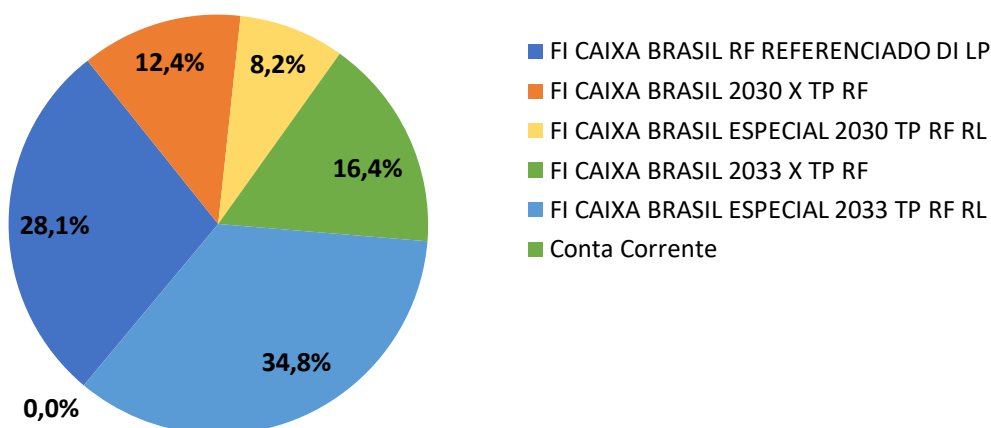
Investimentos do PREV-CE Carteira por Fundo de Investimento e Conta Corrente 12/2024

Instituição	Segmento	Fundo de Investimento / Conta Corrente	Valor (R\$)	Participação
CEF	Renda Fixa	FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP	14.231.354,52	28,15%
CEF	Renda Fixa	FI CAIXA BRASIL 2030 X TP RF	6.282.217,15	12,43%
CEF	Renda Fixa	FI CAIXA BRASIL ESPECIAL 2030 TP RF RL	4.132.049,62	8,17%
CEF	Renda Fixa	FI CAIXA BRASIL 2033 X TP RF	8.305.209,86	16,43%
CEF	Renda Fixa	FI CAIXA BRASIL ESPECIAL 2033 TP RF RL	17.608.808,75	34,83%
CEF	Disponibilidade	Conta Corrente	0,00	0,00%
TOTAL			50.559.639,90	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.



CE-PREVCOM - PREV-CE
31/dez/24

Avaliação a conformidade dos investimentos do plano com as diretrizes de alocação definidas pela Política de Investimentos em vigor, bem como de acordo com a Resolução CMN Nº 4.994.

RESUMO DE ENQUADRAMENTO

CMN Nº 4.994	LIMITES DE ALOCAÇÃO	Alocação Atual (em R\$)	dez/24	Limite Legal	Limite Inferior	Alocação Objetivo	Limite Superior	StatusGeral
Art. 21	Segmento de Renda Fixa	R\$ 50.559.639,90	100,00%	100,00%	70,00%	100,00%	100,00%	✓
Art. 22	Segmento de Renda Variável	R\$ 0,00	0,00%	70,00%	---	0,00%	20,00%	✓
Art. 23	Segmento de Investimentos Estruturados	R\$ 0,00	0,00%	20,00%	---	0,00%	10,00%	✓
Art. 24	Segmento Imobiliário	R\$ 0,00	0,00%	20,00%	---	0,00%	10,00%	✓
Art. 25	Segmento de Operações com Participantes	R\$ 0,00	0,00%	15,00%	---	0,00%	10,00%	✓
Art. 26	Segmento de Investimentos no Exterior	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	---	0,00%	10,00%	✓
Recursos Garantidores		R\$ 50.559.639,90	100,00%					

Art. 27	LIMITES DE ALOCAÇÃO POR EI	Maior observado	Limite Legal	Limite PI	Status
Inciso I	Tesouro Nacional	86,81%	100,00%	100,00%	✓
Inciso II	Instituição Financeira Bancária	3,32%	20,00%	20,00%	✓
Inciso III	Demais Emissores	0,21%	10,00%	10,00%	✓

CRÉDITO	Exposição	Limite PI	Status
Total em Crédito (Grau de Investimento + Grau Especulativo)	13,18%	80%	✓
Grau Especulativo	0,01%	5%	✓

RISCO DE MERCADO	Segmento/Mandato	Modelo	Var / BVaR	% Var / BVaR	Limite PI	Status
CE-PREVCOM - PREV-CE	Consolidado	Não Paramétrico - 21 dia - 95,0% - EWMA (0.95)	VaR	2,22%		✓

Legenda:

- ✓ - Enquadrado
- ! - Apontamento PI
- ✗ - Apontamento Legal

APLICAÇÃO DOS RECURSOS

CMN N° 4.994			LIMITES DE ALOCAÇÃO	Alocação (em R\$)	dez/24	Limite Legal	Alocação Objetivo	Limite Superior	Status
1.1	Art. 21		SEGMENTO DE RENDA FIXA	50.559.639,90	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	✓
1.1.1	Art. 21 Inciso I, alínea a; (§2°)		Títulos da dívida pública mobiliária federal interna e operações compromissadas	43.891.903,67	86,81%	100,00%	---	100,00%	✓
1.1.2	Art. 21 Inciso I, alínea b		Cotas de fundo de índice de renda fixa composto exclusivamente por títulos da dívida pública mobiliária federal interna	0,00	0,00%	100,00%	---	100,00%	✓
1.1.3	§ 1°		Ativos de renda fixa, exceto títulos públicos (conjunto dos ativos listados nos incisos II e III)	6.667.736,23	13,19%	80,00%	---	60,00%	✓
1.1.3.1	Art. 21 Inciso II, alínea a		Ativos financeiros de renda fixa de emissão com obrigação ou coobrigação de instituições financeiras bancárias autorizadas a funcionar pelo Bacen	5.197.841,84	10,28%	80,00%	---	60,00%	✓
1.1.3.1a			CDBs, RDBs, LFs, LHS, LCIs e LCAs	5.159.204,30	10,20%				
1.1.3.1b			DPGEs	29.097,96	0,06%				
1.1.3.1c			Poupança	0,00	0,00%				
1.1.3.1d			Outros	9.539,58	0,02%				
1.1.3.2	Art. 21 Inciso II, alínea b		Ativos financeiros de renda fixa de emissão de sociedade por ações de capital aberto, incluídas as companhias securitizadoras	1.344.755,53	2,66%	80,00%	---	60,00%	✓
1.1.3.2a			Debêntures não incentivadas	1.198.516,89	2,37%				
1.1.3.2b			Notas Promissórias, NCEs e CCEs	101.104,71	0,20%				
1.1.3.2c			Debêntures incentivadas	0,00	0,00%				
1.1.3.2d			Outros	45.133,93	0,09%				
1.1.3.14	Art. 21 Inciso II, alínea c		Cotas de fundo de índice de renda fixa, nos termos da regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários	0,00	0,00%	80,00%	---	60,00%	✓
1.1.3.3	Art. 21 Inciso III, alínea a		Títulos das dívidas públicas mobiliárias estaduais e municipais, desde que emitidos antes da vigência da Lei Complementar nº 148, de 25/11/2014	0,00	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.4	Art. 21 Inciso III, alínea b		Obrigações de organismos multilaterais emitidas no País	0,00	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.5	Art. 21 Inciso III, alínea c		Ativos de instituições financeiras não bancárias e de cooperativas de crédito, autorizadas a funcionar pelo Bacen	121.907,24	0,24%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.5a			LCs, LFs, LHS, LIG, LCIs e LCAs	0,00	0,00%				
1.1.3.5b			DPGEs	0,00	0,00%				
1.1.3.5c			Notas Promissórias	0,00	0,00%				
1.1.3.5d			Debêntures	64.869,38	0,13%				
1.1.3.5e			Outros	57.037,86	0,11%				
1.1.3.6	Art. 21 Inciso III, alínea d		Debêntures emitidas por sociedade por ações de capital fechado nos termos do art. 2° da Lei nº 12.431	0,00	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.7	Art. 21 Inciso III, alínea e		FIDC, FICFIDC e CCB com coobrigação de instituição financeira e CCCB com coobrigação de instituição financeira	0,00	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.7a			FIDCs e FICFDCs	0,00	0,00%				
1.1.3.7b			CCBs e CCCBs	0,00	0,00%				
1.1.3.8	Art. 21 Inciso III, alínea f		CPR, CDCA, CRA e Warrant Agropecuário	0,00	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.12			Caixa, Valores a Pagar/Receber	3.231,61	0,01%	---	---	---	---
1.1.3.13			Operações a termo, opções de renda fixa e swaps	0,00	0,00%				
1.1.3.13a			Termos	0,00	0,00%				
1.1.3.13b			Outros	0,00	0,00%				
1.1.3.15			Outros	0,00	0,00%				
Art. 37, § 2° Inciso I			Ativos transitórios RF	0,00					

APLICAÇÃO DOS RECURSOS

CMN N° 4.994			LIMITES DE ALOCAÇÃO	Alocação (em R\$)	dez/24	Limite Legal	Alocação Objetivo	Limite Superior	Status
1.2	Art. 22	SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL		0,00	0,00%	70,00%	0,00%	20,00%	✓
1.2.1	Art. 22, Inciso I	Ações com nível de governança corporativa		0,00	0,00%	70,00%	---	20,00%	✓
1.2.2	Art. 22, Inciso II	Ações sem nível de governança corporativa		0,00	0,00%	50,00%	---	20,00%	✓
1.2.3	Art. 22, Inciso III	Brazilian Depositary Receipts (BDRs) níveis II e III, BDRs de ETFs		0,00	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓
1.2.3a		Brazilian Depositary Receipts (BDRs) níveis II e III		0,00	0,00%				
1.2.3b		BDRs de ETFs e ETFs no exterior		0,00	0,00%				
1.2.4	Art. 22, Inciso IV	Certificados representativos de ouro físico no padrão negociado em bolsa de mercadorias e de futuros		0,00	0,00%	3,00%	---	3,00%	✓
1.2.5		Valores a pagar/receber e derivativos		0,00	0,00%				
1.2.6		Fundos de renda variável fechados		0,00	0,00%				
1.2.7		Outros		0,00	0,00%				
1.3	Art. 23	SEGMENTO DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		0,00	0,00%	20,00%	0,00%	10,00%	✓
1.3.1	Art. 23, Inciso I, alínea a	Fundos de Participação		0,00	0,00%	15,00%	---	10,00%	✓
1.3.2	Art. 23, Inciso I, alínea b	Fundos Multimercado Estruturado		0,00	0,00%	15,00%	---	10,00%	✓
1.3.3	Art. 23, Inciso I, alínea c	Fundos classificados como "Ações - Mercado de Acesso"		0,00	0,00%	15,00%	---	10,00%	✓
1.3.4	Art. 23, Inciso II	Certificado de Operações Estruturadas (COEs)		0,00	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓
1.3.5		Outros		0,00	0,00%	10,00%			
1.4	Art. 24	SEGMENTO IMOBILIÁRIO		0,00	0,00%	20,00%	0,00%	10,00%	✓
1.4.1	Art. 24, Inciso I	Fundos Imobiliários e cotas de Fundos Imobiliários		0,00	0,00%	20,00%	---	10,00%	✓
1.4.2	Art. 24, Inciso II	Certificados de Recebíveis Imobiliários (CRIs)		0,00	0,00%	20,00%	---	10,00%	✓
1.4.3	Art. 24, Inciso III	Cédula de Crédito Imobiliários (CCIs)		0,00	0,00%	20,00%	---	10,00%	✓
1.4.4		Outros		0,00	0,00%				
1.4.5	Art. 36, inciso XIIIArt. 37, § 4° e § 5°	Imóveis		0,00	0,00%	20,00%	---		✓
1.5	Art. 25	SEGMENTO DE OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		0,00	0,00%	15,00%	0,00%	10,00%	✓
1.6	Art. 26	SEGMENTO EXTERIOR		0,00	0,00%	10,00%	0,00%	10,00%	✓
1.6.1	Art. 26, inciso I	Cotas de FIs e FICFIs classificados como "Dívida Externa" ou títulos da dívida pública mobiliária federal externa		0,00	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓
1.6.2	Art. 26, inciso I	Cotas de fundos de índice do exterior negociados em bolsa do Brasil		0,00	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓
1.6.3	Art. 26, inciso II	Fundos com sufixo "Investimentos no Exterior" que invistam no mínimo 67% em FIs no exterior		0,00	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓
1.6.4	Art. 26, inciso III	Fundos com sufixo "Investimentos no Exterior" que invistam menos que 67% em FIs no exterior		0,00	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓
1.6.5	Art. 26, inciso IV	BDRs classificados como nível I		0,00	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓
1.6.6	Art. 26, inciso V	Demais ativos financeiros no exterior			0,00%				
Recursos Garantidores				50.559.639,90	100%				

