



# Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.cfp-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b62-a222-ea3d40112fc3



Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

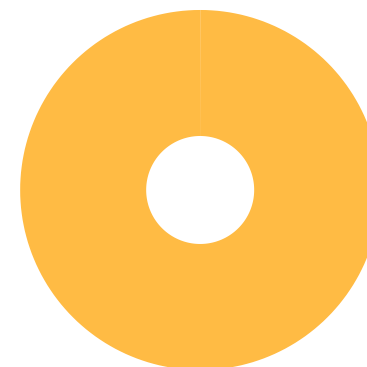
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.943.324,31	81,23%	1.212	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	4.060,51	0,17%	168.776	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	229.981,05	9,61%	763	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	214.955,06	8,99%	576	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>2.392.320,93</b>				

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/ep/validarDoc?seam=Código+do+documento:+b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3>



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2021)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	100,00%	2.392.320,93
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.943.324,31	81,23%	40,00%	70,00%	100,00%	448.996,62
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	2.392.320,93
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	119.616,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.435.392,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.435.392,56
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	448.996,62	18,77%	0,00%	8,00%	40,00%	507.931,75
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	956.928,37
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	478.464,19
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	358.848,14
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	358.848,14
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	119.616,05
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	119.616,05
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	119.616,05
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>2.392.320,93</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>85,00%</b>	<b>570,00%</b>	



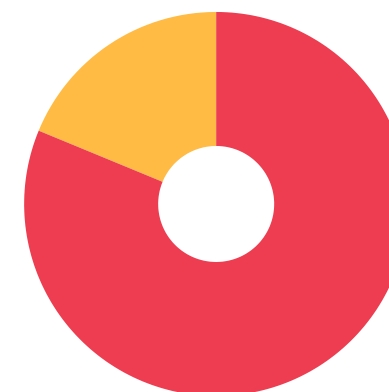
RENDA FIXA 2.392.320,93



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2021)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	717.696,28
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	717.696,28
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	20,00%	478.464,19
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	478.464,19
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	239.232,09
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	119.616,05
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	119.616,05
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>12,00%</b>	<b>120,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	239.232,09
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	239.232,09
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	239.232,09
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>3,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b 7º IV a

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3



**Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2021)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.392.320,93	100,00	0,00

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	40,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Documento Assinado Digitalmente por ZENEDILSON DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://www.tcepe.gov.br/gpp/validador/ocorrencia/assinatura/00944030-1234-4902-2222-222222222222>



**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA FIXA**

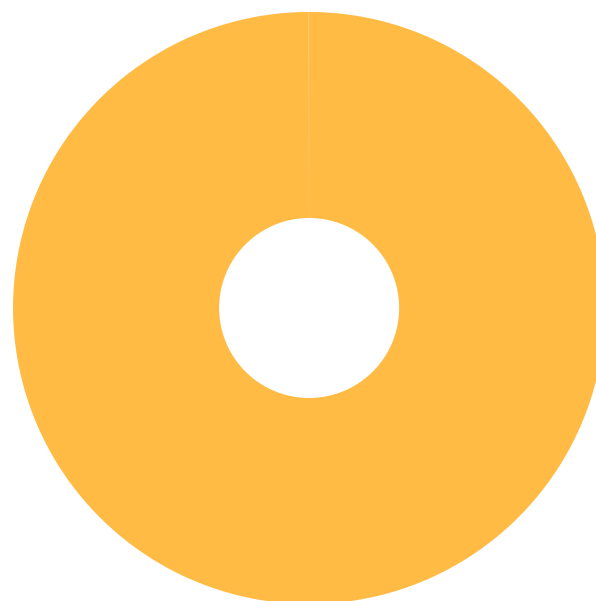
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,04%	0,04%	0,58%	1,02%	3,43%	10,27%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,03%	0,03%	0,54%	0,79%	3,07%	9,59%	0,15%	0,01%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,08%	0,08%	0,24%	0,37%	1,43%	6,15%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,17%	0,17%	0,58%	0,94%	2,21%	7,89%	0,03%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,01%	0,03%	0,06%	0,39%	2,37%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2021)



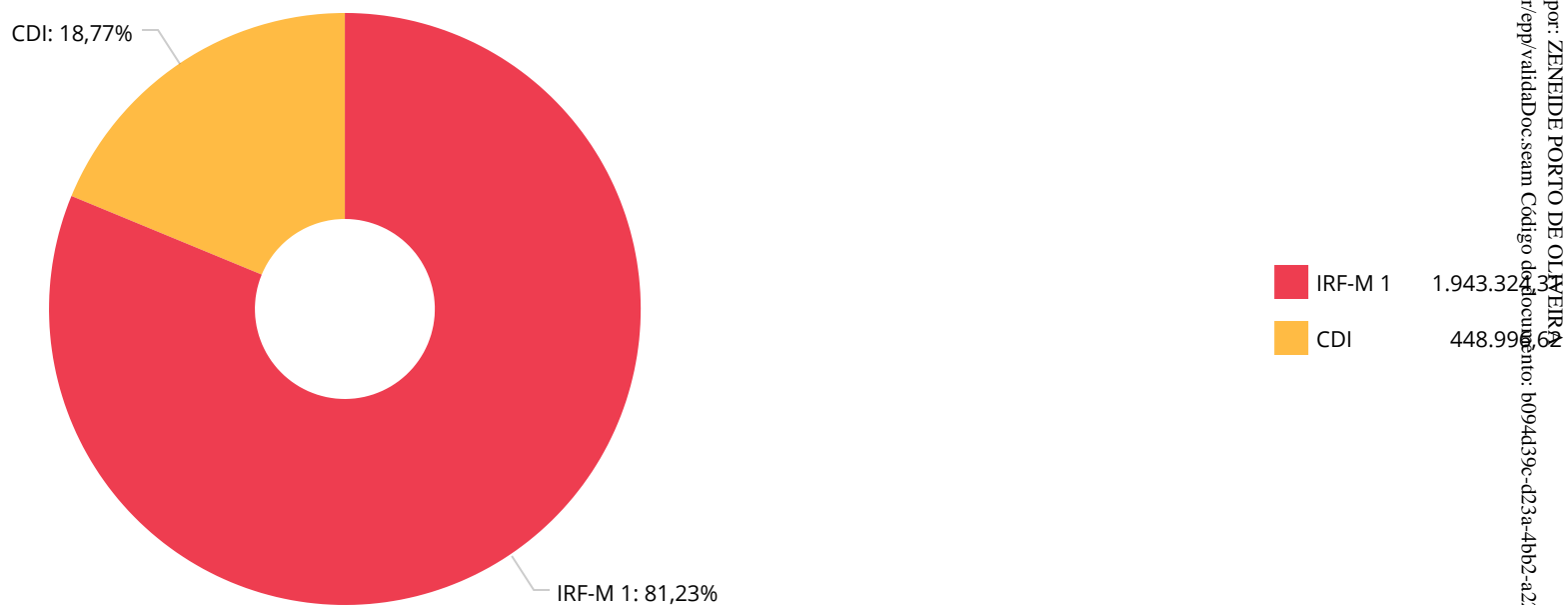
BB GESTÃO: 100,00%

BB GESTÃO 2.392.322,99

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2021)



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3

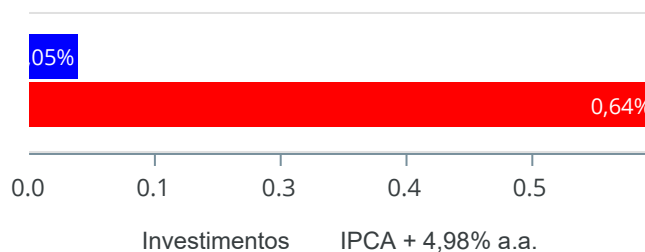




**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V.R.
Janeiro	2.395.758,04	3.020,40	7.606,77	2.392.320,93	1.149,26	1.149,26	0,05%	0,05%	0,64%	0,64%	7,53%	0,

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://pccs.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Investimentos     Meta de Rentabilidade     CDI     IMA-B

IMA-B 5     IMA-B 5+     IMA Geral     IRF-M     IRF-M 1

IRF-M 1+     Ibovespa     IBX     SMLL     IDIV

Investimentos     Meta de Rentabilidade     CDI     IMA-B

IMA-B 5

IMA-B 5+     IMA Geral     IRF-M     IRF-M 1     IRF-M 1+

Ibovespa     IBX     SMLL     IDIV

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d40112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	214.600,67	0,00	0,00	214.955,06	354,39	0,17%	0,17%	0,03
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	235.565,31	0,00	5.768,77	229.981,05	184,51	0,08%	0,08%	0,01
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.942.714,14	0,00	0,00	1.943.324,31	610,17	0,03%	0,03%	0,15
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	2.877,92	3.020,40	1.838,00	4.060,51	0,19	0,00%	0,01%	0,00
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>2.395.758,04</b>	<b>3.020,40</b>	<b>7.606,77</b>	<b>2.392.320,93</b>	<b>1.149,26</b>	<b>0,05%</b>		<b>0,13</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinatura em: https://seccosge.ges.br/sgp/validaDoc.seam Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Variável	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assine em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas em investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe à consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qual/Doc.seam?CodigoDocumento=09459-4234-222-ea340126c3>

# Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.cei-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4fb2-a222-ea3d40112fc3



Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

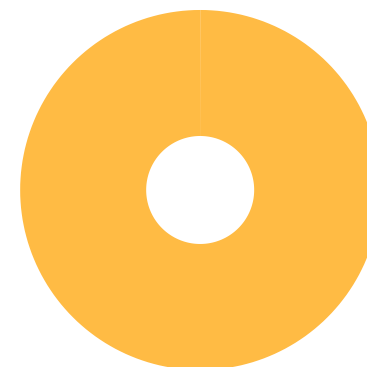
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.703.396,42	70,59%	1.211	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' a
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	5.200,57	0,22%	169.056	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	489.296,12	20,28%	778	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	215.159,98	8,92%	572	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>2.413.053,09</b>				

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/vvalidaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Fevereiro / 2021)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	100,00%	2.413.053,09
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.703.396,42	70,59%	40,00%	70,00%	100,00%	709.656,67
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	2.413.053,09
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	120.652,65
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.447.831,85
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.447.831,85
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	709.656,67	29,41%	0,00%	8,00%	40,00%	255.564,57
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	965.221,24
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	482.610,62
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	361.957,96
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	361.957,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	120.652,65
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	120.652,65
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	120.652,65
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>2.413.053,09</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>85,00%</b>	<b>570,00%</b>	



RENDA FIXA 2.413.053,09

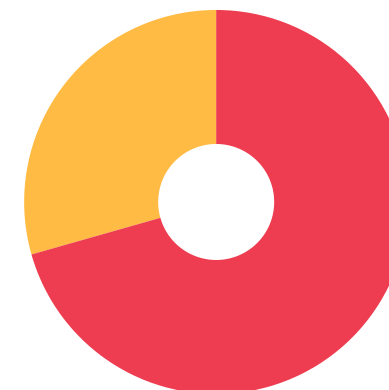




**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 2021)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	723.915,93
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	723.915,93
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	20,00%	482.610,62
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	482.610,62
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	241.305,31
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	120.652,65
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	120.652,65
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>12,00%</b>	<b>120,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	241.305,31
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	241.305,31
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	241.305,31
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>3,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b 7º IV a

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3



**Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2021)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.413.053,09	100,00	-

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	40,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Documento Assinado Digitalmente por ZENEDILSON DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://www.tcepe.gov.br/gpp/validador/ocorrencia/assinatura/00944030-1234-4902-2222-222222222222>



**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2021 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,04%	0,08%	0,39%	0,94%	3,08%	9,80%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,04%	0,35%	0,70%	2,71%	9,12%	0,10%	0,01%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,13%	0,28%	0,45%	0,92%	2,36%	8,07%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,05%	0,13%	0,23%	0,34%	1,26%	5,77%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,10%	0,26%	0,51%	0,86%	2,03%	7,47%	0,02%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,02%	0,03%	0,06%	0,32%	2,20%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3



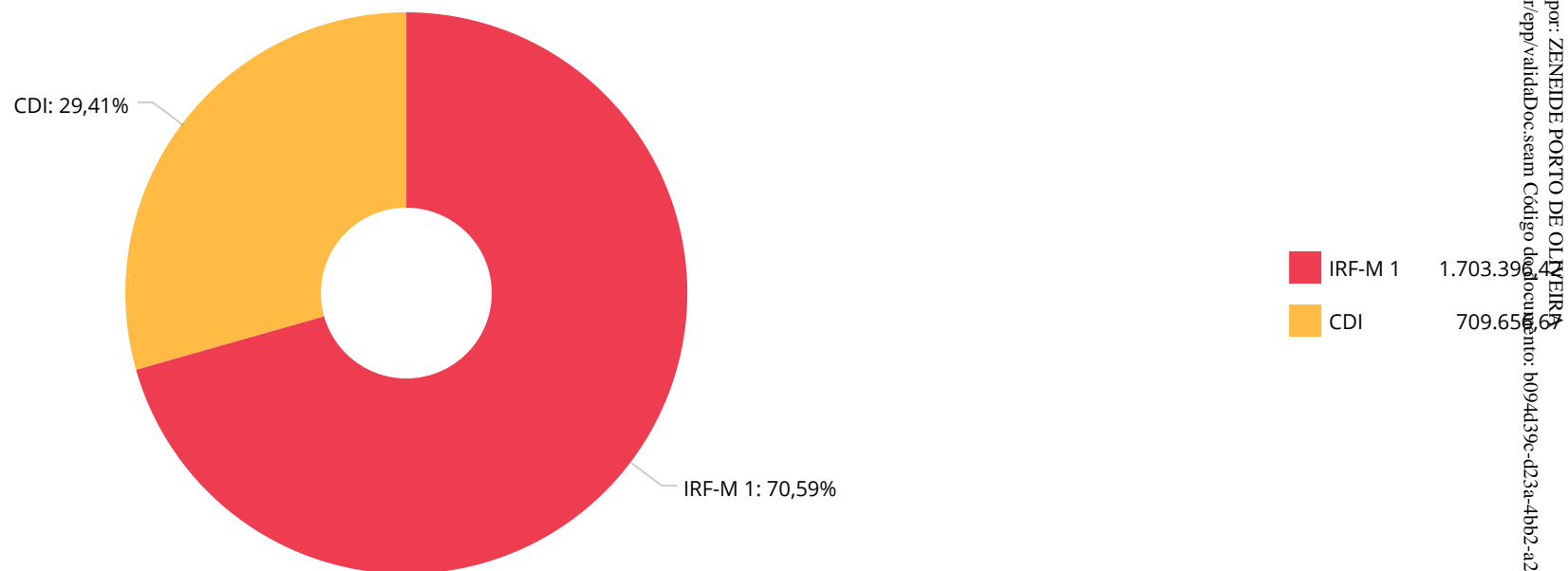
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Fevereiro / 2021)



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Fevereiro / 2021)



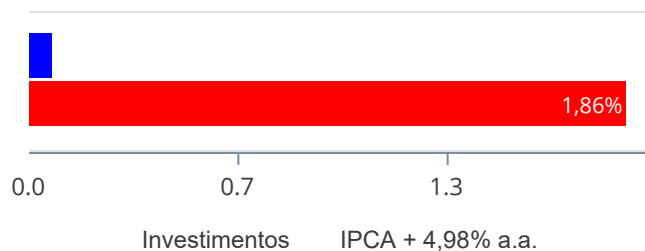
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V.R.
Janeiro	2.395.758,04	3.020,40	7.606,77	2.392.320,93	1.149,26	1.149,26	0,05%	0,05%	0,64%	0,64%	7,53%	0,00%
Fevereiro	2.392.320,93	421.522,90	401.210,54	2.413.053,09	419,80	1.569,06	0,02%	0,07%	1,21%	1,86%	3,52%	0,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://pccs.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3

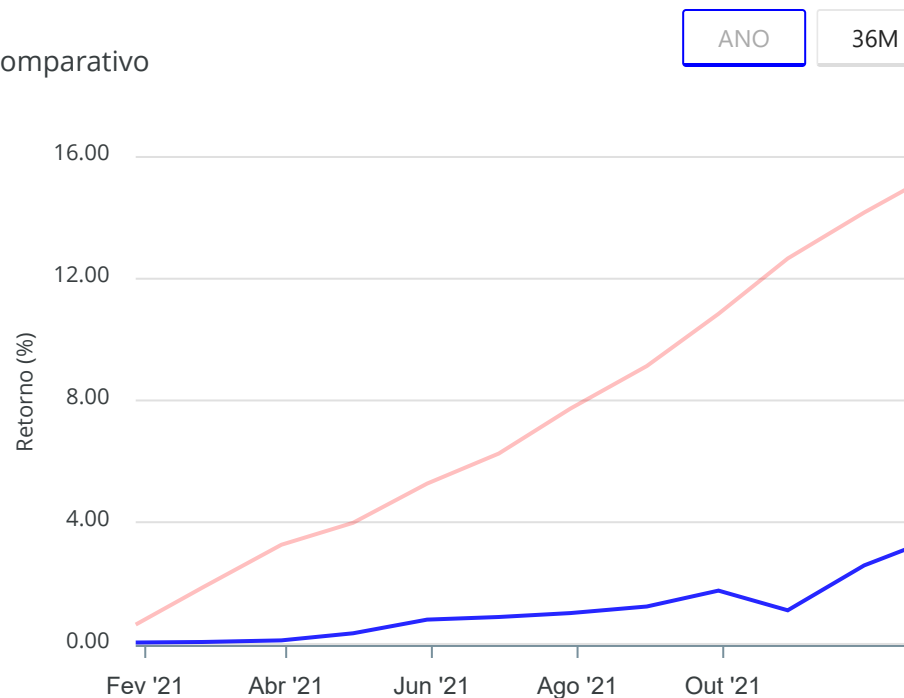


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos      Meta de Rentabilidade       CDI       IMA-B
- IMA-B 5       IMA-B 5+       IMA Geral       IRF-M       IRF-M 1
- IRF-M 1+       Ibovespa       IBX       SMLL       IDIV

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d40112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	214.955,06	0,00	0,00	215.159,98	204,92	0,10%	0,10%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	229.981,05	418.226,20	159.053,68	489.296,12	142,55	0,02%	0,05%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.943.324,31	0,00	240.000,00	1.703.396,42	72,11	0,00%	0,00%	0,10%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	4.060,51	3.296,70	2.156,86	5.200,57	0,22	0,00%	0,01%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>2.392.320,93</b>	<b>421.522,90</b>	<b>401.210,54</b>	<b>2.413.053,09</b>	<b>419,80</b>	<b>0,02%</b>		<b>0,08%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Assinatura em: https://seccos.pse.gov.br/gov/validador/validarDoc.aspx?Codigo=documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3





Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Variável	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assine em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas em investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe à consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qual/Doc.seam?CodigoDoc=222-ea3a4012c3>



# Relatório Analítico dos Investimentos

## em março e 1º trimestre de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.ccp-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d40112fc3



Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2021)

