



Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <http://etcg.cpf-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.832.107,53	3,65%	699	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	266.784,51	0,53%	140	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.809.792,34	5,60%	262	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.768.309,21	9,50%	892	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.625.971,01	15,20%	1.348	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	8.146.359,48	16,23%	443	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	51.008,46	0,10%	763	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	6.935.239,26	13,82%	196	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	770.894,21	1,54%	1.459	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	184.169,62	0,37%	120	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	277.254,64	0,55%	634	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	651.662,31	1,30%	15.624	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	241.526,56	0,48%	26	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	346.258,72	0,69%	31	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.774.358,87	3,54%	70	2,44%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.427.136,16	2,84%	18.040	0,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.201.495,01	2,39%	44.564	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.434.822,40	4,85%	200	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.499.143,81	2,99%	30	0,51%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	764.316,99	1,52%	17	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/ppv/validadoc.aspx?Codigo=documento:3c431dd9-f204-4363-a003-14789702645e>



Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

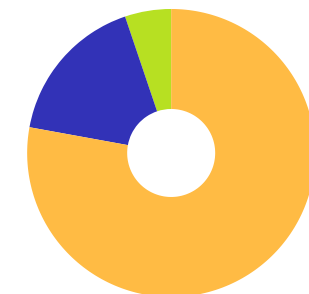
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	31.259,96	0,06%	33	0,39%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.145.115,59	2,28%		1,60%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.604.901,11	5,19%	203	0,12%	Artigo 9º, Inciso III
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.391.486,84	4,77%	6	11,01%	Desenquadrado - RF
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		881.803,89	1,76%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			50.181.374,60				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			881.803,89				Artigo 6º
PL Total			51.063.178,49				

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epv/validarDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	100,00%	50.181.374,60
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	17.302.964,60	34,48%	11,00%	50,00%	60,00%	12.805.860,16
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	50.181.374,60
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.509.068,73
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	5.018.137,46
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	30.108.824,76
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	17.604.373,26	35,08%	4,00%	15,00%	30,00%	-2.549.960,88
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	20.072.549,84
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	10.036.274,92
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.527.206,19
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.527.206,19
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.774.358,87	3,54%	0,00%	5,00%	5,00%	734.709,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.509.068,73
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.509.068,73
Desenquadrado - RF	0,00%	2.391.486,84	4,77%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.391.486,84
Total Renda Fixa	100,00%	39.073.183,57	77,86%	15,00%	75,00%	470,00%	



RENDA FIXA 39.073.183,57
RENDA VARIÁVEL 8.503.289,92
EXTERIOR 2.604.901,11

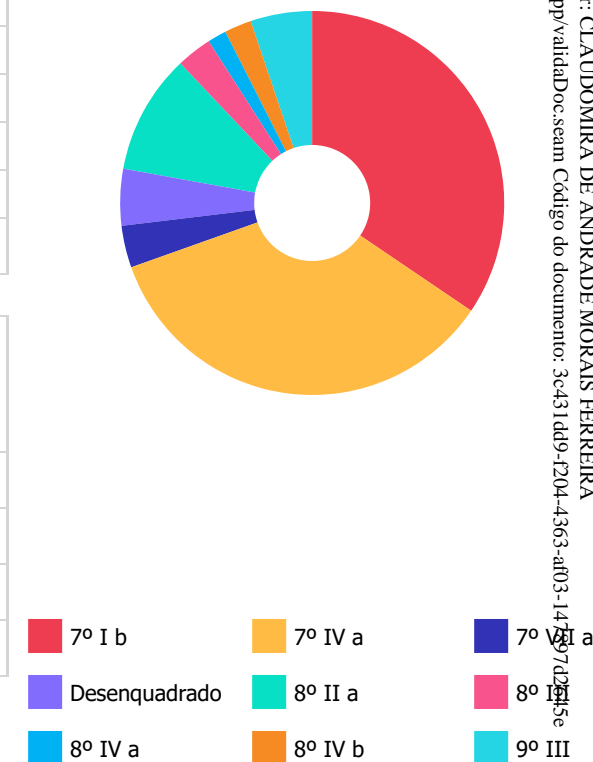
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	5,00%	2.509.068,73
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	15.054.412,38
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	5.063.453,57	10,09%	6,00%	16,00%	20,00%	4.972.821,35
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	10.036.274,92
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.499.143,81	2,99%	3,50%	3,69%	10,00%	3.518.993,65
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	795.576,95	1,59%	0,00%	2,00%	4,00%	1.211.678,03
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.145.115,59	2,28%	0,00%	3,00%	5,00%	1.363.953,14
Total Renda Variável	30,00%	8.503.289,92	16,95%	9,50%	24,69%	94,00%	

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%	5.018.137,46
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.509.068,73
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.604.901,11	5,19%	0,00%	0,31%	5,00%	-95.832,38
Total Exterior	10,00%	2.604.901,11	5,19%	0,00%	0,31%	20,00%	



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-142972215e



Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	16.112.267,90	32,11	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	14.449.892,02	28,80	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.924.891,15	25,76	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.919.474,46	5,82	1,40
MULTINVEST CAPITAL	2.391.486,84	4,77	0,29
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	764.316,99	1,52	0,08
PLURAL	377.518,68	0,75	-
RJI CORRETORA DE VALORES	241.526,56	0,48	0,05

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 %		

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://ste.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,79%	0,79%	4,23%	7,86%	11,79%	24,66%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,03%	0,03%	0,11%	-1,37%	-4,58%	-4,73%	0,41%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,04%	0,04%	0,58%	1,02%	3,43%	10,27%	-	-
BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,03%	0,03%	0,55%	0,82%	3,08%	9,60%	0,16%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,03%	0,03%	0,53%	0,90%	3,22%	9,83%	0,15%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,28%	3,80%	7,55%	20,52%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,12%	-0,12%	-21,80%	-23,81%	-37,21%	-35,57%	0,57%	0,26%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-8,48%	-8,48%	-58,25%	-60,31%	-72,81%	-71,43%	14,19%	0,56%
IRF-M (Benchmark)	-0,80%	-0,80%	1,50%	-0,15%	4,92%	16,95%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,80%	-0,80%	1,50%	-0,30%	4,65%	16,40%	1,53%	0,03%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,64%	0,64%	2,40%	3,16%	-3,55%	6,22%	0,62%	0,06%
CDI (Benchmark)	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%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,16%	0,16%	0,68%	0,95%	2,20%	7,87%	0,02%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,01%	0,04%	0,06%	0,13%	1,04%	0,00%	0,00%
BRANCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,02%	0,02%	0,07%	0,06%	0,42%	3,52%	0,00%	0,00%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.ce.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,16%	0,16%	0,54%	0,82%	2,49%	8,41%	0,02%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,25%	0,25%	2,51%	4,30%	4,56%	8,94%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,47%	-0,47%	3,25%	1,20%	-	-	1,56%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,15%	0,15%	3,08%	3,70%	6,62%	18,65%	0,88%	0,03%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,58%	-0,58%	2,68%	0,52%	3,61%	14,74%	1,40%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,03%	0,03%	2,18%	0,99%	5,83%	20,75%	0,76%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,05%	1,05%	5,06%	9,60%	15,40%	32,92%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,46%	-0,46%	-3,29%	-	-	-97,02%	-	0,83%
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,94%	0,94%	4,70%	8,86%	13,85%	29,35%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,16%	-0,16%	-0,47%	-1,00%	-	-	-	0,00%
Global BDRX (Benchmark)	6,11%	6,11%	9,83%	21,25%	53,50%	120,12%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,79%	5,79%	9,11%	20,97%	53,70%	118,69%	12,35%	0,22%
Ibovespa (Benchmark)	-3,32%	-3,32%	22,47%	11,81%	1,15%	18,15%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-4,97%	-4,97%	22,58%	14,24%	5,75%	36,55%	11,79%	0,47%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-3,18%	-3,18%	16,79%	6,58%	-7,53%	25,82%	13,37%	0,39%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	-2,48%	-2,48%	13,85%	13,11%	-4,84%	13,16%	12,40%	0,41%
CDI (Benchmark)	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-0,07%	-0,07%	2,23%	1,28%	5,85%	13,27%	0,77%	0,02%
IFIX (Benchmark)	0,32%	0,32%	4,07%	5,35%	-6,43%	19,49%	-	-
HAZ FII - ATCR11	-0,46%	-0,46%	-0,33%	-0,47%	1,99%	383,14%	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



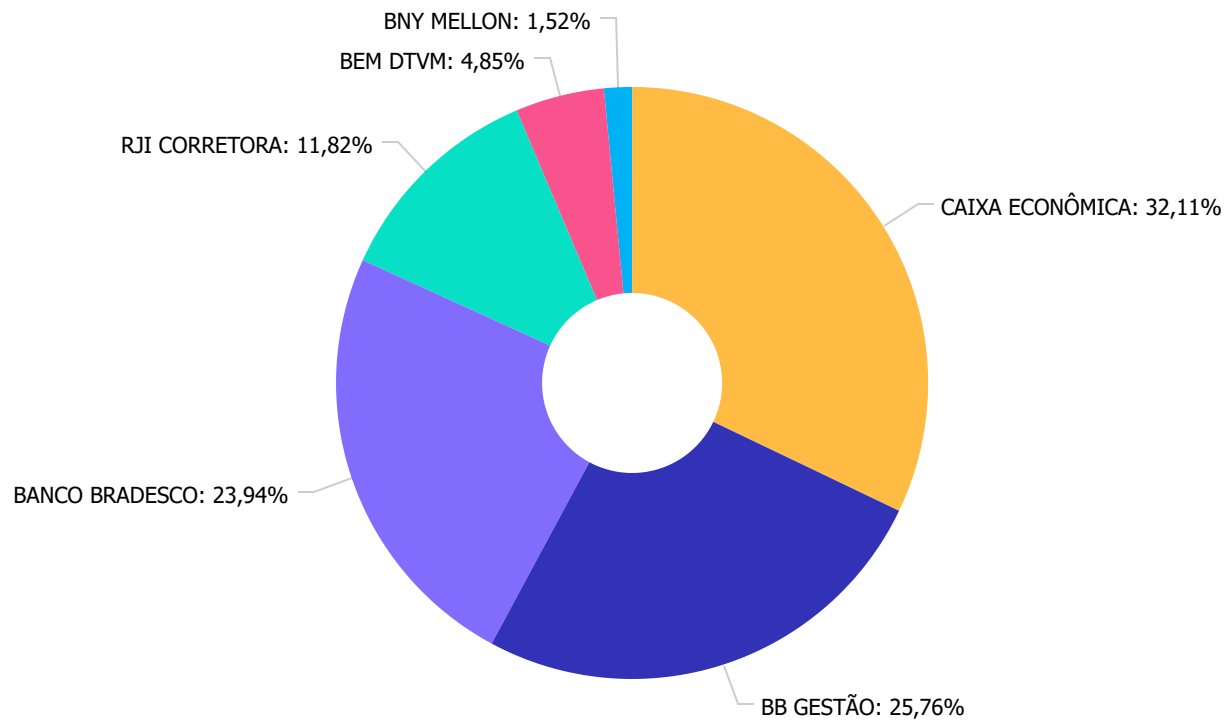
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	6,11%	6,11%	9,83%	21,25%	53,50%	120,12%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,79%	5,79%	9,11%	20,97%	53,70%	118,69%	12,35%	0,22%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

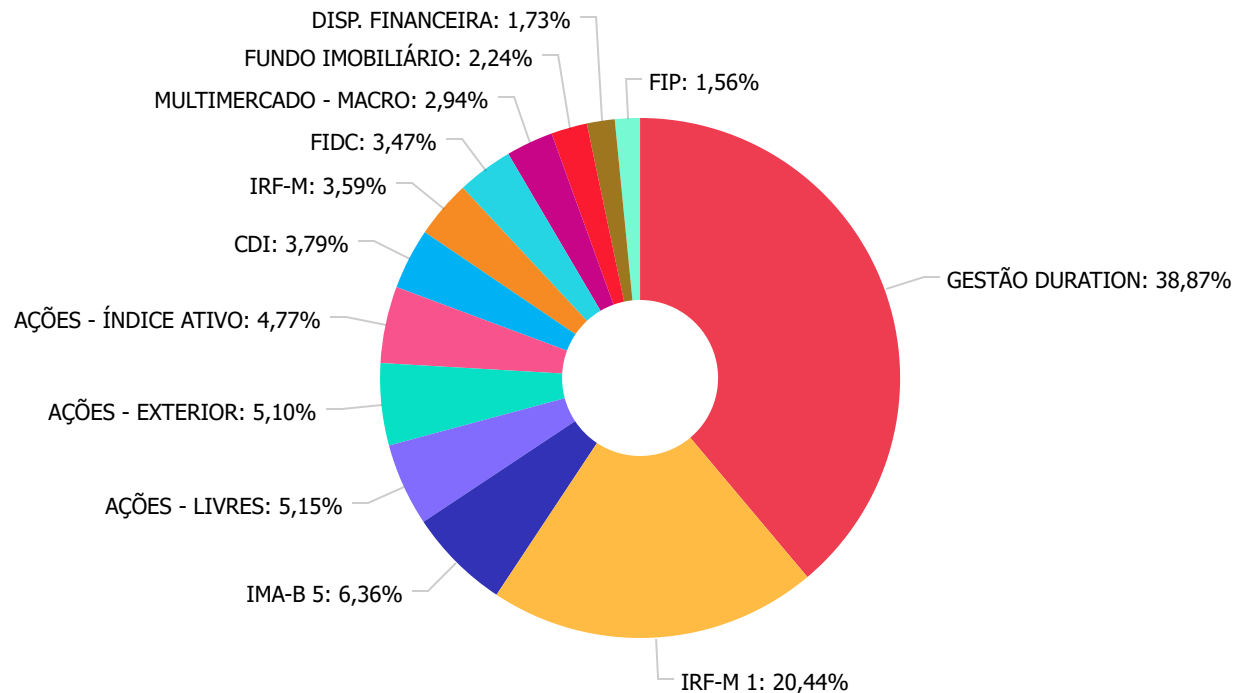


CAIXA ECONÔMICA	16.112.269,91
BB GESTÃO	12.924.891,61
BANCO BRADESCO	12.015.061,61
RJI CORRETORA	5.930.000,54
BEM DTVM	2.434.821,41
BNY MELLON	764.311,88

