



FUNPRECA

Fundo Previdenciário do Município de Casinhas

CARTEIRA PLANO PREVIDENCIÁRIO

Posição em 30/09/2024

Sumário

1. Posição de mercado dos ativos (dados qualitativos)	1
1.1. Estatísticas	2
1.2. Tabela de cotação e taxas	3
1.3. Composição por segmento	4
1.4. Composição por índice financeiro	4
1.5. Prazos de liquidação	5
1.6. Composição da carteira por regras	6
1.6.1. Resolução CMN N° 4.963, de 25 de novembro de 2021 - Política de Investimentos 2024	6
1.7. Volatilidade da carteira	7
2. Carteira	8
2.1. Posição dos ativos (dados quantitativos)	8
2.2. Rendimentos	9
2.3. Evolução mensal do patrimônio líquido	10
2.4. Rentabilidade x Meta mensal	11
2.5. Rentabilidade x Meta anual	12
2.6. Risco ponderado	14
2.7. Distribuição	15
2.7.1. Distribuição por administradores	15
2.7.2. Distribuição por gestores	16
2.8. Resumo por administrador / gestor	17
2.9. Política de investimentos e enquadramentos	18
2.9.1. Resolução CMN N° 4.963, de 25 de novembro de 2021 - Política de Investimentos 2024	18
2.10. Rating de gestores e administradores	19
2.10.1. Administradores	19
2.10.2. Gestores	20
3. Patrimônio, rentabilidade e metas por ano	21
3.1. Plano Previdenciário	21
4. Credenciamento de ativos	24
5. Credenciamento de pessoas jurídicas	25
6. Parecer	26
7. Disclaimer	35
8. Anexos	36
8.1. Conceitos e definições	36

Sumário

8.2. Operações 37



1. Posição de mercado dos ativos (dados qualitativos)

Carteira(s)	CNPJ	Nome completo	Artigo	Gestor	Administrador	Classe de risco
Fundos de investimento						
Plano Previdenciário	05.900.798/0001-41	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA DIVIDENDOS	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 8 I	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Alto
Plano Previdenciário	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF - M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Baixo
Plano Previdenciário	14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF - M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA LP - RESP LIMITADA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Médio
Plano Previdenciário	15.154.441/0001-15	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 8 I	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Alto
Plano Previdenciário	23.215.008/0001-70	CAIXA BRASIL MATRIZ FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESPONSABILIDADE LIMITADA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 III a	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Baixo
Plano Previdenciário	30.568.193/0001-42	BNB SOBERANO CLASSE DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A	Muito baixo
Plano Previdenciário	50.803.936/0001-29	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Muito baixo
Plano Previdenciário	63.375.216/0001-51	BNB SELEÇÃO CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - RESP LIMITADA	Resol. CMN N° 4.963, de 25 de novem. de 2021 - 8 I	BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A	Alto



1.1. Estatísticas

Carteira(s)	Nome completo	Índice	Retorno médio mensal	Menor retorno	Maior retorno	Qtde. mês positivo	Qtde. mês negativo	Qtde. mês acima do índice	Qtde. mês abaixo do índice
Plano Previdenciário	CAIXA BRASIL IRF - M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	IRF-M1	0,84%	0,58%	1,25%	12	0	0	0
Plano Previdenciário	CAIXA BRASIL IRF - M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA LP - RESP LIMITADA	IRF-M	0,40%	-1,69%	2,56%	8	4	0	0
Plano Previdenciário	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	IBOVESPA	-0,06%	-4,11%	5,73%	5	7	0	0
Plano Previdenciário	CAIXA BRASIL MATRIZ FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESPONSABILIDADE LIMITADA	CDI	0,91%	0,83%	1,10%	12	0	12	0
Plano Previdenciário	BNB SOBERANO CLASSE DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	CDI	0,90%	0,82%	1,07%	12	0	12	0
Plano Previdenciário	BNB SELEÇÃO CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - RESP LIMITADA	IBOVESPA	-0,05%	-3,47%	7,49%	4	8	0	0

* As estatísticas são baseadas na rentabilidade dos ativos no período de 01/10/2023 a 30/09/2024



1.2. Tabela de cotização e taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
10.740.670/0001-06 - CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	0,20%
14.508.605/0001-00 - CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA LP - RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	0,20%
15.154.441/0001-15 - FDO DE INV EM COTAS DE FDO DE INV EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	1,72%
23.215.008/0001-70 - CAIXA BRASIL MATRIZ FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	0,20%
30.568.193/0001-42 - BNB SOBERANO CLASSE DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	0,20%
63.375.216/0001-51 - BNB SELEÇÃO CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	2,00%