As informações utilizadas na elaboração deste relatório foram obtidos através de consulta à instituição mencionada neste documento. Os valores apresentados derivam da análise desses dados, bem como da pesquisa em fontes públicas e da interpretação da legislação vigente. A I9Advisory isenta-se de qualquer responsabilidade quanto à utilização das informações contidas neste relatório para fins que não sejam exclusivamente informativos.

APLICAÇÃO DOS RECURSOS

Art. 27	LIMITES DE ALOCAÇÃO POR EMISSOR EM RELAÇÃO AO PLANO	Maior observado	Limite Legal	Limite PI	Status
Inciso I	Tesouro Nacional	86,81%	100,00%	100,00%	✓
Inciso II	Instituição Financeira Bancária	3,32%	20,00%	20,00%	✓
Inciso III	Demais Emissores	0,21%	10,00%	10,00%	✓

CMN N° 4.994	VEDAÇÕES	Status
Art. 36, Inciso I	Realizar operações de compra e venda, ou qualquer outra forma de troca de ativos entre planos de uma mesma EFPC	---
Art. 36, Inciso II	Realizar operações de crédito, inclusive com suas patrocinadoras, ressalvados os casos expressamente previstos no art. 25 da Resolução CMN n° 4.994	✓
Art. 36, Inciso III	Aplicar em ativos financeiros de emissão de pessoas físicas	✓
Art. 36, Inciso IV	Aplicar em ativos financeiros de emissão de sociedades limitadas, ressalvados os casos expressamente previstos na Resolução	✓
Art. 36, Inciso V	Aplicar em ações e demais ativos financeiros de emissão de sociedades por ações de capital fechado, ressalvados os casos expressamente previstos na Resolução	✓
Art. 36, Inciso VI	Realizar operações com ações fora de bolsa de valores ou mercado de balcão ¹	✓
Art. 36, Inciso VII, alínea a	Manter posições em mercados derivativos, diretamente ou por meio de Fundo de investimento a descoberto	✓
Art. 36, Inciso VII, alínea b	Manter posições em mercados derivativos, diretamente ou por meio de Fundo de investimento, que gere a possibilidade de perda superior ao PL ²	✓
Art. 36, Inciso VIII	Realizar Operações day trade, exceto as realizadas em plataformas eletrônicas ou em bolsa, justificadas em relatório atestado pelo AETQ ³	---
Art. 36, Inciso IX	Aplicar recursos no exterior por meio da carteira própria ou administrada	✓
Art. 36, Inciso X	Prestar fiança, aval, aceite ou coobrigar-se de qualquer forma	---
Art. 36, Inciso XI	Locar, emprestar, tomar emprestado, empenhar ou caucionar ativos financeiros ⁴	✓
Art. 36, Inciso XII	Atuar como incorporadora, de forma direta ou indireta	---
Art. 36, Inciso XIII	Adquirir terrenos e imóveis	---
Art. 18	Aplicar em ativos sem ISIN	✓
Art. 30	Fundos em desacordo com os limites de derivativos	✓

¹ Exceto nos casos de distribuição pública, exercício do direito de preferência, conversão de debêntures em ações, exercício do bônus de subscrição, casos que envolvam negociação de participação relevante conforme regulamentação da Previc e demais casos expressamente previstos na Resolução CMN n° 4.994;

² É verificado o regulamento dos fundos investidos, se possuem limite ou vedação para essa operação, contudo, o acompanhamento a nível de operações deve ser realizado pelo administrador do fundo;

³ Os arquivos disponíveis não possibilita a identificar se foi realizado operações de day trade. Tal conferência fica por responsabilidade do administrador do fundo;

⁴ Os arquivos disponíveis não possibilita a identificar os itens que possuem hífens no status. Tal conferência fica por responsabilidade do administrador do fundo;

⁵ Exceto por depósito de garantias em operações com derivativos no âmbito de cada plano de benefícios; operações de empréstimos de ativos financeiros, nos termos do art. 29; e depósito de garantias de ações judiciais no âmbito de cada plano administrado pela EFPC

As informações utilizadas na elaboração deste relatório foram obtidos através de consulta à instituição mencionada neste documento. Os valores apresentados derivam da análise desses dados, bem como da pesquisa em fontes públicas e da interpretação da legislação vigente. A I9Advisory isenta-se de qualquer responsabilidade quanto à utilização das informações contidas neste relatório para fins que não sejam exclusivamente informativos.

31/dez/24

4

Total Ativos		50.508.868,51																				
Fundo / Carteira	Tipo	Descrição	Razão Social	CNPJ	Qtde. Disponível	Qtde. Garantia	Quantidade	Valor Informado	Valor Calculado	Data Compra	Vencimento	% Indexador	Cupom	Indexador	ISIN	Característica	Compromissada	Tem Caixa?	Duration (DU)	Setor IBGE	Setor B3	Rating
A BRASIL ESPECIAL 2030 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RF - RESP LIM	Tít. Público	NTN-9 2030-08-15	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0409-50	172,00	0,00	3,40	14.140,79	14.140,79	22/11/2024	15/08/2030	100,00%	6,82%	IPCA	BRS1TNCN18388	N		✓	1.180,47	Administração pública em geral		NONE
A BRASIL ESPECIAL 2030 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RF - RESP LIM	Tít. Público	NTN-9 2030-08-15	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0409-50	14,00	0,00	0,28	1.151,00	1.150,99	22/11/2024	15/08/2030	100,00%	6,82%	IPCA	BRS1TNCN18388	N		✓	1.180,47	Administração pública em geral		NONE
A BRASIL ESPECIAL 2030 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RF - RESP LIM	Tít. Público	NTN-9 2030-08-15	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0409-50	40,00	0,00	0,79	3.288,56	3.288,55	22/11/2024	15/08/2030	100,00%	6,83%	IPCA	BRS1TNCN18388	N		✓	1.180,47	Administração pública em geral		NONE
A BRASIL ESPECIAL 2030 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RF - RESP LIM	Tít. Público	NTN-9 2030-08-15	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0409-50	501,00	0,00	9,90	41.189,18	41.189,15	22/11/2024	15/08/2030	100,00%	6,83%	IPCA	BRS1TNCN18388	N		✓	1.180,47	Administração pública em geral		NONE
A BRASIL ESPECIAL 2030 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RF - RESP LIM	Tít. Público	NTN-9 2030-08-15	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0409-50	308,00	0,00	6,09	25.321,89	25.321,87	16/12/2024	15/08/2030	100,00%	7,36%	IPCA	BRS1TNCN18388	N		✓	1.180,47	Administração pública em geral		NONE
A BRASIL ESPECIAL 2030 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RF - RESP LIM	Tít. Público	NTN-9 2030-08-15	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0409-50	50,00	0,00	0,99	4.116,60	4.116,60	17/12/2024	15/08/2030	100,00%	7,58%	IPCA	BRS1TNCN18388	N		✓	1.180,47	Administração pública em geral		NONE
A BRASIL ESPECIAL 2030 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RF - RESP LIM	Tít. Público	NTN-9 2030-08-15	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0409-50	157,00	0,00	3,10	12.957,08	12.957,08	19/12/2024	15/08/2030	100,00%	8,00%	IPCA	BRS1TNCN18388	N		✓	1.180,47	Administração pública em geral		NONE
A BRASIL ESPECIAL 2030 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RF - RESP LIM	Tít. Público	NTN-9 2030-08-15	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0409-50	470,00	0,00	9,29	38.640,55	38.640,52	19/12/2024	15/08/2030	100,00%	8,00%	IPCA	BRS1TNCN18388	N		✓	1.180,47	Administração pública em geral		NONE
A BRASIL ESPECIAL 2030 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RF - RESP LIM	Tít. Público	NTN-9 2030-08-15	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0409-50	23,00	0,00	0,45	1.890,92	1.890,92	19/12/2024	15/08/2030	100,00%	8,00%	IPCA	BRS1TNCN18388	N		✓	1.180,47	Administração pública em geral		NONE
A BRASIL ESPECIAL 2030 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RF - RESP LIM	Compromissada	LTN 2026-01-01	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0409-50	0,00	1.247,00	24,65	21.230,09	21.230,09	31/12/2024	02/01/2025	0,00%	12,14%	PRE	BRS1TNC1170707	N		✓		Administração pública em geral		NONE
A BRASIL ESPECIAL 2030 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RF - RESP LIM	Caixa	Caixa					223,18	223,18	223,18									✓				

Produto	Contraparte	Ratings do Emissor	Valor Calculado	Valor Informado
Caixa/Operações Compromissadas				
Compromissada	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL		0,00	0,00
CAIXA	CE-PREVCOM - PREV-CE		0,00	0,00
CAIXA	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO		-355,15	-355,15
CAIXA	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA		364,27	364,27
CAIXA	CAIXA BRASIL ESPECIAL 2033 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RF - RESP LIMITADA		3.286,01	3.286,01
CAIXA	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2033 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA		-186,03	-186,03
CAIXA	CAIXA BRASIL ESPECIAL 2030 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RF - RESP LIMITADA		122,50	122,50
Títulos Públicos				
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL		7.564.732,69	7.567.205,05
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL		36.176.640,76	36.176.684,51
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL		148.014,11	148.014,11
Títulos Privados				
	BCO BRADESCO SA	AAA	693.347,20	696.240,57
	CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	AAA	1.677.258,30	1.676.572,73
	BCO CITIBANK SA	AAA	59.985,71	70.237,93
	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	AAA	309.666,60	309.891,36
	BCO ITAU SA	AAA	365.993,76	367.424,01
	BCO FIBRA SA	BBB	5.659,39	5.795,33
	BCO BTG PACTUAL SA	AAA	29.541,81	29.601,65
	BCO VOLKSWAGEN SA	AAA	152.702,54	152.833,68
	BCO GMAC SA	AAA	37.638,52	62.647,72
	BCO DAYCOVAL SA	AA	109.309,14	109.543,69
	BCO JOHN DEERE SA	AAA	7.267,07	6.043,28
	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	AAA	29.496,07	29.542,50
	BANCO AGIBANK S.A.	A	9.289,62	9.314,20
	BCO MERCANTIL BRASIL SA	A	9.248,18	9.222,86
	BCO CNH CAPITAL SA	AAA	69.090,74	69.291,14
	BCO ABC BRASIL SA	AAA	156.085,82	156.442,26
	BANCO VOTORANTIM S.A.	AA	267.518,01	268.642,91
	BCO SAFRA SA	AAA	256.763,26	257.676,12
	BCO RABOBANK INTERNATIONAL BRASIL SA	AAA	35.471,89	23.843,40
	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	AA	46.749,60	46.909,46
	BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	AA	45.911,88	45.946,39
	BANCO PACCAR S.A.	AAA	3.153,50	3.156,40
	BANCO XP S.A	AAA	77.983,07	78.085,05
	BANCO C6 CONSIGNADO S.A.	A	23.034,41	23.855,95
	BANCO SEGURO S.A.	AAA	14.897,47	14.921,30
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	AAA	38.310,68	37.982,46
	BCO BRASIL SA	AA	400.133,92	400.238,76
	BCO FIDIS INVEST SA (EX BCO FIAT SA)	AAA	79.604,05	79.652,27