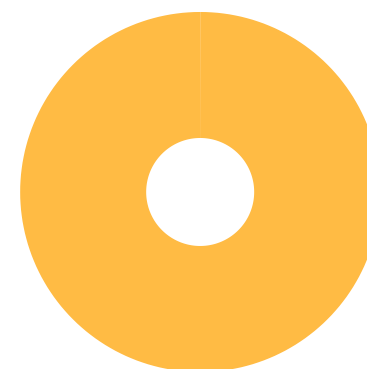
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.703.682,85	82,13%	1.205	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' a
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	3.210,44	0,15%	169.354	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	151.806,02	7,32%	781	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	215.677,07	10,40%	593	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>2.074.376,38</b>				

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/ep/vvalidaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Março / 2021)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	100,00%	2.074.376,38
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.703.682,85	82,13%	40,00%	70,00%	100,00%	370.693,53
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	2.074.376,38
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	103.718,82
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.244.625,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.244.625,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	370.693,53	17,87%	0,00%	8,00%	40,00%	459.057,02
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	829.750,55
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	414.875,28
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	311.156,46
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	311.156,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	103.718,82
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	103.718,82
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	103.718,82
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>2.074.376,38</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>85,00%</b>	<b>570,00%</b>	



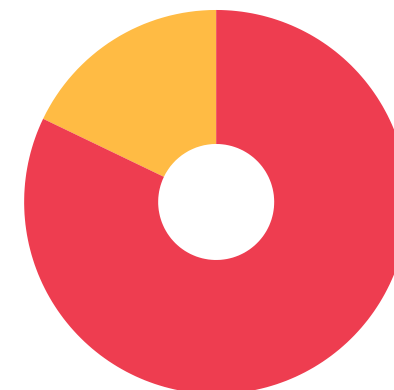
RENDA FIXA 2.074.376,38



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Março / 2021)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	622.312,91
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	622.312,91
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	20,00%	414.875,28
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	414.875,28
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	207.437,64
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	103.718,82
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	103.718,82
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>12,00%</b>	<b>120,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	207.437,64
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	207.437,64
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	207.437,64
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>3,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b 7º IV a

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/vvalidaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3



**Enquadramento por Gestores - base (Março / 2021)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.074.376,38	100,00	0,00

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	40,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Documento Assinado Digitalmente por ZENEDILSON DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://www.tcepe.gov.br/gpp/validador/ocorrencia/assinatura/00944030-1234-4902-2222-222222222222>



**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2021 - RENDA FIXA**

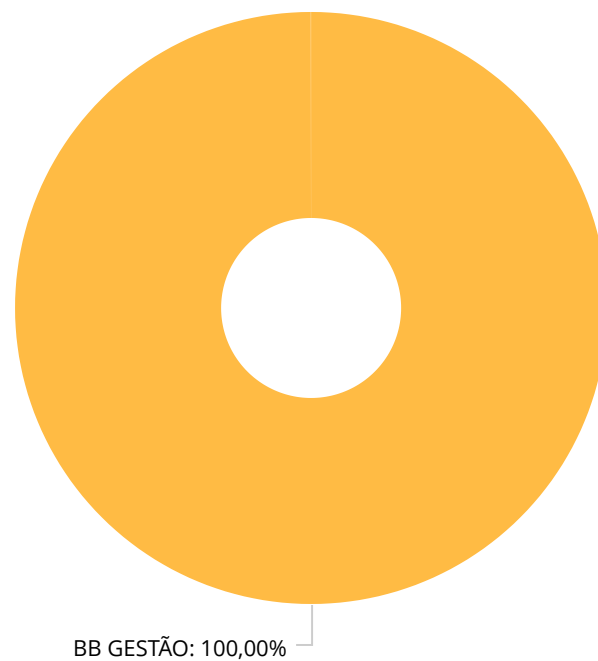
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,04%	0,13%	0,13%	0,83%	2,51%	9,33%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,02%	0,05%	0,05%	0,68%	2,12%	8,66%	0,21%	0,01%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,20%	0,49%	0,49%	0,96%	2,22%	7,78%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,10%	0,23%	0,23%	0,45%	1,12%	5,47%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,24%	0,50%	0,50%	1,07%	2,31%	7,23%	0,04%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,04%	0,06%	0,06%	0,09%	0,28%	2,08%	0,01%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etec.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3





Distribuição dos ativos por Administradores - base (Março / 2021)

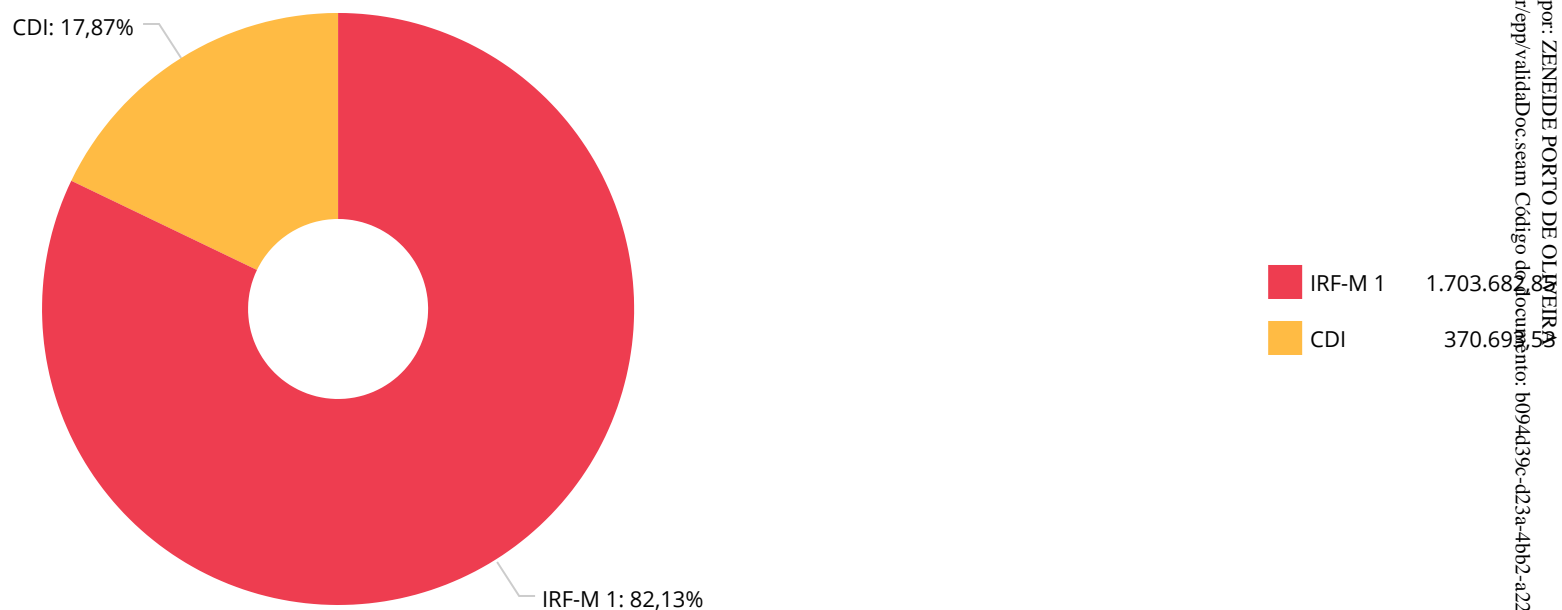


BB GESTÃO 2.074.370,33

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Março / 2021)



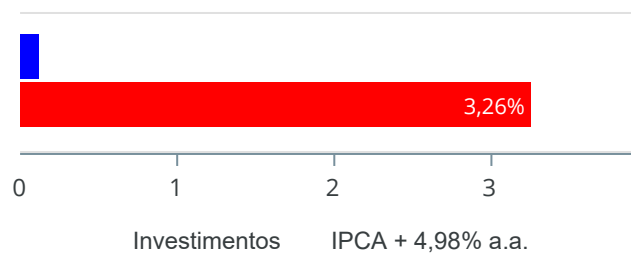
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V.R.
Janeiro	2.395.758,04	3.020,40	7.606,77	2.392.320,93	1.149,26	1.149,26	0,05%	0,05%	0,64%	0,64%	7,53%	0,00%
Fevereiro	2.392.320,93	421.522,90	401.210,54	2.413.053,09	419,80	1.569,06	0,02%	0,07%	1,21%	1,86%	3,52%	0,00%
Março	2.413.053,09	460.871,74	800.828,26	2.074.376,38	1.279,81	2.848,87	0,05%	0,12%	1,38%	3,26%	3,63%	0,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://pccs109.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3

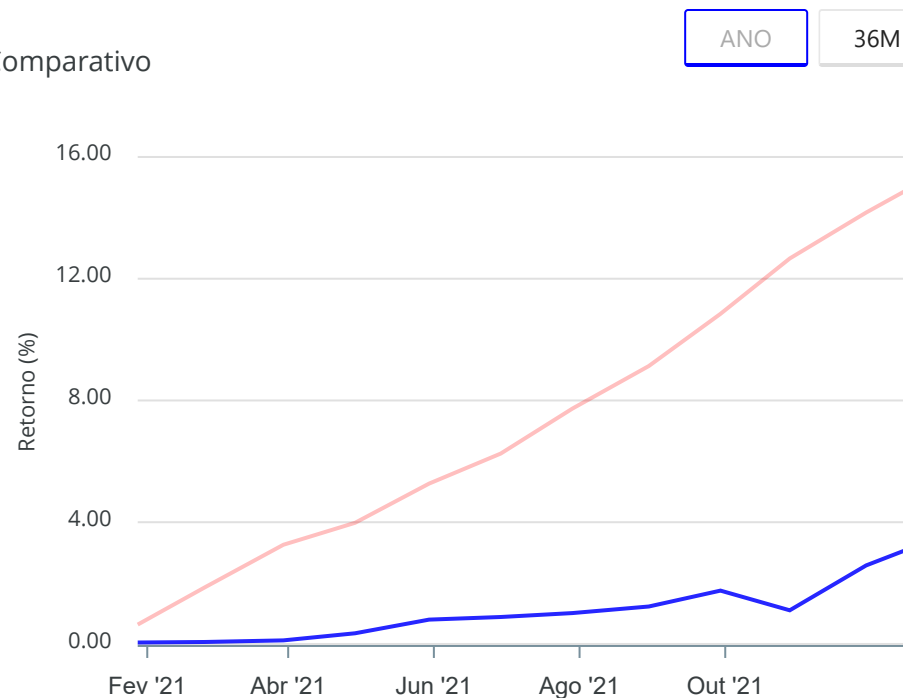


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos
- Meta de Rentabilidade
- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- IMA Geral
- IRF-M
- IRF-M 1
- IRF-M 1+
- Ibovespa
- IBX
- SMLL
- IDIV

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d40112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Março/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	215.159,98	0,00	0,00	215.677,07	517,09	0,24%	0,24%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	489.296,12	447.956,71	785.922,05	151.806,02	475,24	0,05%	0,10%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.703.396,42	0,00	0,00	1.703.682,85	286,43	0,02%	0,02%	0,21%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	5.200,57	12.915,03	14.906,21	3.210,44	1,05	0,01%	0,04%	0,01%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>2.413.053,09</b>	<b>460.871,74</b>	<b>800.828,26</b>	<b>2.074.376,38</b>	<b>1.279,81</b>	<b>0,05%</b>		<b>0,18%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Assinatura em: https://seccom.ge.gov.br/vp/vindex/validaDoc.seam Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Março/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Variável	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assine em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	214.600,67	0,00	0,00	215.677,07	1.076,40	0,50%	0,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.942.714,14	0,00	240.000,00	1.703.682,85	968,71	0,05%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	235.565,31	866.182,91	950.744,50	151.806,02	802,30	0,07%	0,23%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	2.877,92	19.232,13	18.901,07	3.210,44	1,46	0,01%	0,06%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>2.848,87</b>	<b>0,09%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://seccos.tcepe.gov.br/gov/validador/validadorDoc.seam Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assine em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3





## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas em investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe à consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qualificaDoc.seam> Código do Documento: 09459-4234-2021-222-ea34-0127c3

# Relatório Analítico dos Investimentos

em abril de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcac.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3d40112fc3



Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2021)

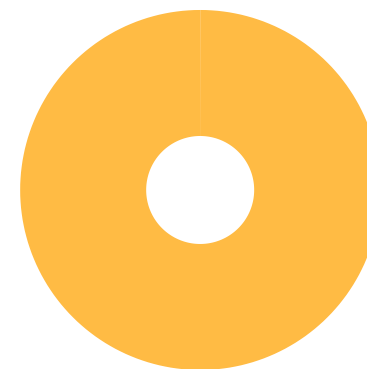
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.707.819,06	78,01%	1.191	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' a
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	3.375,39	0,15%	169.771	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	261.827,21	11,96%	780	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	216.107,25	9,87%	616	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>2.189.128,91</b>				

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/ep/validadorDoc:seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Abril / 2021)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	100,00%	2.189.128,91
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.707.819,06	78,01%	40,00%	70,00%	100,00%	481.309,85
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	2.189.128,91
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	109.456,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.313.477,35
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.313.477,35
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	481.309,85	21,99%	0,00%	8,00%	40,00%	394.341,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	875.651,56
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	437.825,78
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	328.369,34
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	328.369,34
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	109.456,45
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	109.456,45
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	109.456,45
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>2.189.128,91</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>85,00%</b>	<b>570,00%</b>	



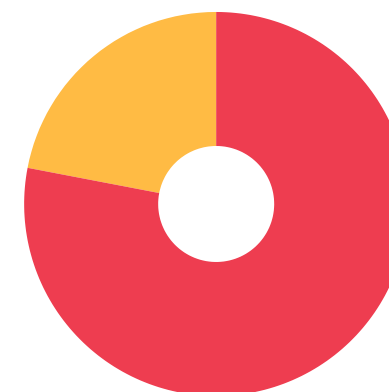
RENDA FIXA 2.189.128,91



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Abril / 2021)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	656.738,67
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	656.738,67
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	20,00%	437.825,78
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	437.825,78
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	218.912,89
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	109.456,45
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	109.456,45
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>12,00%</b>	<b>120,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	218.912,89
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	218.912,89
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	218.912,89
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>3,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b 7º IV a

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/vvalidaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3



**Enquadramento por Gestores - base (Abril / 2021)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.189.128,91	100,00	0,00

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	40,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Documento Assinado Digitalmente por ZENEDILSON DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://www.tcepe.gov.br/gpp/validador/ocorrencia/assinatura/00944030-1234-4902-2222-20210112c31c31>



**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2021 - RENDA FIXA**

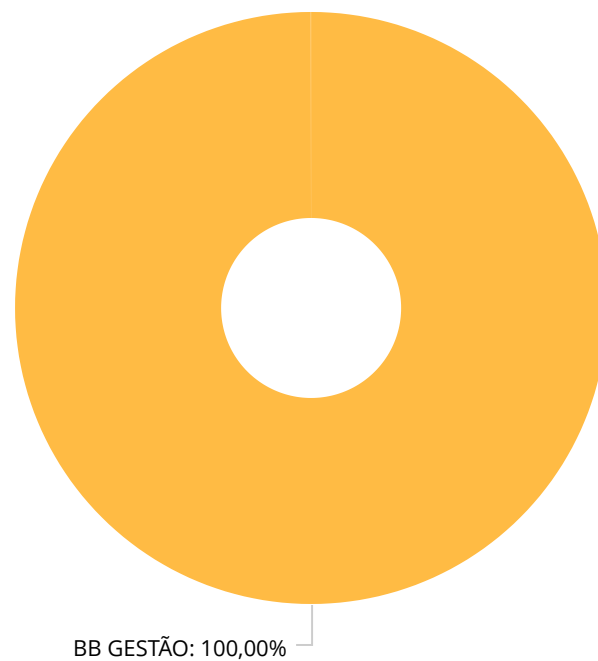
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,27%	0,40%	0,36%	0,94%	2,33%	9,09%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	0,30%	0,26%	0,81%	1,95%	8,38%	0,17%	0,00%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,21%	0,69%	0,54%	1,01%	2,14%	7,45%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,11%	0,34%	0,26%	0,50%	1,03%	5,14%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,20%	0,70%	0,54%	1,12%	2,25%	6,90%	0,02%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,07%	0,12%	0,12%	0,15%	0,30%	1,96%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3



Distribuição dos ativos por Administradores - base (Abril / 2021)



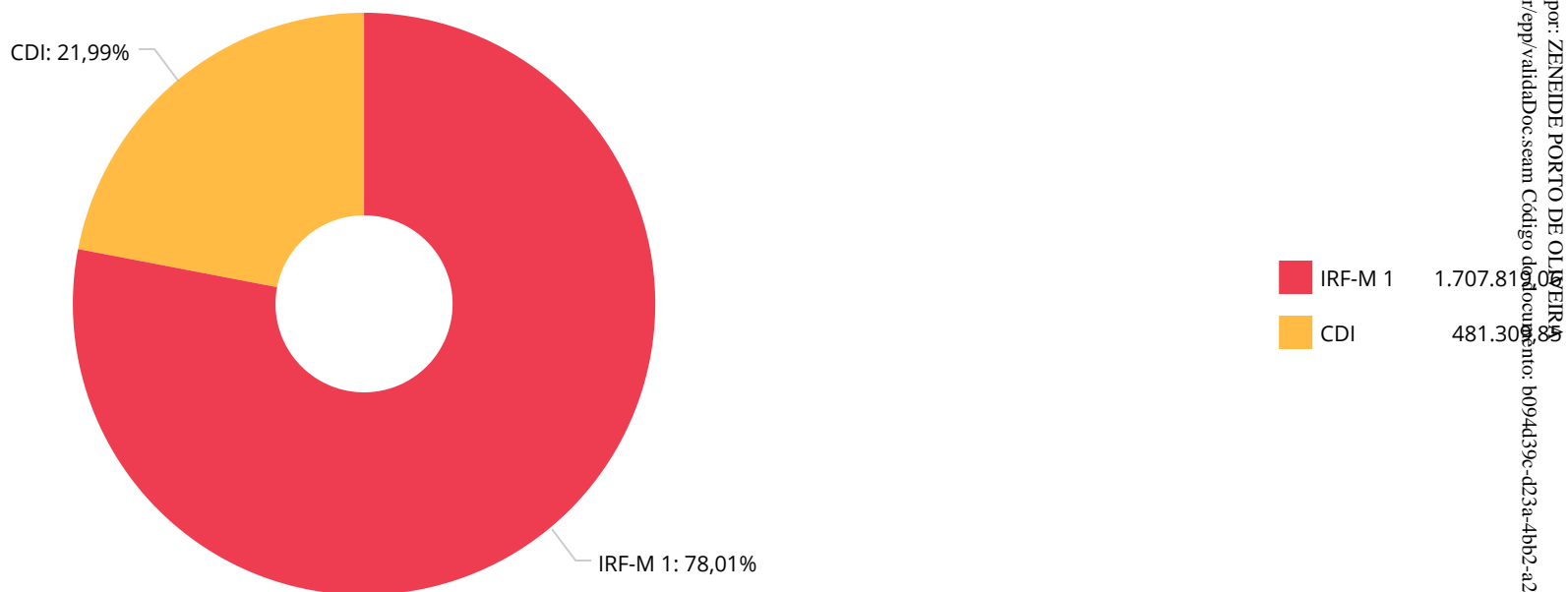
BB GESTÃO 2.189.128,99

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3





Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Abril / 2021)