1.3. Composição por segmento

Segmento	Saldo	%	VsR 12 meses
Renda Fixa	27.674.754,49	88,11%	0,1128%
Renda Variável	3.636.569,42	11,58%	0,5624%
Investimentos no Exterior	0,00	0,00%	0,0000%
Investimentos Estruturados	0,00	0,00%	0,0000%
Fundos Imobiliários	0,00	0,00%	0,0000%
Empréstimos Consignados	0,00	0,00%	0,0000%
Disponibilidade financeira	98.260,32	0,31%	0,0000%
Total geral	31.409.584,23	100,00%	0,0965%

1.4. Composição por índice financeiro

Índice	Valor do saldo	%
CDI	21.368.098,67	68,03%
IBOVESPA	3.636.569,42	11,58%
IRF-M	1.517.726,60	4,83%
IRF-M1	4.788.929,22	15,25%
SCC	98.260,32	0,31%
Total geral	31.409.584,23	100,00%



1.5. Prazos de liquidação

Prazo	Renda Fixa	Renda Variável	Investimentos no Exterior	Investimentos Estruturados	Fundos Imobiliários	Empréstimos Consignados	Disponibilidade financeira	Total
Curto prazo	27.674.754,49	3.636.569,42	0	0	0	0	98.260,32	31.409.584,23
Médio prazo	0	0	0	0	0	0	0	0,00
Longo prazo	0	0	0	0	0	0	0	0,00
Total geral	27.674.754,49	3.636.569,42	0,00	0,00	0,00	0,00	98.260,32	31.409.584,23

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



1.6. Composição da carteira por regras

1.6.1. Resolução CMN N° 4.963, de 25 de novembro de 2021 - Política de Investimentos 2024

Artigo da resolução	Valor do saldo	%	VaR 12 meses
Artigo 7, Inciso I, Alínea b	21.362.110,58	68,01%	0,1037%
Artigo 7, Inciso III, Alínea a	6.312.643,91	20,10%	0,0091%
Artigo 8, Inciso I	3.636.569,42	11,58%	0,5624%
Artigo 26	98.260,32	0,31%	0,0000%
Total geral	31.409.584,23	100,00%	0,1688%



1.7. Volatilidade da carteira

Volatilidade	Valor do saldo	%
Muito baixo	15.153.715,08	48,25%
Baixo	11.101.573,13	35,34%
Médio	1.517.726,60	4,83%
Alto	3.636.569,42	11,58%
Total geral	31.409.584,23	100,00%

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

2. Carteira

2.1. Posição dos ativos (dados quantitativos)

Carteira(s)	CNPJ	Ativo	Valor do saldo	% PL RPPS	% PL Ativo	Rentabilidade mensal	Rentabilidade anual	VaR 12 meses	Volatilidade 12 meses
Fundos de investimento									
Plano Previdenciário	05.900.798/0001-41	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA DIVIDENDOS	0,00	0,00%	0,00%	-0,78%	3,31%	5,40%	11,38%
Plano Previdenciário	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF - M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	4.788.929,22	15,25%	0,06%	0,81%	7,10%	0,19%	0,41%
Plano Previdenciário	14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF - M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA LP - RESP LIMITADA	1.517.726,60	4,83%	0,10%	0,32%	3,70%	1,29%	2,71%
Plano Previdenciário	15.154.441/0001-15	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	983.891,10	3,13%	0,09%	-1,90%	3,18%	2,90%	6,10%
Plano Previdenciário	23.215.008/0001-70	CAIXA BRASIL MATRIZ FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESPONSABILIDADE LIMITADA	6.312.643,91	20,10%	0,11%	0,85%	8,08%	0,05%	0,10%
Plano Previdenciário	30.568.193/0001-42	BNB SOBERANO CLASSE DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	15.055.454,76	47,93%	0,36%	0,83%	7,97%	0,02%	0,05%
Plano Previdenciário	50.803.936/0001-29	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	0,00%	0,00%	0,58%	5,49%	0,02%	0,04%
Plano Previdenciário	63.375.216/0001-51	BNB SELEÇÃO CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - RESP LIMITADA	2.652.678,32	8,45%	3,72%	-3,30%	-1,46%	5,59%	11,76%
Disponibilidade financeira									
Plano Previdenciário	00.360.305/0001-04	CEF: Agência:1295 conta: 76 - 8	97.974,10	-	-	-	-	-	-
Plano Previdenciário	00.360.305/0001-04	CEF: Agência:1295 conta: 71020 - 0	286,22	-	-	-	-	-	-
Total geral			31.409.584,23	99,69%					