Produto	Contraparte	Ratings do Emissor	Valor Calculado	Valor Informado
	SCANIA BANCO S.A.	AAA	16.665,23	16.665,92
	BANCO HSBC SA	AAA	23.506,10	23.350,78
	BANCO RCI BRASIL SA	AAA	8.029,89	8.023,93
	BANCO INDUSTRIAL BRASIL SA	AA	49.643,09	49.687,83
	NU FINANCEIRA S.A. SOCIEDADE DE CREDITO FINANCIAMENTO E INVESTIMENTO	AA	57.029,00	57.037,86
	GOLDMAN SACHS BRASIL BCO MULTIPLO	AAA	58.526,86	58.558,00
	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	AAA	129.188,67	104.815,63
	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	AA	553,25	553,25
	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	AA	11.849,93	11.849,92
	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	AAA	27.429,32	27.429,33
	LOJAS RENNER SA	AAA	9.148,75	9.148,76
	COSAN SA	AA	37.835,90	37.835,90
	MOVIDA PARTICIPACOES	AA	12.349,92	12.349,94
	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	AA	19.261,02	19.261,09
	HAPVIDA PARTICIPACOES INVESTIMENTO SA	AAA	47.801,65	47.801,64
	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	AAA	48.370,68	44.123,70
	SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	AAA	75.271,79	75.271,78
	LOCALIZA RENT A CAR SA	AAA	90.414,30	90.414,32
	LOCALIZA FLEET SA	AAA	11.590,75	11.590,75
	COPEL DISTRIBUICAO SA	AAA	17.458,87	17.458,86
	CIA ENERGETICA RIO GRANDE NORTE COSERN	AAA	39.033,25	39.124,33
	TELEFONICA BRASIL SA	AAA	36.052,26	36.052,26
	CIELO SA	AAA	42.944,93	64.869,38
	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	AAA	68.510,67	68.510,68
	VIBRA ENERGIA SA	AAA	54.291,34	54.291,33
	ENERGISA SA	AA	7.313,49	7.313,49
	CIA SIDERURGICA NACIONAL	AA	24.314,53	24.314,53
	CIA PAULISTA FORCA LUZ	AAA	21.132,86	21.132,86
	EQUATORIAL PARÁ DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.	AA	2.537,36	2.537,34
	MRS LOGISTICA SA	AAA	3.950,31	3.950,31
	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	AA	38.111,93	38.111,90
	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	AAA	39.232,05	39.232,05
	TIM BRASIL SERVIÇOS E PARTICIPAÇÕES S.A.	AAA	51.549,26	51.549,28
	CIA ENERGETICA PERNAMBUCO CELPE	AAA	11.381,48	11.381,48
	ATACADAO SA	AAA	6.411,68	6.411,68
	YDUQS PARTICIPACOES SA	AAA	48.210,60	48.210,60
	ALGAR TELECOM SA	AAA	23.932,64	23.932,64
	RAIA DROGASIL SA	AAA	18.253,89	18.253,88
	ELEKTRO REDES S.A.	AAA	20.759,97	20.759,96
	B3 SA - BRASIL BOLSA BALCAO	AAA	24.557,29	24.557,29
	FLEURY SA	AAA	39.434,34	39.434,30

Produto	Contraparte	Ratings do Emissor	Valor Calculado	Valor Informado
	SUZANO S.A.	AAA	22.708,68	22.708,68
	EDP SAO PAULO DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A.	AAA	11.979,62	11.979,62
	NATURA COSMETICOS SA	AA	20.511,21	20.511,21
	TUPY SA	AAA	19.052,78	19.052,79
	UNIPAR CARBOCLORO SA	AA	46.216,68	46.216,65
	VOTORANTIM CIMENTOS SA	AAA	29.877,58	29.871,08
	REDE D OR SAO LUIZ SA	AAA	80.949,48	80.949,50
	GERDAU SA	AAA	0,00	20.576,85
	CHINA THREE GORGES BRASIL ENERGIA S.A.	AAA	0,00	3.922,09
FIDC/FIP/Cotas de Fundos				

ANEXO II - DEMONSTRATIVOS DO PREV-CE MUNICÍPIOS

I – DEMONSTRATIVO DE RENTABILIDADE E INDICADORES

II – COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

III – COMPLIANCE DOS INVESTIMENTOS E ENQUADRAMENTO LEGAL

IV – QUADRO DE OPERAÇÕES

V – CONSOLIDADO POR CONTRAPARTE

DEMONSTRATIVO DE RENTABILIDADE E INDICADORES

Plano de Previdência Complementar dos Municípios do Estado do Ceará (PREV-CE MUNICÍPIOS)

(Variações Mensais sujeitas a oscilações momentâneas de curto prazo)

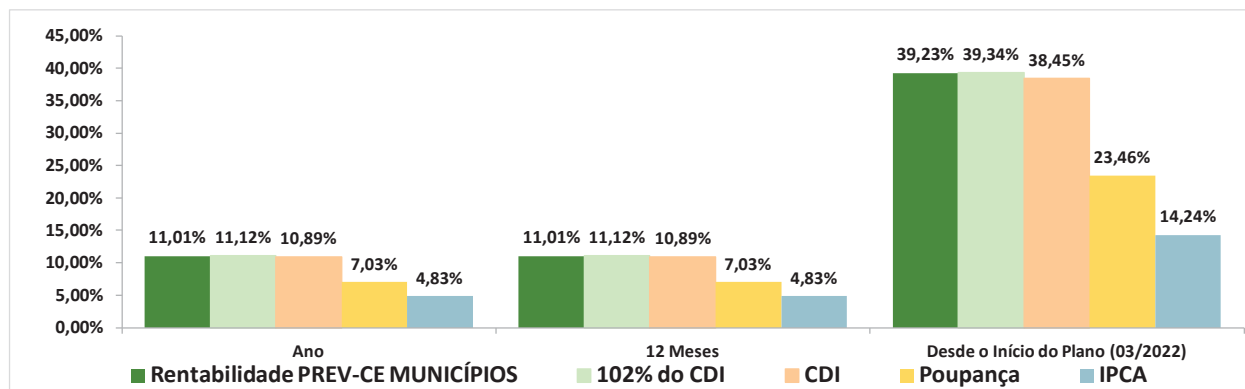
Descrição	Variações Mensais - 2024 (Resultados de Curto Prazo)												Variações Acumuladas		
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Ano	12 Meses	Desde o Início do Plano (03/2022)
Rentabilidade PREV-CE MUNICÍPIOS	1,01%	0,83%	0,86%	0,89%	0,84%	0,81%	0,97%	0,88%	0,85%	0,91%	0,81%	0,83%	11,01%	11,01%	39,23%
Índice de Referência (102% do CDI) ¹	0,99%	0,82%	0,85%	0,91%	0,85%	0,81%	0,93%	0,89%	0,86%	0,95%	0,81%	0,95%	11,12%	11,12%	39,34%
IPCA	0,42%	0,83%	0,16%	0,38%	0,46%	0,21%	0,38%	-0,02%	0,44%	0,56%	0,39%	0,52%	4,83%	4,83%	14,24%
Poupança	0,59%	0,51%	0,53%	0,60%	0,59%	0,54%	0,57%	0,57%	0,57%	0,60%	0,57%	0,58%	7,03%	7,03%	23,46%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	0,84%	0,93%	0,79%	0,93%	10,89%	10,89%	38,45%
PREV-CE MUN. s/ Índice de Referência ²	102,08%	101,72%	101,58%	98,04%	99,22%	100,52%	104,50%	99,17%	99,21%	95,93%	100,52%	87,50%	99,03%	99,03%	99,71%

Fontes: CE-Prevcom (Rentabilidade PREV-CE MUNICÍPIOS e Índice de Referência); IBGE (IPCA); Bacen (CDI e Poupança).

Notas: 1) Índice de Referência atual definido na Política de Investimentos 2024;

2) Indica o percentual de atingimento da Rentabilidade PREV-CE MUNICÍPIOS sobre o Índice de Referência atual.

RENTABILIDADE E INDICADORES ACUMULADOS



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

Investimentos do PREV-CE MUNICÍPIOS

Carteira por Fundo de Investimento e Conta Corrente

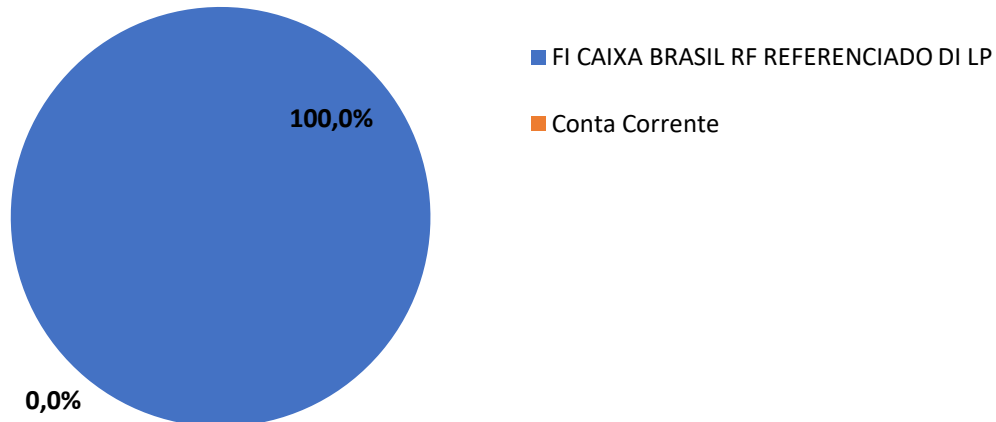
12/2024

Instituição	Segmento	Fundo de Investimento / Conta Corrente	Valor (R\$)	Participação
CEF	Renda Fixa	FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP	3.002.809,81	100,00%
CEF	Disponibilidade	Conta Corrente	0,00	0,00%
TOTAL			3.002.809,81	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.



CE-PREVCOM - PREV-CE MUNICÍPIOS
31/dez/24

Avaliação a conformidade dos investimentos do plano com as diretrizes de alocação definidas pela Política de Investimentos em vigor, bem como de acordo com a Resolução CMN Nº 4.994.

