

GRUPO



Soluções Inteligentes para RPS



Documento Assinado Digitalmente por: LUCIANO ELPIDIO COSTA
cesse em: <https://etce.icepe.tc.br/epv/validaDoc.seam?codigo=2811703-0a6e-4f41-8f8a-febb916d911b>



MACHADOSPREV

Secretaria de Previdência Social

MACHADOS - PE

MACHADOSPREV

Regime Próprio de Previdência do Município de Machado

CARTEIRA PLANO PREVIDENCIÁRIO

Posição em 30/06/2024

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	9
2.4. Rentabilidade x Meta mensal	10
2.5. Rentabilidade x Meta anual	10
2.6. Risco ponderado	11
2.7. Distribuição	11
2.7.1. Distribuição por administradores	11
2.7.2. Distribuição por gestores	12
2.8. Resumo por administrador / gestor	12
2.9. Política de investimentos e enquadramentos	13
2.9.1. Resolução CMN N° 4.963, de 25 de novembro de 2021 - Política de Investimentos 2024	13
2.10. Rating de gestores e administradores	14
2.10.1. Administradores	14
2.10.2. Gestores	15
3. Patrimônio, rentabilidade e metas por ano	16
3.1. Plano Previdenciário	16
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

Documento Assinado Digitalmente por: LUCIANO ELPIDIO COSTA
Acesse em: <https://eic.cei.cepe.ic.br/epv/validaDoc.shtm> Código do documento: 6117b7d3-08a4741-818a-eb910d911b

Sumário

8.2. Operações



Documento Assinado Digitalmente por: LUCIANO ELPIDIO COSTA
Acesse em: <https://etce.icepe.tc.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 8117b7d3-0afa-4f41-818a-febb916d911b

1. Posição de mercado dos ativos (dados qualitativos)

Carteira(s)	CNPJ	Nome completo	Artigo	Gestor	Administrador	Classe de risco
Fundos de investimento						
Plano Previdenciário	03.543.447/0001-03	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA - B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	Resol. CMN Nº 4.963. de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	Médio
Plano Previdenciário	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA - B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Resol. CMN Nº 4.963. de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	Alto
Plano Previdenciário	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	Resol. CMN Nº 4.963. de 25 de novem. de 2021 - 7 III a	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	Muito baixo
Plano Previdenciário	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Resol. CMN Nº 4.963. de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	Médio
Plano Previdenciário	15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	Resol. CMN Nº 4.963. de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	Médio
Plano Previdenciário	30.568.193/0001-42	BNB SOBERANO CLASSE DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	Resol. CMN Nº 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	35.292.588/0001-89	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	Resol. CMN Nº 4.963. de 25 de novem. de 2021 - 7 I b	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	Médio
Plano Previdenciário	35.292.597/0001-70	BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO	Resol. CMN Nº 4.963. de 25 de novem. de 2021 - 10 I	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM 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	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA - B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	IMA-B5	0,69%	-0,28%	1,86%	10	2	0	0
Plano Previdenciário	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA - B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IMA-B	0,15%	-2,62%	2,47%	7	5	0	0
Plano Previdenciário	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	CDI	0,82%	0,75%	0,99%	12	0	12	0
Plano Previdenciário	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	IDKA IPCA 2A	0,71%	-0,26%	1,92%	10	2	0	0
Plano Previdenciário	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	IPCA + Taxa	0,88%	0,80%	1,06%	12	0	0	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	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	IPCA + Taxa	0,75%	0,17%	1,21%	12	0	0	0
Plano Previdenciário	BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO	CDI	0,53%	-0,69%	1,33%	10	2	10	0

* As estatísticas são baseadas na rentabilidade dos ativos no período de 01/07/2023 a 30/06/2024