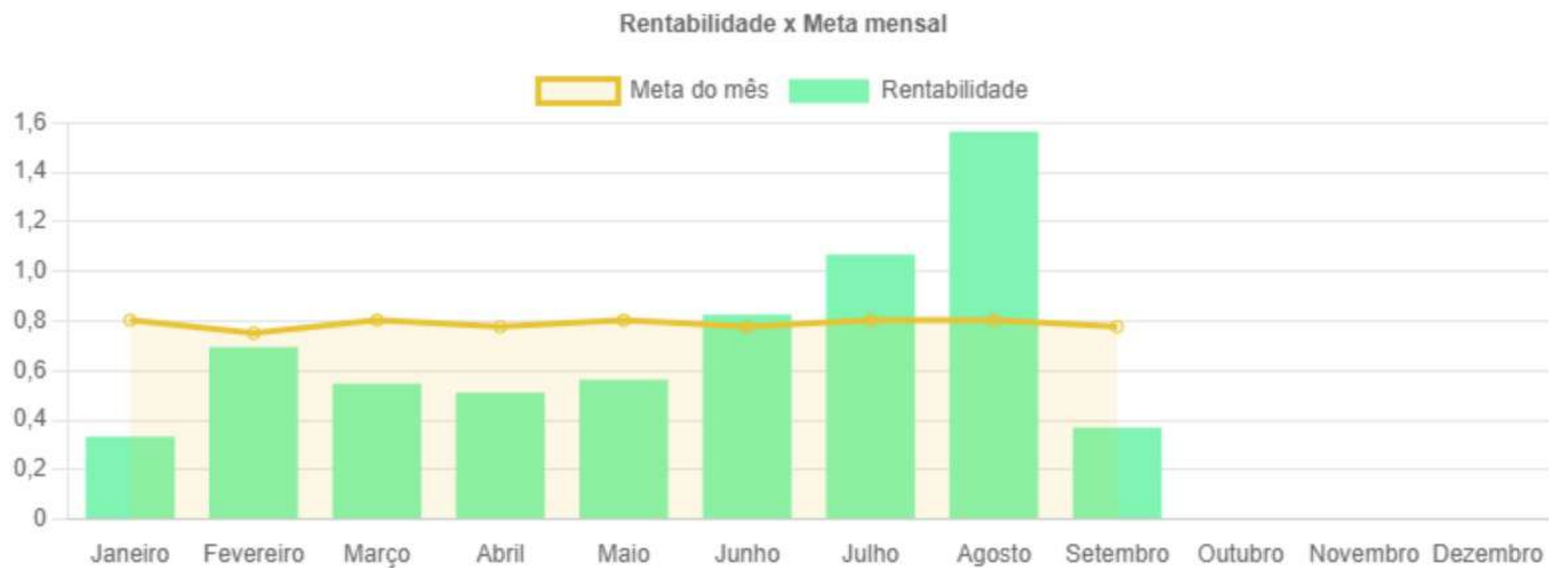
2.2. Rendimentos

Data do movimento	Saldo anterior	Aplicação/Entrada	Resgate/Saída	Retorno do mês	Saldo final	Rentabilidade do mês
31/01/2024	29.223.259,73	0,00	206.000,00	91.513,79	29.501.465,95	0,33%
29/02/2024	29.501.465,95	383.500,00	79.000,00	201.772,24	29.621.168,47	0,69%
31/03/2024	29.621.168,47	390.518,35	327.000,00	160.076,53	29.842.883,32	0,55%
30/04/2024	29.842.883,32	382.755,75	390.000,00	150.277,93	29.983.043,92	0,51%
31/05/2024	29.983.043,92	375.000,00	351.000,00	167.017,82	30.178.261,80	0,56%
30/06/2024	30.178.261,80	370.900,00	360.000,00	248.071,60	30.436.991,36	0,83%
31/07/2024	30.436.991,36	1.500.000,00	1.500.000,00	320.356,67	30.752.416,54	1,07%
31/08/2024	30.752.416,54	379.413,44	384.100,00	468.136,34	31.221.936,17	1,56%
30/09/2024	31.221.936,17	7.278.000,00	7.298.465,89	116.319,61	31.409.584,23	0,37%
Total geral		11.060.087,54	10.895.565,89	1.923.542,53		