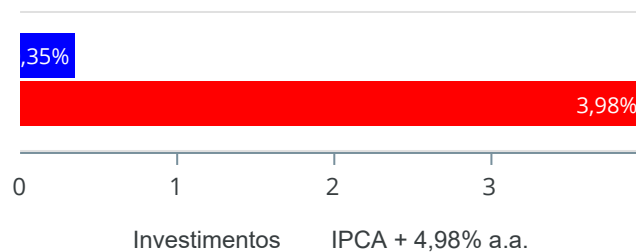
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VR
Janeiro	2.395.758,04	3.020,40	7.606,77	2.392.320,93	1.149,26	1.149,26	0,05%	0,05%	0,64%	0,64%	7,53%	0,00%
Fevereiro	2.392.320,93	421.522,90	401.210,54	2.413.053,09	419,80	1.569,06	0,02%	0,07%	1,21%	1,86%	3,52%	0,00%
Março	2.413.053,09	460.871,74	800.828,26	2.074.376,38	1.279,81	2.848,87	0,05%	0,12%	1,38%	3,26%	3,63%	0,00%
Abril	2.074.376,38	456.838,05	347.150,65	2.189.128,91	5.065,13	7.914,00	0,23%	0,35%	0,70%	3,98%	8,81%	0,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

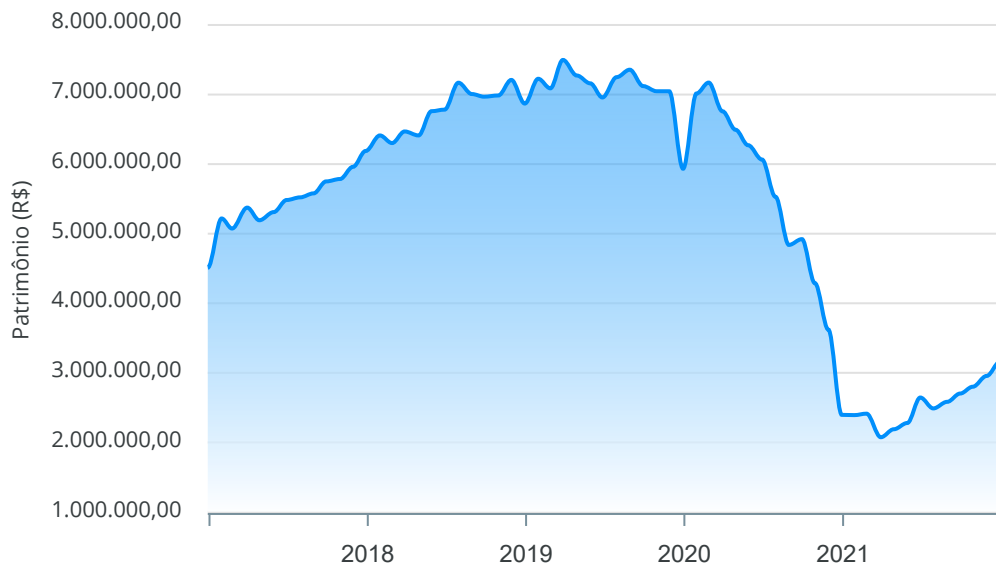


Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://pccs.leg.br/pe/bv/br/pp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3

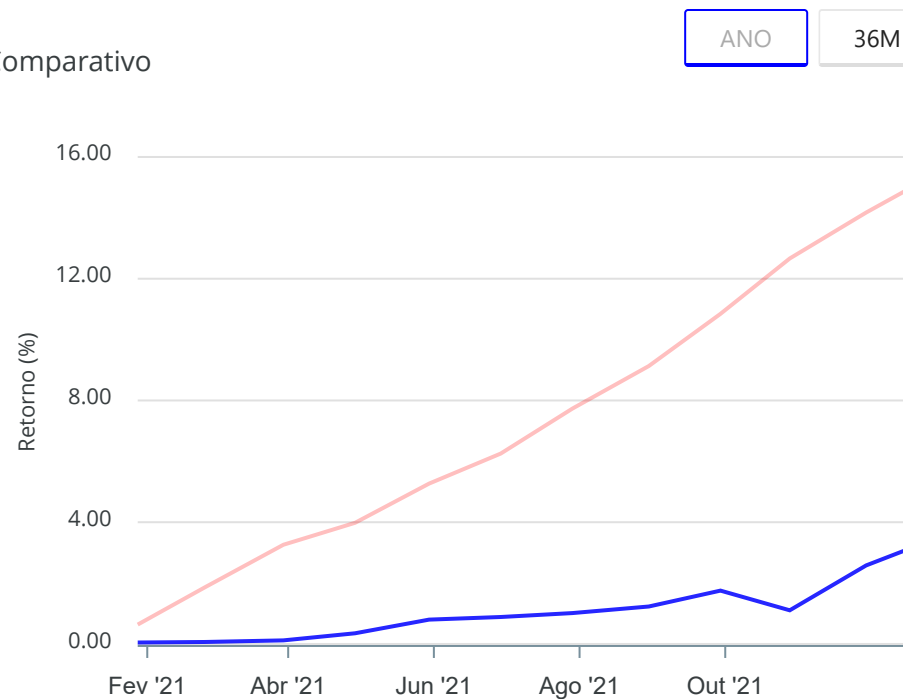


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos    Meta de Rentabilidade     CDI     IMA-B
- IMA-B 5     IMA-B 5+     IMA Geral     IRF-M     IRF-M 1
- IRF-M 1+     Ibovespa     IBX     SMLL     IDIV

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d40112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Abril/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.703.682,85	0,00	0,00	1.707.819,06	4.136,21	0,24%	0,24%	0,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	215.677,07	0,00	0,00	216.107,25	430,18	0,20%	0,20%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	151.806,02	455.798,05	346.273,84	261.827,21	496,98	0,08%	0,11%	0,01%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	3.210,44	1.040,00	876,81	3.375,39	1,76	0,04%	0,07%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>2.074.376,38</b>	<b>456.838,05</b>	<b>347.150,65</b>	<b>2.189.128,91</b>	<b>5.065,13</b>	<b>0,23%</b>		<b>0,13%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinado em: https://seccosge.ges.br/geo/validaDoc.seam Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Abril/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Variável	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assine em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas em investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe à consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qual/Doc.seam?CodigoDoc=222-ea3a-d012-c3>



# Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.ccp-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b62-a222-ea3d40112fc3



**Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2021)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	402.117,61	17,65%	977	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	402.226,30	17,65%	735	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	408.715,01	17,94%	1.184	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	402.591,83	17,67%	560	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	345.865,80	15,18%	791	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	216.721,26	9,51%	637	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	100.542,30	4,41%	199	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>2.278.780,11</b>				

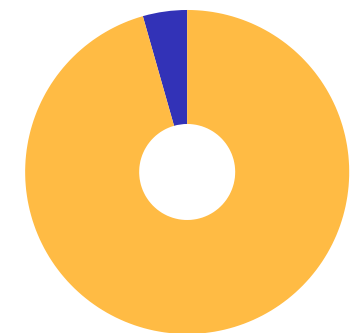
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epqv/validaDoc?seamCodigoDoDocumento:b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3>





**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Maio / 2021)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	100,00%	2.278.780,11
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.213.058,92	53,23%	40,00%	70,00%	100,00%	1.065.721,19
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	2.278.780,11
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	113.939,01
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.367.268,07
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.367.268,07
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	965.178,89	42,36%	0,00%	8,00%	40,00%	-53.666,85
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	911.512,04
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	455.756,02
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	341.817,02
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	341.817,02
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	113.939,01
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	113.939,01
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	113.939,01
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>2.178.237,81</b>	<b>95,59%</b>	<b>40,00%</b>	<b>85,00%</b>	<b>570,00%</b>	



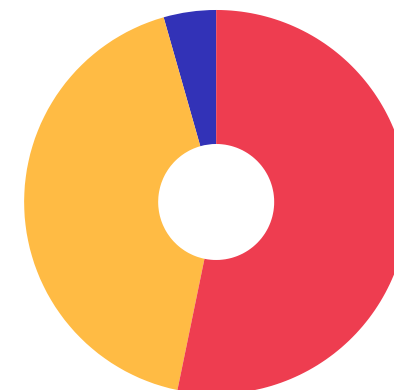
RENDA FIXA 2.178.237,81  
RENDA VARIÁVEL 100.542,30



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Maio / 2021)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	683.634,03
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	683.634,03
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	20,00%	455.756,02
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	455.756,02
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	100.542,30	4,41%	0,00%	3,00%	10,00%	127.335,71
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	113.939,01
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	113.939,01
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>100.542,30</b>	<b>4,41%</b>	<b>0,00%</b>	<b>12,00%</b>	<b>120,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	227.878,01
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	227.878,01
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	227.878,01
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>3,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7° I b    7° IV a    8° III

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3



**Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2021)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.278.780,11	100,00	0,00

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	40,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Documento Assinado Digitalmente por ZENEDILSON DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://www.tcece.org.br/gpp/validador/ocorrencia/assinatura/00944030-1234-4902-2222-222222222222>


**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,88%	2,19%	2,53%	3,96%	8,47%	18,26%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67%	1,51%	1,89%	3,06%	7,77%	16,46%	0,98%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,20%	0,60%	0,52%	0,91%	2,11%	8,57%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	0,47%	0,44%	0,79%	1,73%	7,88%	0,14%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,69%	1,42%	1,92%	3,27%	7,39%	17,55%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,69%	1,36%	1,89%	3,19%	7,12%	17,04%	1,01%	0,02%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,27%	0,97%	0,68%	1,13%	2,18%	7,16%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,19%	0,53%	0,41%	0,64%	1,06%	4,87%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,28%	0,99%	0,73%	1,24%	2,28%	6,64%	0,04%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,83%	3,22%	2,08%	4,61%	8,06%	10,08%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	-0,44%	0,96%	2,25%	4,15%	-	1,19%	0,04%

 Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-e93dc0112fc3



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,27%	0,97%	0,68%	1,13%	2,18%	7,16%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,43%	1,06%	1,46%	2,17%	2,62%	8,65%	0,56%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etce.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



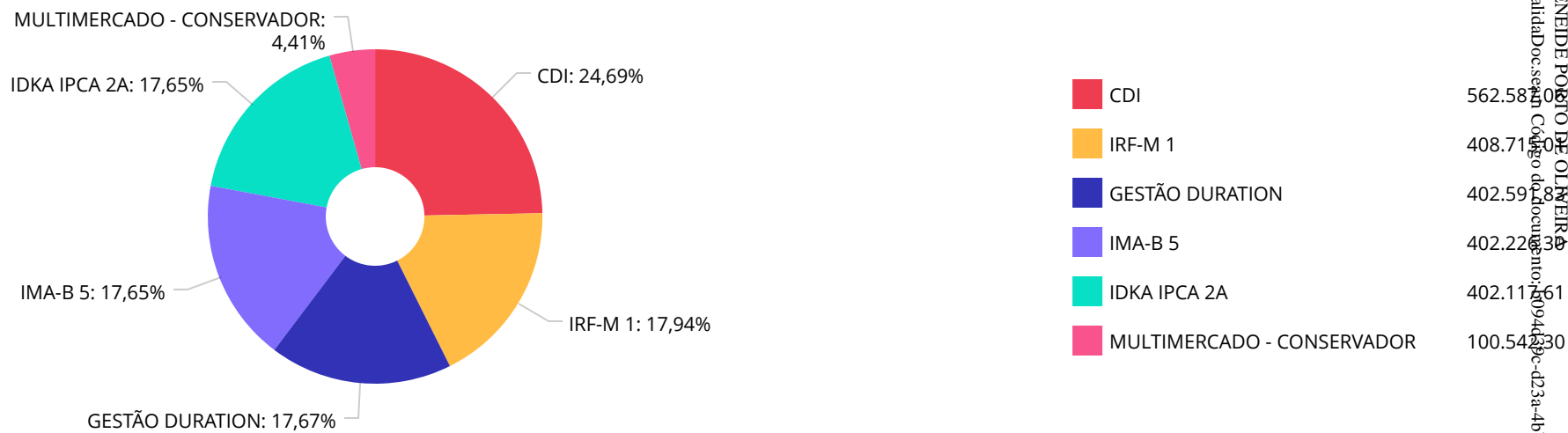
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Maio / 2021)



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Maio / 2021)



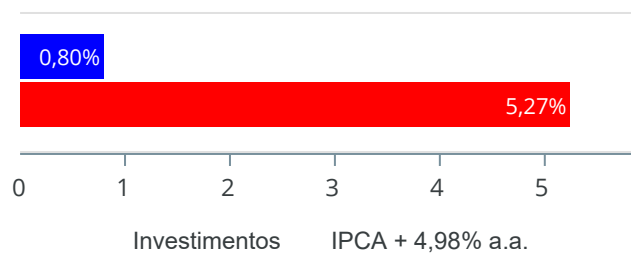
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Asses em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.aspx?Codigo do documento: 78094429-d23a-4b02-a222-ea3de0112fc3>



**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	Variac
Janeiro	2.395.758,04	3.020,40	7.606,77	2.392.320,93	1.149,26	1.149,26	0,05%	0,05%	0,64%	0,64%	7,53%	0,00%
Fevereiro	2.392.320,93	421.522,90	401.210,54	2.413.053,09	419,80	1.569,06	0,02%	0,07%	1,21%	1,86%	3,52%	0,00%
Março	2.413.053,09	460.871,74	800.828,26	2.074.376,38	1.279,81	2.848,87	0,05%	0,12%	1,38%	3,26%	3,63%	0,00%
Abril	2.074.376,38	456.838,05	347.150,65	2.189.128,91	5.065,13	7.914,00	0,23%	0,35%	0,70%	3,98%	8,81%	0,00%
Mai	2.189.128,91	1.741.304,99	1.661.805,04	2.278.780,11	10.151,25	18.065,25	0,45%	0,80%	1,24%	5,27%	15,18%	0,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



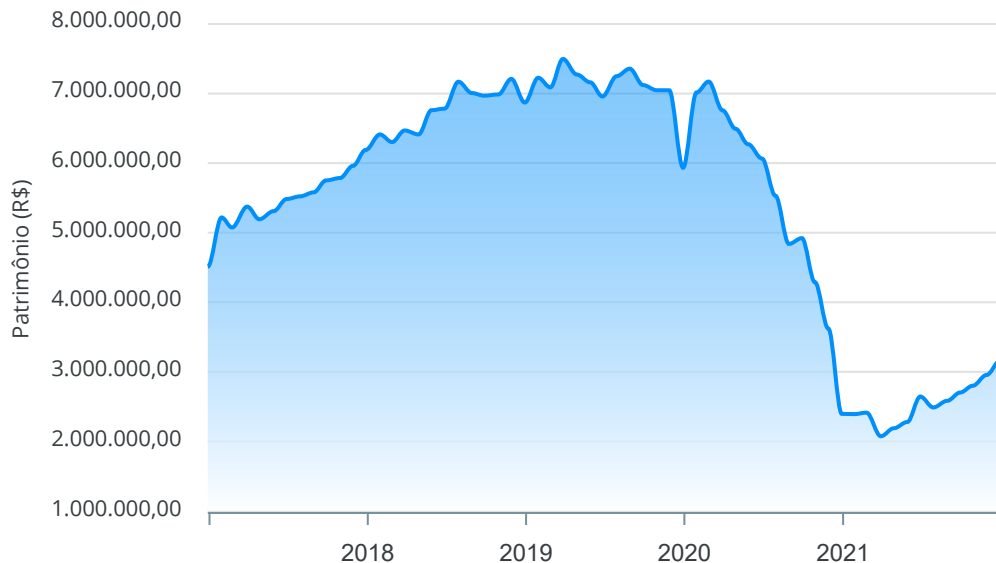
Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: [https://pccs103.pe.gov.br/pepp/vtdadadoc/seam/Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3](https://pccs103.pe.gov.br/pepp/vtdadadoc/seam/Código%20do%20documento%20b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3)



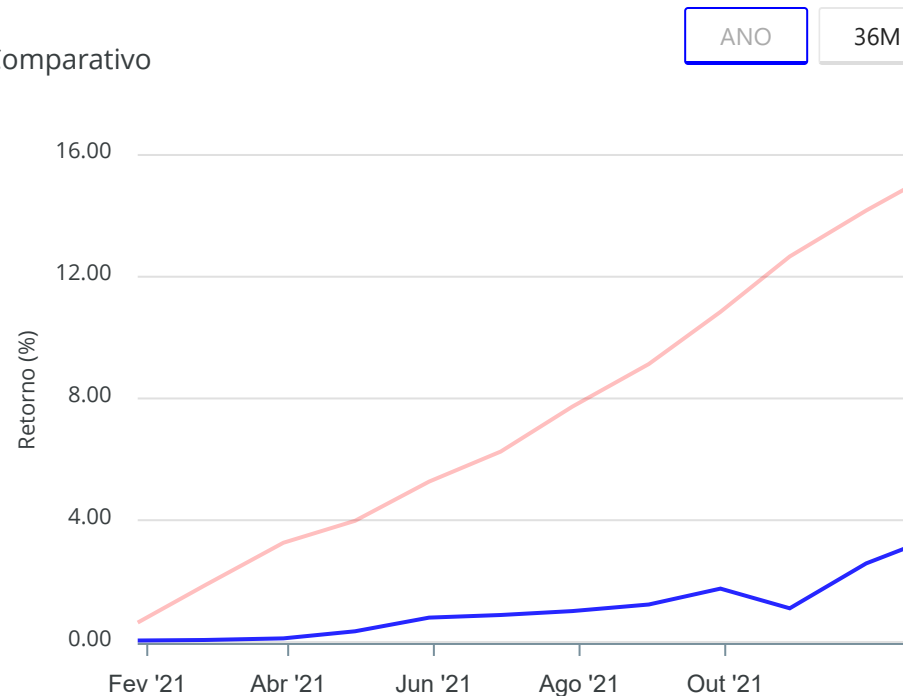


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos      Meta de Rentabilidade       CDI       IMA-B
- IMA-B 5       IMA-B 5+       IMA Geral       IRF-M       IRF-M 1
- IRF-M 1+       Ibovespa       IBX       SMLL       IDIV

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d40112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Maio/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Início
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	400.000,00	0,00	402.591,83	2.591,83	0,65%	0,60%	1,19%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	400.000,00	0,00	402.226,30	2.226,30	0,56%	0,69%	1,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	0,00	400.000,00	0,00	402.117,61	2.117,61	0,53%	0,67%	0,98%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	216.107,25	0,00	0,00	216.721,26	614,01	0,28%	0,28%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	261.827,21	441.304,99	358.428,96	345.865,80	1.162,56	0,17%	0,19%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.707.819,06	0,00	1.300.000,00	408.715,01	895,95	0,05%	0,18%	0,14%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	3.375,39	0,00	3.376,08	0,00	0,69	0,02%	0,12%	0,01%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>2.189.128,91</b>	<b>1.641.304,99</b>	<b>1.661.805,04</b>	<b>2.178.237,81</b>	<b>9.608,95</b>	<b>0,44%</b>		<b>0,62%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinatura em: https://sccs.cce.gov.br/vl/validarDocumento.aspx?CodigoDoDocumento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Maio/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	100.000,00	0,00	100.542,30	542,30	0,54%	0,43%	0,56%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>0,00</b>	<b>100.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>100.542,30</b>	<b>542,30</b>	<b>0,54%</b>		<b>0,56%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://sede.tce.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34d0112fc3



## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas em investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe à consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qualificaDoc.seam?codigoDoc=222-ea3a-0121c3>



# Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.ce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b62-a222-ea3d40112fc3



**Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2021)**

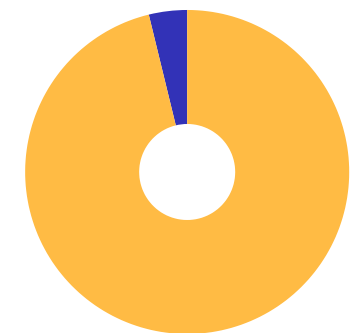
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	401.741,60	15,19%	992	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	401.478,80	15,18%	745	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	409.450,90	15,48%	1.169	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	402.780,35	15,23%	572	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	711.204,35	26,89%	793	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	217.434,05	8,22%	659	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	100.743,56	3,81%	200	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>2.644.833,61</b>				

Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epqv/validaDoc?doc=seamCodigo.do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3>



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Junho / 2021)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	100,00%	2.644.833,61
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.212.671,30	45,85%	40,00%	70,00%	100,00%	1.432.162,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	2.644.833,61
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	132.241,68
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.586.900,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.586.900,17
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.331.418,75	50,34%	0,00%	8,00%	40,00%	-273.485,31
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	1.057.933,44
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	528.966,72
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	396.725,04
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	396.725,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	132.241,68
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	132.241,68
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	132.241,68
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>2.544.090,05</b>	<b>96,19%</b>	<b>40,00%</b>	<b>85,00%</b>	<b>570,00%</b>	



RENDA FIXA 2.544.090,05  
RENDA VARIÁVEL 100.743,56

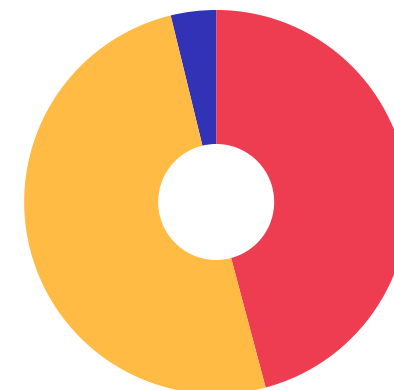
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/vvalidaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc01121c:3



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2021)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	793.450,08
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	793.450,08
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	20,00%	528.966,72
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	528.966,72
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	100.743,56	3,81%	0,00%	3,00%	10,00%	163.739,80
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	132.241,68
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	132.241,68
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>100.743,56</b>	<b>3,81%</b>	<b>0,00%</b>	<b>12,00%</b>	<b>120,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	264.483,36
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	264.483,36
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	264.483,36
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>3,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b    7º IV a    8º III

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3





**Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2021)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.644.833,61	100,00	0,00

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	40,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Documento Assinado Digitalmente por ZENEDILSON DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://www.tcece.org.br/gpp/validador/ocorrencia/assinatura/00944030-1234-4902-2222-222222222222>


**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	-0,32%	1,87%	1,91%	1,87%	7,06%	16,45%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,09%	1,42%	1,42%	1,42%	6,38%	15,08%	1,36%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,21%	0,81%	0,68%	0,81%	2,04%	8,17%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	0,66%	0,60%	0,66%	1,65%	7,46%	0,16%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	-0,13%	1,29%	1,44%	1,29%	6,07%	15,42%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,19%	1,17%	1,37%	1,17%	5,78%	14,87%	1,55%	0,02%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,22%	0,76%	0,53%	0,76%	1,16%	4,70%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,33%	1,32%	0,82%	1,32%	2,35%	6,51%	0,02%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,53%	3,77%	1,68%	3,77%	8,35%	10,66%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	-0,39%	1,36%	-0,39%	3,22%	-	1,46%	0,04%

 Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-e93dc0112fc3



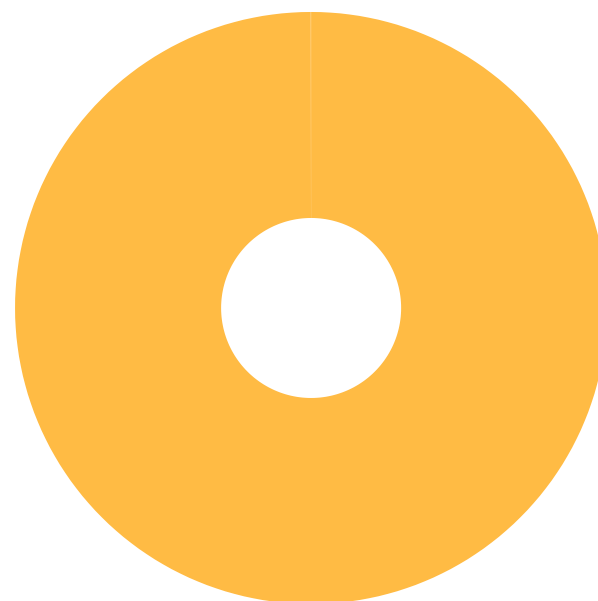
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,20%	1,26%	1,21%	1,26%	2,35%	8,12%	0,46%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



Distribuição dos ativos por Administradores - base (Junho / 2021)



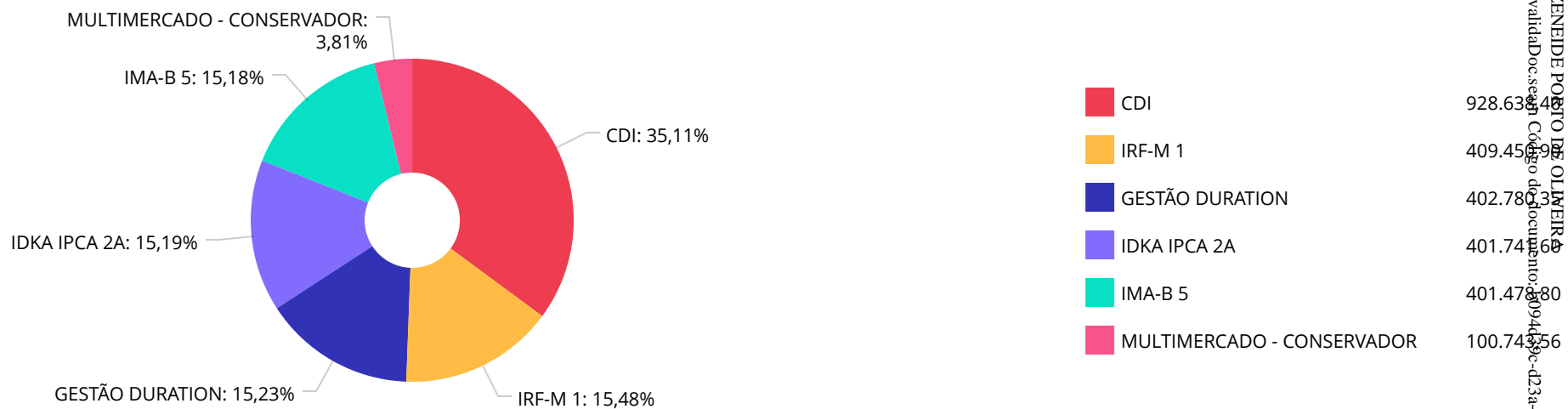
BB GESTÃO: 100,00%

■ BB GESTÃO 2.644.833,66

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2021)



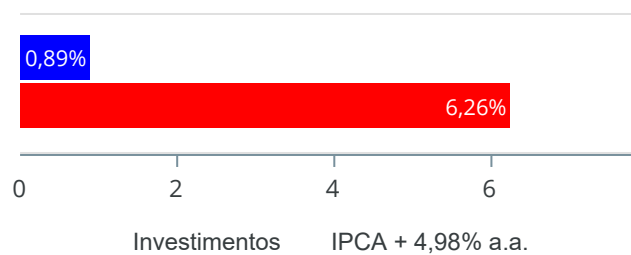
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE POSTO DE OLIVEIRA  
 Acesso em: https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.aspx?Codigo do Documento: 8094459-d23a-4b02-a222-ea3de0112fc3



**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V
Janeiro	2.395.758,04	3.020,40	7.606,77	2.392.320,93	1.149,26	1.149,26	0,05%	0,05%	0,64%	0,64%	7,53%	0,05%
Fevereiro	2.392.320,93	421.522,90	401.210,54	2.413.053,09	419,80	1.569,06	0,02%	0,07%	1,21%	1,86%	3,52%	0,07%
Março	2.413.053,09	460.871,74	800.828,26	2.074.376,38	1.279,81	2.848,87	0,05%	0,12%	1,38%	3,26%	3,63%	0,12%
Abril	2.074.376,38	456.838,05	347.150,65	2.189.128,91	5.065,13	7.914,00	0,23%	0,35%	0,70%	3,98%	8,81%	0,35%
Mai	2.189.128,91	1.741.304,99	1.661.805,04	2.278.780,11	10.151,25	18.065,25	0,45%	0,80%	1,24%	5,27%	15,18%	0,80%
Junho	2.278.780,11	723.450,03	359.654,20	2.644.833,61	2.257,67	20.322,92	0,09%	0,89%	0,94%	6,26%	14,16%	0,89%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por ZENIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://cscs.ces.gov.br/dpp/vtdalDoc.aspx?Codigo=documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3>

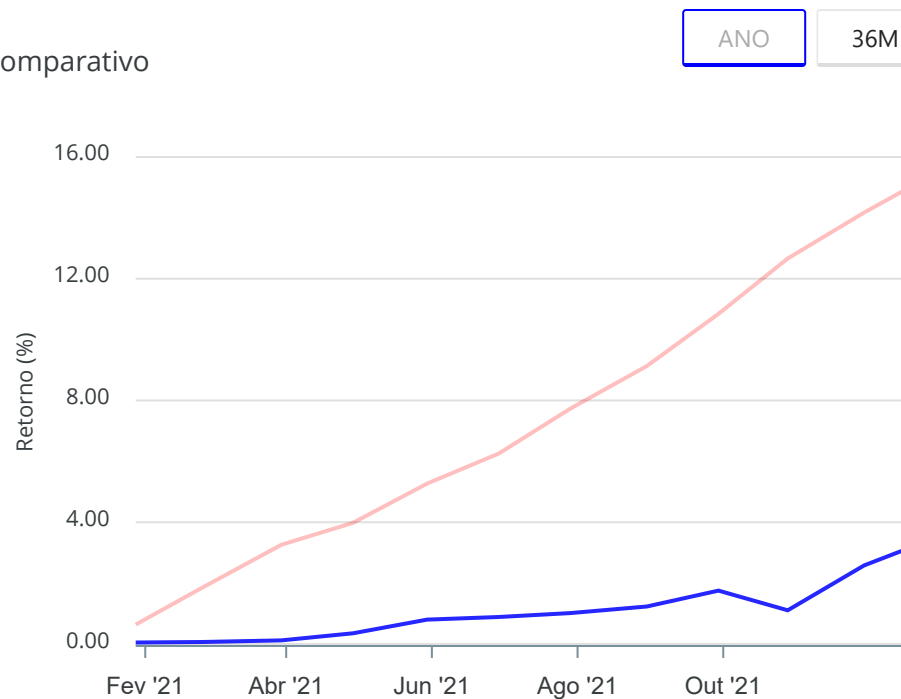


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos
- Meta de Rentabilidade
- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- IMA Geral
- IRF-M
- IRF-M 1
- IRF-M 1+
- Ibovespa
- IBX
- SMLL
- IDIV

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d40112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	216.721,26	0,00	0,00	217.434,05	712,79	0,33%	0,33%	0,02
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	408.715,01	0,00	0,00	409.450,90	735,89	0,18%	0,18%	0,16
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	345.865,80	723.450,03	359.654,20	711.204,35	1.542,72	0,14%	0,22%	0,01
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	402.591,83	0,00	0,00	402.780,35	188,52	0,05%	0,05%	1,46
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	402.117,61	0,00	0,00	401.741,60	-376,01	-0,09%	-0,09%	1,36
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	402.226,30	0,00	0,00	401.478,80	-747,50	-0,19%	-0,19%	1,55
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>2.178.237,81</b>	<b>723.450,03</b>	<b>359.654,20</b>	<b>2.544.090,05</b>	<b>2.056,41</b>	<b>0,08%</b>		<b>0,72</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://seccat.org.br/validador/validador.asp?codigo=documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3





Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	100.542,30	0,00	0,00	100.743,56	201,26	0,20%	0,20%	0,46%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>100.542,30</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>100.743,56</b>	<b>201,26</b>	<b>0,20%</b>		<b>0,46%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://sede.tce.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.703.682,85	0,00	1.300.000,00	409.450,90	5.768,05	0,34%	0,60%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	151.806,02	1.620.553,07	1.064.357,00	711.204,35	3.202,26	0,18%	0,53%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	400.000,00	0,00	402.780,35	2.780,35	0,70%	1,36%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	215.677,07	0,00	0,00	217.434,05	1.756,98	0,81%	0,81%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	0,00	400.000,00	0,00	401.741,60	1.741,60	0,44%	1,42%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	400.000,00	0,00	401.478,80	1.478,80	0,37%	1,37%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	3.210,44	1.040,00	4.252,89	0,00	2,45	0,06%	0,35%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>16.730,49</b>	<b>0,66%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinatura em: https://seccom.pe.gov.br/gov/validarDocumentoCodigo do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Ins
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	100.000,00	0,00	100.743,56	743,56	0,74%	1,21%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>743,56</b>	<b>0,74%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assine em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Int...
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.942.714,14	0,00	1.540.000,00	409.450,90	6.736,76	0,35%	0,65%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	235.565,31	2.486.735,98	2.015.101,50	711.204,35	4.004,56	0,15%	0,76%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	214.600,67	0,00	0,00	217.434,05	2.833,38	1,32%	1,32%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	400.000,00	0,00	402.780,35	2.780,35	0,70%	-0,39%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	0,00	400.000,00	0,00	401.741,60	1.741,60	0,44%	1,42%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	400.000,00	0,00	401.478,80	1.478,80	0,37%	1,17%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	2.877,92	20.272,13	23.153,96	0,00	3,91	0,02%	0,40%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>19.579,36</b>	<b>0,78%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assine em: https://seccom.pe.gov.br/gpd/validarDocumentoCodigo do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Ins
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	100.000,00	0,00	100.743,56	743,56	0,74%	1,26%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>743,56</b>	<b>0,74%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://efcc.ce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas em investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe à consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qual/Doc.seam?CodigoDocumento=09459-4234-2021-222-ea340127c3>

# Relatório Analítico dos Investimentos

## em julho de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.ccp-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b62-a222-ea3d40112fc3



**Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2021)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	402.076,89	16,16%	1.007	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	401.569,47	16,14%	758	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	410.123,80	16,48%	1.154	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	402.332,57	16,17%	582	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	553.257,78	22,23%	797	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	218.288,93	8,77%	687	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	100.816,82	4,05%	200	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>2.488.466,26</b>				

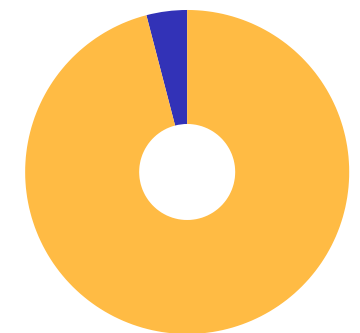
Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epqv/validaDoc?seamCodigo=documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3>





**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Julho / 2021)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	100,00%	2.488.466,26
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.213.770,16	48,78%	40,00%	70,00%	100,00%	1.274.696,10
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	2.488.466,26
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	124.423,31
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.493.079,76
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.493.079,76
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.173.879,28	47,17%	0,00%	8,00%	40,00%	-178.492,78
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	995.386,50
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	497.693,25
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	373.269,94
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	373.269,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	124.423,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	124.423,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	124.423,31
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>2.387.649,44</b>	<b>95,95%</b>	<b>40,00%</b>	<b>85,00%</b>	<b>570,00%</b>	



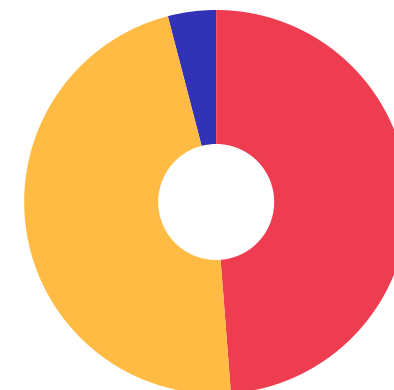
RENDA FIXA 2.387.649,44  
RENDA VARIÁVEL 100.816,82



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2021)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	746.539,88
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	746.539,88
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	20,00%	497.693,25
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	497.693,25
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	100.816,82	4,05%	0,00%	3,00%	10,00%	148.029,81
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	124.423,31
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	124.423,31
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>100.816,82</b>	<b>4,05%</b>	<b>0,00%</b>	<b>12,00%</b>	<b>120,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	248.846,63
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	248.846,63
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	248.846,63
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>3,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b    7º IV a    8º III

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3



**Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2021)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.488.466,26	100,00	0,00

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	40,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Documento Assinado Digitalmente por ZENEDILSON DE OLIVEIRA  
 Acesso em: https://www.tcepe.gov.br/gpp/validacao/assinatura/00944030-1234-4902-2222-222222222222



**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	-0,18%	1,68%	0,38%	1,54%	5,88%	15,07%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	1,50%	0,66%	1,32%	5,61%	14,05%	0,88%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,19%	1,00%	0,60%	0,96%	1,99%	7,60%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,16%	0,82%	0,52%	0,79%	1,58%	6,89%	0,23%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,03%	1,31%	0,59%	1,21%	5,06%	14,34%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	1,19%	0,52%	1,09%	4,79%	13,79%	1,02%	0,02%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,36%	1,64%	0,94%	1,49%	2,44%	6,76%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,25%	1,01%	0,66%	0,93%	1,30%	4,47%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,39%	1,72%	1,01%	1,55%	2,51%	6,34%	0,01%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,96%	4,76%	2,34%	4,50%	8,99%	11,51%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,11%	-0,50%	0,54%	-0,04%	1,16%	-	1,10%	0,04%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etec.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-e93de0112fc3



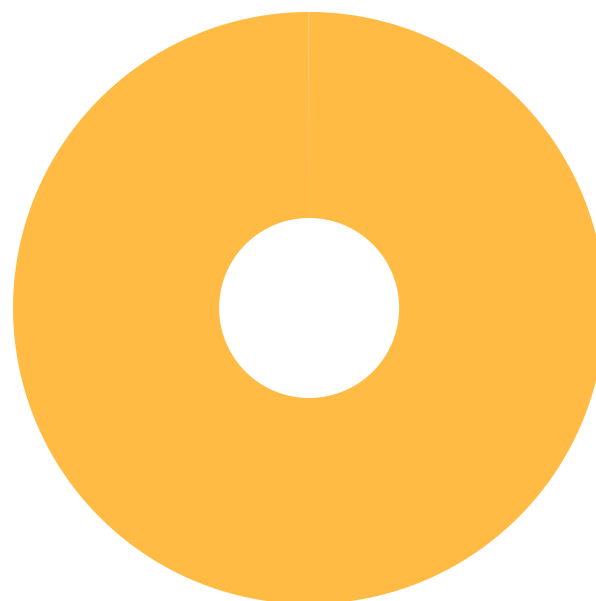
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,36%	1,64%	0,94%	1,49%	2,44%	6,76%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,07%	1,33%	0,71%	1,45%	2,04%	7,76%	0,73%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