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRO DE ANDRADE JUNIOR S FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.aspx?Codigo do Documento: 431919-f204-4363-a003-147897d2645e>



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



GESTÃO DURATION	19.849.906,33
IRF-M 1	10.435.760,60
IMA-B 5	3.246.056,11
AÇÕES - LIVRES	2.628.631,11
AÇÕES - EXTERIOR	2.604.901,11
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.434.824,49
CDI	1.934.980,22
IRF-M	1.832.105,58
FIDC	1.774.358,88
MULTIMERCADO - MACRO	1.499.149,83
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.145.115,59
DISP. FINANCEIRA	881.800,89
FIP	795.570,95

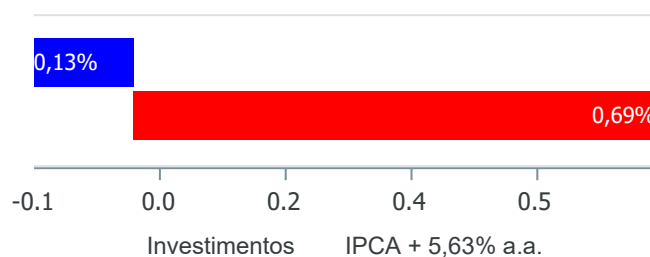
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epv/validarDocumento.aspx?Codigo do documento: 3c8681dd942044563403140897d2645e>



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	51.548.643,67	1.745.203,08	3.044.789,52	50.181.374,60	-67.682,63	-67.682,63	-0,13%	-0,13%	0,69%	0,69%	-19,12%	2,

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e

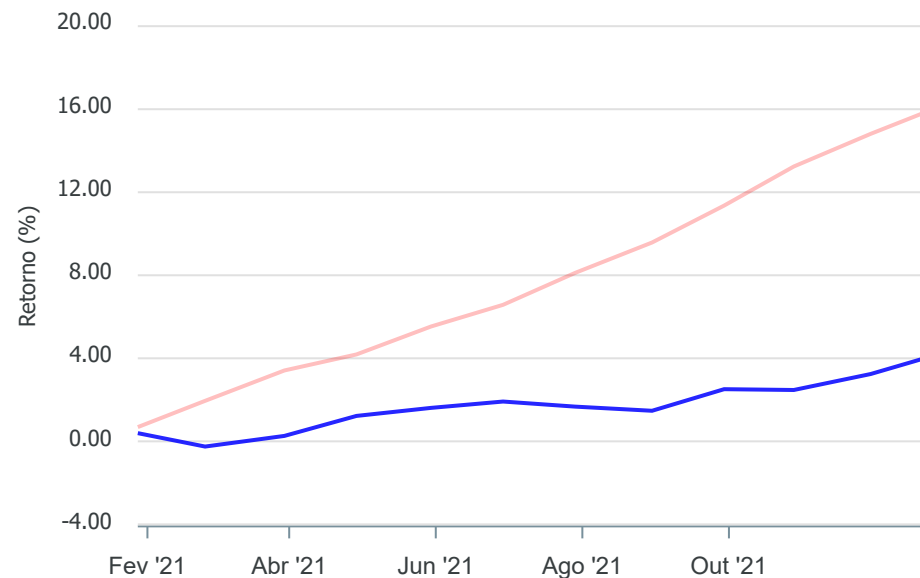


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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 - In
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	3.634.813,41	103.419,41	3.013.146,68	770.894,21	45.808,07	1,23%	0,02%	0,00%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.376.246,45	0,00	0,00	2.391.486,84	15.240,39	0,64%	0,64%	0,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	266.232,29	0,00	0,00	266.784,51	552,22	0,21%	0,15%	0,88%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	276.807,17	0,00	0,00	277.254,64	447,47	0,16%	0,16%	0,02%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	183.883,39	0,00	0,00	184.169,62	286,23	0,16%	0,16%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	50.968,42	0,00	0,00	51.008,46	40,04	0,08%	0,08%	0,01%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.773.808,10	0,00	0,00	1.774.358,87	550,77	0,03%	0,09%	0,41%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.808.985,61	0,00	0,00	2.809.792,34	806,73	0,03%	0,03%	0,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.767.103,56	0,00	0,00	4.768.309,21	1.205,65	0,03%	0,03%	0,76%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.624.048,23	0,00	0,00	7.625.971,01	1.922,78	0,03%	0,03%	0,15%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	378.322,40	0,00	31.642,84	346.258,72	-420,84	-0,11%	-8,48%	14,19%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	241.827,29	0,00	0,00	241.526,56	-300,73	-0,12%	-0,12%	0,57%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	511.598,41	141.843,67	0,00	651.662,31	-1.779,77	-0,27%	0,01%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.184.141,61	0,00	0,00	8.146.359,48	-37.782,13	-0,46%	-0,47%	1,56%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.975.647,39	0,00	0,00	6.935.239,26	-40.408,13	-0,58%	-0,58%	1,40%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.846.616,93	0,00	0,00	1.832.107,53	-14.509,40	-0,79%	-0,80%	1,53%
Total Renda Fixa	41.901.050,66	245.263,08	3.044.789,52	39.073.183,57	-28.340,65	-0,07%		0,97%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinse em: https://seccat.ce.gov.br/vpd/validador.aspx?codigo_documento=3843149-f294-4363-4034-47897d265e



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
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.500.120,05	0,00	0,00	1.499.143,81	-976,24	-0,07%	-0,07%	0,77%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	765.525,67	0,00	0,00	764.316,99	-1.208,68	-0,16%	-	-
HAZ FII - ATCR11	1.150.415,83	0,00	0,00	1.145.115,59	-5.300,24	-0,46%	-0,46%	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	31.404,77	0,00	0,00	31.259,96	-144,81	-0,46%	-	-
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.496.755,63	0,00	0,00	2.434.822,40	-61.933,23	-2,48%	-2,48%	12,40%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.240.970,34	0,00	0,00	1.201.495,01	-39.475,33	-3,18%	-3,18%	13,37%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	1.499.940,00	0,00	1.427.136,16	-72.803,84	-4,85%	-4,97%	11,79%
Total Renda Variável	7.185.192,29	1.499.940,00	0,00	8.503.289,92	-181.842,37	-2,09%		9,79%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinse em: https://sccs.ce.gov.br/epv/validarDadosAssinatura do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.462.400,72	0,00	0,00	2.604.901,11	142.500,39	5,79%	5,79%	12,35%
Total Exterior	2.462.400,72	0,00	0,00	2.604.901,11	142.500,39	5,79%		12,35%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinse em: https://seccom.br.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 3e431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 nos 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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/quali/Doc/seam/Cod/890603003-1478970545e>



Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <http://etcg.cpf-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/ppv/validarDoc?seamCodigoDoDocumento:3c431dd9-f204-4363-803-14789702645e>
Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.810.294,80	3,67%	692	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	258.680,01	0,52%	140	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	462.438,07	0,94%	261	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.744.108,01	9,61%	903	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.634.840,41	15,46%	1.341	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	8.070.735,27	16,34%	484	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	51.032,85	0,10%	778	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	6.868.806,76	13,91%	195	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	875.939,86	1,77%	1.475	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.605.560,30	5,28%	121	0,68%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	277.470,57	0,56%	630	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	240.339,55	0,49%	26	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	345.941,08	0,70%	31	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.726.596,35	3,50%	70	2,44%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.357.979,96	2,75%	19.147	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.185.256,95	2,40%	44.822	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.355.855,91	4,77%	200	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.489.089,19	3,02%	32	0,50%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	763.566,15	1,55%	17	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	31.156,51	0,06%	33	0,39%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '



Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

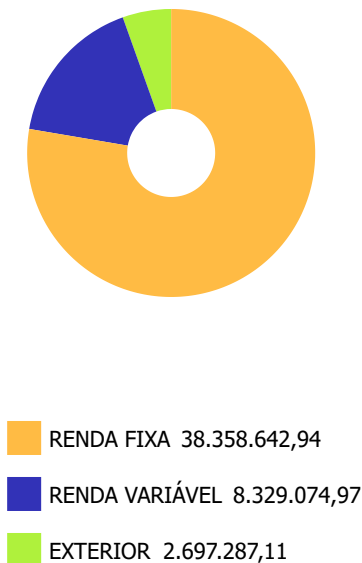
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.146.170,30	2,32%		1,59%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.697.287,11	5,46%	239	0,11%	Artigo 9º, Inciso III
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.385.859,05	4,83%	5	11,70%	Desenquadrado - RF
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		367.017,27	0,74%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			49.385.005,02				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			367.017,27				Artigo 6º
PL Total			49.752.022,29				

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epi/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	100,00%	49.385.005,02
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	14.910.361,30	30,19%	11,00%	50,00%	60,00%	14.720.641,71
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	49.385.005,02
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.469.250,25
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.938.500,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	29.631.003,01
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	19.335.826,24	39,15%	4,00%	15,00%	30,00%	-4.520.324,73
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	19.754.002,01
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	9.877.001,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.407.750,75
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.407.750,75
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.726.596,35	3,50%	0,00%	5,00%	5,00%	742.653,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.469.250,25
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.469.250,25
Desenquadrado - RF	0,00%	2.385.859,05	4,83%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.385.859,05
Total Renda Fixa	100,00%	38.358.642,94	77,67%	15,00%	75,00%	470,00%	



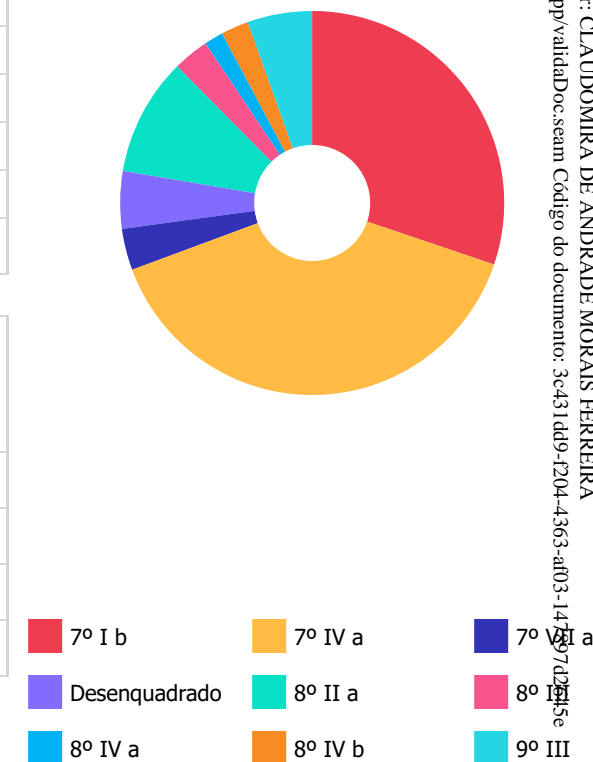
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	5,00%	2.469.250,25
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	14.815.501,51
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	4.899.092,82	9,92%	6,00%	16,00%	20,00%	4.977.908,18
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	9.877.001,00
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.489.089,19	3,02%	3,50%	3,69%	10,00%	3.449.411,31
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	794.722,66	1,61%	0,00%	2,00%	4,00%	1.180.677,54
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.146.170,30	2,32%	0,00%	3,00%	5,00%	1.323.079,95
Total Renda Variável	30,00%	8.329.074,97	16,87%	9,50%	24,69%	94,00%	

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%	4.938.500,50
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.469.250,25
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.697.287,11	5,46%	0,00%	0,31%	5,00%	-228.036,86
Total Exterior	10,00%	2.697.287,11	5,46%	0,00%	0,31%	20,00%	