2.3. Evolução mensal do patrimônio líquido

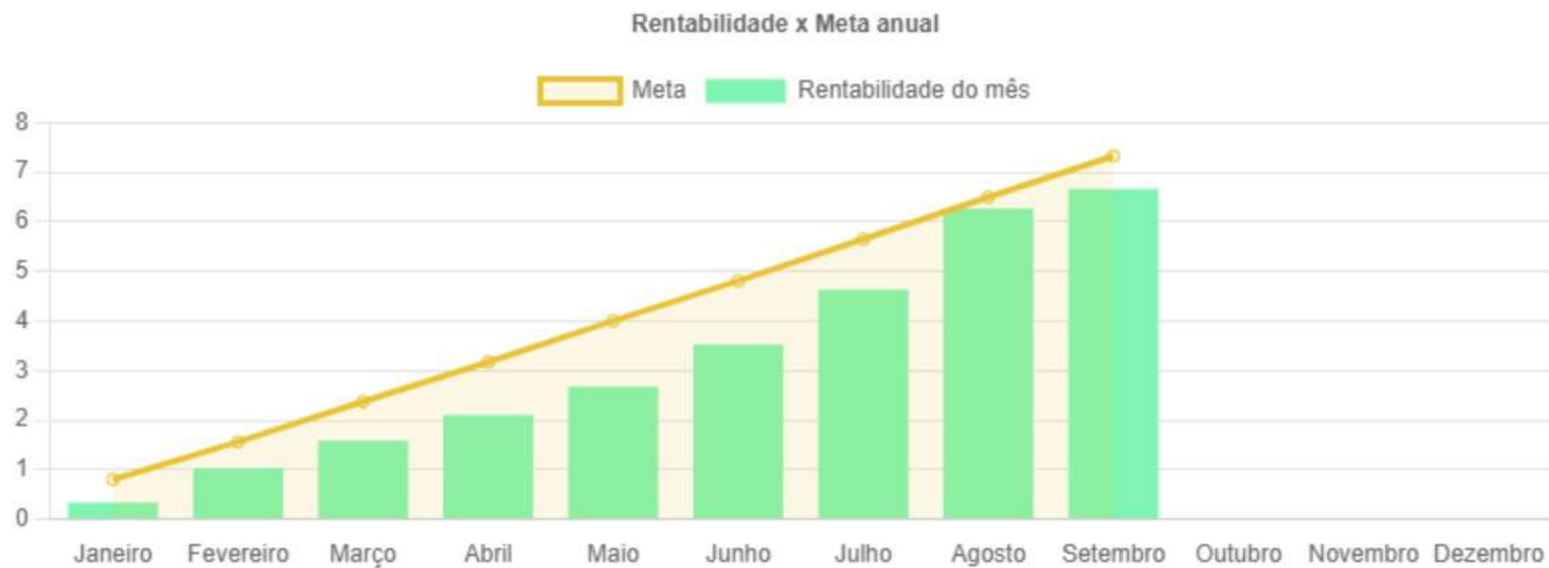


2.4. Rentabilidade x Meta mensal



* A projeção da meta é feita pela taxa de juros (9,91%).

2.5. Rentabilidade x Meta anual



* A projeção da meta é feita pela taxa de juros (9,91%).



Mês	Meta mensal	Rentabilidade mensal	Alcance para a meta mensal	Meta acumulada anual	Rentabilidade acumulada anual
Janeiro	0,80%	0,33%	📉 -0,47%	0,80%	0,33%
Fevereiro	0,75%	0,69%	📉 -0,06%	1,56%	1,03%
Março	0,80%	0,55%	📉 -0,26%	2,38%	1,58%
Abril	0,78%	0,51%	📉 -0,27%	3,17%	2,10%
Maio	0,80%	0,56%	📉 -0,24%	4,00%	2,68%
Junho	0,78%	0,83%	📈 0,05%	4,81%	3,53%
Julho	0,80%	1,07%	📈 0,26%	5,65%	4,63%
Agosto	0,80%	1,56%	📈 0,76%	6,50%	6,27%
Setembro	0,78%	0,37%	📉 -0,41%	7,33%	6,66%

* A projeção da meta é feita pela taxa de juros (9,91%).