1.2. Tabela de cotação e taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
03.543.447/0001-03 - BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	0,20%
07.442.078/0001-05 - BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	0,20%
13.077.415/0001-05 - BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	1,00%
13.322.205/0001-35 - BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	0,20%
15.486.093/0001-83 - BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	0,15%
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%
35.292.588/0001-89 - BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00%	0,00%
35.292.597/0001-70 - BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO	D+1	D+1	D+1	D+1	0,00%	0,00%

1.3. Composição por segmento

Segmento	Saldo	%	VaR 12 meses
Renda Fixa	10.836.224,92	93,62%	0,5494%
Renda Variável	0,00	0,00%	0,0000%
Investimentos no Exterior	0,00	0,00%	0,0000%
Investimentos Estruturados	737.876,95	6,38%	0,0537%
Fundos Imobiliários	0,00	0,00%	0,0000%
Empréstimos Consignados	0,00	0,00%	0,0000%
Disponibilidade financeira	0,00	0,00%	0,0000%
Total geral	11.574.101,87	100,00%	0,0862%

1.4. Composição por índice financeiro

Índice	Valor do saldo	%
CDI	3.483.719,74	30,10%
IMA-B	1.390.475,86	12,01%
IMA-B5	650.443,34	5,62%
IDKA IPCA 2A	2.776.709,63	23,99%
IPCA + Taxa	3.272.753,30	28,28%
Total geral	11.574.101,87	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	9.622.310,11	0	0	737.876,95	0	0	0	10.360.187,06
Médio prazo	1.213.914,81	0	0	0	0	0	0	1.213.914,81
Longo prazo	0	0	0	0	0	0	0	0,00
Total geral	10.836.224,92	0,00	0,00	737.876,95	0,00	0,00	0,00	11.574.101,87

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

1.6. Composição da carteira por regras

1.6.1. Resolução CMN Nº 4.963, de 25 de novembro de 2021 - Política de Investimentos 2024

Artigo da resolução	Valor do saldo	%	VaR 12 meses
Artigo 7, Inciso I, Alínea b	9.919.314,24	85,70%	0,5470%
Artigo 7, Inciso III, Alínea a	916.910,68	7,92%	0,0024%
Artigo 10, Inciso I	737.876,95	6,38%	0,0537%
Total geral	11.574.101,87	100,00%	0,2010%



1.7. Volatilidade da carteira

Volatilidade	Valor do saldo	%
Muito baixo	2.745.842,79	23,72%
Médio	6.699.906,27	57,89%
Alto	2.128.352,81	18,39%
Total geral	11.574.101,87	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
<i>Fundos de investimento</i>									
Plano Previdenciário	03.543.447/0001-03	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA - B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	650.443,34	5,62%	0,01%	0,37%	3,20%	0,82%	1,74%
Plano Previdenciário	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA - B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	1.390.475,86	12,01%	0,03%	-0,99%	-1,23%	1,84%	3,87%
Plano Previdenciário	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	916.910,68	7,92%	0,02%	0,71%	4,71%	0,03%	0,06%
Plano Previdenciário	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	2.776.709,63	23,99%	0,05%	0,26%	3,11%	0,81%	1,71%
Plano Previdenciário	15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	563.471,47	4,87%	1,23%	0,77%	5,10%	0,03%	0,07%
Plano Previdenciário	30.568.193/0001-42	BNB SOBERANO CLASSE DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - RESP LIMITADA	1.828.932,11	15,80%	0,05%	0,79%	5,19%	0,04%	0,08%
Plano Previdenciário	35.292.588/0001-89	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	2.709.281,83	23,41%	0,04%	0,38%	3,84%	0,33%	0,70%
Plano Previdenciário	35.292.597/0001-70	BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO	737.876,95	6,38%	0,70%	0,21%	2,19%	0,84%	1,77%
Total geral			11.574.101,87	100,00%					