RESUMO DE ENQUADRAMENTO

CMN Nº 4.994	LIMITES DE ALOCAÇÃO	Alocação Atual (em R\$)	dez/24	Limite Legal	Limite Inferior	Alocação Objetivo	Limite Superior	StatusGeral
Art. 21	Segmento de Renda Fixa	R\$ 3.002.809,81	100,00%	100,00%	70,00%	100,00%	100,00%	✓
Art. 22	Segmento de Renda Variável	R\$ 0,00	0,00%	70,00%	---	0,00%	20,00%	✓
Art. 23	Segmento de Investimentos Estruturados	R\$ 0,00	0,00%	20,00%	---	0,00%	10,00%	✓
Art. 24	Segmento Imobiliário	R\$ 0,00	0,00%	20,00%	---	0,00%	10,00%	✓
Art. 25	Segmento de Operações com Participantes	R\$ 0,00	0,00%	15,00%	---	0,00%	0,00%	✓
Art. 26	Segmento de Investimentos no Exterior	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	---	0,00%	10,00%	✓
Recursos Garantidores		R\$ 3.002.809,81	100,00%					

Art. 27	LIMITES DE ALOCAÇÃO POR EI	Maior observado	Limite Legal	Limite PI	Status
Inciso I	Tesouro Nacional	53,17%	100,00%	100,00%	✓
Inciso II	Instituição Financeira Bancária	11,78%	20,00%	20,00%	✓
Inciso III	Demais Emissores	0,74%	10,00%	10,00%	✓

CRÉDITO	Exposição	Limite PI	Status
Total em Crédito (Grau de Investimento + Grau Especulativo)	46,83%	80%	✓
Grau Especulativo	0,04%	5%	✓

RISCO DE MERCADO	Segmento/Mandato	Modelo	Var / BVaR	% Var / BVaR	Limite PI	Status
CE-PREVCOM - PREV-CE MUNICÍPIOS	Consolidado	Não Paramétrico - 21 dia - 95,0% - EWMA (0.95)	VaR	0,02%		✓

Legenda:

- ✓ - Enquadrado
- ! - Apontamento PI
- ✗ - Apontamento Legal

APLICAÇÃO DOS RECURSOS

CMN N° 4.994			LIMITES DE ALOCAÇÃO	Alocação (em R\$)	dez/24	Limite Legal	Alocação Objetivo	Limite Superior	Status
1.1	Art. 21		SEGMENTO DE RENDA FIXA	3.002.809,81	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	✓
1.1.1	Art. 21 Inciso I, alínea a; (§2°)		Títulos da dívida pública mobiliária federal interna e operações compromissadas	1.596.677,08	53,17%	100,00%	---	100,00%	✓
1.1.2	Art. 21 Inciso I, alínea b		Cotas de fundo de índice de renda fixa composto exclusivamente por títulos da dívida pública mobiliária federal interna	0,00	0,00%	100,00%	---	100,00%	✓
1.1.3	§ 1°		Ativos de renda fixa, exceto títulos públicos (conjunto dos ativos listados nos incisos II e III)	1.406.132,73	46,83%	80,00%	---	60,00%	✓
1.1.3.1	Art. 21 Inciso II, alínea a		Ativos financeiros de renda fixa de emissão com obrigação ou coobrigação de instituições financeiras bancárias autorizadas a funcionar pelo Bacen	1.096.742,44	36,52%	80,00%	---	60,00%	✓
1.1.3.1a			CDBs, RDBs, LFs, LHS, LCIs e LCAs	1.088.589,93	36,25%				
1.1.3.1b			DPGEs	6.139,66	0,20%				
1.1.3.1c			Poupança	0,00	0,00%				
1.1.3.1d			Outros	2.012,85	0,07%				
1.1.3.2	Art. 21 Inciso II, alínea b		Ativos financeiros de renda fixa de emissão de sociedade por ações de capital aberto, incluídas as companhias securitizadoras	283.742,85	9,45%	80,00%	---	60,00%	✓
1.1.3.2a			Debêntures não incentivadas	252.886,56	8,42%				
1.1.3.2b			Notas Promissórias, NCEs e CCEs	21.333,05	0,71%				
1.1.3.2c			Debêntures incentivadas	0,00	0,00%				
1.1.3.2d			Outros	9.523,24	0,32%				
1.1.3.14	Art. 21 Inciso II, alínea c		Cotas de fundo de índice de renda fixa, nos termos da regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários	0,00	0,00%	80,00%	---	60,00%	✓
1.1.3.3	Art. 21 Inciso III, alínea a		Títulos das dívidas públicas mobiliárias estaduais e municipais, desde que emitidos antes da vigência da Lei Complementar nº 148, de 25/11/2014	0,00	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.4	Art. 21 Inciso III, alínea b		Obrigações de organismos multilaterais emitidas no País	0,00	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.5	Art. 21 Inciso III, alínea c		Ativos de instituições financeiras não bancárias e de cooperativas de crédito, autorizadas a funcionar pelo Bacen	25.722,38	0,86%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.5a			LCs, LFs, LHS, LIG, LCIs e LCAs	0,00	0,00%				
1.1.3.5b			DPGEs	0,00	0,00%				
1.1.3.5c			Notas Promissórias	0,00	0,00%				
1.1.3.5d			Debêntures	13.687,41	0,46%				
1.1.3.5e			Outros	12.034,96	0,40%				
1.1.3.6	Art. 21 Inciso III, alínea d		Debêntures emitidas por sociedade por ações de capital fechado nos termos do art. 2° da Lei nº 12.431	0,00	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.7	Art. 21 Inciso III, alínea e		FIDC, FICFIDC e CCB com coobrigação de instituição financeira e CCCB com coobrigação de instituição financeira	0,00	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.7a			FIDCs e FICFDCs	0,00	0,00%				
1.1.3.7b			CCBs e CCCBs	0,00	0,00%				
1.1.3.8	Art. 21 Inciso III, alínea f		CPR, CDCA, CRA e Warrant Agropecuário	0,00	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.12			Caixa, Valores a Pagar/Receber	-74,94	0,00%	---	---	---	---
1.1.3.13			Operações a termo, opções de renda fixa e swaps	0,00	0,00%				
1.1.3.13a			Termos	0,00	0,00%				
1.1.3.13b			Outros	0,00	0,00%				
1.1.3.15			Outros	0,00	0,00%				
Art. 37, § 2° Inciso I			Ativos transitórios RF	0,00					

APLICAÇÃO DOS RECURSOS

CMN N° 4.994			LIMITES DE ALOCAÇÃO	Alocação (em R\$)	dez/24	Limite Legal	Alocação Objetivo	Limite Superior	Status
1.2	Art. 22		SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	0,00	0,00%	70,00%	0,00%	20,00%	✓
1.2.1	Art. 22, Inciso I		Ações com nível de governança corporativa	0,00	0,00%	70,00%	---	20,00%	✓
1.2.2	Art. 22, Inciso II		Ações sem nível de governança corporativa	0,00	0,00%	50,00%	---	20,00%	✓
1.2.3	Art. 22, Inciso III		Brazilian Depositary Receipts (BDRs) níveis II e III, BDRs de ETFs	0,00	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓
1.2.3a			Brazilian Depositary Receipts (BDRs) níveis II e III	0,00	0,00%				
1.2.3b			BDRs de ETFs e ETFs no exterior	0,00	0,00%				
1.2.4	Art. 22, Inciso IV		Certificados representativos de ouro físico no padrão negociado em bolsa de mercadorias e de futuros	0,00	0,00%	3,00%	---	3,00%	✓
1.2.5			Valores a pagar/receber e derivativos	0,00	0,00%				
1.2.6			Fundos de renda variável fechados	0,00	0,00%				
1.2.7			Outros	0,00	0,00%				
1.3	Art. 23		SEGMENTO DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	0,00%	20,00%	0,00%	10,00%	✓
1.3.1	Art. 23, Inciso I, alínea a		Fundos de Participação	0,00	0,00%	15,00%	---	10,00%	✓
1.3.2	Art. 23, Inciso I, alínea b		Fundos Multimercado Estruturado	0,00	0,00%	15,00%	---	10,00%	✓
1.3.3	Art. 23, Inciso I, alínea c		Fundos classificados como "Ações - Mercado de Acesso"	0,00	0,00%	15,00%	---	10,00%	✓
1.3.4	Art. 23, Inciso II		Certificado de Operações Estruturadas (COEs)	0,00	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓
1.3.5			Outros	0,00	0,00%	10,00%			
1.4	Art. 24		SEGMENTO IMOBILIÁRIO	0,00	0,00%	20,00%	0,00%	10,00%	✓
1.4.1	Art. 24, Inciso I		Fundos Imobiliários e cotas de Fundos Imobiliários	0,00	0,00%	20,00%	---	10,00%	✓
1.4.2	Art. 24, Inciso II		Certificados de Recebíveis Imobiliários (CRIs)	0,00	0,00%	20,00%	---	10,00%	✓
1.4.3	Art. 24, Inciso III		Cédula de Crédito Imobiliários (CCIs)	0,00	0,00%	20,00%	---	10,00%	✓
1.4.4			Outros	0,00	0,00%				
1.4.5	Art. 36, inciso XIII	Art. 37, § 4° e § 5°	Imóveis	0,00	0,00%	20,00%	---		✓
1.5	Art. 25		SEGMENTO DE OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	0,00	0,00%	15,00%	0,00%	0,00%	✓
1.6	Art. 26		SEGMENTO EXTERIOR	0,00	0,00%	10,00%	0,00%	10,00%	✓
1.6.1	Art. 26, inciso I		Cotas de FIs e FICFIs classificados como "Dívida Externa" ou títulos da dívida pública mobiliária federal externa	0,00	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓
1.6.2	Art. 26, inciso I		Cotas de fundos de índice do exterior negociados em bolsa do Brasil	0,00	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓
1.6.3	Art. 26, inciso II		Fundos com sufixo "Investimentos no Exterior" que invistam no mínimo 67% em FIs no exterior	0,00	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓
1.6.4	Art. 26, inciso III		Fundos com sufixo "Investimentos no Exterior" que invistam menos que 67% em FIs no exterior	0,00	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓
1.6.5	Art. 26, inciso IV		BDRs classificados como nível I	0,00	0,00%	10,00%	---	10,00%	✓
1.6.6	Art. 26, inciso V		Demais ativos financeiros no exterior		0,00%				
Recursos Garantidores				3.002.809,81	100%				

As informações utilizadas na elaboração deste relatório foram obtidos através de consulta à instituição mencionada neste documento. Os valores apresentados derivam da análise desses dados, bem como da pesquisa em fontes públicas e da interpretação da legislação vigente. A I9Advisory isenta-se de qualquer responsabilidade quanto à utilização das informações contidas neste relatório para fins que não sejam exclusivamente informativos.