2.6. Risco ponderado



Data	Índice	Risco
31/01/2024	1,7188	Baixo
29/02/2024	1,2471	Baixo
31/03/2024	1,7466	Baixo
30/04/2024	1,2366	Baixo
31/05/2024	1,7353	Baixo
30/06/2024	1,7376	Baixo
31/07/2024	1,7896	Baixo
31/08/2024	1,7924	Baixo
30/09/2024	1,2823	Baixo

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



2.7. Distribuição

2.7.1. Distribuição por administradores

CNPJ	Nome	Saldo na carteira	% da carteira	Total ANBIMA sob administração	Valor do investimento em RPPS do administrador	Percentual proporcional do segmento de RPPS sobre o patrimônio do administrador	Máximo permitido no segmento de RPPS
Fundos de investimento							
62.318.407/0001-19	 S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	17.708.133,08	56,38%	441.407.710.292,84	5.553.893.444,55	1,26%	50,00%
Total		17.708.133,08	56,38%				
Disponibilidade financeira							
00.360.305/0001-04	 CAIXA ECONOMICA FEDERAL	13.701.451,15	43,62%	641.984.807.960,00	73.774.538.510,00	11,49%	50,00%
Total		13.701.451,15	43,62%				
Total geral		31.409.584,23	100,00%				

2.7.2. Distribuição por gestores

CNPJ	Nome	Saldo na carteira	% da carteira	Total ANBIMA sob gestão	Saldo na carteira sobre o total sob gestão (%)	Máximo permitido na carteira
Disponibilidade financeira						
00.360.305/0001-04	 CAIXA ECONOMICA FEDERAL	98.260,32	0,31%	30.275.246.595,97	0,00%	5,00%
Total		98.260,32	0,31%			
Fundos de investimento						
07.237.373/0001-20	 BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	17.708.133,08	56,38%	16.204.814.759,39	0,11%	5,00%
42.040.639/0001-40	 CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	13.603.190,83	43,31%	515.436.033.268,24	0,00%	5,00%
Total		31.311.323,91	99,69%			
Total geral		31.409.584,23	100,00%			

2.8. Resumo por administrador / gestor

Administrador	Gestores	Valor	% Carteira
 62.318.407/0001-19 - S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	 07.237.373/0001-20 - BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S.A.	17.708.133,08	56,38%
 00.360.305/0001-04 - CAIXA ECONOMICA FEDERAL	 00.360.305/0001-04 - CAIXA ECONOMICA FEDERAL	98.260,32	0,31%
	 42.040.639/0001-40 - CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	13.603.190,83	43,31%
Total		31.409.584,23	100,00%

2.9. Política de investimentos e enquadramentos

2.9.1. Resolução CMN N° 4.963, de 25 de novembro de 2021 - Política de Investimentos 2024

Descrição	Artigo	Aplicado \$	Resolução CMN N° 4.963, de 25 de novembro de 2021	Política de Investimentos 2024			Resultado				
			Limite	Limite inferior	Estratégia alvo	Limite superior	Posição atual da carteira	Diferença do limite superior	Situação	Disponível para aplicar	
Renda Fixa											
Fundo/Classe de Investimento - 100% Títulos Públicos SELIC	Artigo 7, Inciso I, Alínea b	21.362.110,58	100,00%		50,00%	88,00%	100,00%	68,01%	31,99%	Enquadrado	-
Fundo/Classe de Investimento em Renda Fixa - Geral	Artigo 7, Inciso III, Alínea a	6.312.643,91	60,00%		0,00%	0,00%	60,00%	20,10%	39,90%	Enquadrado	12.533.106,63
Total em renda fixa		27.674.754,49						88,11%			
Renda Variável											
Fundo/Classe de Investimento em Ações	Artigo 8, Inciso I	3.636.569,42	30,00%		5,00%	12,00%	20,00%	11,58%	8,42%	Enquadrado	2.645.347,43
Total em renda variável		3.636.569,42						11,58%			
Disponibilidade financeira											
Do Segmento de Disponibilidade Financeira	Artigo 26	98.260,32	0,00%					0,31%	-	Enquadrado	-
Total em disponibilidade financeira		98.260,32						0,31%			
Total		31.409.584,23						100,00%			