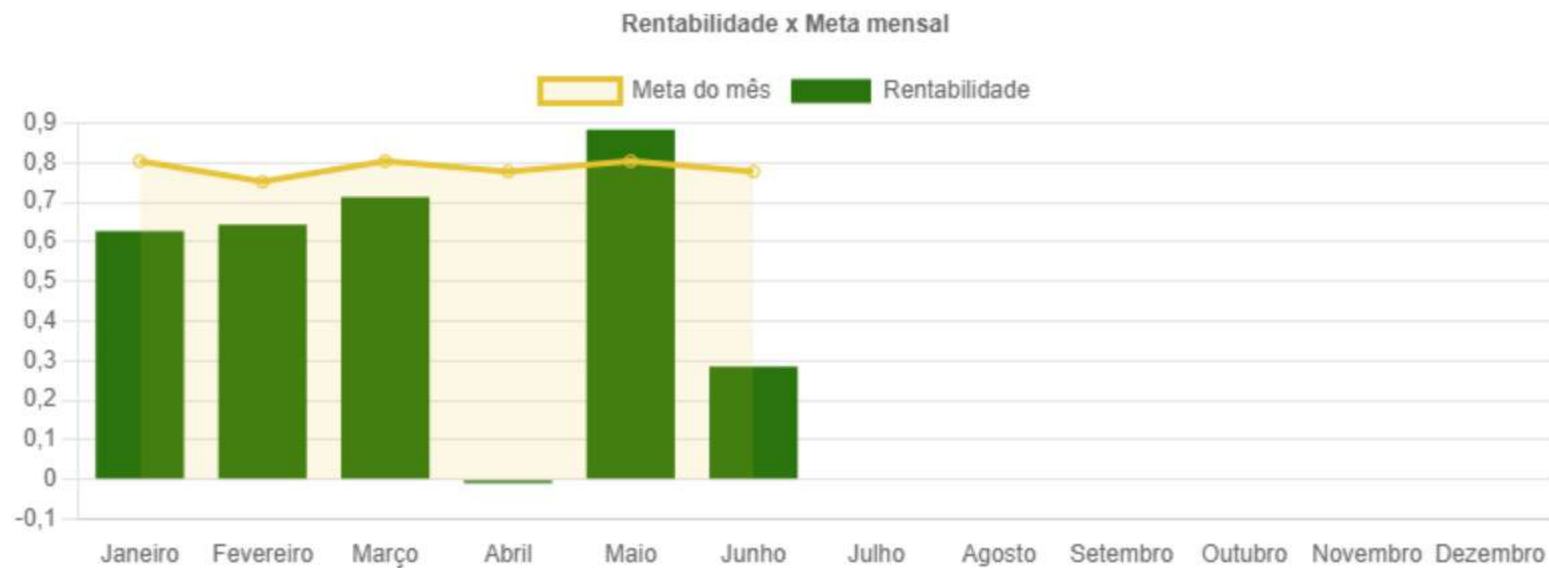
2.2. Rendimentos

Data do movimento	Saldo anterior	Aplicação/Entrada	Resgate/Saída	Retorno do mês	Saldo final	Rentabilidade do mês
31/01/2024	10.436.269,84	423.811,50	449.653,36	66.271,50	10.476.699,48	0,63%
29/02/2024	10.476.699,48	785.440,33	329.194,22	68.940,09	11.001.885,68	0,64%
31/03/2024	11.001.885,68	463.331,43	477.592,81	78.541,83	11.066.166,13	0,71%
30/04/2024	11.066.166,13	454.803,55	559.518,22	-1.036,81	10.960.414,65	-0,01%
31/05/2024	10.960.414,65	840.073,23	514.983,42	97.873,62	11.383.378,08	0,88%
30/06/2024	11.383.378,08	647.287,38	489.142,45	32.578,86	11.574.101,87	0,29%
Total geral		3.614.747,42	2.820.084,48	343.169,09		