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-142972215e



Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	17.959.266,40	36,37	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.733.979,84	25,79	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	12.052.129,79	24,40	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.872.766,65	5,82	-
MULTINVEST CAPITAL	2.385.859,05	4,83	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	763.566,15	1,55	-
PLURAL	377.097,59	0,76	-
RJI CORRETORA DE VALORES	240.339,55	0,49	-

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 %		

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://scte.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,35%	2,15%	4,14%	8,44%	12,47%	25,13%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-2,69%	-2,66%	-2,19%	-3,84%	-6,51%	-7,32%	4,91%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,04%	0,08%	0,39%	0,94%	3,08%	9,80%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,02%	0,04%	0,33%	0,82%	2,87%	9,36%	0,10%	0,01%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,01%	0,02%	0,34%	0,72%	2,70%	9,11%	0,10%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,60%	-0,49%	1,33%	2,75%	6,23%	19,15%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,49%	-0,62%	-0,02%	-22,41%	-37,57%	-36,03%	0,79%	0,26%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,09%	-8,56%	-8,81%	-58,46%	-71,73%	-71,48%	0,48%	0,57%
IRF-M (Benchmark)	-1,18%	-1,97%	-0,06%	-0,58%	3,01%	15,23%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,19%	-1,98%	-0,05%	-0,68%	2,76%	14,70%	1,02%	0,04%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,24%	0,41%	1,68%	2,31%	-4,48%	5,28%	0,57%	0,05%
CDI (Benchmark)	0,13%	0,28%	0,45%	0,92%	2,36%	8,07%	-	-
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,02%	0,05%	0,07%	0,10%	0,33%	3,25%	0,00%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,05%	0,13%	0,23%	0,34%	1,26%	5,77%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08%	0,24%	0,60%	0,88%	2,00%	7,44%	0,02%	0,00%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,06%	0,21%	0,48%	0,73%	2,25%	7,96%	0,03%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etec.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12
IPCA (Benchmark)	0,86%	1,11%	2,48%	4,95%	5,20%	9,41%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,93%	-1,39%	1,27%	1,32%	-	-	1,29%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,45%	-0,30%	1,31%	2,80%	5,57%	17,55%	1,01%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,51%	-0,48%	0,83%	1,04%	4,64%	19,53%	0,95%	0,03%
BRAPRES ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,96%	-1,53%	0,91%	0,42%	2,22%	13,17%	1,16%	0,05%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etec.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc;seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,58%	2,65%	4,94%	10,14%	16,10%	33,38%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,33%	-0,79%	-3,18%	-4,45%	-	-97,02%	-	0,83%
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,48%	2,43%	4,60%	9,42%	14,55%	29,81%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,10%	-0,26%	-0,42%	-0,88%	-	-	-	0,00%
Global BDRX (Benchmark)	3,93%	10,28%	11,31%	9,94%	69,17%	115,88%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,55%	9,54%	10,30%	8,76%	68,74%	114,04%	6,26%	0,20%
Ibovespa (Benchmark)	-4,37%	-7,55%	1,05%	10,73%	5,63%	15,12%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-4,85%	-9,57%	-0,15%	10,15%	9,93%	34,73%	13,04%	0,46%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-1,35%	-4,48%	3,14%	8,77%	-0,99%	26,47%	11,75%	0,38%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	-3,24%	-5,64%	1,82%	10,71%	3,53%	10,67%	13,26%	0,40%
CDI (Benchmark)	0,13%	0,28%	0,45%	0,92%	2,36%	8,07%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-0,67%	-0,74%	0,67%	0,81%	4,79%	12,50%	1,11%	0,02%
IFIX (Benchmark)	0,25%	0,57%	2,78%	3,75%	-2,61%	18,56%	-	-
HAZ FII - ATCR11	0,46%	0,00%	0,15%	-0,04%	2,29%	385,37%	-	-

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validarDoc> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



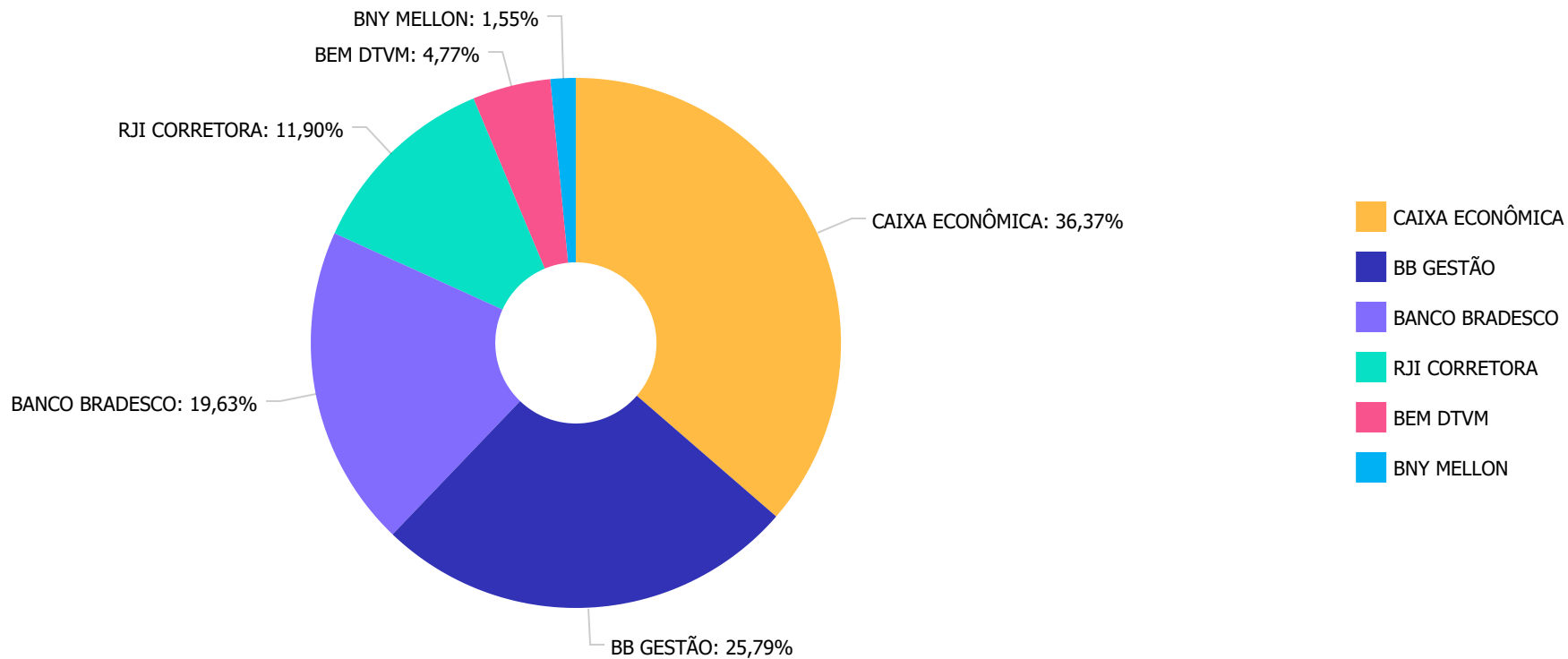
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	3,93%	10,28%	11,31%	9,94%	69,17%	115,88%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,55%	9,54%	10,30%	8,76%	68,74%	114,04%	6,26%	0,20%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



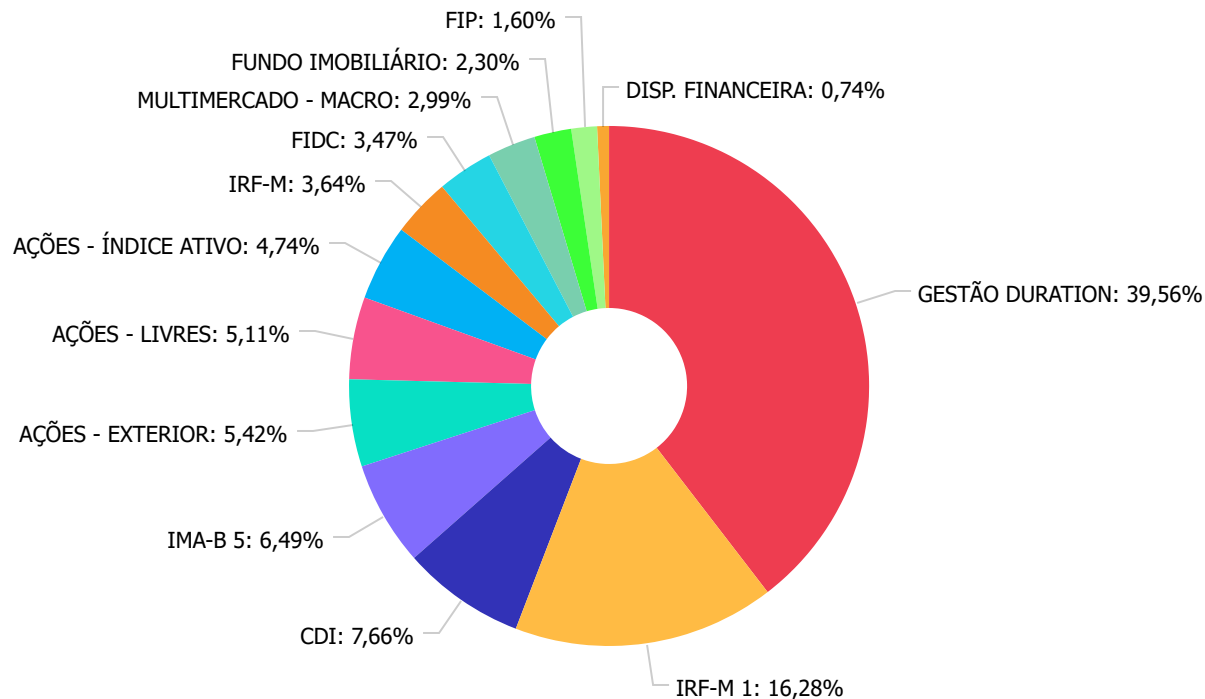
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Fevereiro / 2021)



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRO DE ANDRADE JUNIOR AS FERREIRA
 Acesso em: https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.aspx?CodigoDocumento=126431019-f204-4363-a003-147897d2645e



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



GESTÃO DURATION	19.683.650,00
IRF-M 1	8.097.270,49
CDI	3.810.000,50
IMA-B 5	3.230.810,94
AÇÕES - EXTERIOR	2.697.287,11
AÇÕES - LIVRES	2.543.230,90
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.355.850,99
IRF-M	1.810.290,38
FIDC	1.726.596,33
MULTIMERCADO - MACRO	1.489.081,10
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.146.170,30
FIP	794.720,66
DISP. FINANCEIRA	367.011,27

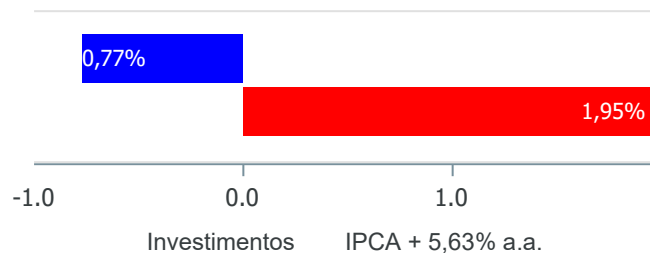
Documento Assinado Digitalmente por: CLAYTON VIANA DE ANDRADE MORAIS
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/portal/validarDocumento.aspx?CodigoDocumento=30314897/02645e>



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	51.548.643,67	1.745.203,08	3.044.789,52	50.181.374,60	-67.682,63	-67.682,63	-0,13%	-0,13%	0,69%	0,69%	-19,12%	2,
Fevereiro	50.181.374,60	2.923.373,86	3.396.843,50	49.385.005,02	-322.899,94	-390.582,57	-0,64%	-0,77%	1,26%	1,95%	-39,67%	2,

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://pccs.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e