2.10. Rating de gestores e administradores

2.10.1. Administradores

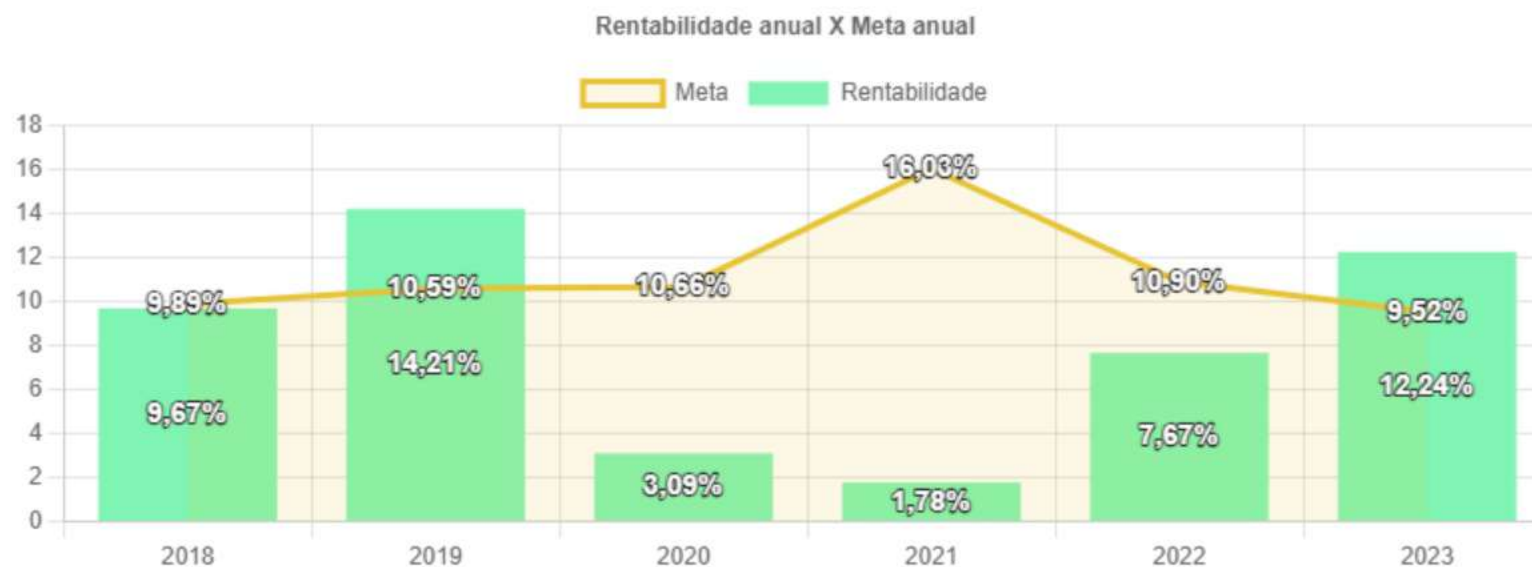
CNPJ	Nome	Descrição	Nota	Descrição	Data de aprovação	Data de vencimento	Valor do saldo
62.318.407/0001-19	 S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A	Moody's	MQ1	Excelente	09/01/2025	09/01/2026	18.325.448,49
00.360.305/0001-04	 CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Fitch	Exc.	Excelente	08/08/2024	08/08/2025	14.413.073,82

2.10.2. Gestores

CNPJ		Nome	Descrição	Nota	Descrição	Data de aprovação	Data de vencimento	Valor do saldo
00.360.305/0001-04		CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Fitch	Exc.	Excelente	08/08/2024	08/08/2025	144.702,53
07.237.373/0001-20		BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	Fitch	For	Forte	20/03/2024	20/03/2025	18.325.448,49
42.040.639/0001-40		CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	Fitch	Exc.	Excelente	08/08/2024	08/08/2025	14.268.371,29

3. Patrimônio, rentabilidade e metas por ano

3.1. Plano Previdenciário





Ano	Patrimônio	Meta	Rentabilidade	% Atingimento
2018	14.991.456,04	9,89%	9,67%	-0,22%
2019	17.646.699,39	10,59%	14,21%	3,62%
2020	18.896.056,01	10,66%	3,09%	-7,57%
2021	20.789.280,74	16,03%	1,78%	-14,25%
2022	23.419.651,94	10,90%	7,67%	-3,23%
2023	29.223.259,73	9,52%	12,24%	2,72%

Evolução do patrimônio





4. Credenciamento de ativos

Nome completo	Descrição	Data de solicitação	Data de aprovação	Data de vencimento
BNB SOBERANO CLASSE DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	Atualização do credenciamento	04/03/2024	01/04/2024	31/03/2026
BNB SELEÇÃO CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - RESP LIMITADA	Atualização do credenciamento	04/03/2024	01/04/2024	31/03/2026
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA DIVIDENDOS	Atualização do credenciamento	04/03/2024	01/04/2024	31/03/2026
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	credenciamento	01/06/2024	01/06/2024	01/06/2026
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA LP - RESP LIMITADA	CREDENCIAMENTO PARA VIABILIZAR OS LANÇAMENTOS.	01/06/2024	01/06/2024	01/06/2026
FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	Trata-se de credenciamento apenas para permitir dois registros de aplicação que ocorreu no mês de agosto. No entanto, as aplicações não foram autorizadas pelo RPPS. Partiu de uma decisão unilateral da Instituição 104-Caixa, conforme ofício nº 002/2024 SEG CARUARU, emitido pela Superintendência Executiva Governo Caruaru da Caixa, em 03/09/2024.	20/08/2024	20/08/2024	20/08/2026
CAIXA BRASIL MATRIZ FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESPONSABILIDADE LIMITADA	Credenciamento	04/09/2024	04/09/2024	04/09/2026
FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	Credenciamento	25/06/2024	25/06/2024	25/06/2026