2.3. Evolução mensal do patrimônio líquido

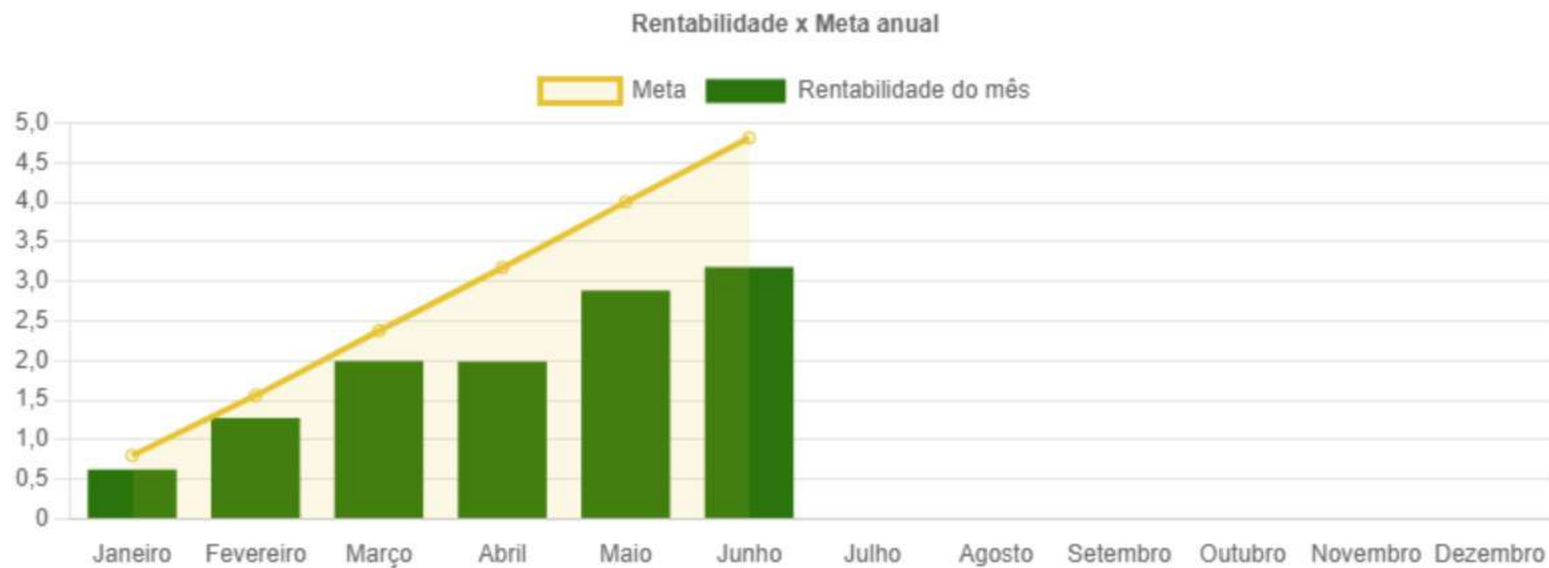


2.4. Rentabilidade x Meta mensal



* 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%	0,63%	📉 -0,18%	0,80%	0,63%
Fevereiro	0,75%	0,64%	📉 -0,11%	1,56%	1,27%
Março	0,80%	0,71%	📉 -0,09%	2,38%	2,00%
Abril	0,78%	-0,01%	📉 -0,79%	3,17%	1,99%
Maio	0,80%	0,88%	📈 0,08%	4,00%	2,89%
Junho	0,78%	0,29%	📉 -0,49%	4,81%	3,18%

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

2.6. Risco ponderado



Data	Índice	Risco
31/01/2024	2.8331	Médio
29/02/2024	2.6472	Médio
31/03/2024	2.7767	Médio
30/04/2024	2.6841	Médio
31/05/2024	2.5674	Médio
30/06/2024	2.7094	Médio

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 TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A	1.828.932,11	15,80%	344.096.272.103,98	5.553.893.444,55	1,61%	50,00%
30.822.936/0001-69	 BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	9.745.169,76	84,20%	1.613.742.567.000,00	90.489.156.000,00	5,61%	50,00%
Total		11.574.101,87	100,00%				
Total geral		11.574.101,87	100,00%				