APLICAÇÃO DOS RECURSOS

Art. 27	LIMITES DE ALOCAÇÃO POR EMISSOR EM RELAÇÃO AO PLANO	Maior observado	Limite Legal	Limite PI	Status
Inciso I	Tesouro Nacional	53,17%	100,00%	100,00%	✓
Inciso II	Instituição Financeira Bancária	11,78%	20,00%	20,00%	✓
Inciso III	Demais Emissores	0,74%	10,00%	10,00%	✓

CMN N° 4.994	VEDAÇÕES	Status
Art. 36, Inciso I	Realizar operações de compra e venda, ou qualquer outra forma de troca de ativos entre planos de uma mesma EFPC	---
Art. 36, Inciso II	Realizar operações de crédito, inclusive com suas patrocinadoras, ressalvados os casos expressamente previstos no art. 25 da Resolução CMN n° 4.994	✓
Art. 36, Inciso III	Aplicar em ativos financeiros de emissão de pessoas físicas	✓
Art. 36, Inciso IV	Aplicar em ativos financeiros de emissão de sociedades limitadas, ressalvados os casos expressamente previstos na Resolução	✓
Art. 36, Inciso V	Aplicar em ações e demais ativos financeiros de emissão de sociedades por ações de capital fechado, ressalvados os casos expressamente previstos na Resolução	✓
Art. 36, Inciso VI	Realizar operações com ações fora de bolsa de valores ou mercado de balcão ¹	✓
Art. 36, Inciso VII, alínea a	Manter posições em mercados derivativos, diretamente ou por meio de Fundo de investimento a descoberto	✓
Art. 36, Inciso VII, alínea b	Manter posições em mercados derivativos, diretamente ou por meio de Fundo de investimento, que gere a possibilidade de perda superior ao PL ²	✓
Art. 36, Inciso VIII	Realizar Operações day trade, exceto as realizadas em plataformas eletrônicas ou em bolsa, justificadas em relatório atestado pelo AETQ ³	---
Art. 36, Inciso IX	Aplicar recursos no exterior por meio da carteira própria ou administrada	✓
Art. 36, Inciso X	Prestar fiança, aval, aceite ou coobrigar-se de qualquer forma	---
Art. 36, Inciso XI	Locar, emprestar, tomar emprestado, empenhar ou caucionar ativos financeiros ⁴	✓
Art. 36, Inciso XII	Atuar como incorporadora, de forma direta ou indireta	---
Art. 36, Inciso XIII	Adquirir terrenos e imóveis	---
Art. 18	Aplicar em ativos sem ISIN	✓
Art. 30	Fundos em desacordo com os limites de derivativos	✓

¹ Exceto nos casos de distribuição pública, exercício do direito de preferência, conversão de debêntures em ações, exercício do bônus de subscrição, casos que envolvam negociação de participação relevante conforme regulamentação da Previc e demais casos expressamente previstos na Resolução CMN n° 4.994;

² É verificado o regulamento dos fundos investidos, se possuem limite ou vedação para essa operação, contudo, o acompanhamento a nível de operações deve ser realizado pelo administrador do fundo;

³ Os arquivos disponíveis não possibilita a identificar se foi realizado operações de day trade. Tal conferência fica por responsabilidade do administrador do fundo;

⁴ Os arquivos disponíveis não possibilita a identificar os itens que possuem hífens no status. Tal conferência fica por responsabilidade do administrador do fundo;

⁵ Exceto por depósito de garantias em operações com derivativos no âmbito de cada plano de benefícios; operações de empréstimos de ativos financeiros, nos termos do art. 29; e depósito de garantias de ações judiciais no âmbito de cada plano administrado pela EFPC

As informações utilizadas na elaboração deste relatório foram obtidos através de consulta à instituição mencionada neste documento. Os valores apresentados derivam da análise desses dados, bem como da pesquisa em fontes públicas e da interpretação da legislação vigente. A I9Advisory isenta-se de qualquer responsabilidade quanto à utilização das informações contidas neste relatório para fins que não sejam exclusivamente informativos.

Total Ativos		2.992.106,30																				
Fundo / Carteira	Tipo	Descrição	Razão Social	CNPJ	Qtde. Disponível	Qtde. Garantia	Quantidade	Valor Informado	Valor Calculado	Data Compra	Vencimento	% Indexador	Cupom	Indexador	ISIN	Característica	Compromissada	Tem Caixa?	Duration (DU)	Sector IBGE	Sector B3	Rating
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	Debitura	FLRYB0	FLURY SA	60.840.056/0001-33	6.300,00	0,00	1,00	1.007,43	1.007,43	30/10/2024	21/10/2031	100,00%	0,55%	CDI	BRFLRY08005	N		✓	1.035,09	Laboratórios clínicos	> Hospitais, Análises e I	AAA
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	Debitura	VBRFL0	VBRFL ENERGIA SA	34.274.230/0001-02	15.000,00	0,00	2,38	2.352,81	2.352,81	14/11/2024	04/01/2032	100,00%	1,05%	CDI	BRVBR008078	N		✓	992,15	Indústria e comércio de bens de consumo duráveis e não duráveis	Indústria e Comércio	AAA
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	Debitura	GGBRA0	GERDAU SA	33.611.500/0001-19	27.230,00	0,00	4,33	4.341,71		10/12/2024	30/12/2028	100,00%	0,55%	CDI	BRGGBR080078	N		✓		Indústria e comércio de bens de consumo duráveis e não duráveis	Indústria e Comércio	AAA
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	Debitura	CHTH11	CHINA THREE GORGES BRASIL ENERGIA S.A.	19.014.221/0001-47	5.102,00	0,00	0,82	827,56		19/12/2024	15/12/2029	100,00%	0,50%	CDI	BRCHTH080003	N		✓		Indústria e comércio de bens de consumo duráveis e não duráveis	Indústria e Comércio	AAA
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	Debitura	NTSD26	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	04.992.714/0001-84	13.000,00	0,00	2,07	2.368,28	2.368,28	20/12/2024	15/02/2031	100,00%	0,99%	CDI	BRNTSD080071	N		✓	926,57	Transporte rodoviário	Transporte	AAA
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	Debitura	NTSD06	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	04.992.714/0001-84	698,00	0,00	0,11	111,42	111,42	20/12/2024	15/02/2031	100,00%	1,04%	CDI	BRNTSD080071	N		✓	926,57	Transporte rodoviário	Transporte	AAA
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	Debitura	CELI17	CELSA SA	01.027.036/0001-91	29.050,00	0,00	4,62	4.621,05		23/12/2024	17/12/2027	100,00%	0,54%	CDI	BRCELD080039	N		✓		Indústria e comércio de bens de consumo duráveis e não duráveis	Indústria e Comércio	AAA
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	Caixa	Caixa					1,79	1,79	1,79							N		✓				AAA

Produto	Contraparte	Ratings do Emissor	Valor Calculado	Valor Informado
Caixa/Operações Compromissadas				
Compromissada	SECRETARIA TESOUREO NACIONAL		0,00	0,00
CAIXA	CE-PREVCOM - PREV-CE MUNICÍPIOS		0,00	0,00
CAIXA	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO		-74,94	-74,94
Títulos Públicos				
LFT	SECRETARIA TESOUREO NACIONAL		1.596.155,41	1.596.677,08
Títulos Privados				
	BCO BRADESCO SA	AAA	146.295,97	146.906,47
	CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	AAA	353.900,80	353.756,14
	BCO CITIBANK SA	AAA	12.656,96	14.820,17
	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	AAA	65.339,52	65.386,95
	BCO ITAU SA	AAA	77.224,53	77.526,31
	BCO FIBRA SA	BBB	1.194,13	1.222,81
	BCO BTG PACTUAL SA	AAA	6.233,31	6.245,94
	BCO VOLKSWAGEN SA	AAA	32.220,17	32.247,84
	BCO GMAC SA	AAA	7.941,71	13.218,64
	BCO DAYCOVAL SA	AA	23.064,18	23.113,67
	BCO JOHN DEERE SA	AAA	1.533,35	1.275,13
	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	AAA	6.223,66	6.233,46
	BANCO AGIBANK S.A.	A	1.960,11	1.965,29
	BCO MERCANTIL BRASIL SA	A	1.951,36	1.946,02
	BCO CNH CAPITAL SA	AAA	14.578,12	14.620,40
	BCO ABC BRASIL SA	AAA	32.934,04	33.009,25
	BANCO VOTORANTIM S.A.	AA	56.446,19	56.683,54
	BCO SAFRA SA	AAA	54.176,94	54.369,55
	BCO RABOBANK INTERNATIONAL BRASIL SA	AAA	7.484,55	5.030,95
	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	AA	9.864,15	9.897,88
	BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	AA	9.687,39	9.694,67
	BANCO PACCAR S.A.	AAA	665,39	666,00
	BANCO XP S.A	AAA	16.454,40	16.475,91
	BANCO C6 CONSIGNADO S.A.	A	4.860,25	5.033,60
	BANCO SEGURO S.A.	AAA	3.143,36	3.148,39
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	AAA	8.083,54	8.014,28
	BCO BRASIL SA	AA	84.428,09	84.450,21
	BCO FIDIS INVEST SA (EX BCO FIAT SA)	AAA	16.796,42	16.806,60
	SCANIA BANCO S.A.	AAA	3.516,36	3.516,50
	BANCO HSBC SA	AAA	4.959,78	4.927,01
	BANCO RCI BRASIL SA	AAA	1.694,30	1.693,05
	BANCO INDUSTRIAL BRASIL SA	AA	10.474,67	10.484,11
	NU FINANCEIRA S.A. SOCIEDADE DE CREDITO FINANCIAMENTO E INVESTIMENTO	AA	12.033,10	12.034,96
	GOLDMAN SACHS BRASIL BCO MULTIPLO	AAA	12.349,14	12.355,71

Produto	Contraparte	Ratings do Emissor	Valor Calculado	Valor Informado
	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	AAA	27.258,75	22.116,05
	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	AA	116,73	116,73
	VAMOS LOCACAO DE CAMINHOS MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	AA	2.500,33	2.500,33
	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	AAA	5.787,58	5.787,58
	LOJAS RENNER SA	AAA	1.930,38	1.930,38
	COSAN SA	AA	7.983,36	7.983,36
	MOVIDA PARTICIPACOES	AA	2.605,83	2.605,83
	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	AA	4.064,07	4.064,08
	HAPVIDA PARTICIPACOES INVESTIMENTO SA	AAA	10.086,13	10.086,13
	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	AAA	10.206,19	9.310,08
	SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	AAA	15.882,32	15.882,31
	LOCALIZA RENT A CAR SA	AAA	19.077,38	19.077,38
	LOCALIZA FLEET SA	AAA	2.445,64	2.445,64
	COPEL DISTRIBUICAO SA	AAA	3.683,81	3.683,81
	CIA ENERGETICA RIO GRANDE NORTE COSERN	AAA	8.236,00	8.255,22
	TELEFONICA BRASIL SA	AAA	7.607,01	7.607,01
	CIELO SA	AAA	9.061,36	13.687,41
	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	AAA	14.455,72	14.455,72
	VIBRA ENERGIA SA	AAA	11.455,45	11.455,45
	ENERGISA SA	AA	1.543,14	1.543,14
	CIA SIDERURGICA NACIONAL	AA	5.130,36	5.130,36
	CIA PAULISTA FORCA LUZ	AAA	4.459,03	4.459,03
	EQUATORIAL PARÁ DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.	AA	535,38	535,38
	MRS LOGISTICA SA	AAA	833,51	833,51
	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	AA	8.041,60	8.041,60
	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	AAA	8.277,95	8.277,95
	TIM BRASIL SERVIÇOS E PARTICIPAÇÕES S.A.	AAA	10.876,87	10.876,88
	CIA ENERGETICA PERNAMBUCO CELPE	AAA	2.401,49	2.401,49
	ATACADAO SA	AAA	1.352,86	1.352,86
	YDUQS PARTICIPACOES SA	AAA	10.172,42	10.172,42
	ALGAR TELECOM SA	AAA	5.049,78	5.049,78
	RAIA DROGASIL SA	AAA	3.851,56	3.851,56
	ELEKTRO REDES S.A.	AAA	4.380,34	4.380,34
	B3 SA - BRASIL BOLSA BALCAO	AAA	5.181,58	5.181,58
	FLEURY SA	AAA	8.320,63	8.320,62
	SUZANO S.A.	AAA	4.791,52	4.791,52
	EDP SAO PAULO DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A.	AAA	2.527,69	2.527,69
	NATURA COSMETICOS SA	AA	4.327,86	4.327,86
	TUPY SA	AAA	4.020,13	4.020,13
	UNIPAR CARBOCLORO SA	AA	9.751,70	9.751,69
	VOTORANTIM CIMENTOS SA	AAA	6.304,16	6.302,79