5. Credenciamento de pessoas jurídicas

Nome	Descrição	Data de solicitação	Data de aprovação	Data de vencimento
CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	Atualização do credenciamento	10/02/2024	01/03/2024	28/02/2026
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	Atualização do credenciamento	10/02/2024	18/03/2024	17/03/2026
S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A	Atualização do credenciamento	10/02/2024	18/03/2024	17/03/2026
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	Atualização do credenciamento	10/02/2024	18/03/2024	17/03/2026

6. Parecer

Parecer NUI CONSULTORIA EMPRESARIAL LTDA

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Casinhas / PE

 GRUPO NUI

José Marcos Alves de Barros
Consultor de investimentos

1. PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

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

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

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

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

1- Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)

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

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

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

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

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

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

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

5- Renda Fixa Crédito Privado

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

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

6- Fundo de Ações CVM e ETF RV CVM

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

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

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

8- Fundo de Ações – BDR Nível I

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

9- Fundos Multimercados

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

ASSINATURAS DO COMITÊ/CONSELHO DELIBERATIVO

2. PARECER DO CONSELHO FISCAL

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

ASSINATURAS DO CONSELHO FISCAL

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

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

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

4. CENÁRIOS

1. Resumo de Mercado

Em setembro, o cenário global permanece marcado pela incerteza, com o Federal Reserve dos EUA mantendo cortes graduais de juros em 0,25 p.p., projetando uma taxa final de 3,5%. A economia chinesa continua a receber estímulos, embora enfrente desafios estruturais, impactando os preços das commodities. No Brasil, o crescimento do PIB para 2024 permanece em 3,1%, com uma desaceleração esperada para 1,8% em 2025, devido ao aperto das condições monetárias. A inflação, revisada para 4,6% em 2024, é pressionada pela alta da energia elétrica e pelo câmbio mais depreciado.

2. Panorama Brasil

O Brasil continua mostrando crescimento robusto em 2024, impulsionado pelo aumento da renda e do crédito, com previsão de crescimento do PIB em 3,1%. O mercado de trabalho está em uma posição favorável, com a taxa de desemprego caindo para 6,5%, o menor nível desde 2012. Contudo, os desafios fiscais persistem, com a dívida pública projetada para crescer nos próximos anos, atingindo 82,4% do PIB até o fim de 2025. As pressões inflacionárias, devido à baixa ociosidade econômica e problemas climáticos, têm elevado as projeções do IPCA. O governo está a caminho de atingir a meta fiscal em 2024, com um déficit primário de 0,6% do PIB, impulsionado por receitas extraordinárias, como dividendos estatais e tributos sobre apostas online. No entanto, o cenário fiscal para 2025 é mais incerto, com a necessidade de novas fontes de arrecadação.

3. Panorama Internacional

No cenário internacional, o Fed iniciou cortes de juros em 2024, com previsão de novos cortes moderados. A China continua a enfrentar dificuldades para acelerar o crescimento, mesmo com pacotes de estímulo. O aumento da demanda por commodities, em especial metais, e as tensões geopolíticas no Oriente Médio, são fatores que continuam a impactar os preços globais. Na América Latina, a expectativa de juros mais baixos nos EUA favorece a recuperação das moedas da região, embora a incerteza global permaneça um desafio significativo para os mercados emergentes.

4. Impactos nos Mercados de Renda Fixa

O mercado de renda fixa brasileiro continua atrativo, com a Selic projetada para atingir 12% ao final de 2024. A inflação controlada e o aperto nas condições monetárias tornam os títulos prefixados e indexados ao IPCA uma boa oportunidade para quem busca proteção contra a inflação e retornos reais atrativos. Além disso, títulos corporativos de baixo risco também são recomendados, dado o crescimento econômico sustentado.

5. Impactos nos Mercados de Renda Variável

No mercado de renda variável, a volatilidade permanece, especialmente devido ao cenário fiscal incerto e às pressões inflacionárias. No entanto, setores como consumo e construção civil continuam a se beneficiar do aumento da renda e do crédito. Exportadoras de commodities, como petróleo e minérios, também são boas apostas, dada a valorização dos preços das commodities impulsionada pela demanda global. Entretanto, os investidores devem ser cautelosos, pois a volatilidade global e os desafios fiscais podem afetar o desempenho das empresas listadas na bolsa.