2.7.2. Distribuição por gestores

CNPJ	Nome	Saldo na carteira	% da carteira	Total ANBIMA sob gestão	Saldo na carteira sobre o total sob gestão (%)	Máximo permitido na carteira
Fundos de investimento						
30.822.936/0001-69	 BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	9.745.169,76	84,20%	1.610.066.821.663,80	0,00%	5,00%
07.237.373/0001-20	 BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	1.828.932,11	15,80%	14.949.447.526,97	0,01%	5,00%
Total		11.574.101,87	100,00%			
Total geral		11.574.101,87	100,00%			

2.8. Resumo por administrador / gestor

Administrador	Gestores	Valor	% Carteira
 62.318.407/0001-19 - S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A	 07.237.373/0001-20 - BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	1.828.932,11	15,80%
 30.822.936/0001-69 - BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	 30.822.936/0001-69 - BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	9.745.169,76	84,20%
Total		11.574.101,87	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	9.919.314,24	100,00%	60,00%	70,00%	100,00%	85,70%	14,30%	Enquadrado	-	
Fundo/Classe de Investimento em Renda Fixa - Geral	Artigo 7, Inciso III, Alínea a	916.910,68	60,00%	20,00%	20,00%	60,00%	7,92%	52,08%	Desenquadrado	6.027.550,44	
Total em renda fixa		10.836.224,92					93,62%				
Investimentos Estruturados											
Fundo/Classe de Investimento Multimercado FIM	Artigo 10, Inciso I	737.876,95	10,00%	10,00%	10,00%	10,00%	6,38%	3,62%	Desenquadrado	419.533,24	
Total em investimentos estruturados		737.876,95					6,38%				
Total		11.574.101,87					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 sal
62.318.407/0001-19		S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A	Moodys	MQ1	Excelente	09/01/2025	09/01/2026	1.968.863
30.822.936/0001-69		BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	Fitch	Exc.	Excelente	14/11/2024	14/11/2025	10.196.129

2.10.2. Gestores

CNPJ		Nome	Descrição	Nota	Descrição	Data de aprovação	Data de vencimento	Valor do saldo
30.822.936/0001-69		BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	Fitch	Exc.	Excelente	14/11/2024	14/11/2025	10.196.129,8
07.237.373/0001-20		BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	Fitch	For	Forte	20/03/2024	20/03/2025	1.968.863,9

3. Patrimônio, rentabilidade e metas por ano

3.1. Plano Previdenciário



Ano	Patrimônio	Meta	Rentabilidade	% Atingimento
2018	6.597.578,07	9,89%	10,12%	0,23%
2019	6.775.030,58	10,59%	0,01%	-10,58%
2020	7.853.865,33	9,90%	0,01%	-9,89%
2021	8.084.597,87	16,39%	0,01%	-16,38%
2022	10.056.622,88	10,84%	0,01%	-10,83%
2023	10.436.269,86	9,84%	0,01%	-9,83%





4. Credenciamento de ativos

Nome completo	Descrição	Data de solicitação	Data de aprovação	Data de vencimento
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO	Atualização do credenciamento	04/03/2024	04/03/2024	03/03/2026
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	Atualização do credenciamento	20/03/2024	01/04/2024	31/03/2026
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Atualização do credenciamento	20/03/2024	01/04/2024	31/03/2026
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO	Atualização do credenciamento	20/03/2024	01/04/2024	31/03/2026
BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	Atualização do credenciamento	20/03/2024	01/04/2024	31/03/2026
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	Atualização do credenciamento	01/04/2024	01/04/2024	31/03/2026
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	Atualização do credenciamento	01/04/2024	01/04/2024	31/03/2026