Produto	Contraparte	Ratings do Emissor	Valor Calculado	Valor Informado
	REDE D OR SAO LUIZ SA	AAA	17.080,31	17.080,31
	GERDAU SA	AAA	0,00	4.341,71
	CHINA THREE GORGES BRASIL ENERGIA S.A.	AAA	0,00	827,56
FIDC/FIP/Cotas de Fundos				

ANEXO III – DEMONSTRATIVOS DO PGA

I – DEMONSTRATIVO DE RENTABILIDADE E INDICADORES

II – COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

III – COMPLIANCE DOS INVESTIMENTOS E ENQUADRAMENTO LEGAL

IV – QUADRO DE OPERAÇÕES

V – CONSOLIDADO POR CONTRAPARTE

DEMONSTRATIVO DE RENTABILIDADE E INDICADORES

Plano de Gestão Administrativa (PGA) (Variações Mensais sujeitas a oscilações momentâneas de curto prazo)

Descrição	Variações Mensais - 2024 (Resultados de Curto Prazo)												Variações Acumuladas		
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	Ano	12 Meses	Desde o Início do Plano (01/2021)
Rentabilidade PGA	0,81%	0,71%	0,74%	0,14%	0,96%	0,68%	1,01%	0,65%	0,20%	0,56%	0,20%	-0,64%	6,18%	6,18%	36,51%
Índice de Referência (IPCA) ¹	0,42%	0,83%	0,16%	0,38%	0,46%	0,21%	0,38%	-0,02%	0,44%	0,56%	0,39%	0,52%	4,83%	4,83%	27,69%
PGA sobre Índice de Referência ²	192,86%	85,54%	462,50%	36,84%	208,70%	323,81%	265,79%	-3250,00%	45,45%	100,00%	51,28%	-123,08%	127,85%	127,85%	131,85%
Retorno Real PGA (acima IPCA) ³	0,39%	-0,12%	0,58%	-0,24%	0,50%	0,47%	0,63%	0,67%	-0,24%	-	-0,19%	-1,15%	1,28%	1,28%	6,91%

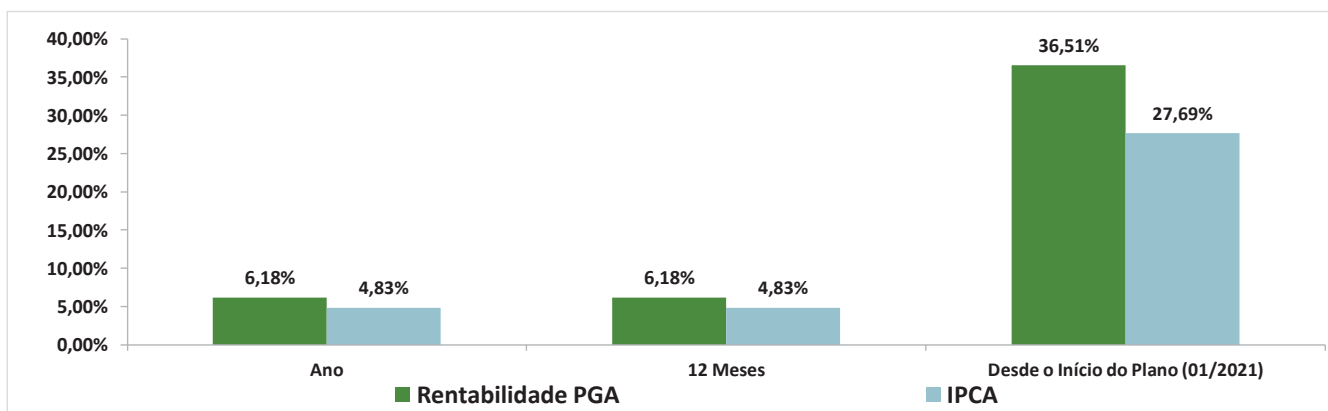
Fontes: CE-Prevcom (Rentabilidade PGA); IBGE (IPCA).

Notas: 1) Índice de Referência atual definido na Política de Investimentos 2024;

2) Indica o percentual de atingimento da Rentabilidade do PGA sobre o Índice de Referência atual;

3) Indica o retorno real obtido pelos investimentos do PGA, acima da inflação medida pelo Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA).

RENTABILIDADE E INDICADORES ACUMULADOS



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

Investimentos do PGA

Carteira por Fundo de Investimento e Conta Corrente

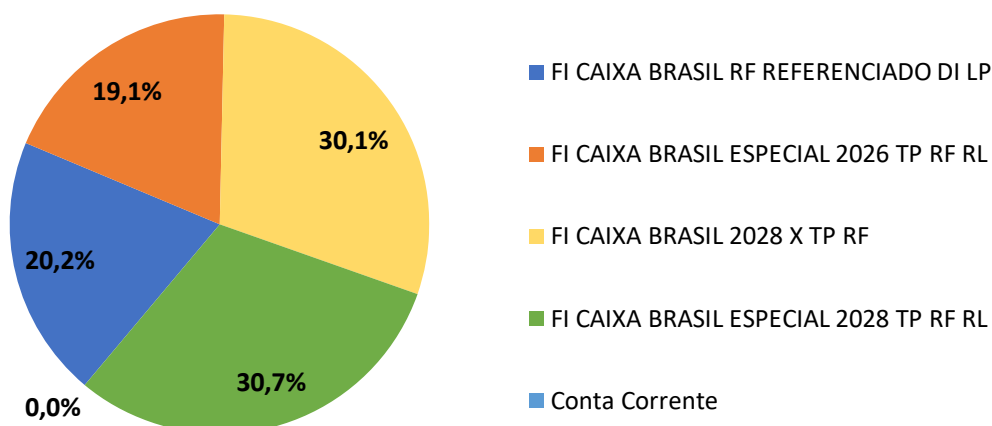
12/2024

Instituição	Segmento	Fundo de Investimento / Conta Corrente	Valor (R\$)	Participação
CEF	Renda Fixa	FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP	5.565.898,83	20,19%
CEF	Renda Fixa	FI CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TP RF RL	5.254.775,97	19,06%
CEF	Renda Fixa	FI CAIXA BRASIL 2028 X TP RF	8.287.084,06	30,06%
CEF	Renda Fixa	FI CAIXA BRASIL ESPECIAL 2028 TP RF RL	8.457.774,69	30,68%
CEF	Disponibilidade	Conta Corrente	0,00	0,00%
TOTAL			27.565.533,55	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.



CE-PREVCOM - PGA

31/dez/24

Avaliação a conformidade dos investimentos do plano com as diretrizes de alocação definidas pela Política de Investimentos em vigor, bem como de acordo com a Resolução CMN Nº 4.994.

RESUMO DE ENQUADRAMENTO

CMN Nº 4.994	LIMITES DE ALOCAÇÃO	Alocação Atual (em R\$)	dez/24	Limite Legal	Limite Inferior	Alocação Objetivo	Limite Superior	StatusGral
Art. 21	Segmento de Renda Fixa	R\$ 27.565.533,55	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	✓
Art. 22	Segmento de Renda Variável	R\$ 0,00	0,00%	70,00%	---	0,00%	0,00%	✓
Art. 23	Segmento de Investimentos Estruturados	R\$ 0,00	0,00%	20,00%	---	0,00%	0,00%	✓
Art. 24	Segmento Imobiliário	R\$ 0,00	0,00%	20,00%	---	0,00%	0,00%	✓
Art. 25	Segmento de Operações com Participantes	R\$ 0,00	0,00%	15,00%	---	0,00%	0,00%	✓
Art. 26	Segmento de Investimentos no Exterior	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	---	0,00%	0,00%	✓
Recursos Garantidores		R\$ 27.565.533,55	100,00%					

Art. 27	LIMITES DE ALOCAÇÃO POR EI	Maior observado	Limite Legal	Limite PI	Status
Inciso I	Tesouro Nacional	90,55%	100,00%	100,00%	✓
Inciso II	Instituição Financeira Bancária	2,38%	20,00%	20,00%	✓
Inciso III	Demais Emissores	0,15%	10,00%	10,00%	✓

CRÉDITO	Exposição	Limite PI	Status
Total em Crédito (Grau de Investimento + Grau Especulativo)	9,46%	80%	✓
Grau Especulativo	0,01%	5%	✓

RISCO DE MERCADO	Segmento/Mandato	Modelo	Var / BVaR	% Var / BVaR	Limite PI	Status
CE-PREVCOM - PGA	Consolidado	Não Paramétrico - 21 dia - 95,0% - EWMA (0.95)	VaR	1,36%		✓

Legenda:

- ✓ - Enquadrado
- ! - Apontamento PI
- ✗ - Apontamento Legal

APLICAÇÃO DOS RECURSOS

CMN N° 4.994			LIMITES DE ALOCAÇÃO	Alocação (em R\$)	dez/24	Limite Legal	Alocação Objetivo	Limite Superior	Status
1.1	Art. 21		SEGMENTO DE RENDA FIXA	27.565.533,55	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	✓
1.1.1	Art. 21 Inciso I, alínea a; (§2°)		Títulos da dívida pública mobiliária federal interna e operações compromissadas	24.959.313,40	90,55%	100,00%	---	100,00%	✓
1.1.2	Art. 21 Inciso I, alínea b		Cotas de fundo de índice de renda fixa composto exclusivamente por títulos da dívida pública mobiliária federal interna	0,00	0,00%	100,00%	---	100,00%	✓
1.1.3	§ 1°		Ativos de renda fixa, exceto títulos públicos (conjunto dos ativos listados nos incisos II e III)	2.606.220,15	9,45%	80,00%	---	60,00%	✓
1.1.3.1	Art. 21 Inciso II, alínea a		Ativos financeiros de renda fixa de emissão com obrigação ou coobrigação de instituições financeiras bancárias autorizadas a funcionar pelo Bacen	2.032.881,82	7,37%	80,00%	---	60,00%	✓
1.1.3.1a			CDBs, RDBs, LFs, LHs, LCIs e LCAs	2.017.770,63	7,32%				
1.1.3.1b			DPGEs	11.380,24	0,04%				
1.1.3.1c			Poupança	0,00	0,00%				
1.1.3.1d			Outros	3.730,94	0,01%				
1.1.3.2	Art. 21 Inciso II, alínea b		Ativos financeiros de renda fixa de emissão de sociedade por ações de capital aberto, incluídas as companhias securitizadoras	525.935,41	1,91%	80,00%	---	60,00%	✓
1.1.3.2a			Debêntures não incentivadas	468.741,31	1,70%				
1.1.3.2b			Notas Promissórias, NCEs e CCEs	39.542,17	0,14%				
1.1.3.2c			Debêntures incentivadas	0,00	0,00%				
1.1.3.2d			Outros	17.651,93	0,06%				
1.1.3.14	Art. 21 Inciso II, alínea c		Cotas de fundo de índice de renda fixa, nos termos da regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários	0,00	0,00%	80,00%	---	60,00%	✓
1.1.3.3	Art. 21 Inciso III, alínea a		Títulos das dívidas públicas mobiliárias estaduais e municipais, desde que emitidos antes da vigência da Lei Complementar nº 148, de 25/11/2014	0,00	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.4	Art. 21 Inciso III, alínea b		Obrigações de organismos multilaterais emitidas no País	0,00	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.5	Art. 21 Inciso III, alínea c		Ativos de instituições financeiras não bancárias e de cooperativas de crédito, autorizadas a funcionar pelo Bacen	47.678,06	0,17%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.5a			LCs, LFs, LHs, LIG, LCIs e LCAs	0,00	0,00%				
1.1.3.5b			DPGEs	0,00	0,00%				
1.1.3.5c			Notas Promissórias	0,00	0,00%				
1.1.3.5d			Debêntures	25.370,49	0,09%				
1.1.3.5e			Outros	22.307,57	0,08%				
1.1.3.6	Art. 21 Inciso III, alínea d		Debêntures emitidas por sociedade por ações de capital fechado nos termos do art. 2° da Lei nº 12.431	0,00	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.7	Art. 21 Inciso III, alínea e		FIDC, FICFIDC e CCB com coobrigação de instituição financeira e CCCB com coobrigação de instituição financeira	0,00	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.7a			FIDCs e FICFDCs	0,00	0,00%				
1.1.3.7b			CCBs e CCCBs	0,00	0,00%				
1.1.3.8	Art. 21 Inciso III, alínea f		CPR, CDCA, CRA e Warrant Agropecuário	0,00	0,00%	20,00%	---	20,00%	✓
1.1.3.12			Caixa, Valores a Pagar/Receber	-275,14	0,00%	---	---	---	---
1.1.3.13			Operações a termo, opções de renda fixa e swaps	0,00	0,00%				
1.1.3.13a			Termos	0,00	0,00%				
1.1.3.13b			Outros	0,00	0,00%				
1.1.3.15			Outros	0,00	0,00%				
Art. 37, § 2° Inciso I			Ativos transitórios RF	0,00					

APLICAÇÃO DOS RECURSOS

CMN N° 4.994			LIMITES DE ALOCAÇÃO	Alocação (em R\$)	dez/24	Limite Legal	Alocação Objetivo	Limite Superior	Status
1.2	Art. 22		SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	0,00	0,00%	70,00%	0,00%	0,00%	✓
1.2.1	Art. 22, Inciso I		Ações com nível de governança corporativa	0,00	0,00%	70,00%	---	0,00%	✓
1.2.2	Art. 22, Inciso II		Ações sem nível de governança corporativa	0,00	0,00%	50,00%	---	0,00%	✓
1.2.3	Art. 22, Inciso III		Brazilian Depositary Receipts (BDRs) níveis II e III, BDRs de ETFs	0,00	0,00%	10,00%	---	0,00%	✓
1.2.3a			Brazilian Depositary Receipts (BDRs) níveis II e III	0,00	0,00%				
1.2.3b			BDRs de ETFs e ETFs no exterior	0,00	0,00%				
1.2.4	Art. 22, Inciso IV		Certificados representativos de ouro físico no padrão negociado em bolsa de mercadorias e de futuros	0,00	0,00%	3,00%	---	0,00%	✓
1.2.5			Valores a pagar/receber e derivativos	0,00	0,00%				
1.2.6			Fundos de renda variável fechados	0,00	0,00%				
1.2.7			Outros	0,00	0,00%				
1.3	Art. 23		SEGMENTO DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	0,00%	20,00%	0,00%	0,00%	✓
1.3.1	Art. 23, Inciso I, alínea a		Fundos de Participação	0,00	0,00%	15,00%	---	0,00%	✓
1.3.2	Art. 23, Inciso I, alínea b		Fundos Multimercado Estruturado	0,00	0,00%	15,00%	---	0,00%	✓
1.3.3	Art. 23, Inciso I, alínea c		Fundos classificados como "Ações - Mercado de Acesso"	0,00	0,00%	15,00%	---	0,00%	✓
1.3.4	Art. 23, Inciso II		Certificado de Operações Estruturadas (COEs)	0,00	0,00%	10,00%	---	0,00%	✓
1.3.5			Outros	0,00	0,00%	10,00%			
1.4	Art. 24		SEGMENTO IMOBILIÁRIO	0,00	0,00%	20,00%	0,00%	0,00%	✓
1.4.1	Art. 24, Inciso I		Fundos Imobiliários e cotas de Fundos Imobiliários	0,00	0,00%	20,00%	---	0,00%	✓
1.4.2	Art. 24, Inciso II		Certificados de Recebíveis Imobiliários (CRIs)	0,00	0,00%	20,00%	---	0,00%	✓
1.4.3	Art. 24, Inciso III		Cédula de Crédito Imobiliários (CCIs)	0,00	0,00%	20,00%	---	0,00%	✓
1.4.4			Outros	0,00	0,00%				
1.4.5	Art. 36, inciso XIIIArt. 37, § 4° e § 5°		Imóveis	0,00	0,00%	20,00%	---		✓
1.5	Art. 25		SEGMENTO DE OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	0,00	0,00%	15,00%	0,00%	0,00%	✓
1.6	Art. 26		SEGMENTO EXTERIOR	0,00	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	✓
1.6.1	Art. 26, inciso I		Cotas de FIs e FICFIs classificados como "Dívida Externa" ou títulos da dívida pública mobiliária federal externa	0,00	0,00%	10,00%	---	0,00%	✓
1.6.2	Art. 26, inciso I		Cotas de fundos de índice do exterior negociados em bolsa do Brasil	0,00	0,00%	10,00%	---	0,00%	✓
1.6.3	Art. 26, inciso II		Fundos com sufixo "Investimentos no Exterior" que invistam no mínimo 67% em FIs no exterior	0,00	0,00%	10,00%	---	0,00%	✓
1.6.4	Art. 26, inciso III		Fundos com sufixo "Investimentos no Exterior" que invistam menos que 67% em FIs no exterior	0,00	0,00%	10,00%	---	0,00%	✓
1.6.5	Art. 26, inciso IV		BDRs classificados como nível I	0,00	0,00%	10,00%	---	0,00%	✓
1.6.6	Art. 26, inciso V		Demais ativos financeiros no exterior		0,00%				
Recursos Garantidores				27.565.533,55	100%				

As informações utilizadas na elaboração deste relatório foram obtidos através de consulta à instituição mencionada neste documento. Os valores apresentados derivam da análise desses dados, bem como da pesquisa em fontes públicas e da interpretação da legislação vigente. A I9Advisory isenta-se de qualquer responsabilidade quanto à utilização das informações contidas neste relatório para fins que não sejam exclusivamente informativos.

APLICAÇÃO DOS RECURSOS

Art. 27	LIMITES DE ALOCAÇÃO POR EMISSOR EM RELAÇÃO AO PLANO	Maior observado	Limite Legal	Limite PI	Status
Inciso I	Tesouro Nacional	90,55%	100,00%	100,00%	✓
Inciso II	Instituição Financeira Bancária	2,38%	20,00%	20,00%	✓
Inciso III	Demais Emissores	0,15%	10,00%	10,00%	✓

CMN N° 4.994	VEDAÇÕES	Status
Art. 36, Inciso I	Realizar operações de compra e venda, ou qualquer outra forma de troca de ativos entre planos de uma mesma EFPC	---
Art. 36, Inciso II	Realizar operações de crédito, inclusive com suas patrocinadoras, ressalvados os casos expressamente previstos no art. 25 da Resolução CMN n° 4.994	✓
Art. 36, Inciso III	Aplicar em ativos financeiros de emissão de pessoas físicas	✓
Art. 36, Inciso IV	Aplicar em ativos financeiros de emissão de sociedades limitadas, ressalvados os casos expressamente previstos na Resolução	✓
Art. 36, Inciso V	Aplicar em ações e demais ativos financeiros de emissão de sociedades por ações de capital fechado, ressalvados os casos expressamente previstos na Resolução	✓
Art. 36, Inciso VI	Realizar operações com ações fora de bolsa de valores ou mercado de balcão ¹	✓
Art. 36, Inciso VII, alínea a	Manter posições em mercados derivativos, diretamente ou por meio de Fundo de investimento a descoberto	✓
Art. 36, Inciso VII, alínea b	Manter posições em mercados derivativos, diretamente ou por meio de Fundo de investimento, que gere a possibilidade de perda superior ao PL ²	✓
Art. 36, Inciso VIII	Realizar Operações day trade, exceto as realizadas em plataformas eletrônicas ou em bolsa, justificadas em relatório atestado pelo AETQ ³	---
Art. 36, Inciso IX	Aplicar recursos no exterior por meio da carteira própria ou administrada	✓
Art. 36, Inciso X	Prestar fiança, aval, aceite ou coobrigar-se de qualquer forma	---
Art. 36, Inciso XI	Locar, emprestar, tomar emprestado, empenhar ou caucionar ativos financeiros ⁴	✓
Art. 36, Inciso XII	Atuar como incorporadora, de forma direta ou indireta	---
Art. 36, Inciso XIII	Adquirir terrenos e imóveis	---
Art. 18	Aplicar em ativos sem ISIN	✓
Art. 30	Fundos em desacordo com os limites de derivativos	✓

¹ Exceto nos casos de distribuição pública, exercício do direito de preferência, conversão de debêntures em ações, exercício do bônus de subscrição, casos que envolvam negociação de participação relevante conforme regulamentação da Previc e demais casos expressamente previstos na Resolução CMN n° 4.994;

² É verificado o regulamento dos fundos investidos, se possuem limite ou vedação para essa operação, contudo, o acompanhamento a nível de operações deve ser realizado pelo administrador do fundo;

³ Os arquivos disponíveis não possibilita a identificar se foi realizado operações de day trade. Tal conferência fica por responsabilidade do administrador do fundo;

⁴ Os arquivos disponíveis não possibilita a identificar os itens que possuem hífens no status. Tal conferência fica por responsabilidade do administrador do fundo;

⁵ Exceto por depósito de garantias em operações com derivativos no âmbito de cada plano de benefícios; operações de empréstimos de ativos financeiros, nos termos do art. 29; e depósito de garantias de ações judiciais no âmbito de cada plano administrado pela EFPC

As informações utilizadas na elaboração deste relatório foram obtidos através de consulta à instituição mencionada neste documento. Os valores apresentados derivam da análise desses dados, bem como da pesquisa em fontes públicas e da interpretação da legislação vigente. A I9Advisory isenta-se de qualquer responsabilidade quanto à utilização das informações contidas neste relatório para fins que não sejam exclusivamente informativos.