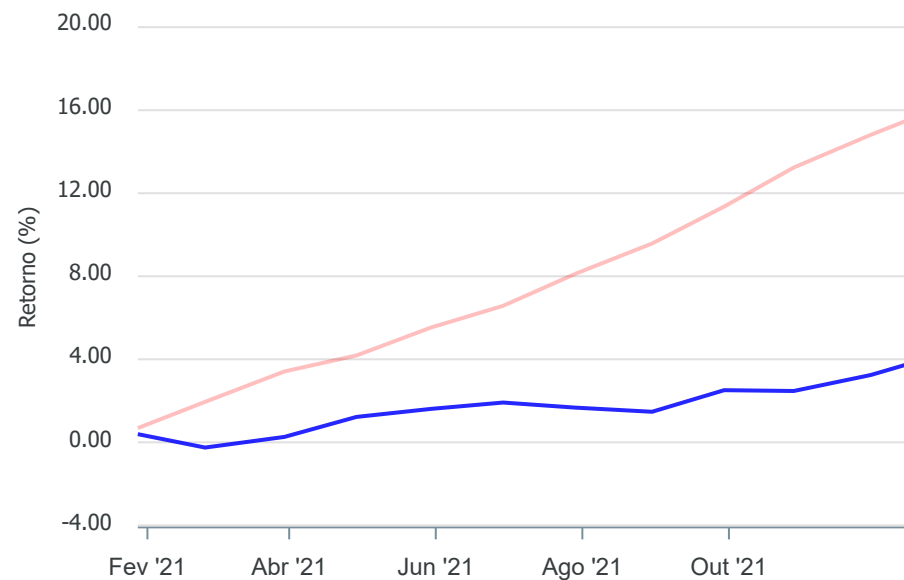


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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 - In
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	277.254,64	0,00	0,00	277.470,57	215,93	0,08%	0,08%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	51.008,46	0,00	0,00	51.032,85	24,39	0,05%	0,05%	0,01%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.809.792,34	0,00	2.348.047,14	462.438,07	692,87	0,02%	-0,01%	0,10%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	770.894,21	169.349,80	64.487,70	875.939,86	183,55	0,02%	0,02%	0,00%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	184.169,62	2.551.211,23	130.325,21	2.605.560,30	504,66	0,02%	0,06%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.625.971,01	7.494,86	0,00	7.634.840,41	1.374,54	0,02%	0,02%	0,10%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	651.662,31	195.317,97	847.019,15	0,00	38,87	0,00%	0,01%	0,00%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	346.258,72	0,00	0,00	345.941,08	-317,64	-0,09%	-0,09%	0,48%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.391.486,84	0,00	0,00	2.385.859,05	-5.627,79	-0,24%	-0,24%	0,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	266.784,51	0,00	6.964,30	258.680,01	-1.140,20	-0,43%	-0,45%	1,01%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	241.526,56	0,00	0,00	240.339,55	-1.187,01	-0,49%	-0,49%	0,79%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.768.309,21	0,00	0,00	4.744.108,01	-24.201,20	-0,51%	-0,51%	0,95%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.146.359,48	0,00	0,00	8.070.735,27	-75.624,21	-0,93%	-0,93%	1,29%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.935.239,26	0,00	0,00	6.868.806,76	-66.432,50	-0,96%	-0,96%	1,16%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.832.107,53	0,00	0,00	1.810.294,80	-21.812,73	-1,19%	-1,19%	1,02%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.774.358,87	0,00	0,00	1.726.596,35	-47.762,52	-2,69%	-2,69%	4,91%
Total Renda Fixa	39.073.183,57	2.923.373,86	3.396.843,50	38.358.642,94	-241.070,99	-0,62%		0,94%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinatura em: https://sccs.tcepe.gov.br/validador/validador.asp?codigo_documento=36431489-f294-4368-4034-47897d2065e



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
HAZ FII - ATCR11	1.145.115,59	0,00	0,00	1.146.170,30	1.054,71	0,09%	0,46%	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	764.316,99	0,00	0,00	763.566,15	-750,84	-0,10%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	31.259,96	0,00	0,00	31.156,51	-103,45	-0,33%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.499.143,81	0,00	0,00	1.489.089,19	-10.054,62	-0,67%	-0,67%	1,11
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.201.495,01	0,00	0,00	1.185.256,95	-16.238,06	-1,35%	-1,35%	11,75
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.434.822,40	0,00	0,00	2.355.855,91	-78.966,49	-3,24%	-3,24%	13,26
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.427.136,16	0,00	0,00	1.357.979,96	-69.156,20	-4,85%	-4,85%	13,04
Total Renda Variável	8.503.289,92	0,00	0,00	8.329.074,97	-174.214,95	-2,05%		10,10

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinatura em: https://etec.ce.gov.br/gov/validador/validador.do?codigo_documento=3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.604.901,11	0,00	0,00	2.697.287,11	92.386,00	3,55%	3,55%	6,26%
Total Exterior	2.604.901,11	0,00	0,00	2.697.287,11	92.386,00	3,55%		6,26%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinse em: https://sede.tcepe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 3e431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 nos 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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qualificaDoc.seam> Código do Documento: 343.019-F204-2063-003-147897-545e



Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <http://etcg.cfp.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.794.842,42	3,70%	682	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	259.442,49	0,53%	140	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	462.423,62	0,95%	258	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.758.390,12	9,80%	917	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.635.541,34	15,72%	1.345	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	8.042.905,14	16,56%	526	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	51.086,13	0,11%	781	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	6.831.578,07	14,07%	195	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	572.019,05	1,18%	1.471	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.833.290,74	3,78%	130	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	277.744,98	0,57%	630	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	240.256,35	0,49%	26	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	348.000,53	0,72%	31	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.727.952,47	3,56%	70	2,44%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.476.481,28	3,04%	19.792	0,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.269.152,11	2,61%	44.956	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.359.519,19	4,86%	197	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.492.884,88	3,07%	33	0,48%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	762.758,66	1,57%	17	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	31.018,16	0,06%	33	0,39%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '



Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2021)

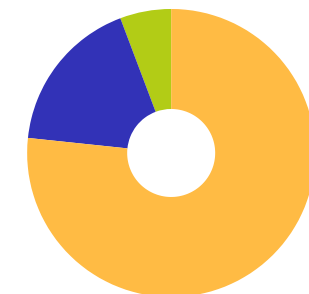
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.147.817,68	2,36%		1,60%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.789.743,95	5,75%	290	0,10%	Artigo 9º, Inciso III
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.393.295,66	4,93%	5	11,70%	Desenquadrado - RF
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		345.228,51	0,71%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			48.558.145,02				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			345.228,51				Artigo 6º
PL Total			48.903.373,53				

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epi/validarDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	100,00%	48.558.145,02
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	14.910.639,99	30,71%	11,00%	50,00%	60,00%	14.224.247,02
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	48.558.145,02
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.427.907,25
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.855.814,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	29.134.887,01
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	18.196.880,99	37,47%	4,00%	15,00%	30,00%	-3.629.437,48
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	19.423.258,01
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	9.711.629,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.283.721,75
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.283.721,75
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.727.952,47	3,56%	0,00%	5,00%	5,00%	699.954,78
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.427.907,25
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.427.907,25
Desenquadrado - RF	0,00%	2.393.295,66	4,93%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.393.295,66
Total Renda Fixa	100,00%	37.228.769,11	76,67%	15,00%	75,00%	470,00%	



RENDA FIXA 37.228.769,11
RENDA VARIÁVEL 8.539.631,96
EXTERIOR 2.789.743,95

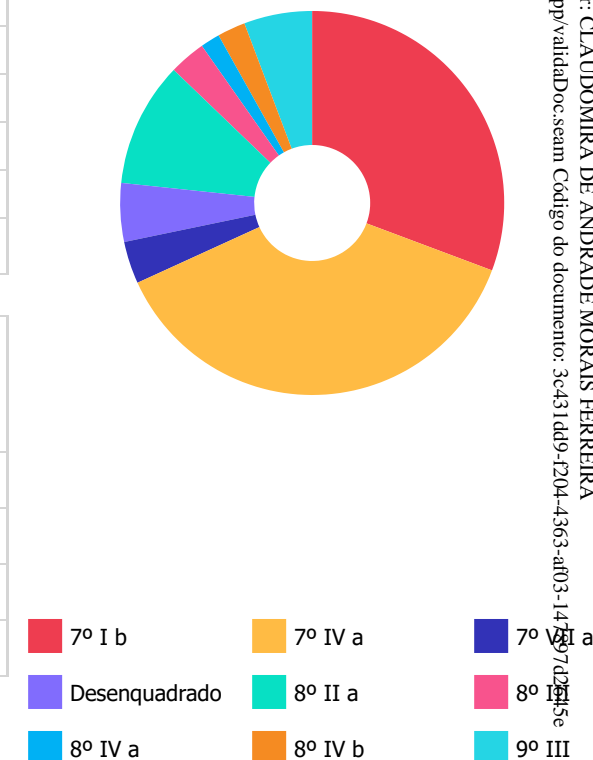
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	5,00%	2.427.907,25
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	14.567.443,51
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	5.105.152,58	10,51%	6,00%	16,00%	20,00%	4.606.476,42
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	9.711.629,00
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.492.884,88	3,07%	3,50%	3,69%	10,00%	3.362.929,62
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	793.776,82	1,63%	0,00%	2,00%	4,00%	1.148.548,98
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.147.817,68	2,36%	0,00%	3,00%	5,00%	1.280.089,57
Total Renda Variável	30,00%	8.539.631,96	17,59%	9,50%	24,69%	94,00%	

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%	4.855.814,50
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.427.907,25
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.789.743,95	5,75%	0,00%	0,31%	5,00%	-361.836,70
Total Exterior	10,00%	2.789.743,95	5,75%	0,00%	0,31%	20,00%	



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-1429702915e



Enquadramento por Gestores - base (Março / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	17.294.711,13	35,62	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.893.909,57	26,55	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	11.718.424,81	24,13	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.875.770,15	5,92	1,61
MULTINVEST CAPITAL	2.393.295,66	4,93	0,28
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	762.758,66	1,57	0,08
PLURAL	379.018,69	0,78	-
RJI CORRETORA DE VALORES	240.256,35	0,49	0,05

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 %		

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://ste.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,56%	3,74%	3,74%	8,81%	13,47%	25,49%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,08%	-2,59%	-2,59%	-1,53%	-5,22%	-7,26%	0,35%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,04%	0,13%	0,13%	0,83%	2,51%	9,33%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,01%	0,05%	0,05%	0,70%	2,27%	8,88%	0,21%	0,00%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00%	0,02%	0,02%	0,69%	2,11%	8,61%	0,21%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,34%	-0,15%	-0,15%	3,23%	8,50%	18,63%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,04%	-0,65%	-0,65%	-22,44%	-25,18%	-34,18%	0,89%	0,22%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,60%	-8,02%	-8,02%	-58,07%	-61,30%	-70,46%	0,97%	0,54%
IRF-M (Benchmark)	-0,84%	-2,80%	-2,80%	-0,87%	2,25%	13,59%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,85%	-2,82%	-2,82%	-0,88%	1,99%	13,08%	1,90%	0,04%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,31%	0,72%	0,72%	2,52%	-3,12%	5,30%	0,98%	0,05%
CDI (Benchmark)	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%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,10%	0,34%	0,34%	0,98%	1,96%	7,05%	0,06%	0,00%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,15%	0,37%	0,37%	0,95%	2,01%	7,64%	0,02%	0,00%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,05%	0,10%	0,10%	0,16%	0,27%	3,02%	0,01%	0,00%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12
IPCA (Benchmark)	0,93%	2,05%	2,05%	5,25%	6,10%	9,60%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,35%	-1,73%	-1,73%	1,86%	4,77%	-	1,94%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,30%	-0,01%	-0,01%	3,21%	7,72%	17,04%	1,60%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,30%	-0,18%	-0,18%	1,86%	5,09%	19,24%	1,36%	0,03%
BRAPRES ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,54%	-2,07%	-2,07%	0,87%	3,86%	12,01%	1,70%	0,04%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,85%	4,55%	4,55%	10,55%	17,15%	33,83%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,44%	-1,23%	-1,23%	-4,46%	-	-97,04%	-	-
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,73%	4,20%	4,20%	9,81%	15,57%	30,22%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,11%	-0,36%	-0,36%	-0,83%	-	-	-	-
Global BDRX (Benchmark)	3,08%	13,67%	13,67%	15,61%	65,34%	109,56%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,43%	13,29%	13,29%	14,78%	64,18%	108,61%	10,72%	0,20%
Ibovespa (Benchmark)	6,00%	-2,00%	-2,00%	23,29%	59,73%	22,24%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	8,73%	-1,68%	-1,68%	25,98%	76,37%	44,87%	10,24%	0,27%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	7,08%	2,28%	2,28%	23,12%	50,44%	35,35%	9,78%	0,20%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	0,16%	-5,50%	-5,50%	14,00%	51,45%	10,58%	10,61%	0,18%
CDI (Benchmark)	0,20%	0,49%	0,49%	0,96%	2,22%	7,78%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,26%	-0,48%	-0,48%	1,45%	4,73%	12,37%	1,06%	0,02%
IFIX (Benchmark)	-1,38%	-0,81%	-0,81%	1,86%	14,14%	14,65%	-	-
HAZ FII - ATCR11	-0,23%	-0,23%	-0,23%	-0,38%	2,00%	384,28%	-	-