5. Credenciamento de pessoas jurídicas

Nome	Descrição	Data de solicitação	Data de aprovação	Data de vencimento
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	Atualização do credenciamento	10/02/2024	01/03/2024	28/02/2026
BANCO DO BRASIL S.A.	Atualização do credenciamento	10/02/2024	01/03/2024	28/02/2026

Documento Assinado Digitalmente por: LUCIANO ELPIDIO COSTA
Acesse em: <https://etce.icepe.tc.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 8117b7d3-0afa-4f41-818a-feb916d911b

6. Parecer

Parecer NUI CONSULTORIA EMPRESARIAL LTDA

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Machados / 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 de 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

O mês de junho é marcado pela crescente incerteza econômica global e local. Nos EUA, o Federal Reserve continua a manter a possibilidade de cortes de juros, com expectativas agora para dezembro, mas ainda há desafios inflacionários que podem adiar o ciclo de flexibilização. No Brasil, o real se desvalorizou 13% no acumulado do ano e as perspectivas de inflação aumentaram devido à combinação de um câmbio mais fraco e à alta dos preços do petróleo. O cenário fiscal doméstico continua a pressionar a economia, com um déficit primário estimado em 0,5% do PIB para 2024.

2. Panorama Brasil

O crescimento econômico do Brasil permanece resiliente, com o PIB projetado para crescer 2,2% em 2024. O mercado de trabalho segue aquecido, com a taxa de desemprego atingindo o menor nível desde 2014 (7% em maio), o que impulsiona o consumo interno. No entanto, a depreciação do real, combinada com a alta dos preços das commodities, especialmente do petróleo, está gerando pressão inflacionária. A projeção do IPCA foi elevada para 3,8% em 2024. O déficit primário do governo central deve atingir 0,5% do PIB em 2024, com despesas obrigatórias crescendo acima das expectativas, o que aumenta a pressão sobre o arcabouço fiscal. A política monetária restritiva mantém a taxa Selic estável em 10,50% até o final de 2025.

3. Panorama Internacional

No cenário global, o Fed dos EUA continua monitorando os indicadores econômicos, com uma possível redução nas taxas de juros sendo adiada para o final do ano. As preocupações com a inflação nos serviços e o mercado de trabalho ainda apertado são os principais obstáculos para uma flexibilização mais rápida da política monetária. Na Europa, o Banco Central Europeu (BCE) manteve uma política monetária restritiva, mas sinaliza possíveis cortes no futuro próximo, dependendo da evolução da inflação. Já na China, o crescimento econômico continua a depender de estímulos, com desafios no setor imobiliário e uma demanda interna fraca.

4. Impactos nos Mercados de Renda Fixa

O mercado de renda fixa no Brasil continua a oferecer oportunidades, especialmente com a Selic mantida em níveis elevados. Títulos prefixados e indexados ao IPCA permanecem atrativos, proporcionando proteção contra a inflação e boas taxas de retorno real. Com a desvalorização do real e as incertezas fiscais, os prêmios de risco nos títulos de dívida também aumentaram, o que pode beneficiar investidores que buscam retornos maiores.

5. Impactos nos Mercados de Renda Variável

O mercado de renda variável enfrenta volatilidade devido à combinação de incertezas fiscais e a desvalorização do real. Setores ligados ao consumo interno, como varejo e construção civil, podem continuar a se beneficiar do mercado de trabalho aquecido e do aumento da renda das famílias. Entretanto, a alta dos preços das commodities, especialmente do petróleo, favorece as exportadoras brasileiras de commodities, como as do setor de mineração e energia. Apesar disso, a cautela é recomendada devido ao risco cambial e à volatilidade do cenário externo, que podem impactar negativamente os mercados acionários no curto prazo.

6. Impactos nos Mercados de Investimentos no Exterior

Os mercados internacionais enfrentam incertezas com o adiamento do ciclo de cortes de juros nos EUA, e o fortalecimento do dólar tem pressionado moedas emergentes, como o real. A depreciação do real em relação ao dólar aumentou o prêmio de risco sobre os ativos brasileiros, criando um cenário desafiador para investidores com exposição internacional. Setores de tecnologia e consumo nos EUA, além de commodities em mercados emergentes, são áreas promissoras para diversificação, uma vez que a flexibilização monetária nos EUA, embora lenta, pode favorecer esses setores nos próximos meses.