6. Impactos nos Mercados de Investimentos no Exterior

Os mercados internacionais enfrentam um cenário de juros em queda nos EUA e recuperação gradual das moedas emergentes. A desvalorização do dólar pode abrir oportunidades em ativos ligados ao consumo e tecnologia nos EUA. Além disso, o aumento da demanda por commodities na China favorece os exportadores de metais e outros produtos ligados ao ciclo de crescimento do país.

5. ATA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Ata do Comitê/Conselho Deliberativo

Data:

6. ATA DO CONSELHO FISCAL

Ata do Conselho Fiscal

Data:



7. Disclaimer

Esse relatório é parte integrante do software



Versão 1.54.1816 - 07/03/2025 - 11/03/2025 14:59:32

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



8. Anexos

8.1. Conceitos e definições

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

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

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

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

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

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

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

8.2. Operações

Plano Previdenciário

Número da APR	Data da operação	Tipo de operação	Valor	CNPJ do ativo	Nome do ativo	Valor da cota	Quantidade de cotas	PL do ativo
-	30/09/2024	Aplicação	270.000,00	23.215.008/0001-70	CAIXA BRASIL MATRIZ FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESPONSABILIDADE LIMITADA	2.09795200	128696.93872882	5.910.577.806,47
-	30/09/2024	Aplicação	8.000,00	23.215.008/0001-70	CAIXA BRASIL MATRIZ FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESPONSABILIDADE LIMITADA	2.09795200	3813.24262900	5.910.577.806,47
-	18/09/2024	Aplicação	1.000.000,00	15.154.441/0001-15	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	2.76374906	361827.35056272	1.083.406.263,60
-	11/09/2024	Resgate	918.771,99	05.900.798/0001-41	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA DIVIDENDOS	5.35845400	171462.14001277	255.658.894,18
-	10/09/2024	Aplicação	6.000.000,00	23.215.008/0001-70	CAIXA BRASIL MATRIZ FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESPONSABILIDADE LIMITADA	2.08590800	2876445.17399617	6.018.233.640,48
-	10/09/2024	Resgate	6.000.000,00	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	3.61266100	1660825.63517584	8.273.518.071,45
-	03/09/2024	Resgate	379.693,90	50.803.936/0001-29	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.10054500	345005.33826422	18.561.103.217,18
-	30/08/2024	Aplicação	109.413,44	50.803.936/0001-29	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.09994700	99471.55635681	18.622.961.489,58
-	29/08/2024	Aplicação	270.000,00	50.803.936/0001-29	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.09964500	245533.78590363	20.015.815.964,23
-	16/08/2024	Resgate	384.100,00	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	3.58865400	107031.77291542	8.165.049.627,61
-	30/07/2024	Aplicação	1.500.000,00	14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA LP - RESP LIMITADA	2.98585100	502369.34126988	1.813.104.950,35
-	30/07/2024	Resgate	1.130.000,00	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	3.57225500	316326.80197802	8.037.705.093,90
-	16/07/2024	Resgate	370.000,00	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	3.56399600	103816.05366560	8.092.092.704,77
-	28/06/2024	Aplicação	370.900,00	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	3.54102800	104743.59423309	7.877.165.450,51
-	19/06/2024	Resgate	360.000,00	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	3.53186600	101929.12188628	8.299.587.970,52
-	29/05/2024	Aplicação	375.000,00	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	3.51762200	106606.11060540	8.545.367.085,32



Número da APR	Data da operação	Tipo de operação	Valor	CNPJ do ativo	Nome do ativo	Valor da cota	Quantidade de cotas	PL do ativo
-	21/05/2024	Resgate	351.000,00	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	3.51104200	99970.32220065	8.777.091.547,62
-	30/04/2024	Aplicação	382.755,75	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	3.49306100	109576.02801669	8.588.764.215,21
-	22/04/2024	Resgate	390.000,00	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	3.48572900	111884.77360116	8.893.454.252,81
-	27/03/2024	Aplicação	390.518,35	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	3.47148200	112493.26656454	8.602.334.771,44
-	22/03/2024	Resgate	327.000,00	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	3.46744900	94305.64083279	9.011.170.211,57
-	29/02/2024	Aplicação	383.500,00	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	3.44532400	111310.28605728	8.662.829.991,66
-	23/02/2024	Resgate	79.000,00	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	3.43929600	22969.81707884	8.967.155.116,67
-	26/01/2024	Resgate	206.000,00	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	3.41594800	60305.36764611	8.687.990.785,06