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



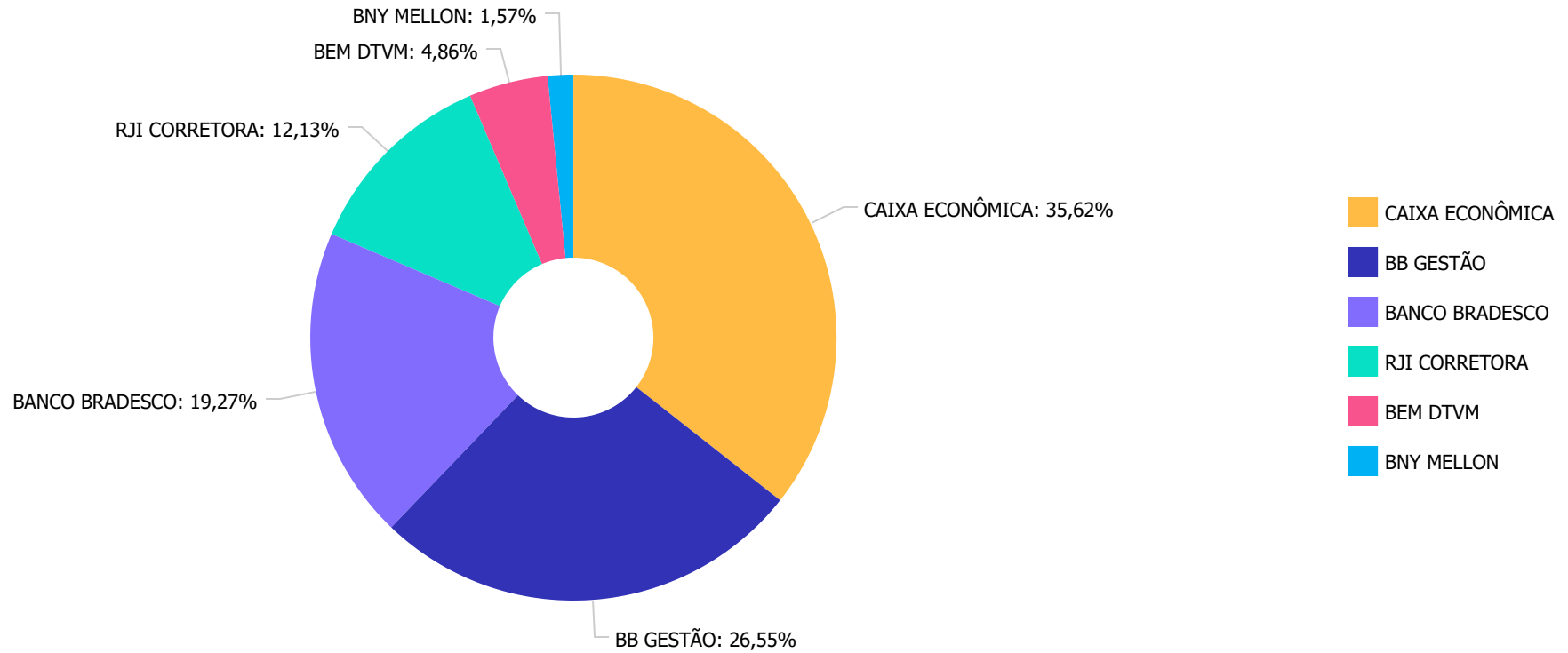
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	3,08%	13,67%	13,67%	15,61%	65,34%	109,56%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,43%	13,29%	13,29%	14,78%	64,18%	108,61%	10,72%	0,20%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



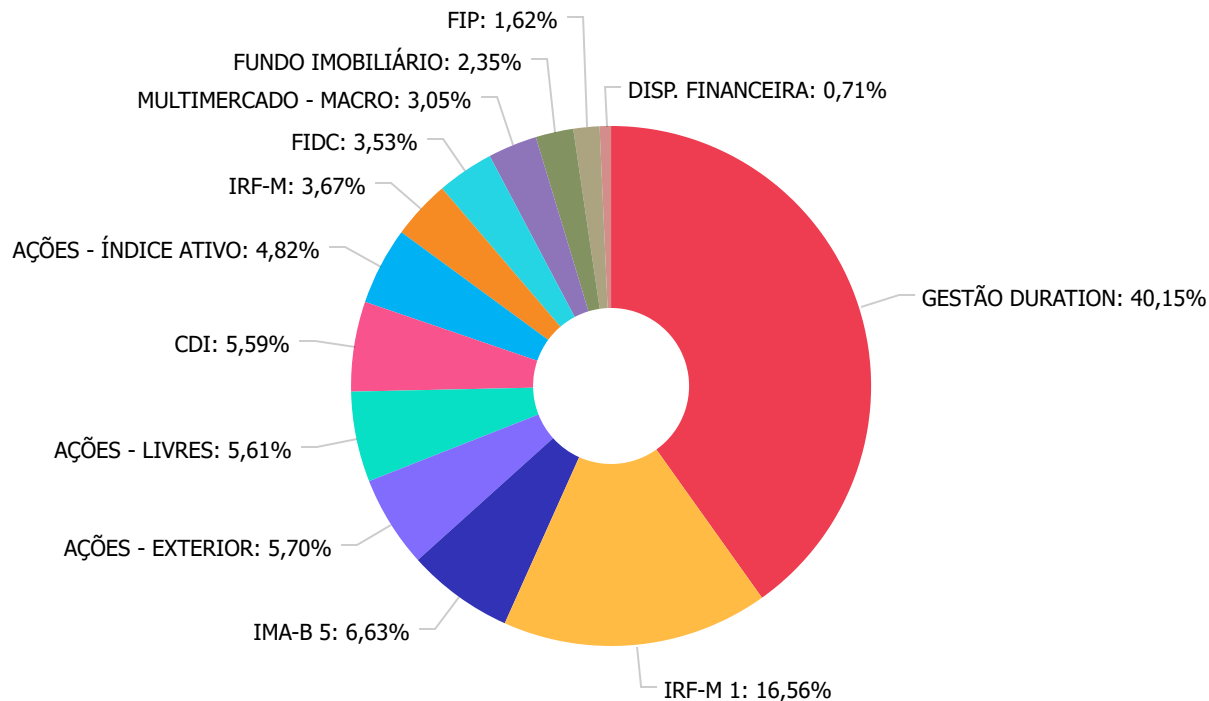
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Março / 2021)



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE FERREIRA
 Acesso em: https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.aspx?CodigoDocumento=431619-f204-4363-a003-147897d2645e



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



GESTÃO DURATION	19.632.870,00
IRF-M 1	8.097.960,00
IMA-B 5	3.240.990,00
AÇÕES - EXTERIOR	2.789.740,00
AÇÕES - LIVRES	2.745.630,00
CDI	2.734.140,00
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.359.510,00
IRF-M	1.794.840,00
FIDC	1.727.950,00
MULTIMERCADO - MACRO	1.492.880,00
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.147.810,00
FIP	793.770,00
DISP. FINANCEIRA	345.220,00

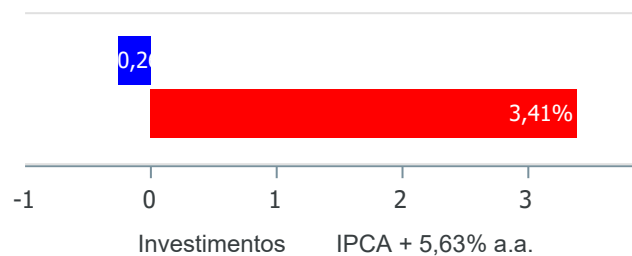
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDIO MORA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/portal/DocAssinam/CodigoDocumento/3c31dd942044363403142897d2645e>



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	51.548.643,67	1.745.203,08	3.044.789,52	50.181.374,60	-67.682,63	-67.682,63	-0,13%	-0,13%	0,69%	0,69%	-19,12%	2,
Fevereiro	50.181.374,60	2.923.373,86	3.396.843,50	49.385.005,02	-322.899,94	-390.582,57	-0,64%	-0,77%	1,26%	1,95%	-39,67%	2,
Março	49.385.005,02	2.462.542,61	3.543.201,50	48.558.145,02	253.798,89	-136.783,68	0,51%	-0,26%	1,44%	3,41%	-7,73%	2,

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://pccs.leg.br/pe/srv/br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e

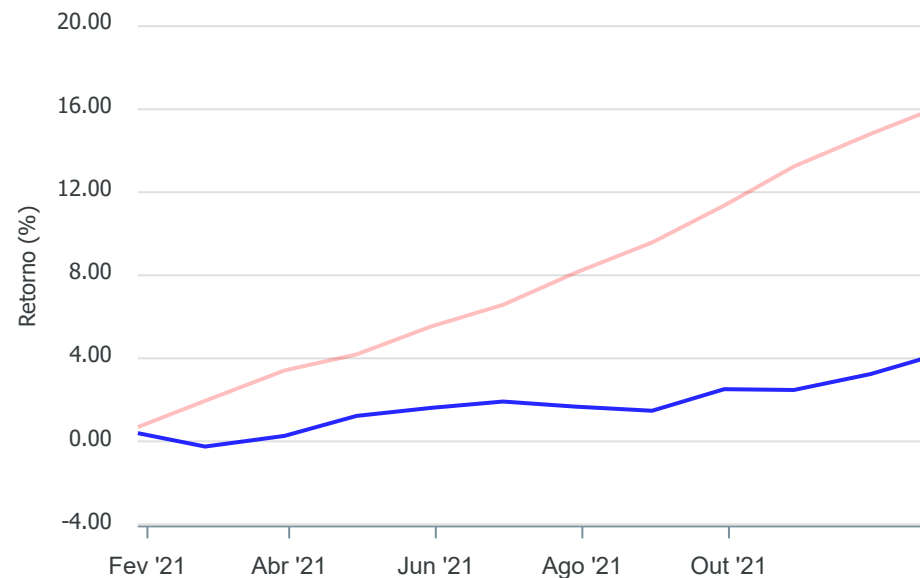


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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 - In
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	345.941,08	0,00	0,00	348.000,53	2.059,45	0,60%	0,60%	0,97
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.385.859,05	0,00	0,00	2.393.295,66	7.436,61	0,31%	0,31%	0,98
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.744.108,01	0,00	0,00	4.758.390,12	14.282,11	0,30%	0,30%	1,36
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	258.680,01	0,00	0,00	259.442,49	762,48	0,29%	0,29%	1,60
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.605.560,30	214.000,00	990.000,00	1.833.290,74	3.730,44	0,13%	0,15%	0,02
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	51.032,85	0,00	0,00	51.086,13	53,28	0,10%	0,10%	0,01
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	277.470,57	0,00	0,00	277.744,98	274,41	0,10%	0,10%	0,06
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.726.596,35	0,00	0,00	1.727.952,47	1.356,12	0,08%	0,08%	0,35
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	875.939,86	2.248.542,61	2.553.201,50	572.019,05	738,08	0,02%	0,05%	0,01
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.634.840,41	0,00	0,00	7.635.541,34	700,93	0,01%	0,01%	0,21
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	462.438,07	0,00	0,00	462.423,62	-14,45	0,00%	0,00%	0,21
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	240.339,55	0,00	0,00	240.256,35	-83,20	-0,03%	-0,03%	0,89
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.070.735,27	0,00	0,00	8.042.905,14	-27.830,13	-0,34%	-0,34%	1,94
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.868.806,76	0,00	0,00	6.831.578,07	-37.228,69	-0,54%	-0,54%	1,70
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.810.294,80	0,00	0,00	1.794.842,42	-15.452,38	-0,85%	-0,85%	1,90
Total Renda Fixa	38.358.642,94	2.462.542,61	3.543.201,50	37.228.769,11	-49.214,94	-0,13%		1,15

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinatura em: https://sccs.trfpe.gov.br/vl/validador.aspx?codigo_documento=36431469-f294-436e-403e-417897d2645e



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
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.357.979,96	0,00	0,00	1.476.481,28	118.501,32	8,73%	8,73%	10,24%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.185.256,95	0,00	0,00	1.269.152,11	83.895,16	7,08%	7,08%	9,78%
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.489.089,19	0,00	0,00	1.492.884,88	3.795,69	0,25%	0,25%	1,06%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.355.855,91	0,00	0,00	2.359.519,19	3.663,28	0,16%	0,16%	10,61%
HAZ FII - ATCR11	1.146.170,30	0,00	0,00	1.147.817,68	1.647,38	0,14%	-0,23%	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	763.566,15	0,00	0,00	762.758,66	-807,49	-0,11%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	31.156,51	0,00	0,00	31.018,16	-138,35	-0,44%	-	-
Total Renda Variável	8.329.074,97	0,00	0,00	8.539.631,96	210.556,99	2,53%		8,21%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinse em: https://seccom.gov.br/gpf/validadorDoc/seam/Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.697.287,11	0,00	0,00	2.789.743,95	92.456,84	3,43%	3,43%	10,72%
Total Exterior	2.697.287,11	0,00	0,00	2.789.743,95	92.456,84	3,43%		10,72%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinse em: https://seccom.br.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 3e431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 (%)	(%) Int...
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	3.634.813,41	2.521.311,82	5.630.835,88	572.019,05	46.729,70	0,76%	0,10%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.376.246,45	0,00	0,00	2.393.295,66	17.049,21	0,72%	0,72%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	183.883,39	2.765.211,23	1.120.325,21	1.833.290,74	4.521,33	0,15%	0,36%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.624.048,23	7.494,86	0,00	7.635.541,34	3.998,25	0,05%	0,05%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.808.985,61	0,00	2.348.047,14	462.423,62	1.485,15	0,05%	0,02%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	378.322,40	0,00	31.642,84	348.000,53	1.320,97	0,35%	-8,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	276.807,17	0,00	0,00	277.744,98	937,81	0,34%	0,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	266.232,29	0,00	6.964,30	259.442,49	174,50	0,07%	-0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	50.968,42	0,00	0,00	51.086,13	117,71	0,23%	0,23%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	241.827,29	0,00	0,00	240.256,35	-1.570,94	-0,65%	-0,65%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	511.598,41	337.161,64	847.019,15	0,00	-1.740,90	-0,21%	0,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.767.103,56	0,00	0,00	4.758.390,12	-8.713,44	-0,18%	-0,18%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.773.808,10	0,00	0,00	1.727.952,47	-45.855,63	-2,59%	-2,59%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.846.616,93	0,00	0,00	1.794.842,42	-51.774,51	-2,80%	-2,82%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.184.141,61	0,00	0,00	8.042.905,14	-141.236,47	-1,73%	-1,73%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.975.647,39	0,00	0,00	6.831.578,07	-144.069,32	-2,07%	-2,07%
				Total Renda Fixa	-318.626,58	-0,67%	