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 - 12/03/2025 18:42:46

© 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
-	28/06/2024	Aplicação	31.707,42	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.84695609	11137.30559856	5.048.562.747,1
-	27/06/2024	Aplicação	53.169,46	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.84595353	18682.47651957	4.917.971.406,3
-	26/06/2024	Aplicação	174.465,19	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.84497060	61324.07484281	6.257.963.617,0
-	25/06/2024	Resgate	64.139,74	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.84392743	22553.22668342	5.587.587.598,2
-	21/06/2024	Resgate	10.435,72	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.84191144	3672.07783224	5.007.747.470,0
-	20/06/2024	Aplicação	6.237,73	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.84091930	2195.67306963	5.090.675.854,2
-	19/06/2024	Resgate	409.566,99	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.83992734	144217.41860480	5.395.809.564,6
-	18/06/2024	Resgate	5.000,00	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.83890519	1761.24233300	5.270.137.962,3
-	13/06/2024	Aplicação	16.269,50	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.83588415	5737.01150662	4.732.908.187,2
-	12/06/2024	Aplicação	12.354,26	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.83491080	4357.90078474	4.664.826.501,0
-	10/06/2024	Aplicação	262.257,16	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.83289032	92575.82552649	4.552.626.802,6
-	04/06/2024	Aplicação	90.826,66	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.82890883	32106.60557060	4.283.715.910,6
-	31/05/2024	Resgate	74.093,10	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.82685594	26210.42655608	4.168.595.178,5
-	29/05/2024	Aplicação	184.788,39	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.82588723	65391.28243982	4.168.906.297,44
-	28/05/2024	Aplicação	156.433,96	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.82489622	55376.88743836	6.305.003.763,18
-	27/05/2024	Aplicação	147.097,83	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.82388364	52090.61305373	5.721.779.193,47

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
-	20/05/2024	Resgate	20.709,24	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.81897459	7346.37342013	4.649.834.259,4
-	17/05/2024	Resgate	410.181,08	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.81797747	145558.67971507	7.563.557.485,4
-	16/05/2024	Resgate	5.000,00	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.81699379	1774.94178999	4.785.328.629,9
-	15/05/2024	Resgate	5.000,00	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.81600743	1775.56349700	4.868.840.934,7
-	14/05/2024	Aplicação	2.215,46	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.81500997	787.01675078	4.402.947.099,4
-	10/05/2024	Aplicação	255.837,43	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.81303969	90946.96776212	4.415.992.726,7
-	09/05/2024	Aplicação	3.518,56	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.81202142	1251.25647158	4.416.898.196,3
-	07/05/2024	Aplicação	89.372,61	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.81002420	31804.92538107	4.181.668.367,6
-	06/05/2024	Aplicação	808,99	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.80902603	287.99661924	4.223.769.378,5
-	30/04/2024	Aplicação	183.440,81	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.80594245	65375.82764750	4.150.521.759,6
-	29/04/2024	Resgate	62.033,92	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.80492790	22116.04797400	4.490.524.166,6
-	25/04/2024	Resgate	10.000,00	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.80292234	3567.70498322	5.572.937.016,9
-	23/04/2024	Aplicação	20.955,25	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.80088691	7481.64801841	4.563.671.898,2
-	19/04/2024	Resgate	33.927,81	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.79887006	12121.96681971	4.556.326.768,9
-	18/04/2024	Resgate	442.454,77	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.79785928	158140.46587790	4.840.784.638,8
-	16/04/2024	Aplicação	85.158,84	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.79582520	30459.28622433	4.396.010.136,7
-	15/04/2024	Resgate	2.000,00	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.79481750	715.61023215	4.367.509.433,19
-	10/04/2024	Aplicação	165.248,65	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.79176513	59191.45855941	4.265.613.541,93
-	08/04/2024	Resgate	9.101,72	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.78975523	3262.55146047	4.380.590.338,15