31/dez/24

Quadro Operações

31/dez/24

Total Ativos		27.545.694,40																			
Fundo / Carteira	Descrição	Tipo	Risco-Social	CNPJ	Qtd. Operado	Qtd. Garantia	Quantidade	Valor Informado	Valor Calculado	Data Compra	Vencimento	% Indexador	Cupon	Indexador	BON	Característica	Tem Caixa?	Duração (Dd)	Sector BGE	Sector 83	Rating
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	9.000,00	294.250,04	62,24	294.250,04	294.250,04	20/05/2024	15/08/2028	6,08%	6,08%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	1.400,00	0,00	2,25	9.465,88	9.465,88	20/05/2024	15/08/2028	6,08%	6,08%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	15,00	0,00	1,85	777,22	777,22	24/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,13%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	1.454,00	0,00	2,33	98.268,40	98.268,40	24/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,16%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTITO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	5,51	0,00	2,20	2.280,30	2.280,30	24/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,18%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	15,00	0,00	0,18	743,43	743,43	24/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,16%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	83,00	0,00	13,69	57.649,89	57.649,89	24/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,16%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	700,00	0,00	11,23	47.309,41	47.309,41	24/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,16%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	260,00	0,00	4,17	13.512,17	13.512,17	24/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,16%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	150,00	0,00	2,35	30.745,99	30.745,99	24/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,16%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	30,00	0,00	0,48	2.027,55	2.027,55	27/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,19%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	21,00	0,00	0,34	1.410,28	1.410,28	24/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,17%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	200,00	0,00	3,21	13.534,97	13.534,97	28/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,17%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	473,00	0,00	7,58	31.867,44	31.867,44	31/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,17%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	10,00	0,00	1,60	1.534,69	1.534,69	31/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,23%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	1.200,00	0,00	19,26	81.201,84	81.201,85	31/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,23%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	230,00	0,00	3,69	15.544,52	15.544,52	31/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,23%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	2,07	0,00	0,01	8.718,45	8.718,45	31/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,23%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	75,00	0,00	11,79	49.674,88	49.674,88	31/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,23%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	95,00	0,00	15,2	6.420,56	6.420,56	31/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,25%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	2.181,00	0,00	35,00	147.402,60	147.402,60	31/05/2024	15/08/2028	6,00%	6,23%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	115,00	0,00	1,85	7.772,26	7.772,26	06/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,27%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	40,00	0,00	7,41	31.291,88	31.291,88	06/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,27%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	430,00	0,00	7,04	29.665,76	29.666,76	07/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,24%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	178,00	0,00	2,86	12.030,11	12.030,11	07/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,24%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	10,00	0,00	1,60	1.678,49	1.678,49	10/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,30%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	6,37	0,00	0,01	2.156,24	2.156,24	10/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,30%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	15,00	0,00	1,38	1.284,11	1.284,11	20/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,39%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	2.660,00	0,00	42,69	179.775,75	179.775,75	11/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,40%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	405,00	0,00	6,50	27.373,27	27.373,27	13/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,54%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	6,20	0,00	0,01	2.935,12	2.935,12	13/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,54%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	1.000,00	0,00	6,07	67.584,67	67.584,67	19/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,51%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	10,00	0,00	1,60	1.758,49	1.758,49	19/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,51%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	50,00	0,00	0,80	3.379,24	3.379,24	19/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,51%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	230,00	0,00	3,69	15.544,52	15.544,52	20/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,51%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	1,00	0,00	0,01	8.741,24	8.741,24	20/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,17%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	85,00	0,00	1,36	5.744,71	5.744,71	24/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,37%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	26,00	0,00	0,42	1.757,21	1.757,21	24/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,37%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	20,00	0,00	0,32	1.351,70	1.351,70	24/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,37%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	15,00	0,00	0,25	1.284,11	1.284,11	24/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,37%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	15,00	0,00	0,05	202,75	202,75	24/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,37%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	39,00	0,00	0,63	2.635,81	2.635,81	24/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,37%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	17,00	0,00	0,27	1.148,94	1.148,94	24/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,37%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	26,00	0,00	0,42	1.757,21	1.757,21	24/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,37%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	51,00	0,00	0,84	3.712,17	3.712,17	24/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,37%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA-BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	NTRY N° 2024-08-15	Ti Público	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	00.394.460/0400-50	60,00	0,00	0,96	4.055,09	4.055,09	24/06/2024	15/08/2028	6,00%	6,37%	IPCA	INSTRUT/Nº400	N	✓	604,00	Administração pública em geral	NONE	NONE
F																					

31/dez/24

5

31/dez/24

Total Ativos					27.545.694,40																		
Fundo / Carteira		Tipo	Descrição	Razão Social	CNPJ	Qtde. Disponível	Qtde. Garantia	Quantidade	Valor Informado	Valor Calculado	Data Compra	Vencimento	% Indexador	Cupom	Indexador	ISIN	Característica	Compromissada	Tem Caixa?	Duration (DU)	Setor IBGE	Setor B3	Rating
A.BRASIL ESPECIAL 2028 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RF - RESP LIM		Caixa	Caixa					101,01	101,01	101,01							N		/				

Produto	Contraparte	Ratings do Emissor	Valor Calculado	Valor Informado
Caixa/Operações Compromissadas				
Compromissada	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL		0,00	0,00
CAIXA	CE-PREVCOM - PGA		0,00	0,00
CAIXA	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO		-138,90	-138,90
CAIXA	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2028 X TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA		-43,12	-43,12
CAIXA	CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RF - RESP LIMITADA		-74,86	-74,86
CAIXA	CAIXA BRASIL ESPECIAL 2028 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RF - RESP LIMITADA		-18,25	-18,25
Títulos Públicos				
LFT	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL		2.958.575,50	2.959.542,44
NTN-B	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL		21.877.470,64	21.877.470,16
LTN	SECRETARIA TESOIRO NACIONAL		122.300,80	122.300,80
Títulos Privados				
	BCO BRADESCO SA	AAA	271.168,87	272.300,47
	CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	AAA	655.977,62	655.709,49
	BCO CITIBANK SA	AAA	23.460,48	27.470,13
	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	AAA	121.110,96	121.198,86
	BCO ITAU SA	AAA	143.140,57	143.699,94
	BCO FIBRA SA	BBB	2.213,39	2.266,56
	BCO BTG PACTUAL SA	AAA	11.553,84	11.577,24
	BCO VOLKSWAGEN SA	AAA	59.722,14	59.773,42
	BCO GMAC SA	AAA	14.720,47	24.501,60
	BCO DAYCOVAL SA	AA	42.750,93	42.842,66
	BCO JOHN DEERE SA	AAA	2.842,16	2.363,54
	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	AAA	11.535,95	11.554,11
	BANCO AGIBANK S.A.	A	3.633,18	3.642,80
	BCO MERCANTIL BRASIL SA	A	3.616,97	3.607,07
	BCO CNH CAPITAL SA	AAA	27.021,47	27.099,84
	BCO ABC BRASIL SA	AAA	61.045,34	61.184,74
	BANCO VOTORANTIM S.A.	AA	104.626,59	105.066,54
	BCO SAFRA SA	AAA	100.420,40	100.777,42
	BCO RABOBANK INTERNATIONAL BRASIL SA	AAA	13.873,10	9.325,18
	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	AA	18.283,82	18.346,34
	BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	AA	17.956,19	17.969,69
	BANCO PACCAR S.A.	AAA	1.233,34	1.234,47
	BANCO XP S.A	AAA	30.499,27	30.539,15
	BANCO C6 CONSIGNADO S.A.	A	9.008,78	9.330,09
	BANCO SEGURO S.A.	AAA	5.826,42	5.835,74
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	AAA	14.983,35	14.854,98
	BCO BRASIL SA	AA	156.492,83	156.533,83
	BCO FIDIS INVEST SA (EX BCO FIAT SA)	AAA	31.133,24	31.152,09
	SCANIA BANCO S.A.	AAA	6.517,79	6.518,06

Produto	Contraparte	Ratings do Emissor	Valor Calculado	Valor Informado
	BANCO HSBC SA	AAA	9.193,26	9.132,52
	BANCO RCI BRASIL SA	AAA	3.140,50	3.138,17
	BANCO INDUSTRIAL BRASIL SA	AA	19.415,47	19.432,97
	NU FINANCEIRA S.A. SOCIEDADE DE CREDITO FINANCIAMENTO E INVESTIMENTO	AA	22.304,11	22.307,57
	GOLDMAN SACHS BRASIL BCO MULTIPLO	AAA	22.889,92	22.902,10
	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	AAA	50.525,83	40.993,51
	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	AA	216,37	216,38
	VAMOS LOCAÇAO DE CAMINHOS MAQUINAS E EQUIPAMENTOS S.A.	AA	4.634,52	4.634,52
	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	AAA	10.727,64	10.727,64
	LOJAS RENNER SA	AAA	3.578,09	3.578,09
	COSAN SA	AA	14.797,67	14.797,67
	MOVIDA PARTICIPACOES	AA	4.830,07	4.830,07
	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	AA	7.533,01	7.533,03
	HAPVIDA PARTICIPACOES INVESTIMENTO SA	AAA	18.695,28	18.695,28
	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	AAA	18.917,83	17.256,83
	SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	AAA	29.438,88	29.438,88
	LOCALIZA RENT A CAR SA	AAA	35.361,14	35.361,14
	LOCALIZA FLEET SA	AAA	4.533,15	4.533,15
	COPEL DISTRIBUICAO SA	AAA	6.828,18	6.828,18
	CIA ENERGETICA RIO GRANDE NORTE COSERN	AAA	15.265,95	15.301,57
	TELEFONICA BRASIL SA	AAA	14.100,08	14.100,08
	CIELO SA	AAA	16.795,81	25.370,49
	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	AAA	26.794,60	26.794,60
	VIBRA ENERGIA SA	AAA	21.233,41	21.233,40
	ENERGISA SA	AA	2.860,31	2.860,31
	CIA SIDERURGICA NACIONAL	AA	9.509,44	9.509,44
	CIA PAULISTA FORÇA LUZ	AAA	8.265,09	8.265,09
	EQUATORIAL PARÁ DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.	AA	992,36	992,36
	MRS LOGISTICA SA	AAA	1.544,97	1.544,97
	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	AA	14.905,62	14.905,61
	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	AAA	15.343,70	15.343,70
	TIM BRASIL SERVIÇOS E PARTICIPAÇÕES S.A.	AAA	20.160,97	20.160,98
	CIA ENERGETICA PERNAMBUCO CELPE	AAA	4.451,31	4.451,31
	ATACADAO SA	AAA	2.507,61	2.507,61
	YDUQS PARTICIPACOES SA	AAA	18.855,22	18.855,22
	ALGAR TELECOM SA	AAA	9.360,08	9.360,08
	RAIA DROGASIL SA	AAA	7.139,12	7.139,11
	ELEKTRO REDES S.A.	AAA	8.119,25	8.119,24
	B3 SA - BRASIL BOLSA BALCAO	AAA	9.604,38	9.604,38
	FLEURY SA	AAA	15.422,82	15.422,80
	SUZANO S.A.	AAA	8.881,39	8.881,39

Produto	Contraparte	Ratings do Emissor	Valor Calculado	Valor Informado
	EDP SAO PAULO DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A.	AAA	4.685,24	4.685,24
	NATURA COSMETICOS SA	AA	8.021,96	8.021,96
	TUPY SA	AAA	7.451,56	7.451,57
	UNIPAR CARBOCLORO SA	AA	18.075,40	18.075,38
	VOTORANTIM CIMENTOS SA	AAA	11.685,16	11.682,61
	REDE D OR SAO LUIZ SA	AAA	31.659,43	31.659,44
	GERDAU SA	AAA	0,00	8.047,63
	CHINA THREE GORGES BRASIL ENERGIA S.A.	AAA	0,00	1.533,94
FIDC/FIP/Cotas de Fundos				