Distribuição dos ativos por Administradores - base (Julho / 2021)



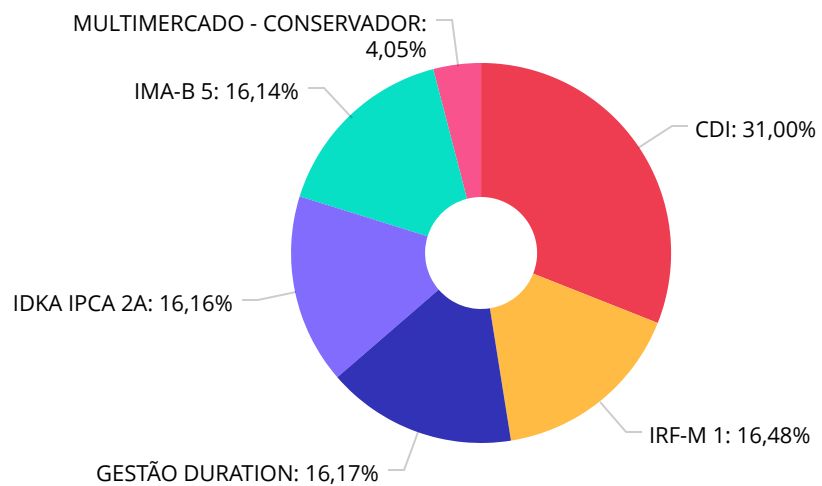
BB GESTÃO: 100,00%

■ BB GESTÃO 2.488.462,21

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Julho / 2021)



CDI	771.547,78
IRF-M 1	410.128,55
GESTÃO DURATION	402.335,84
IDKA IPCA 2A	402.078,84
IMA-B 5	401.566,47
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	100.810,82

771.547,78  
410.128,55  
402.335,84  
402.078,84  
401.566,47  
100.810,82

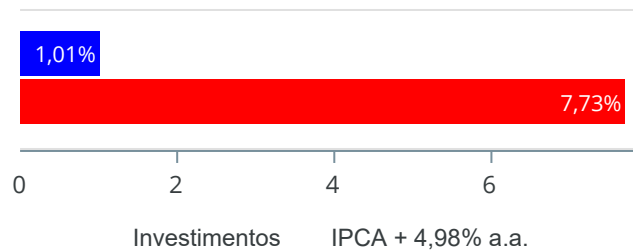
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesso em: https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.aspx?CodigoDoc=10094439-d23a-4b02-a222-ea3de0112fc3



**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	Variância
Janeiro	2.395.758,04	3.020,40	7.606,77	2.392.320,93	1.149,26	1.149,26	0,05%	0,05%	0,64%	0,64%	7,53%	0,00%
Fevereiro	2.392.320,93	421.522,90	401.210,54	2.413.053,09	419,80	1.569,06	0,02%	0,07%	1,21%	1,86%	3,52%	0,00%
Março	2.413.053,09	460.871,74	800.828,26	2.074.376,38	1.279,81	2.848,87	0,05%	0,12%	1,38%	3,26%	3,63%	0,00%
Abril	2.074.376,38	456.838,05	347.150,65	2.189.128,91	5.065,13	7.914,00	0,23%	0,35%	0,70%	3,98%	8,81%	0,00%
Mai	2.189.128,91	1.741.304,99	1.661.805,04	2.278.780,11	10.151,25	18.065,25	0,45%	0,80%	1,24%	5,27%	15,18%	0,00%
Junho	2.278.780,11	723.450,03	359.654,20	2.644.833,61	2.257,67	20.322,92	0,09%	0,89%	0,94%	6,26%	14,16%	0,00%
Julho	2.644.833,61	590.750,69	750.494,37	2.488.466,26	3.376,33	23.699,25	0,13%	1,01%	1,39%	7,73%	13,12%	0,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por ZENIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://cda.leg.br/pe/pe-tyv-bv/4pp/vtdal/oc/see/49>  
Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



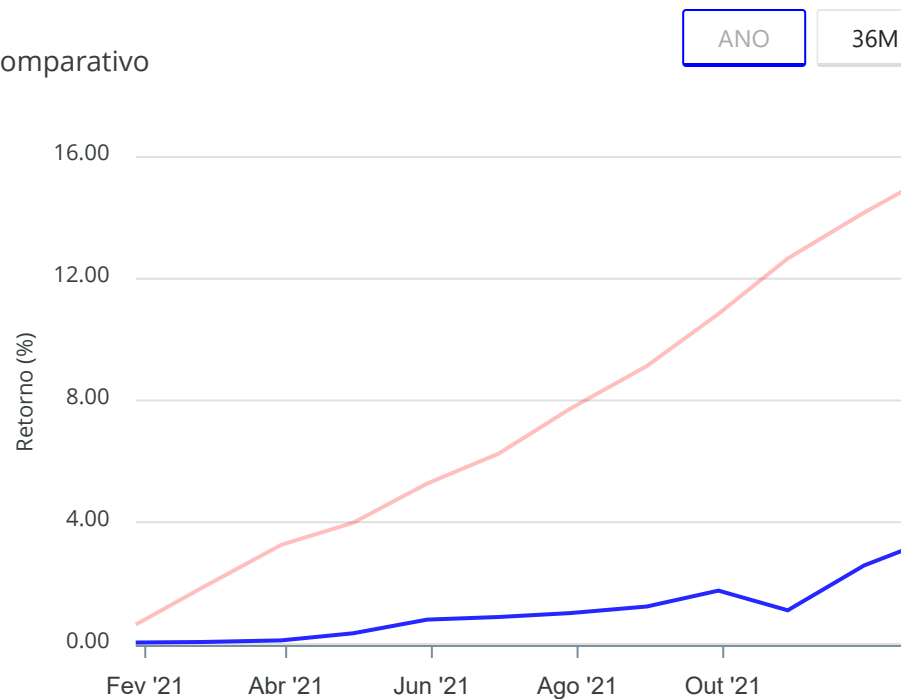


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos
- Meta de Rentabilidade
- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- IMA Geral
- IRF-M
- IRF-M 1
- IRF-M 1+
- Ibovespa
- IBX
- SMLL
- IDIV

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d40112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	217.434,05	0,00	0,00	218.288,93	854,88	0,39%	0,39%	0,01
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	409.450,90	0,00	0,00	410.123,80	672,90	0,16%	0,16%	0,23
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	711.204,35	590.750,69	750.494,37	553.257,78	1.797,11	0,14%	0,25%	0,01
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	401.741,60	0,00	0,00	402.076,89	335,29	0,08%	0,08%	0,88
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	401.478,80	0,00	0,00	401.569,47	90,67	0,02%	0,02%	1,02
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	402.780,35	0,00	0,00	402.332,57	-447,78	-0,11%	-0,11%	1,10
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>2.544.090,05</b>	<b>590.750,69</b>	<b>750.494,37</b>	<b>2.387.649,44</b>	<b>3.303,07</b>	<b>0,13%</b>		<b>0,55</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://seccat.org.br/validador/validador.asp?codigo=documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	100.743,56	0,00	0,00	100.816,82	73,26	0,07%	0,07%	0,73%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>100.743,56</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>100.816,82</b>	<b>73,26</b>	<b>0,07%</b>		<b>0,73%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://sede.tce-pi.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34d0112fc3



## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas em investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe à consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qualificaDoc.seam> Código do Documento: 09459-4234-2021-222-ea34-0127c3

# Relatório Analítico dos Investimentos

## em agosto de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.ccp-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b62-a222-ea3d40112fc3



**Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2021)**

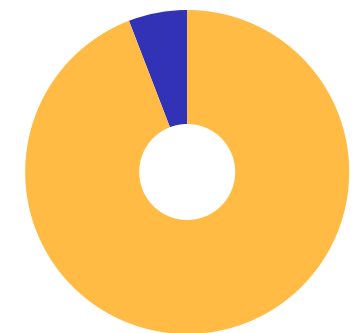
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	453.103,95	17,54%	1.007	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	452.312,19	17,51%	763	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	461.604,50	17,87%	1.156	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	150.488,22	5,83%	599	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	450.717,21	17,45%	584	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	244.525,16	9,47%	802	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	219.264,96	8,49%	737	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	151.147,46	5,85%	197	0,04%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>2.583.163,65</b>				

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: [https://etec.tce.pe.gov.br/ep/validaDoc?scan=Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3](https://etec.tce.pe.gov.br/ep/validaDoc?scan=Código%20do%20documento%3A%20b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3)



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Agosto / 2021)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	100,00%	2.583.163,65
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.517.508,86	58,75%	40,00%	70,00%	100,00%	1.065.654,79
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	2.583.163,65
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	129.158,18
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.549.898,19
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.549.898,19
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	914.507,33	35,40%	0,00%	8,00%	40,00%	118.758,13
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	1.033.265,46
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	516.632,73
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	387.474,55
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	387.474,55
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	129.158,18
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	129.158,18
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	129.158,18
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>2.432.016,19</b>	<b>94,15%</b>	<b>40,00%</b>	<b>85,00%</b>	<b>570,00%</b>	



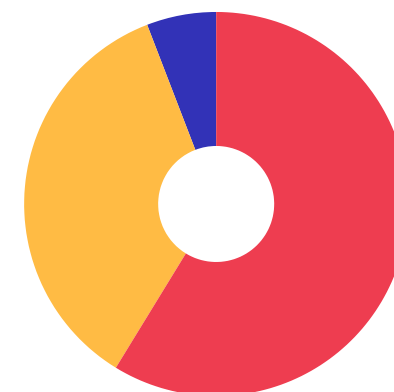
RENDA FIXA 2.432.016,19  
RENDA VARIÁVEL 151.147,46



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2021)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	774.949,10
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	774.949,10
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	20,00%	516.632,73
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	516.632,73
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	151.147,46	5,85%	0,00%	3,00%	10,00%	107.168,91
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	129.158,18
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	129.158,18
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>151.147,46</b>	<b>5,85%</b>	<b>0,00%</b>	<b>12,00%</b>	<b>120,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	258.316,37
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	258.316,37
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	258.316,37
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>3,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b    7º IV a    8º III

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3





**Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2021)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.583.163,65	100,00	0,00

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	40,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Documento Assinado Digitalmente por ZENEDILSON DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://www.tcepe.gov.br/gpp/validador/ocorrencia/assinatura/00944030-1234-4902-2222-20210112c31>


**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2021 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,26%	1,95%	-0,23%	2,29%	5,08%	15,28%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	1,68%	0,17%	2,06%	5,08%	14,20%	1,09%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,37%	1,37%	0,77%	1,29%	2,24%	7,41%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33%	1,16%	0,68%	1,12%	1,83%	6,69%	0,15%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,15%	1,47%	0,05%	1,97%	4,77%	14,45%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,10%	1,30%	-0,06%	1,82%	4,51%	13,87%	1,31%	0,02%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	-0,60%	-2,63%	-0,86%	-0,67%	-1,25%	7,35%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,65%	-2,82%	-0,97%	-0,86%	-1,54%	6,76%	1,47%	0,03%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,43%	2,07%	1,10%	1,78%	2,72%	6,68%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,30%	1,31%	0,77%	1,18%	1,53%	4,35%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,45%	2,17%	1,17%	1,91%	2,78%	6,29%	0,03%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,87%	5,67%	2,38%	4,51%	9,68%	12,35%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,46%	-0,96%	-0,52%	0,44%	1,76%	-	1,34%	0,03%

 Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-e33dc0112c3



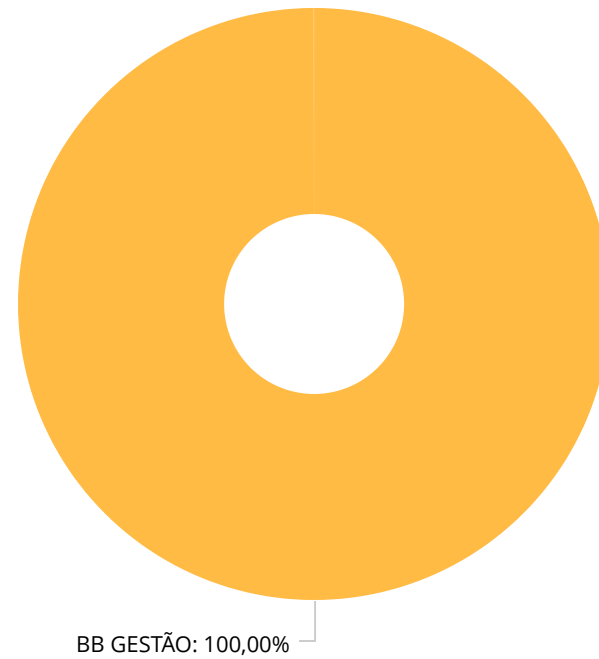
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,43%	2,07%	1,10%	1,78%	2,72%	6,68%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,21%	1,55%	0,48%	1,95%	2,69%	7,42%	0,58%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



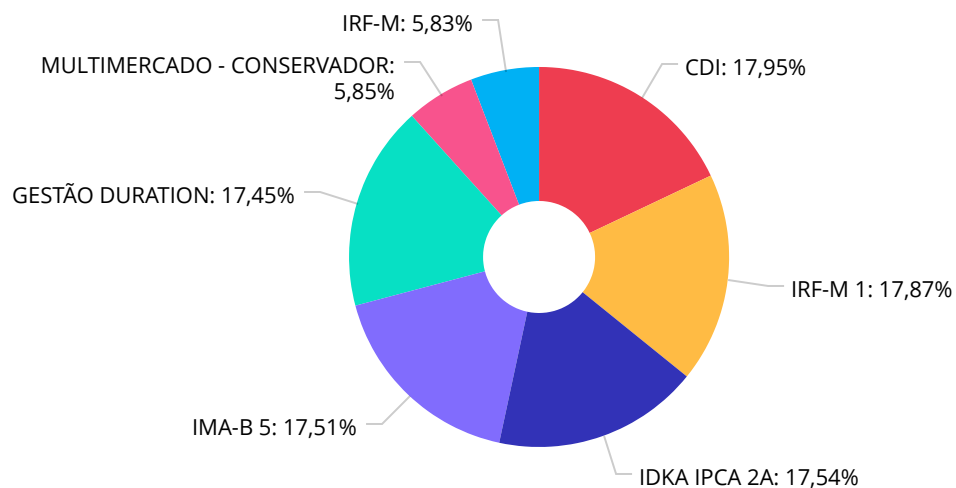
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Agosto / 2021)



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Agosto / 2021)



CDI	463.790,11
IRF-M 1	461.604,05
IDKA IPCA 2A	453.100,99
IMA-B 5	452.311,11
GESTÃO DURATION	450.710,21
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	151.140,46
IRF-M	150.480,22

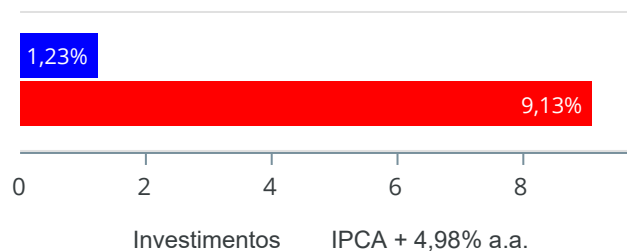
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE RORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDocumentoSam>  
 Id do documento: b0f4d390-4b02-4222-ea3dc0112fc3



**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V
Janeiro	2.395.758,04	3.020,40	7.606,77	2.392.320,93	1.149,26	1.149,26	0,05%	0,05%	0,64%	0,64%	7,53%	0,05%
Fevereiro	2.392.320,93	421.522,90	401.210,54	2.413.053,09	419,80	1.569,06	0,02%	0,07%	1,21%	1,86%	3,52%	0,07%
Março	2.413.053,09	460.871,74	800.828,26	2.074.376,38	1.279,81	2.848,87	0,05%	0,12%	1,38%	3,26%	3,63%	0,12%
Abril	2.074.376,38	456.838,05	347.150,65	2.189.128,91	5.065,13	7.914,00	0,23%	0,35%	0,70%	3,98%	8,81%	0,35%
Mai	2.189.128,91	1.741.304,99	1.661.805,04	2.278.780,11	10.151,25	18.065,25	0,45%	0,80%	1,24%	5,27%	15,18%	0,80%
Junho	2.278.780,11	723.450,03	359.654,20	2.644.833,61	2.257,67	20.322,92	0,09%	0,89%	0,94%	6,26%	14,16%	0,89%
Julho	2.644.833,61	590.750,69	750.494,37	2.488.466,26	3.376,33	23.699,25	0,13%	1,01%	1,39%	7,73%	13,12%	1,01%
Agosto	2.488.466,26	1.188.375,94	1.099.200,73	2.583.163,65	5.522,18	29.221,43	0,21%	1,23%	1,30%	9,13%	13,48%	1,23%

**Investimentos x Meta de Rentabilidade**



Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://cda.leg.br/pe/pe-adv/pe-adv/v/validarDoc.aspx?CodigoDocumento=b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3>

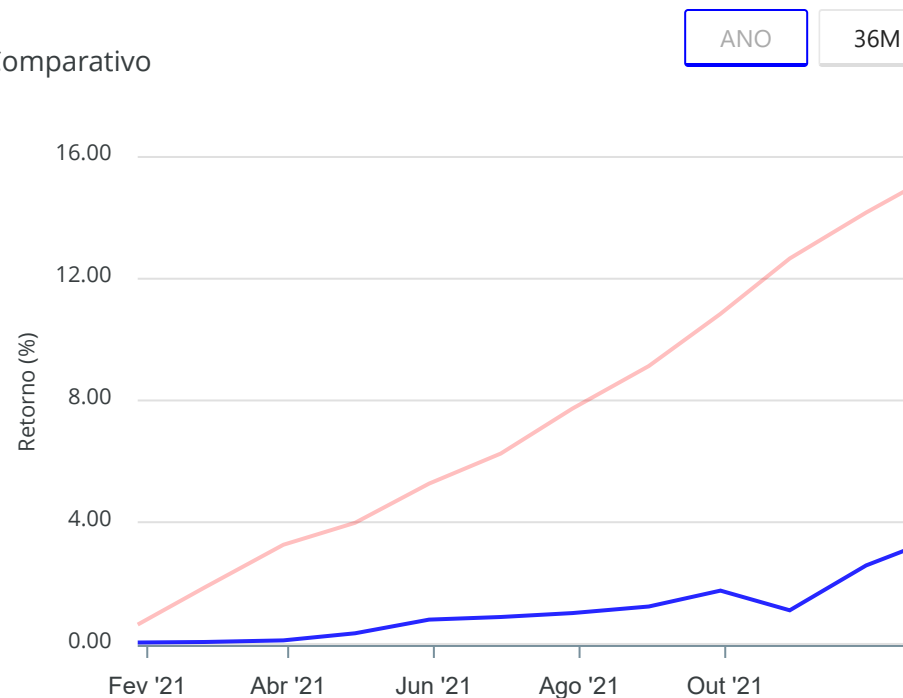


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos      Meta de Rentabilidade       CDI       IMA-B
- IMA-B 5       IMA-B 5+       IMA Geral       IRF-M       IRF-M 1
- IRF-M 1+       Ibovespa       IBX       SMLL       IDIV