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
-	28/03/2024	Aplicação	180.402,80	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.78369391	64806.98159806	4.354.660.093,33
-	27/03/2024	Resgate	70.845,68	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.78269495	25459.37706898	4.604.776.072,11
-	20/03/2024	Aplicação	58.519,96	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.77763396	21068.27639737	5.313.589.894,88
-	19/03/2024	Resgate	399.747,13	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.77658259	143970.91281913	4.801.541.617,41
-	15/03/2024	Resgate	6.000,00	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.77447768	2162.56920834	4.711.791.962,71
-	08/03/2024	Aplicação	212.584,47	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.76921905	76766.93904009	4.644.136.426,11
-	05/03/2024	Aplicação	11.824,20	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.76607308	4274.72436845	4.221.716.747,61
-	04/03/2024	Resgate	1.000,00	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.76502321	361.66061695	4.175.242.720,21
-	29/02/2024	Aplicação	99.697,06	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.76285129	36084.84479814	4.488.445.035,81
-	26/02/2024	Aplicação	1.197,80	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.75969593	434.03332482	6.103.009.953,81
-	21/02/2024	Aplicação	2.920,77	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.75649053	1059.59732791	4.696.952.772,51
-	20/02/2024	Resgate	7.469,92	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.75550626	2710.90656132	4.483.379.106,11
-	19/02/2024	Resgate	310.574,30	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.75444582	112753.82428833	7.976.665.705,71
-	16/02/2024	Aplicação	38.755,73	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.75342120	14075.48180424	4.517.099.631,51
-	15/02/2024	Aplicação	142.933,64	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.75237242	51931.06825275	4.484.142.968,81
-	09/02/2024	Aplicação	477.935,07	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.75025359	173778.54599946	4.107.266.812,31
-	08/02/2024	Resgate	10.500,00	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.74919057	3819.30598576	4.139.544.295,96
-	07/02/2024	Aplicação	22.000,26	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.74814133	8005.50530638	4.189.805.458,08
-	05/02/2024	Resgate	650,00	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.74606574	236.70227210	4.052.307.225,12

Documento Assinado Digitalmente por: LUCIANO ELPIDIO COSTA
Acesse em: <https://receipecp.c.b/epv/validaDoc.aspx?CodigoDoDocumento=8117b7d3-0afa-4141-818a-febb916d911b>

Número da APR	Data da operação	Tipo de operação	Valor	CNPJ do ativo	Nome do ativo	Valor da cota	Quantidade de cotas	PL do ativo
-	31/01/2024	Resgate	4.500,00	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.74289352	1640.60324150	4.198.417.498,2
-	30/01/2024	Resgate	33.900,93	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.74180836	12364.44183867	4.130.943.227,5
-	25/01/2024	Resgate	11.000,00	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.73860663	4016.64111943	4.332.230.010,8
-	19/01/2024	Aplicação	2.301,97	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.73424965	841.90190899	4.225.758.964,3
-	18/01/2024	Resgate	400.252,43	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.73315688	146443.26965966	4.262.694.760,7
-	16/01/2024	Aplicação	124.265,25	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.73096968	45502.24446285	4.313.632.797,7
-	15/01/2024	Aplicação	42.789,13	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.72987104	15674.41442216	4.272.580.404,7
-	10/01/2024	Aplicação	144.572,09	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.72660021	53022.84121808	4.183.424.550,8
-	04/01/2024	Aplicação	85.222,81	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.72232896	31305.11090034	4.054.273.867,4
-	03/01/2024	Aplicação	24.660,25	13.077.415/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RENDA FIXA SIMPLES FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2.72116060	9062.40153558	3.946.592.299,9