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinatura em: https://seccom.pe.gov.br/validador/validarDocumentoCodigo do documento: 36431409-f204-4363-4034-47897d2645e



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 (%)	(%) Inicial
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.462.400,72	0,00	0,00	2.789.743,95	327.343,23	13,29%	13,29%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.240.970,34	0,00	0,00	1.269.152,11	28.181,77	2,27%	2,28%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	31.404,77	0,00	0,00	31.018,16	-386,61	-1,23%	-1,23%
HAZ FII - ATCR11	1.150.415,83	0,00	0,00	1.147.817,68	-2.598,15	-0,23%	-0,23%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	765.525,67	0,00	0,00	762.758,66	-2.767,01	-0,36%	-0,36%
BRADERCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.500.120,05	0,00	0,00	1.492.884,88	-7.235,17	-0,48%	-0,48%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	1.499.940,00	0,00	1.476.481,28	-23.458,72	-1,56%	-1,68%
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	2.496.755,63	0,00	0,00	2.359.519,19	-137.236,44	-5,50%	-5,50%
				Total Renda Variável	181.842,90	1,63%	

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinatura em: https://seccor.gov.br/gpp/validarDocumento.aspx?Codigo=documento:3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 nos 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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qualificaDoc.seam> Código do Documento: 343.019-F204-2063-003-147897-545e



Relatório Analítico dos Investimentos

em abril de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <http://etcg.cpf-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/ppv/validadoc.aspx?Codigo=documento:3c431dd9-f204-4363-a003-14789702645e>
Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.809.451,69	3,67%	661	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	261.346,50	0,53%	140	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.790.010,96	9,70%	941	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.657.106,93	15,51%	1.333	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	8.099.811,20	16,41%	546	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	51.141,57	0,10%	780	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	6.867.987,28	13,91%	195	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	1.371.224,32	2,78%	1.467	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.835.756,03	3,72%	141	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	278.477,67	0,56%	656	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	240.645,86	0,49%	26	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	397.194,00	0,80%	31	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.733.399,37	3,51%	70	2,44%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.513.901,11	3,07%	21.277	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.370.159,27	2,78%	48.362	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.439.624,19	4,94%	192	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.502.741,37	3,04%	32	0,45%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	761.971,04	1,54%	17	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	30.870,16	0,06%	33	0,39%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.144.954,23	2,32%		1,60%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '



Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2021)

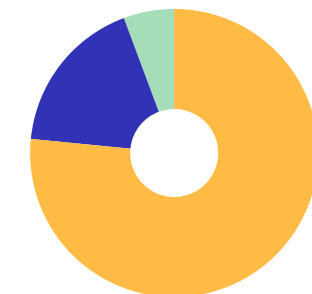
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.806.826,55	5,69%	354	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.399.000,71	4,86%	5	11,70%	Desenquadrado - RF
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		800.534,47	1,62%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			49.363.602,01				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			800.534,47				Artigo 6º
PL Total			50.164.136,48				

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	100,00%	49.363.602,01
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	14.517.916,08	29,41%	11,00%	50,00%	60,00%	15.100.245,13
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	49.363.602,01
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.468.180,10
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.936.360,20
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	29.618.161,21
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	19.142.237,93	38,78%	4,00%	15,00%	30,00%	-4.333.157,33
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	19.745.440,80
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	9.872.720,40
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.404.540,30
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.404.540,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.733.399,37	3,51%	0,00%	5,00%	5,00%	734.780,73
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.468.180,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.468.180,10
Desenquadrado - RF	0,00%	2.399.000,71	4,86%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.399.000,71
Total Renda Fixa	100,00%	37.792.554,09	76,56%	15,00%	75,00%	470,00%	



■ RENDA FIXA 37.792.554,09
■ RENDA VARIÁVEL 8.764.221,37
■ EXTERIOR 2.806.826,55

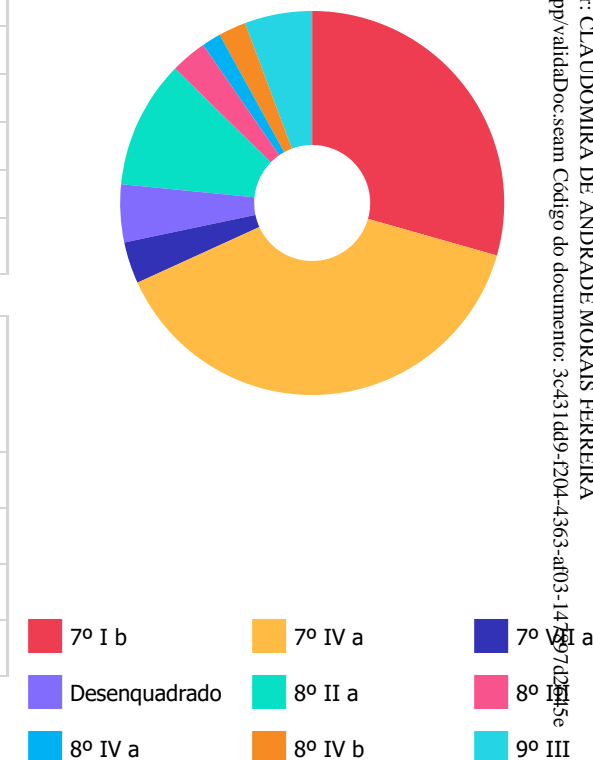
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	5,00%	2.468.180,10
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	14.809.080,60
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	5.323.684,57	10,78%	6,00%	16,00%	20,00%	4.549.035,83
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	9.872.720,40
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.502.741,37	3,04%	3,50%	3,69%	10,00%	3.433.618,83
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	792.841,20	1,61%	0,00%	2,00%	4,00%	1.181.702,88
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.144.954,23	2,32%	0,00%	3,00%	5,00%	1.323.225,87
Total Renda Variável	30,00%	8.764.221,37	17,75%	9,50%	24,69%	94,00%	

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%	4.936.360,20
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.468.180,10
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.806.826,55	5,69%	0,00%	0,31%	5,00%	-338.646,45
Total Exterior	10,00%	2.806.826,55	5,69%	0,00%	0,31%	20,00%	



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-1429702915e



Enquadramento por Gestores - base (Abril / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	17.368.178,14	35,18	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.105.811,34	26,55	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	12.181.577,16	24,68	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.878.353,60	5,83	1,61
MULTINVEST CAPITAL	2.399.000,71	4,86	0,27
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	761.971,04	1,54	0,08
PLURAL	428.064,16	0,87	-
RJI CORRETORA DE VALORES	240.645,86	0,49	0,05

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 %		

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://ste.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,85%	4,62%	3,80%	8,19%	14,17%	25,13%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,32%	-2,28%	-2,31%	-2,20%	-4,67%	-7,38%	0,44%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,27%	0,40%	0,36%	0,94%	2,33%	9,09%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,28%	0,34%	0,31%	0,84%	2,12%	8,65%	0,16%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,87%	0,72%	0,62%	3,92%	8,92%	18,36%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,16%	-0,49%	-0,37%	-22,08%	-25,36%	-34,50%	0,65%	0,22%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,23%	-8,23%	0,27%	-58,14%	-61,48%	-70,65%	0,10%	0,54%
IRF-M (Benchmark)	0,84%	-1,98%	-1,19%	0,30%	1,94%	13,86%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	-2,03%	-1,24%	0,24%	1,73%	13,33%	1,55%	0,04%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,24%	0,96%	0,31%	2,72%	-1,32%	4,46%	0,90%	0,05%
CDI (Benchmark)	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%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,08%	0,18%	0,16%	0,23%	0,27%	2,80%	0,00%	0,00%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,13%	0,50%	0,34%	0,88%	1,83%	7,22%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,26%	0,60%	0,44%	1,13%	2,22%	6,79%	0,08%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validarDoc> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12
IPCA (Benchmark)	0,31%	2,37%	2,11%	4,67%	6,76%	9,32%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	-1,04%	-0,57%	2,66%	4,74%	-	1,53%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	0,73%	0,58%	3,67%	8,15%	16,59%	1,25%	0,02%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,53%	-1,54%	-0,97%	1,69%	3,36%	11,75%	1,34%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,67%	0,48%	0,46%	2,64%	4,63%	18,72%	1,03%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,11%	5,71%	4,61%	9,90%	17,88%	33,43%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,48%	-1,70%	-1,25%	-4,49%	-	-97,05%	-	0,83%
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,00%	5,24%	4,27%	9,17%	16,29%	29,84%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,10%	-0,46%	-0,31%	-0,77%	-	30,13%	-	0,00%
Global BDRX (Benchmark)	0,98%	14,79%	8,17%	18,81%	43,53%	100,22%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,61%	13,99%	7,75%	17,57%	42,44%	98,93%	10,13%	0,15%
Ibovespa (Benchmark)	1,94%	-0,10%	3,33%	26,55%	47,68%	23,39%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2,53%	0,81%	6,08%	30,04%	58,89%	43,43%	5,37%	0,26%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	7,96%	10,42%	14,04%	33,19%	49,24%	42,36%	5,72%	0,20%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	3,40%	-2,29%	0,20%	14,08%	46,56%	13,03%	6,65%	0,18%
CDI (Benchmark)	0,21%	0,69%	0,54%	1,01%	2,14%	7,45%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,66%	0,18%	0,24%	2,47%	4,08%	12,54%	0,95%	0,02%
IFIX (Benchmark)	0,51%	-0,31%	-0,64%	3,41%	9,89%	14,06%	-	-
HAZ FII - ATCR11	-0,25%	-0,48%	-0,01%	-0,34%	1,84%	383,07%	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



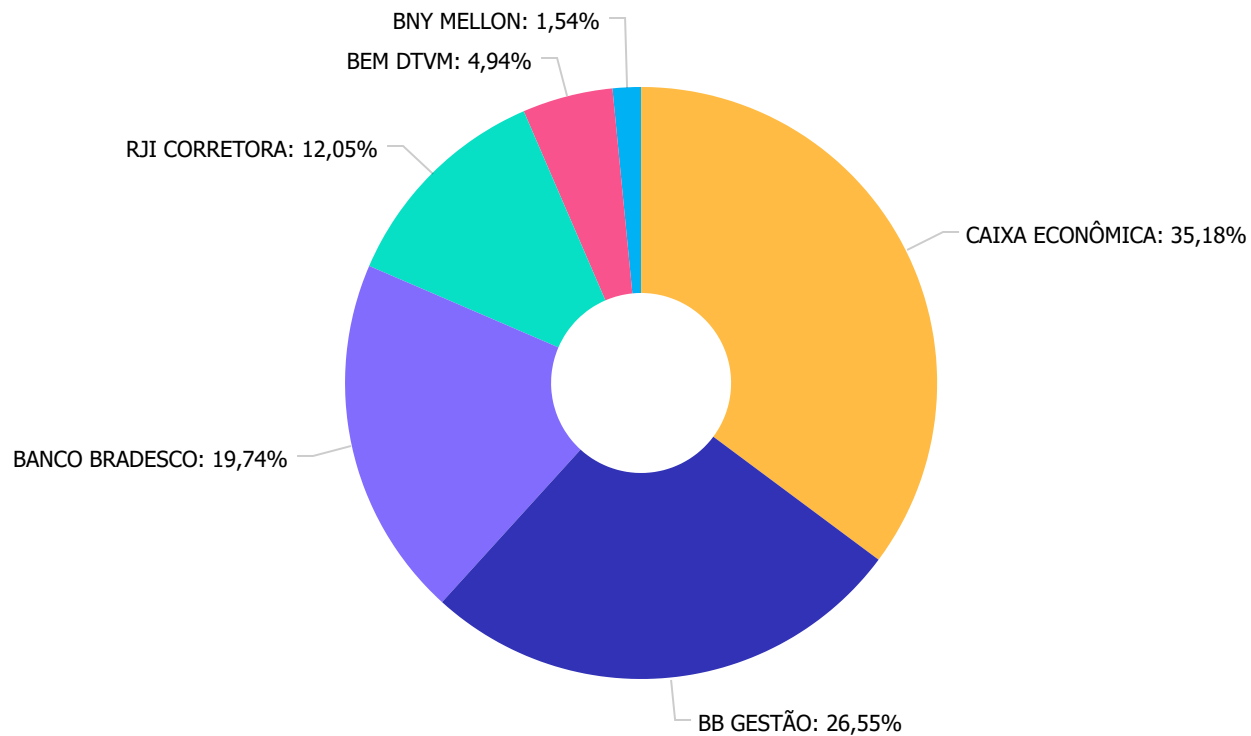
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,98%	14,79%	8,17%	18,81%	43,53%	100,22%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,61%	13,99%	7,75%	17,57%	42,44%	98,93%	10,13%	0,15%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