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d40112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instt	Var - In
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	218.288,93	0,00	0,00	219.264,96	976,03	0,45%	0,45%	0,03
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	150.000,00	0,00	150.488,22	488,22	0,33%	-0,65%	1,47
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	410.123,80	50.000,00	0,00	461.604,50	1.480,70	0,32%	0,33%	0,15
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	402.076,89	50.000,00	0,00	453.103,95	1.027,06	0,23%	0,18%	1,09
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	401.569,47	50.000,00	0,00	452.312,19	742,72	0,16%	0,10%	1,31
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	553.257,78	788.375,94	1.099.200,73	244.525,16	2.092,17	0,16%	0,30%	0,01
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	402.332,57	50.000,00	0,00	450.717,21	-1.615,36	-0,36%	-0,45%	1,34
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>2.387.649,44</b>	<b>1.138.375,94</b>	<b>1.099.200,73</b>	<b>2.432.016,19</b>	<b>5.191,54</b>	<b>0,21%</b>		<b>0,82</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://seccao.fps.gov.br/gp/validador.aspx?CodigoDoDocumento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3





Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	100.816,82	50.000,00	0,00	151.147,46	330,64	0,22%	0,21%	0,58%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>100.816,82</b>	<b>50.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>151.147,46</b>	<b>330,64</b>	<b>0,22%</b>		<b>0,58%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://sede.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas em investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe à consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qualificaDoc.seam> Código do Documento: 09459-4234-222-ea340127c3



# Relatório Analítico dos Investimentos

## em setembro e 3º trimestre de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.ce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3



**Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)**

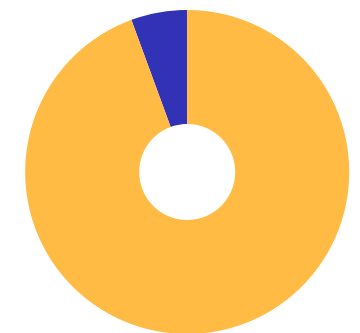
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	457.786,53	16,94%	1.014	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	456.733,93	16,90%	770	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	463.295,43	17,14%	1.140	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	149.922,64	5,55%	581	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	451.200,44	16,70%	587	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	352.041,24	13,03%	800	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	220.271,69	8,15%	768	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	151.207,23	5,60%	196	0,04%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>2.702.459,13</b>				

Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epv/validaDoc?seamCodigo=documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d40112fc3>



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2021)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	100,00%	2.702.459,13
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.527.738,53	56,53%	40,00%	70,00%	100,00%	1.174.720,60
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	2.702.459,13
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	135.122,96
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.621.475,48
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.621.475,48
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.023.513,37	37,87%	0,00%	8,00%	40,00%	57.470,28
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	1.080.983,65
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	540.491,83
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	405.368,87
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	405.368,87
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	135.122,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	135.122,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	135.122,96
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>2.551.251,90</b>	<b>94,40%</b>	<b>40,00%</b>	<b>85,00%</b>	<b>570,00%</b>	



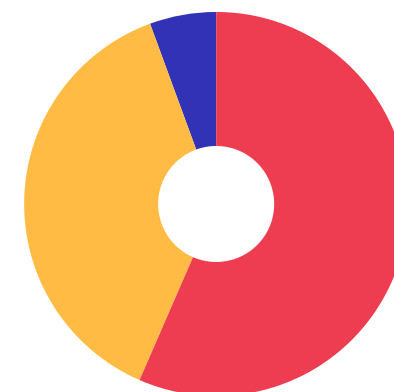
RENDA FIXA 2.551.251,90  
RENDA VARIÁVEL 151.207,23



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2021)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	810.737,74
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	810.737,74
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	20,00%	540.491,83
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	540.491,83
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	151.207,23	5,60%	0,00%	3,00%	10,00%	119.038,68
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	135.122,96
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	135.122,96
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>151.207,23</b>	<b>5,60%</b>	<b>0,00%</b>	<b>12,00%</b>	<b>120,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	270.245,91
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	270.245,91
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	270.245,91
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>3,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b    7º IV a    8º III

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3



**Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2021)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.702.459,13	100,00	0,00

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	40,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Documento Assinado Digitalmente por ZENEDILSON DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://www.tcepe.gov.br/gpp/validador/ocorrencia/assinatura/00944030-1234-4902-2222-222222222222>


**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	1,10%	3,07%	1,18%	3,12%	6,21%	14,71%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	2,74%	1,30%	2,74%	6,05%	13,77%	0,73%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,40%	1,78%	0,96%	1,65%	2,49%	7,15%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,37%	1,53%	0,87%	1,48%	2,16%	6,42%	0,30%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	1,00%	2,48%	1,18%	2,64%	5,95%	13,62%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,98%	2,29%	1,11%	2,49%	5,70%	13,04%	0,82%	0,02%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	-0,33%	-2,95%	-1,39%	-0,15%	-1,02%	5,48%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,38%	-3,19%	-1,51%	-0,38%	-1,26%	4,87%	1,41%	0,03%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,35%	1,66%	0,90%	1,43%	1,88%	4,33%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	2,64%	1,31%	2,13%	3,23%	6,30%	0,03%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	1,16%	6,90%	3,02%	4,75%	10,25%	13,70%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	-0,85%	-0,46%	0,90%	2,78%	-	0,67%	0,03%

 Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-e93de0112c63





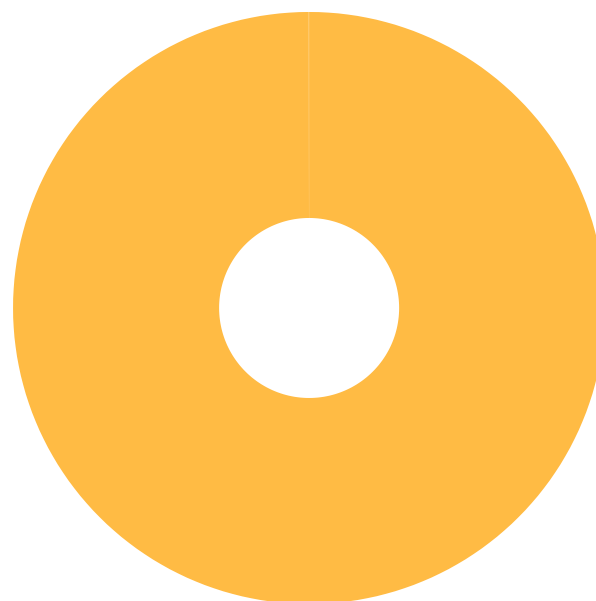
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,04%	1,59%	0,32%	1,53%	3,53%	6,08%	0,63%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



Distribuição dos ativos por Administradores - base (Setembro / 2021)



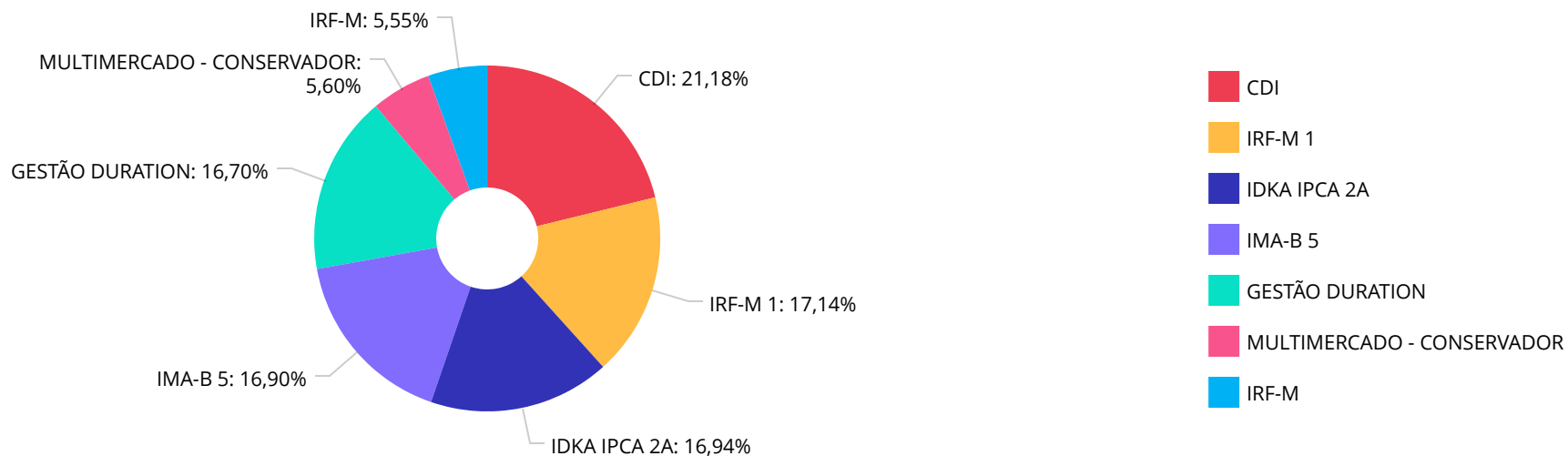
BB GESTÃO: 100,00%

BB GESTÃO 2.702.451,11

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2021)



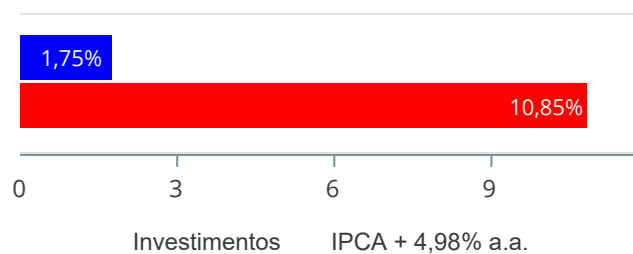
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE RORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDocumento.aspx?Titulo=documento:6024339-4222-4b02-4222-ea34e0112fc3>



**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V
Janeiro	2.395.758,04	3.020,40	7.606,77	2.392.320,93	1.149,26	1.149,26	0,05%	0,05%	0,64%	0,64%	7,53%	0,05%
Fevereiro	2.392.320,93	421.522,90	401.210,54	2.413.053,09	419,80	1.569,06	0,02%	0,07%	1,21%	1,86%	3,52%	0,08%
Março	2.413.053,09	460.871,74	800.828,26	2.074.376,38	1.279,81	2.848,87	0,05%	0,12%	1,38%	3,26%	3,63%	0,10%
Abril	2.074.376,38	456.838,05	347.150,65	2.189.128,91	5.065,13	7.914,00	0,23%	0,35%	0,70%	3,98%	8,81%	0,13%
Mai	2.189.128,91	1.741.304,99	1.661.805,04	2.278.780,11	10.151,25	18.065,25	0,45%	0,80%	1,24%	5,27%	15,18%	0,16%
Junho	2.278.780,11	723.450,03	359.654,20	2.644.833,61	2.257,67	20.322,92	0,09%	0,89%	0,94%	6,26%	14,16%	0,17%
Julho	2.644.833,61	590.750,69	750.494,37	2.488.466,26	3.376,33	23.699,25	0,13%	1,01%	1,39%	7,73%	13,12%	0,18%
Agosto	2.488.466,26	1.188.375,94	1.099.200,73	2.583.163,65	5.522,18	29.221,43	0,21%	1,23%	1,30%	9,13%	13,48%	0,19%
Setembro	2.583.163,65	581.056,94	475.637,48	2.702.459,13	13.876,02	43.097,45	0,52%	1,75%	1,57%	10,85%	16,17%	0,20%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://cctc.les.gov.br/dpp/vtdalDoc.aspx?IdDoc=554911>  
Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3

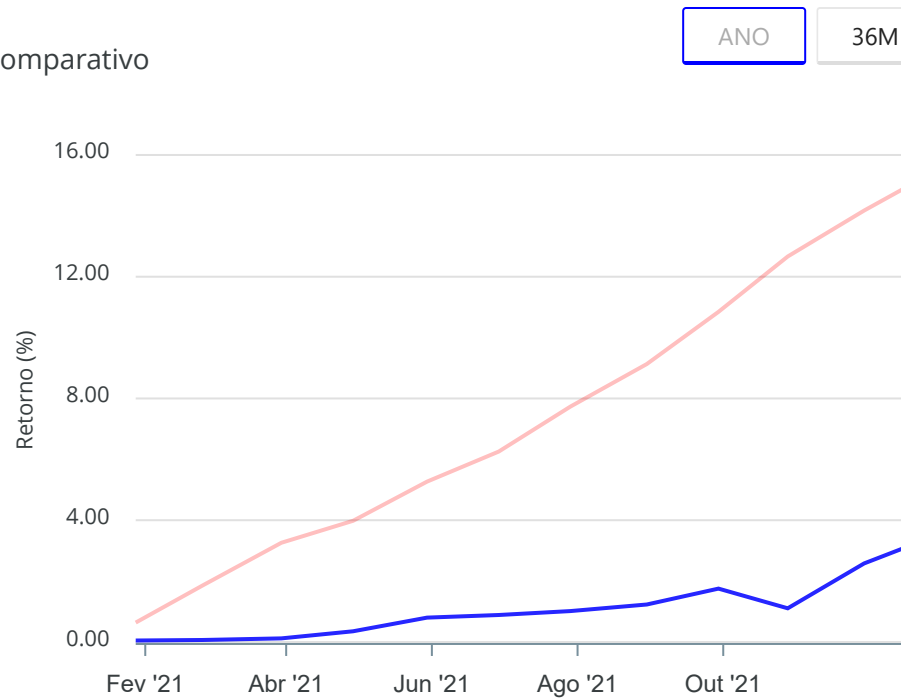


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos
- Meta de Rentabilidade
- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- IMA Geral
- IRF-M
- IRF-M 1
- IRF-M 1+
- Ibovespa
- IBX
- SMLL
- IDIV

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d40112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	453.103,95	0,00	0,00	457.786,53	4.682,58	1,03%	1,03%	0,73%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	452.312,19	0,00	0,00	456.733,93	4.421,74	0,98%	0,98%	0,82%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	219.264,96	0,00	0,00	220.271,69	1.006,73	0,46%	0,46%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	461.604,50	0,00	0,00	463.295,43	1.690,93	0,37%	0,37%	0,30%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	244.525,16	581.056,94	475.637,48	352.041,24	2.096,62	0,25%	0,35%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	450.717,21	0,00	0,00	451.200,44	483,23	0,11%	0,11%	0,67%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	150.488,22	0,00	0,00	149.922,64	-565,58	-0,38%	-0,38%	1,41%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>2.432.016,19</b>	<b>581.056,94</b>	<b>475.637,48</b>	<b>2.551.251,90</b>	<b>13.816,25</b>	<b>0,54%</b>		<b>0,54%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://seccat.org.br/validador/validador.do?codigo\_documento=b09d439c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	151.147,46	0,00	0,00	151.207,23	59,77	0,04%	0,04%	0,63%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>151.147,46</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>151.207,23</b>	<b>59,77</b>	<b>0,04%</b>		<b>0,63%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assine em: <https://eodetec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34d0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	401.741,60	50.000,00	0,00	457.786,53	6.044,93	1,34%	1,30%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	711.204,35	1.960.183,57	2.325.332,58	352.041,24	5.985,90	0,22%	0,90%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	401.478,80	50.000,00	0,00	456.733,93	5.255,13	1,16%	1,11%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	409.450,90	50.000,00	0,00	463.295,43	3.844,53	0,84%	0,87%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	217.434,05	0,00	0,00	220.271,69	2.837,64	1,31%	1,31%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	150.000,00	0,00	149.922,64	-77,36	-0,05%	-1,51%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	402.780,35	50.000,00	0,00	451.200,44	-1.579,91	-0,35%	-0,46%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>22.310,86</b>	<b>0,46%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinatura em: https://seccom.pe.gov.br/gov/validador/validarDocumento.aspx?Codigo=documento: b09d439c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3





Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Ins
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	100.743,56	50.000,00	0,00	151.207,23	463,67	0,31%	0,32%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>463,67</b>	<b>0,31%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://efcc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d0112fc3



## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas em investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe à consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: [https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qualificaDoc.seam?codigo\\_documento=09459-4234-222-ea340126c3](https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qualificaDoc.seam?codigo_documento=09459-4234-222-ea340126c3)

# Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.cfp-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d40112fc3



**Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2021)**

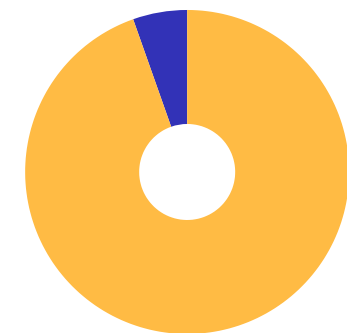
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	452.051,57	16,14%	1.026	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	450.911,66	16,10%	778	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	460.892,12	16,46%	1.136	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	145.907,83	5,21%	562	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	447.156,51	15,97%	587	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	470.450,81	16,80%	810	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	221.348,59	7,90%	798	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	151.516,21	5,41%	197	0,05%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>2.800.235,30</b>				

Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: [https://etce.tce.pe.gov.br/epv/validaDoc?scan=Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3](https://etce.tce.pe.gov.br/epv/validaDoc?scan=Código%20do%20documento%3A%20b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3)



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Outubro / 2021)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	100,00%	2.800.235,30
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.509.763,18	53,92%	40,00%	70,00%	100,00%	1.290.472,12
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	2.800.235,30
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	140.011,77
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.680.141,18
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.680.141,18
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.138.955,91	40,67%	0,00%	8,00%	40,00%	-18.861,79
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	1.120.094,12
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	560.047,06
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	420.035,30
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	420.035,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	140.011,77
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	140.011,77
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	140.011,77
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>2.648.719,09</b>	<b>94,59%</b>	<b>40,00%</b>	<b>85,00%</b>	<b>570,00%</b>	



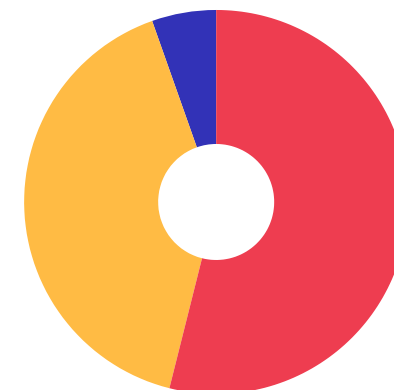
RENDA FIXA 2.648.719,09  
RENDA VARIÁVEL 151.516,21



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 2021)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	840.070,59
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	840.070,59
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	20,00%	560.047,06
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	560.047,06
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	151.516,21	5,41%	0,00%	3,00%	10,00%	128.507,32
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	140.011,77
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	140.011,77
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>151.516,21</b>	<b>5,41%</b>	<b>0,00%</b>	<b>12,00%</b>	<b>120,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	280.023,53
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	280.023,53
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	280.023,53
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>3,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b    7º IV a    8º III

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3



**Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2021)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.800.235,30	100,00	0,00

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	40,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Documento Assinado Digitalmente por ZENEDILSON DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://www.tcece.org.br/gpp/validador/ocorrencia/assinatura/00944030-1234-4902-2222-222222222222>


**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2021 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	-1,47%	1,56%	-0,12%	0,25%	4,62%	11,66%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,25%	1,45%	-0,05%	0,61%	4,38%	10,97%	1,89%	0,03%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	-0,54%	1,23%	0,23%	0,83%	1,78%	5,91%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,52%	1,00%	0,18%	0,70%	1,52%	5,24%	0,74%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	-1,24%	1,22%	-0,10%	0,49%	4,43%	10,39%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-1,28%	0,98%	-0,21%	0,31%	4,16%	9,80%	2,00%	0,03%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	-2,63%	-5,50%	-3,53%	-3,59%	-3,30%	0,99%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,68%	-5,78%	-3,67%	-3,83%	-3,60%	0,38%	3,02%	0,04%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,48%	3,00%	1,35%	2,29%	3,32%	6,65%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,40%	2,07%	1,05%	1,72%	2,23%	4,34%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,49%	3,14%	1,40%	2,43%	3,57%	6,36%	0,05%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	1,25%	8,24%	3,32%	5,73%	10,67%	15,01%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,90%	-1,74%	-1,24%	-0,71%	1,93%	-	1,43%	0,03%

 Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112c3





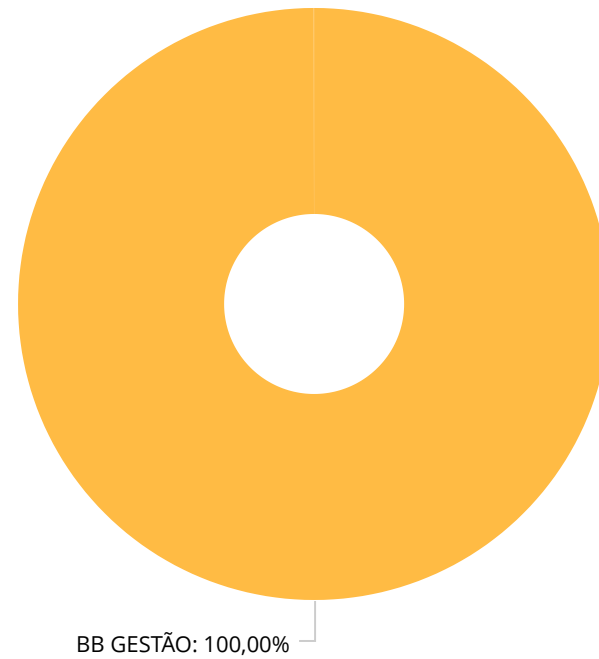
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,48%	3,00%	1,35%	2,29%	3,32%	6,65%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,20%	1,80%	0,46%	1,16%	3,96%	5,49%	0,65%	0,01%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



Distribuição dos ativos por Administradores - base (Outubro / 2021)

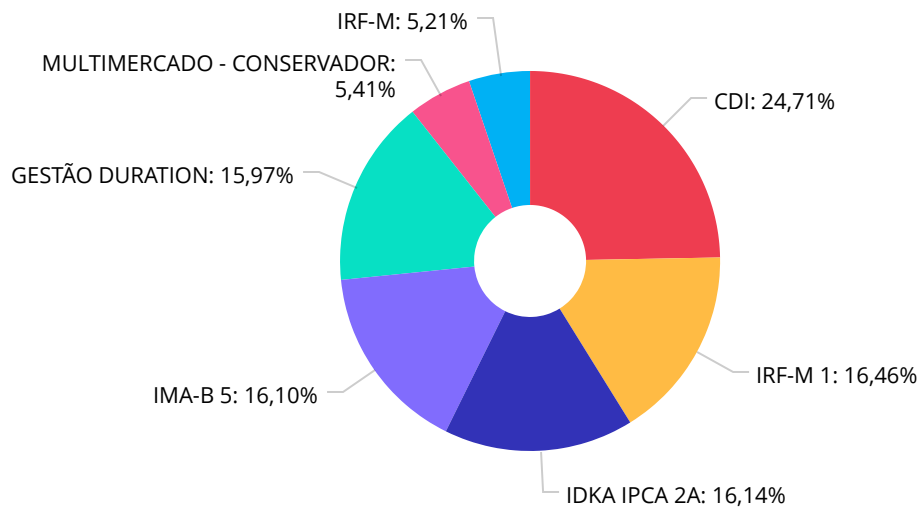


BB GESTÃO 2.800.239,33

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Outubro / 2021)



CDI	691.794,4
IRF-M 1	460.891,1
IDKA IPCA 2A	452.055,5
IMA-B 5	450.916,6
GESTÃO DURATION	447.155,1
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	151.511,21
IRF-M	145.901,83

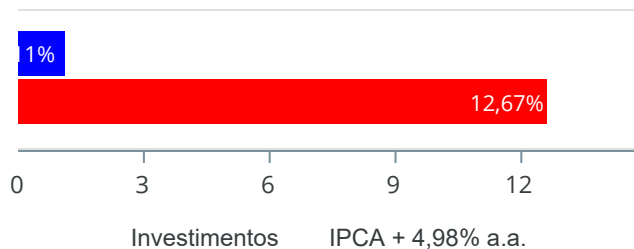
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE BORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDocumento.aspx?CodigoDocumento=6082439423a4b02422ea34e0112fc3>



**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V
Janeiro	2.395.758,04	3.020,40	7.606,77	2.392.320,93	1.149,26	1.149,26	0,05%	0,05%	0,64%	0,64%	7,53%	0,
Fevereiro	2.392.320,93	421.522,90	401.210,54	2.413.053,09	419,80	1.569,06	0,02%	0,07%	1,21%	1,86%	3,52%	0,
Março	2.413.053,09	460.871,74	800.828,26	2.074.376,38	1.279,81	2.848,87	0,05%	0,12%	1,38%	3,26%	3,63%	0,
Abril	2.074.376,38	456.838,05	347.150,65	2.189.128,91	5.065,13	7.914,00	0,23%	0,35%	0,70%	3,98%	8,81%	0,
Maio	2.189.128,91	1.741.304,99	1.661.805,04	2.278.780,11	10.151,25	18.065,25	0,45%	0,80%	1,24%	5,27%	15,18%	0,
Junho	2.278.780,11	723.450,03	359.654,20	2.644.833,61	2.257,67	20.322,92	0,09%	0,89%	0,94%	6,26%	14,16%	0,
Julho	2.644.833,61	590.750,69	750.494,37	2.488.466,26	3.376,33	23.699,25	0,13%	1,01%	1,39%	7,73%	13,12%	0,
Agosto	2.488.466,26	1.188.375,94	1.099.200,73	2.583.163,65	5.522,18	29.221,43	0,21%	1,23%	1,30%	9,13%	13,48%	0,
Setembro	2.583.163,65	581.056,94	475.637,48	2.702.459,13	13.876,02	43.097,45	0,52%	1,75%	1,57%	10,85%	16,17%	0,
Outubro	2.702.459,13	867.947,57	752.236,32	2.800.235,30	-17.935,08	25.162,37	-0,64%	1,11%	1,64%	12,67%	8,73%	1,

Investimentos x Meta de Rentabilidade



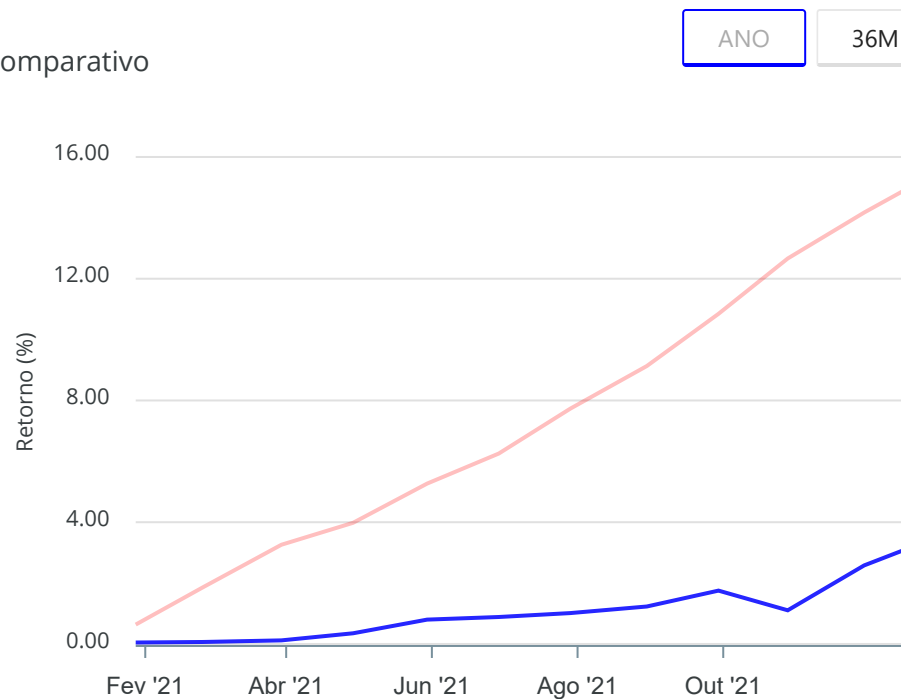


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos      Meta de Rentabilidade       CDI       IMA-B
- IMA-B 5       IMA-B 5+       IMA Geral       IRF-M       IRF-M 1
- IRF-M 1+       Ibovespa       IBX       SMLL       IDIV

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d40112fc3



## Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Outubro/2021

## FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	220.271,69	0,00	0,00	221.348,59	1.076,90	0,49%	0,49%	0,05
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	352.041,24	867.947,57	752.236,32	470.450,81	2.698,32	0,22%	0,40%	0,01
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	463.295,43	0,00	0,00	460.892,12	-2.403,31	-0,52%	-0,52%	0,74
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	451.200,44	0,00	0,00	447.156,51	-4.043,93	-0,90%	-0,90%	1,43
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	457.786,53	0,00	0,00	452.051,57	-5.734,96	-1,25%	-1,25%	1,89
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	456.733,93	0,00	0,00	450.911,66	-5.822,27	-1,27%	-1,27%	2,00
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	149.922,64	0,00	0,00	145.907,83	-4.014,81	-2,68%	-2,68%	3,02
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>2.551.251,90</b>	<b>867.947,57</b>	<b>752.236,32</b>	<b>2.648.719,09</b>	<b>-18.244,06</b>	<b>-0,68%</b>		<b>1,20</b>

 Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Assine em: <https://seccom.mec.gov.br/gov/valida/validaDocumento.asp?codigo=001121c3-b094d39c-d23a-4bb2-a222-ef3dc01121c3>



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Outubro/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	151.207,23	0,00	0,00	151.516,21	308,98	0,20%	0,20%	0,65%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>151.207,23</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>151.516,21</b>	<b>308,98</b>	<b>0,20%</b>		<b>0,65%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://docs.receita.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas em investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe à consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qual/Doc.seam?CodigoDoc=222-ea3a-0121c3>



# Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.cej.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d40112fc3



**Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2021)**

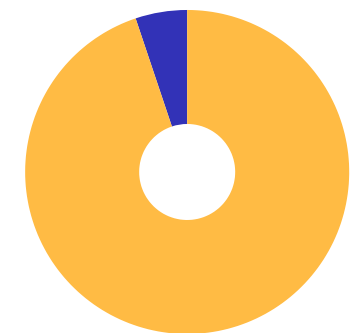
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	463.032,72	15,67%	1.026	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	462.063,66	15,63%	782	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	464.454,05	15,72%	1.122	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	148.536,35	5,03%	542	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	454.048,43	15,36%	588	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	588.239,91	19,90%	815	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	222.744,39	7,54%	839	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	152.328,27	5,15%	196	0,05%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>2.955.447,78</b>				

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: [https://etec.tce.pe.gov.br/epv/validaDoc?scan=Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3](https://etec.tce.pe.gov.br/epv/validaDoc?scan=Código%20do%20documento%3A%20b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3)



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Novembro / 2021)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	100,00%	2.955.447,78
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.538.086,78	52,04%	40,00%	70,00%	100,00%	1.417.361,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	2.955.447,78
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	147.772,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.773.268,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.773.268,67
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.265.032,73	42,80%	0,00%	8,00%	40,00%	-82.853,62
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	1.182.179,11
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	591.089,56
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	443.317,17
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	443.317,17
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	147.772,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	147.772,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	147.772,39
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>2.803.119,51</b>	<b>94,85%</b>	<b>40,00%</b>	<b>85,00%</b>	<b>570,00%</b>	



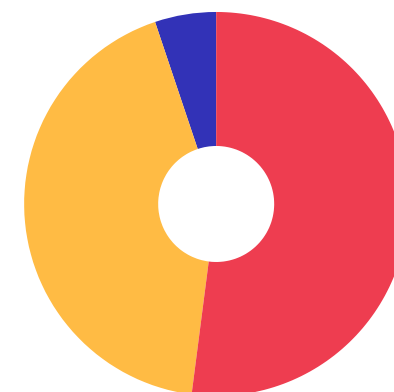
RENDA FIXA 2.803.119,51  
RENDA VARIÁVEL 152.328,27



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Novembro / 2021)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	886.634,33
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	886.634,33
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	20,00%	591.089,56
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	591.089,56
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	152.328,27	5,15%	0,00%	3,00%	10,00%	143.216,51
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	147.772,39
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	147.772,39
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>152.328,27</b>	<b>5,15%</b>	<b>0,00%</b>	<b>12,00%</b>	<b>120,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	295.544,78
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	295.544,78
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	295.544,78
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>3,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b    7º IV a    8º III

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3



**Enquadramento por Gestores - base (Novembro / 2021)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.955.447,78	100,00	0,00

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	40,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Documento Assinado Digitalmente por ZENEDILSON DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://www.tcepe.gov.br/gpp/validador/ocorrencia/assinatura/00944030-1234-4002-2222-222222222222>


**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2021 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	2,51%	4,11%	2,12%	1,88%	5,91%	14,44%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,43%	3,91%	2,19%	2,36%	5,50%	13,43%	1,11%	0,03%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,79%	2,03%	0,65%	1,42%	2,35%	6,40%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	1,78%	0,62%	1,30%	2,10%	5,73%	0,32%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	2,50%	3,75%	2,25%	2,30%	5,65%	13,47%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2,47%	3,48%	2,16%	2,10%	5,35%	12,86%	1,23%	0,04%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	1,79%	-3,81%	-1,21%	-2,06%	-1,93%	3,27%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80%	-4,08%	-1,30%	-2,26%	-2,20%	2,67%	1,82%	0,04%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,59%	3,60%	1,51%	2,62%	3,77%	6,87%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,51%	2,58%	1,26%	2,04%	2,69%	4,56%	0,00%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,63%	3,80%	1,59%	2,78%	4,06%	6,66%	0,03%	0,01%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,95%	9,26%	3,40%	5,86%	10,74%	15,51%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,54%	-0,22%	0,74%	0,22%	2,47%	-	1,19%	0,04%

 Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validarDoc> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-e33d0112c63



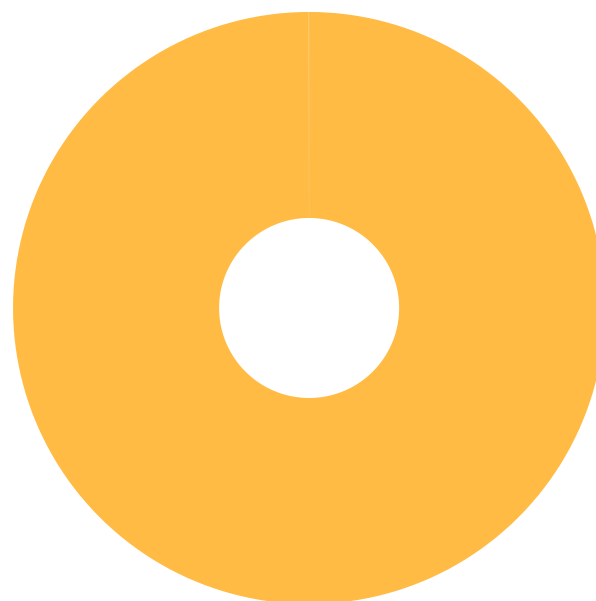
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,59%	3,60%	1,51%	2,62%	3,77%	6,87%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,54%	2,34%	0,78%	1,27%	3,47%	5,22%	0,75%	0,01%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



Distribuição dos ativos por Administradores - base (Novembro / 2021)



BB GESTÃO: 100,00%

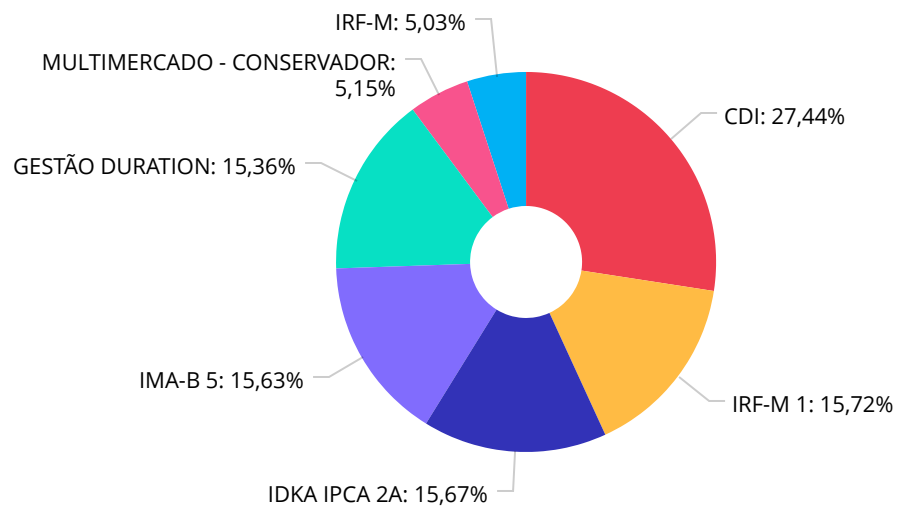
■ BB GESTÃO 2.955.447,71

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3





Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Novembro / 2021)



CDI	810.983,33
IRF-M 1	464.454,00
IDKA IPCA 2A	463.032,71
IMA-B 5	462.062,66
GESTÃO DURATION	454.042,43
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	152.322,27
IRF-M	148.530,35

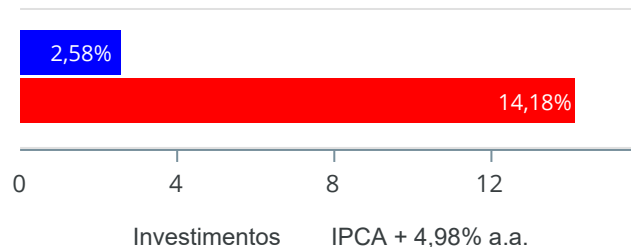
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE BORTO DE OLIVEIRA  
 Assinado em: 30/11/2021  
 Acesso em: https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDocumento.asp?CodigoDocumento=008043906123a44b024222ea34e0112fc3