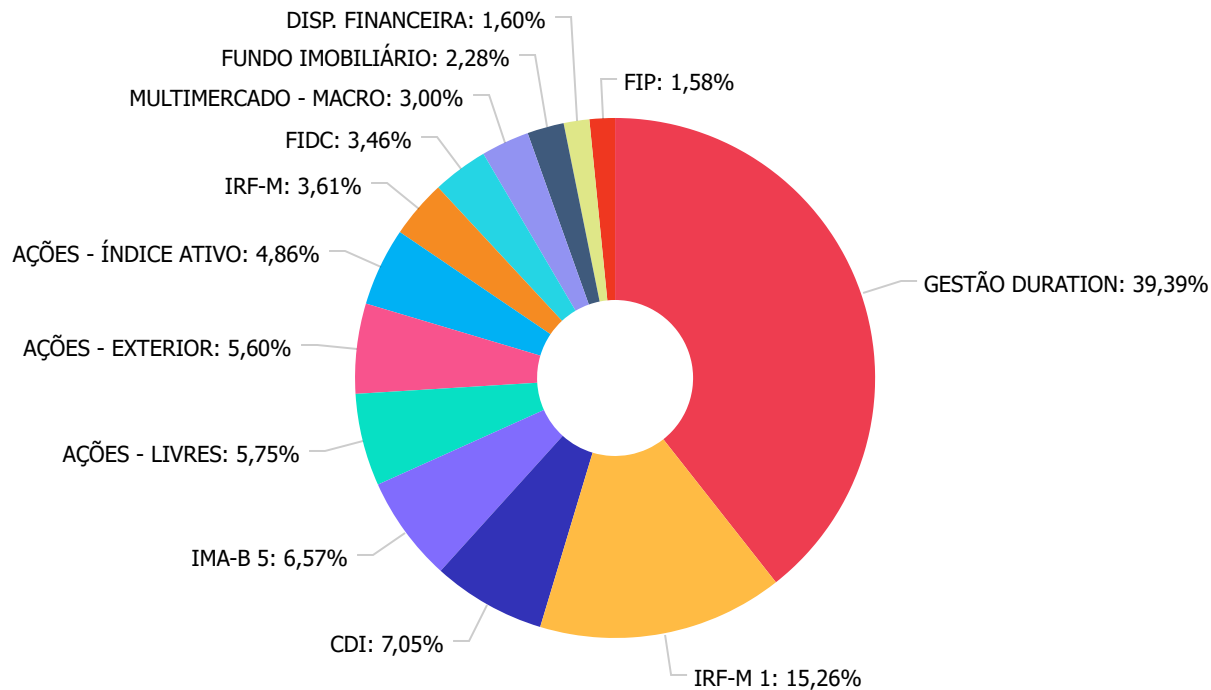


Administradora	Valor
CAIXA ECONÔMICA	17.368.171,11
BB GESTÃO	13.105.811,38
BANCO BRADESCO	9.741.951,99
RJI CORRETORA	5.946.066,32
BEM DTVM	2.439.624,11
BNY MELLON	761.977,87

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRANDA DE ANDRADE FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.aspx?Codigo do Documento: 7431419-f204-4363-a003-147897d2645e>



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



GESTÃO DURATION	19.757.804,41
IRF-M 1	7.657.109,55
CDI	3.536.599,55
IMA-B 5	3.298.180,00
AÇÕES - LIVRES	2.884.060,33
AÇÕES - EXTERIOR	2.806.820,11
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.439.624,11
IRF-M	1.809.450,33
FIDC	1.733.390,11
MULTIMERCADO - MACRO	1.502.741,23
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.144.954,23
DISP. FINANCEIRA	800.538,47
FIP	792.841,20

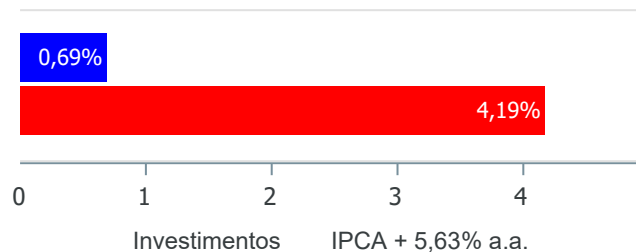
Documento Assinado Digitalmente por: CLAYTON ARAÚJO DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/validador>



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	51.548.643,67	1.745.203,08	3.044.789,52	50.181.374,60	-67.682,63	-67.682,63	-0,13%	-0,13%	0,69%	0,69%	-19,12%	2,
Fevereiro	50.181.374,60	2.923.373,86	3.396.843,50	49.385.005,02	-322.899,94	-390.582,57	-0,64%	-0,77%	1,26%	1,95%	-39,67%	2,
Março	49.385.005,02	2.462.542,61	3.543.201,50	48.558.145,02	253.798,89	-136.783,68	0,51%	-0,26%	1,44%	3,41%	-7,73%	2,
Abril	48.558.145,02	3.610.764,05	3.274.894,15	49.363.602,01	469.587,09	332.803,41	0,96%	0,69%	0,75%	4,19%	16,57%	2,

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://pccs.fcp.gov.br/validador> Doc:seam Código do documento: 3e431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e

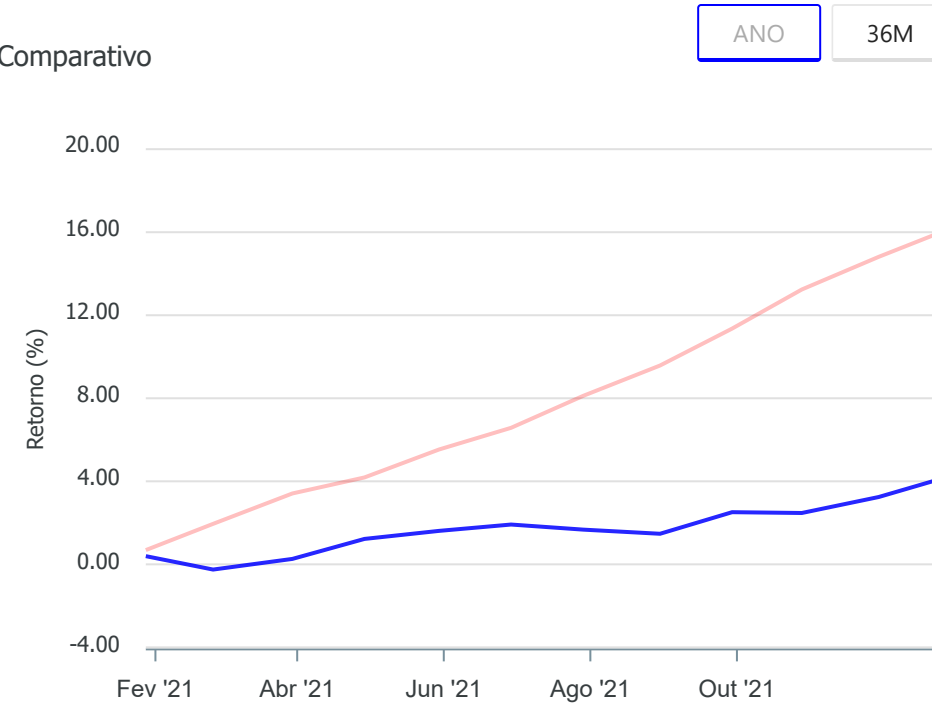


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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 - Inicial
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	348.000,53	0,00	0,00	397.194,00	49.193,47	14,14%	-0,23%	0,10
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.794.842,42	0,00	0,00	1.809.451,69	14.609,27	0,81%	0,81%	1,55
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	259.442,49	0,00	0,00	261.346,50	1.904,01	0,73%	0,73%	1,25
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.042.905,14	0,00	0,00	8.099.811,20	56.906,06	0,71%	0,71%	1,53
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.758.390,12	0,00	0,00	4.790.010,96	31.620,84	0,66%	0,66%	1,03
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.831.578,07	0,00	0,00	6.867.987,28	36.409,21	0,53%	0,53%	1,34
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.727.952,47	0,00	0,00	1.733.399,37	5.446,90	0,32%	0,32%	0,44
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.635.541,34	0,00	0,00	7.657.106,93	21.565,59	0,28%	0,28%	0,16
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	277.744,98	0,00	0,00	278.477,67	732,69	0,26%	0,26%	0,08
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.393.295,66	0,00	0,00	2.399.000,71	5.705,05	0,24%	0,24%	0,90
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	462.423,62	0,00	463.228,45	0,00	804,83	0,17%	0,20%	0,17
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	240.256,35	0,00	0,00	240.645,86	389,51	0,16%	0,16%	0,65
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.833.290,74	0,00	0,00	1.835.756,03	2.465,29	0,13%	0,13%	0,01
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	51.086,13	0,00	0,00	51.141,57	55,44	0,11%	0,11%	0,01
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	572.019,05	3.610.764,05	2.811.665,70	1.371.224,32	106,92	0,00%	0,08%	0,00
Total Renda Fixa	37.228.769,11	3.610.764,05	3.274.894,15	37.792.554,09	227.915,08	0,61%		0,90

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinatura em: https://sccs.trf4.jus.br/visualizarAssinaturaCodigo do Documento: 36431489-f204-4368-4039-4789702645e



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
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.269.152,11	0,00	0,00	1.370.159,27	101.007,16	7,96%	7,96%	5,72%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.359.519,19	0,00	0,00	2.439.624,19	80.105,00	3,39%	3,39%	6,65%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.476.481,28	0,00	0,00	1.513.901,11	37.419,83	2,53%	2,53%	5,37%
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.492.884,88	0,00	0,00	1.502.741,37	9.856,49	0,66%	0,66%	0,95%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	762.758,66	0,00	0,00	761.971,04	-787,62	-0,10%	-	-
HAZ FII - ATCR11	1.147.817,68	0,00	0,00	1.144.954,23	-2.863,45	-0,25%	-0,25%	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	31.018,16	0,00	0,00	30.870,16	-148,00	-0,48%	-	-
Total Renda Variável	8.539.631,96	0,00	0,00	8.764.221,37	224.589,41	2,63%		4,92%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinse em: https://sccs.tcepe.gov.br/gov/validaDoc.seam?codigo do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.789.743,95	0,00	0,00	2.806.826,55	17.082,60	0,61%	0,61%	10,13
Total Exterior	2.789.743,95	0,00	0,00	2.806.826,55	17.082,60	0,61%		10,13

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinse em: https://seccom.tce.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 3e431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 nos 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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE RIBEIRO DE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/quali/Doc.seam?CodigoDoc=343019-F204-2063-003-147897-0545e>



Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <http://etcg.cpf-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.812.327,34	3,61%	644	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	263.130,55	0,52%	140	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.801.444,20	9,58%	966	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.670.141,51	15,30%	1.316	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	8.148.520,69	16,25%	560	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	51.239,51	0,10%	791	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	6.897.109,34	13,76%	197	0,48%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	1.960.042,97	3,91%	1.476	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.840.854,47	3,67%	151	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	279.155,81	0,56%	672	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	241.095,46	0,48%	26	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	292.476,55	0,58%	31	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.734.481,12	3,46%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.601.818,17	3,19%	23.295	0,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.405.718,47	2,80%	53.001	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.585.810,05	5,16%	187	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.508.314,61	3,01%	32	0,45%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	761.219,22	1,52%	17	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	30.727,52	0,06%	33	0,39%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.146.572,92	2,29%		1,60%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '



Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2021)

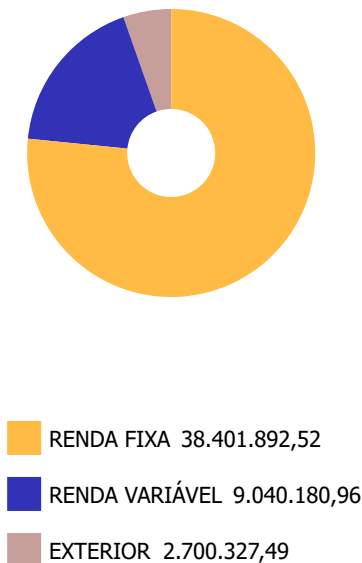
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.700.327,49	5,39%	407	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.409.873,00	4,81%	5	11,70%	Desenquadrado - RF
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		855.863,38	1,71%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			50.142.400,97				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			855.863,38				Artigo 6º
PL Total			50.998.264,35				