**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V
Janeiro	2.395.758,04	3.020,40	7.606,77	2.392.320,93	1.149,26	1.149,26	0,05%	0,05%	0,64%	0,64%	7,53%	0,
Fevereiro	2.392.320,93	421.522,90	401.210,54	2.413.053,09	419,80	1.569,06	0,02%	0,07%	1,21%	1,86%	3,52%	0,
Março	2.413.053,09	460.871,74	800.828,26	2.074.376,38	1.279,81	2.848,87	0,05%	0,12%	1,38%	3,26%	3,63%	0,
Abril	2.074.376,38	456.838,05	347.150,65	2.189.128,91	5.065,13	7.914,00	0,23%	0,35%	0,70%	3,98%	8,81%	0,
Mai	2.189.128,91	1.741.304,99	1.661.805,04	2.278.780,11	10.151,25	18.065,25	0,45%	0,80%	1,24%	5,27%	15,18%	0,
Junho	2.278.780,11	723.450,03	359.654,20	2.644.833,61	2.257,67	20.322,92	0,09%	0,89%	0,94%	6,26%	14,16%	0,
Julho	2.644.833,61	590.750,69	750.494,37	2.488.466,26	3.376,33	23.699,25	0,13%	1,01%	1,39%	7,73%	13,12%	0,
Agosto	2.488.466,26	1.188.375,94	1.099.200,73	2.583.163,65	5.522,18	29.221,43	0,21%	1,23%	1,30%	9,13%	13,48%	0,
Setembro	2.583.163,65	581.056,94	475.637,48	2.702.459,13	13.876,02	43.097,45	0,52%	1,75%	1,57%	10,85%	16,17%	0,
Outubro	2.702.459,13	867.947,57	752.236,32	2.800.235,30	-17.935,08	25.162,37	-0,64%	1,11%	1,64%	12,67%	8,73%	1,
Novembro	2.800.235,30	460.134,82	347.418,84	2.955.447,78	42.496,50	67.658,87	1,46%	2,58%	1,34%	14,18%	18,21%	0,

Investimentos x Meta de Rentabilidade

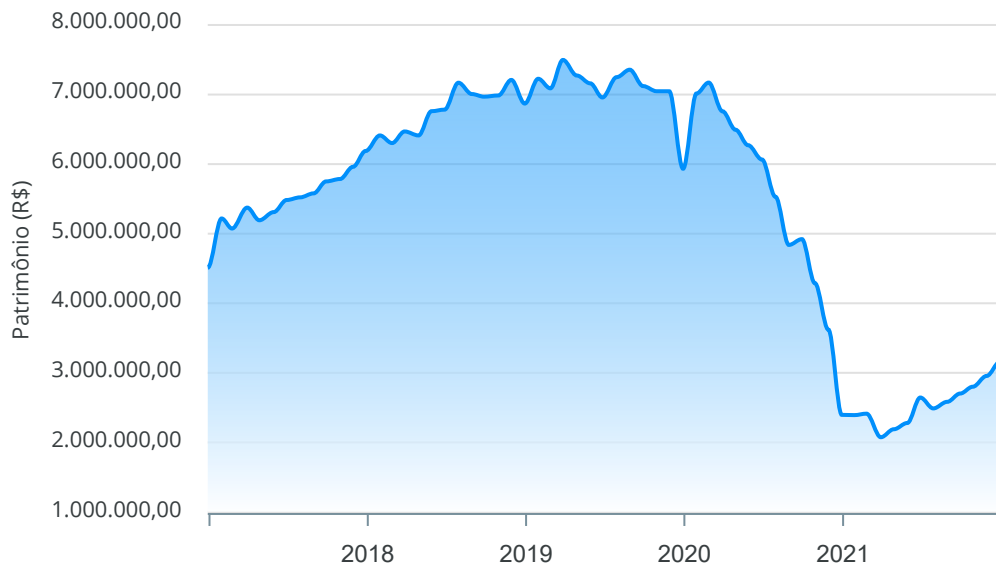


Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: https://cda.ces.gov.br/pepv/portal/portal.do?acao=assinatura

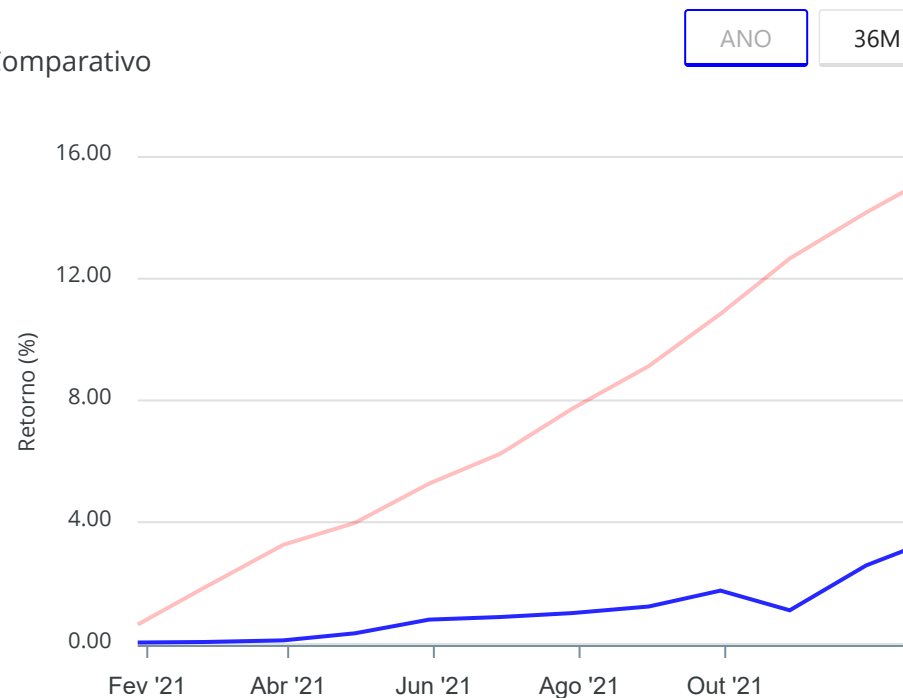


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos
- Meta de Rentabilidade
- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- IMA Geral
- IRF-M
- IRF-M 1
- IRF-M 1+
- Ibovespa
- IBX
- SMLL
- IDIV

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d40112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Novembro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	450.911,66	0,00	0,00	462.063,66	11.152,00	2,47%	2,47%	1,23%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	452.051,57	0,00	0,00	463.032,72	10.981,15	2,43%	2,43%	1,11%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	145.907,83	0,00	0,00	148.536,35	2.628,52	1,80%	1,80%	1,82%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	447.156,51	0,00	0,00	454.048,43	6.891,92	1,54%	1,54%	1,19%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	460.892,12	0,00	0,00	464.454,05	3.561,93	0,77%	0,77%	0,32%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	221.348,59	0,00	0,00	222.744,39	1.395,80	0,63%	0,63%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	470.450,81	460.134,82	347.418,84	588.239,91	5.073,12	0,55%	0,51%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>2.648.719,09</b>	<b>460.134,82</b>	<b>347.418,84</b>	<b>2.803.119,51</b>	<b>41.684,44</b>	<b>1,51%</b>		<b>0,73%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://seccatopen.ges.br/gpp/validaDocumentoCodigo do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Novembro/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	151.516,21	0,00	0,00	152.328,27	812,06	0,54%	0,54%	0,75%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>151.516,21</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>152.328,27</b>	<b>812,06</b>	<b>0,54%</b>		<b>0,75%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://sede.tce.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas em investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe à consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qualificaDoc.seam> Código do Documento: 09459-4234-222-ea34012c3



# Relatório Analítico dos Investimentos

## em dezembro, 4º trimestre e ano de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.ce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b62-a222-ea3d40112fc3



**Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	566.731,17	17,93%	1.035	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	565.793,78	17,90%	788	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	568.499,11	17,99%	1.127	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	151.323,95	4,79%	540	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	771.813,56	24,42%	803	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	381.815,65	12,08%	854	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	154.110,71	4,88%	199	0,05%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>3.160.087,93</b>				

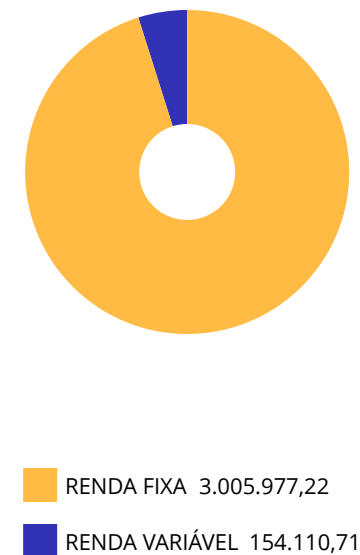
Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: [https://etec.tce.pe.gov.br/epv/validaDoc?scan=Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3](https://etec.tce.pe.gov.br/epv/validaDoc?scan=Código%20do%20documento%3A%20b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3)





**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2021)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	100,00%	3.160.087,93
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.852.348,01	58,62%	40,00%	70,00%	100,00%	1.307.739,92
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	3.160.087,93
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	158.004,40
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.896.052,76
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.896.052,76
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.153.629,21	36,51%	0,00%	8,00%	40,00%	110.405,96
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	1.264.035,17
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	632.017,59
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	474.013,19
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	474.013,19
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	158.004,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	158.004,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	158.004,40
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>3.005.977,22</b>	<b>95,12%</b>	<b>40,00%</b>	<b>85,00%</b>	<b>570,00%</b>	



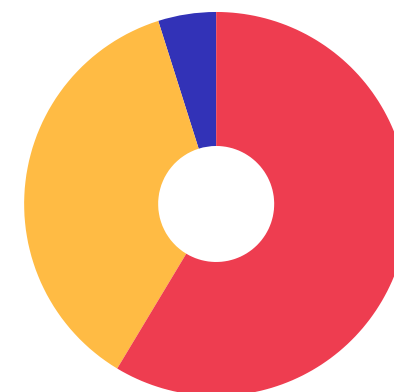
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/vvalidaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2021)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	948.026,38
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	948.026,38
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	20,00%	632.017,59
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	632.017,59
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	154.110,71	4,88%	0,00%	3,00%	10,00%	161.898,08
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	158.004,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	158.004,40
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>154.110,71</b>	<b>4,88%</b>	<b>0,00%</b>	<b>12,00%</b>	<b>120,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	316.008,79
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	316.008,79
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	316.008,79
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>3,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b    7º IV a    8º III

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



**Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2021)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.160.087,93	100,00	0,00

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	40,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Documento Assinado Digitalmente por ZENEDILSON DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://www.tcece.org.br/gpp/validador/ocorrencia/assinatura/00944030-1234-4902-2222-222222222222>



**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,83%	4,97%	1,84%	3,05%	4,97%	14,02%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,65%	1,86%	3,18%	4,65%	12,93%	1,05%	0,03%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,88%	2,93%	1,13%	2,10%	2,93%	6,88%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,84%	2,64%	1,10%	1,97%	2,64%	6,20%	0,20%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,79%	4,57%	2,03%	3,24%	4,57%	12,97%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,76%	4,27%	1,94%	3,06%	4,27%	12,38%	1,04%	0,03%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	1,89%	-1,99%	0,98%	-0,42%	-1,99%	4,57%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,88%	-2,28%	0,94%	-0,59%	-2,28%	3,97%	1,54%	0,04%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,67%	3,27%	1,58%	2,49%	3,27%	4,96%	0,02%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,80%	4,62%	1,93%	3,26%	4,62%	7,13%	0,03%	0,01%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-e33dc0112fc3



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,17%	3,54%	1,92%	2,25%	3,54%	5,62%	0,65%	0,01%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



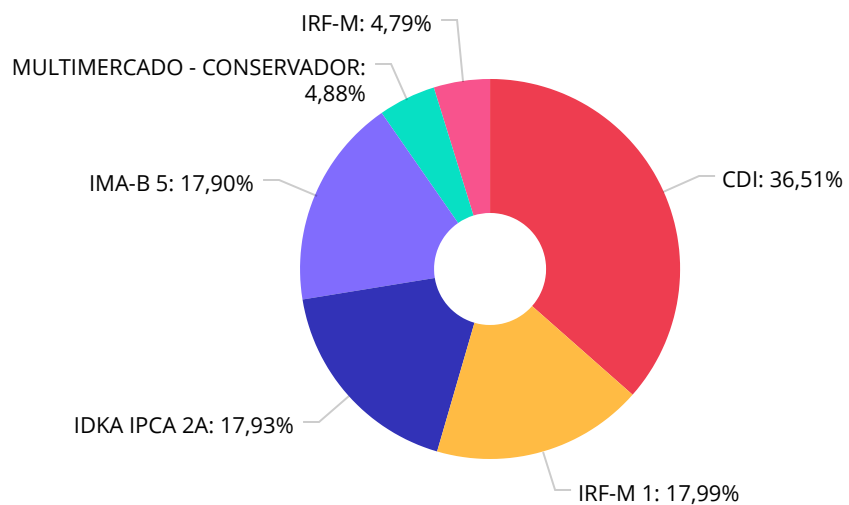
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2021)



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea34e0112fc3



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2021)



CDI	1.153.622,22
IRF-M 1	568.491,11
IDKA IPCA 2A	566.731,11
IMA-B 5	565.797,77
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	154.111,71
IRF-M	151.322,95

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.aspx?CodigoDocumento=0094489-d23a-4b02-a222-ea3de0112fc3>





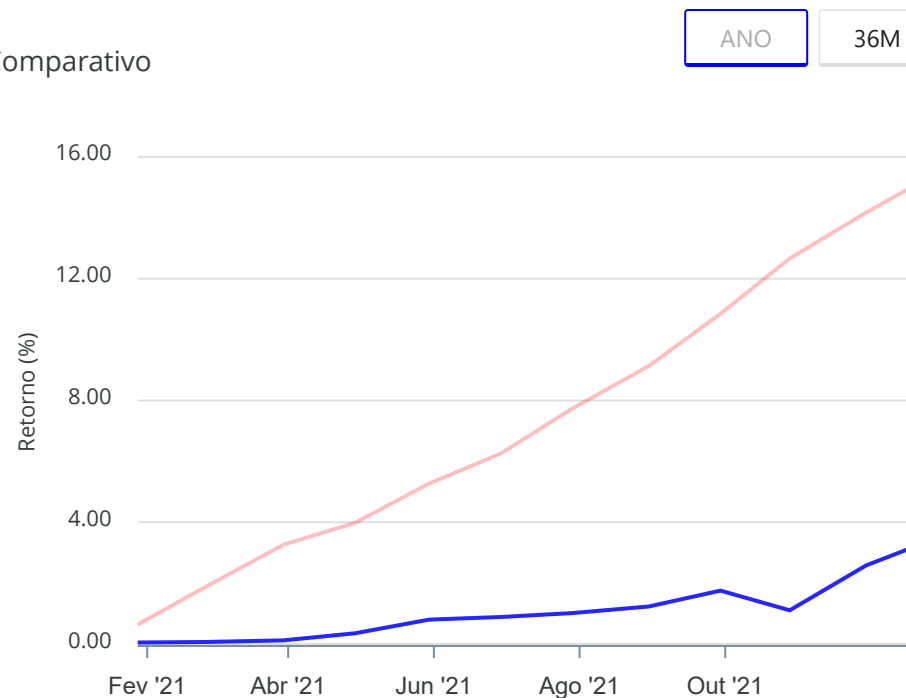


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos      Meta de Rentabilidade       CDI       IMA-B
- IMA-B 5       IMA-B 5+       IMA Geral       IRF-M       IRF-M 1
- IRF-M 1+       Ibovespa       IBX       SMLL       IDIV

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d40112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instt	Var - In
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	148.536,35	0,00	0,00	151.323,95	2.787,60	1,88%	1,88%	1,54%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	454.048,43	0,00	457.325,17	0,00	3.276,74	0,72%	0,76%	0,79%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	464.454,05	100.000,00	0,00	568.499,11	4.045,06	0,72%	0,84%	0,20%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	462.063,66	100.000,00	0,00	565.793,78	3.730,12	0,66%	0,76%	1,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	463.032,72	100.000,00	0,00	566.731,17	3.698,45	0,66%	0,71%	1,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	222.744,39	157.068,06	0,00	381.815,65	2.003,20	0,53%	0,80%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	588.239,91	1.278.259,98	1.102.055,56	771.813,56	7.369,23	0,39%	0,67%	0,02%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>2.803.119,51</b>	<b>1.735.328,04</b>	<b>1.559.380,73</b>	<b>3.005.977,22</b>	<b>26.910,40</b>	<b>0,90%</b>		<b>0,52%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Assinse em: https://scc.trfcp.jus.br/visualizarAssinatura.do?codigoDoDocumento: b094d39c-d23a-4bb2-a222-ea3dc0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	152.328,27	0,00	0,00	154.110,71	1.782,44	1,17%	1,17%	0,65%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>152.328,27</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>154.110,71</b>	<b>1.782,44</b>	<b>1,17%</b>		<b>0,65%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://docs.tcepe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	352.041,24	2.606.342,37	2.201.710,72	771.813,56	15.140,67	0,51%	1,58%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	456.733,93	100.000,00	0,00	565.793,78	9.059,85	1,63%	1,94%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	457.786,53	100.000,00	0,00	566.731,17	8.944,64	1,60%	1,86%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	451.200,44	0,00	457.325,17	0,00	6.124,73	1,36%	1,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	463.295,43	100.000,00	0,00	568.499,11	5.203,68	0,92%	1,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	220.271,69	157.068,06	0,00	381.815,65	4.475,90	1,19%	1,93%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	149.922,64	0,00	0,00	151.323,95	1.401,31	0,93%	0,93%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>50.350,78</b>	<b>1,70%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinatura em: https://seccom.mun.gov.br/gov/validador/validarDocumentoCodigo do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Ins
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	151.207,23	0,00	0,00	154.110,71	2.903,48	1,92%	1,92%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>2.903,48</b>	<b>1,92%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://efcc.ce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Int...
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	235.565,31	7.053.261,92	6.542.144,80	771.813,56	25.131,13	0,34%	3,27%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	0,00	550.000,00	0,00	566.731,17	16.731,17	3,04%	4,65%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	550.000,00	0,00	565.793,78	15.793,78	2,87%	4,27%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.942.714,14	150.000,00	1.540.000,00	568.499,11	15.784,97	0,75%	2,64%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	214.600,67	157.068,06	0,00	381.815,65	10.146,92	2,73%	4,62%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	450.000,00	457.325,17	0,00	7.325,17	1,63%	0,53%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	150.000,00	0,00	151.323,95	1.323,95	0,88%	-2,28%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	2.877,92	20.272,13	23.153,96	0,00	3,91	0,02%	2,51%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>92.241,00</b>	<b>3,17%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://seccom.mpe.gov.br/gov/validador/validador.do?sessao=6&codigo\_documento=b09d4d39c-d23a-4b02-a222-ea3dc0112fc3



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Ins
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	150.000,00	0,00	154.110,71	4.110,71	2,74%	3,54%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>4.110,71</b>	<b>2,74%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://efcc.ce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: b094d39c-d23a-4b02-a222-ea3d0112fc3



## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas em investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe à consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qualificaDoc.seam> Código do Documento: 09459-4234-222-ea34012c3