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	100,00%	50.142.400,97
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	14.547.043,60	29,01%	11,00%	50,00%	60,00%	15.538.396,98
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	50.142.400,97
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.507.120,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	5.014.240,10
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	30.085.440,58
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	19.710.494,80	39,31%	4,00%	15,00%	30,00%	-4.667.774,51
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	20.056.960,39
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	10.028.480,19
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.521.360,15
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.521.360,15
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.734.481,12	3,46%	0,00%	5,00%	5,00%	772.638,93
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.507.120,05
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.507.120,05
Desenquadrado - RF	0,00%	2.409.873,00	4,81%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.409.873,00
Total Renda Fixa	100,00%	38.401.892,52	76,59%	15,00%	75,00%	470,00%	



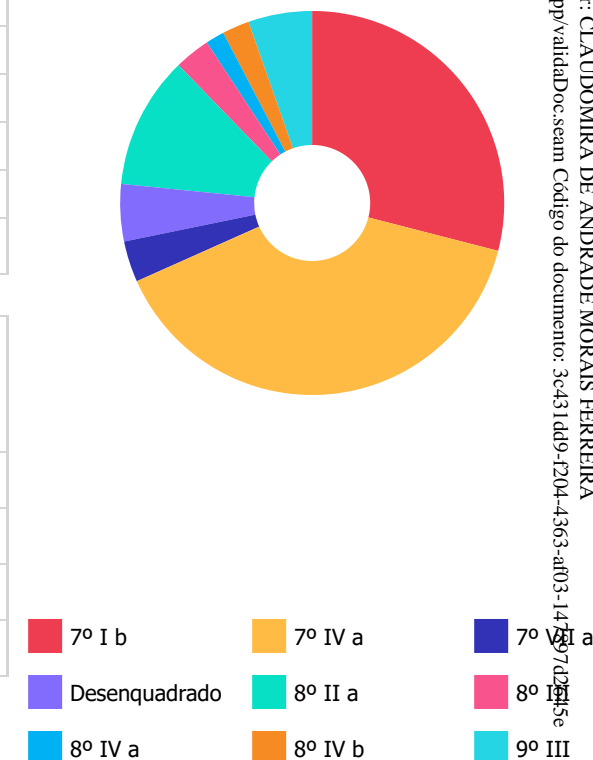
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	5,00%	2.507.120,05
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	15.042.720,29
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	5.593.346,69	11,15%	6,00%	16,00%	20,00%	4.435.133,50
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	10.028.480,19
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.508.314,61	3,01%	3,50%	3,69%	10,00%	3.505.925,49
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	791.946,74	1,58%	0,00%	2,00%	4,00%	1.213.749,30
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.146.572,92	2,29%	0,00%	3,00%	5,00%	1.360.547,13
Total Renda Variável	30,00%	9.040.180,96	18,03%	9,50%	24,69%	94,00%	

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%	5.014.240,10
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.507.120,05
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.700.327,49	5,39%	0,00%	0,31%	5,00%	-193.207,44
Total Exterior	10,00%	2.700.327,49	5,39%	0,00%	0,31%	20,00%	



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-1429702915e



Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	17.291.923,48	34,49	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.282.754,73	26,49	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	12.951.276,97	25,83	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.881.054,04	5,75	2,97
MULTINVEST CAPITAL	2.409.873,00	4,81	0,27
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	761.219,22	1,52	0,08
PLURAL	323.204,07	0,64	0,00
RJI CORRETORA DE VALORES	241.095,46	0,48	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 %		

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://scte.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,40%	6,08%	3,85%	8,15%	15,59%	25,97%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,06%	-2,22%	0,46%	-1,75%	-4,20%	-7,57%	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,20%	0,60%	0,52%	0,91%	2,11%	8,57%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,17%	0,51%	0,46%	0,79%	1,89%	8,12%	0,14%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,69%	1,42%	1,92%	3,27%	7,39%	17,55%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,19%	-0,30%	0,32%	0,29%	-25,79%	-35,86%	0,51%	0,22%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-16,58%	-23,45%	-16,28%	-23,66%	-67,84%	-75,73%	26,55%	0,54%
IRF-M (Benchmark)	0,20%	-1,79%	0,19%	0,13%	0,71%	12,10%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,16%	-1,87%	0,11%	0,06%	0,51%	11,56%	1,19%	0,03%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,45%	1,42%	1,01%	2,70%	-1,25%	3,94%	0,55%	0,05%
CDI (Benchmark)	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%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,24%	0,85%	0,61%	1,21%	2,14%	6,48%	0,05%	0,00%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,14%	0,32%	0,27%	0,34%	0,38%	2,61%	0,01%	0,00%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,28%	0,78%	0,56%	1,05%	1,85%	6,91%	0,03%	0,00%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12
IPCA (Benchmark)	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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	1,42%	1,72%	3,05%	6,93%	15,76%	0,89%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,24%	0,72%	1,21%	2,05%	3,45%	15,85%	1,14%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,42%	-1,13%	0,41%	1,33%	2,64%	10,28%	1,27%	0,04%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etcc.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,67%	7,48%	4,70%	9,88%	19,35%	34,31%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	160,19%	155,76%	157,80%	149,59%	-	-92,32%	-	0,83%
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,56%	6,88%	4,34%	9,14%	17,74%	30,70%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,10%	-0,56%	-0,31%	-0,73%	-1,73%	30,33%	-	0,00%
Global BDRX (Benchmark)	-3,85%	10,37%	0,08%	11,40%	34,12%	106,10%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,79%	9,66%	0,11%	10,42%	33,33%	105,13%	5,87%	0,17%
Ibovespa (Benchmark)	6,16%	6,05%	14,70%	15,91%	44,41%	30,08%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5,81%	6,66%	17,96%	17,78%	53,80%	48,84%	6,90%	0,25%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	2,60%	13,28%	18,60%	22,33%	43,24%	47,54%	7,89%	0,20%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	5,99%	3,57%	9,76%	11,75%	44,03%	18,60%	7,79%	0,17%
CDI (Benchmark)	0,27%	0,97%	0,68%	1,13%	2,18%	7,16%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,37%	0,55%	1,29%	1,96%	3,26%	11,74%	1,01%	0,02%
IFIX (Benchmark)	-1,56%	-1,87%	-2,43%	0,28%	5,97%	10,33%	-	-
HAZ FII - ATCR11	0,14%	-0,33%	-0,33%	-0,19%	1,94%	383,75%	-	-

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



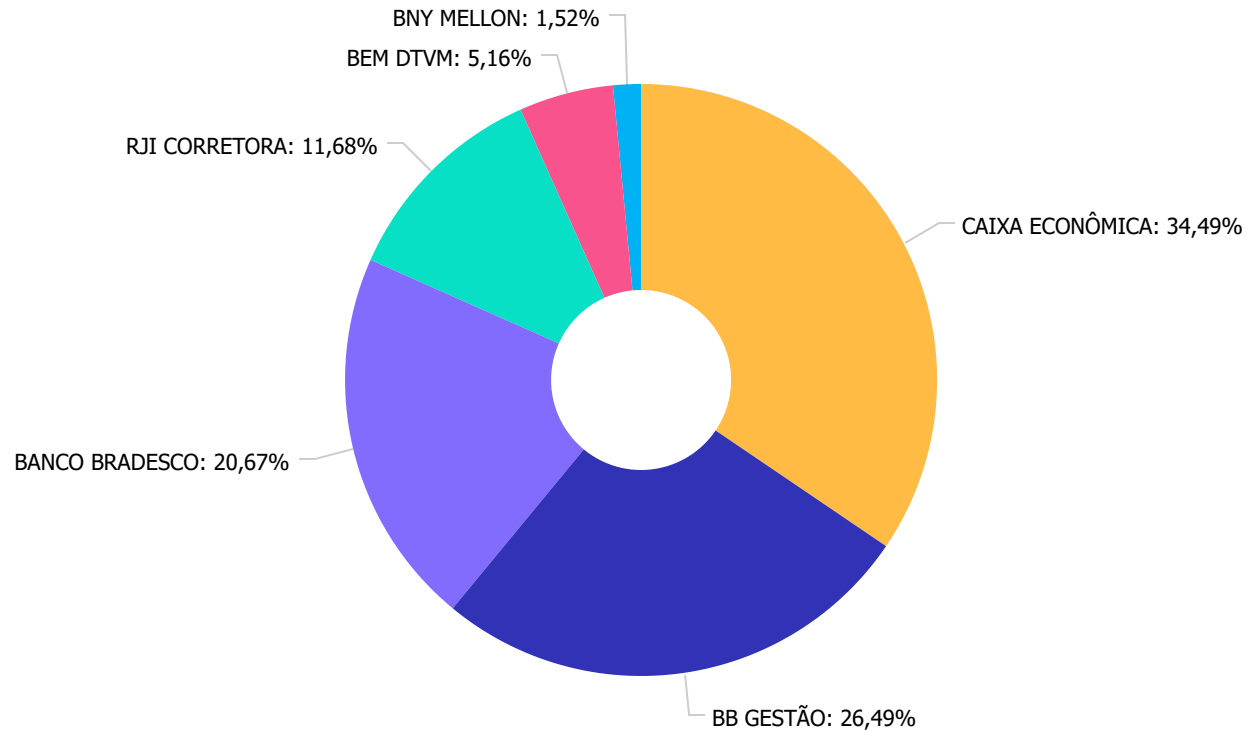
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-3,85%	10,37%	0,08%	11,40%	34,12%	106,10%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,79%	9,66%	0,11%	10,42%	33,33%	105,13%	5,87%	0,17%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

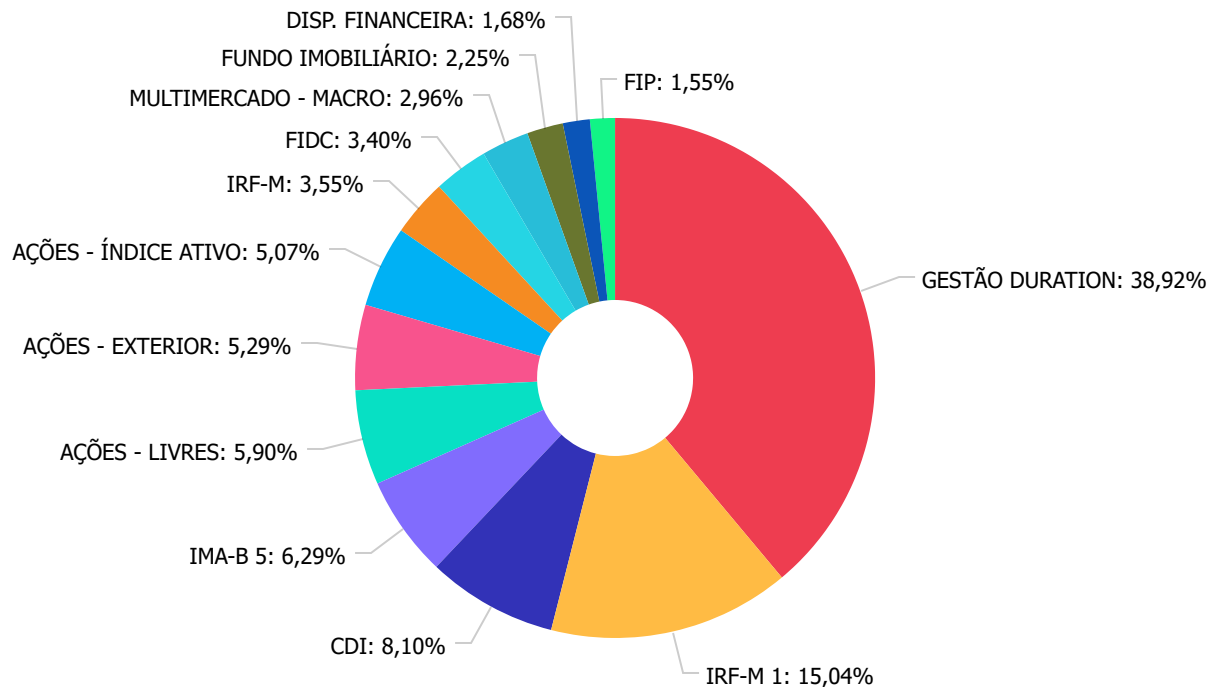


CAIXA ECONÔMICA	17.291.924,49
BB GESTÃO	13.282.751,50
BANCO BRADESCO	10.365.460,99
RJI CORRETORA	5.855.220,55
BEM DTVM	2.585.810,00
BNY MELLON	761.210,00

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRO DE ANDRADE MENOR DOS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validarDoc.aspx?CodigoDocumento=431619-f204-4363-a003-147897d2645e>



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



GESTÃO DURATION	19.847.072,22
IRF-M 1	7.670.144,72
CDI	4.131.291,70
IMA-B 5	3.206.570,66
AÇÕES - LIVRES	3.007.530,66
AÇÕES - EXTERIOR	2.700.324,40
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.585.810,00
IRF-M	1.812.321,11
FIDC	1.734.481,11
MULTIMERCADO - MACRO	1.508.316,67
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.146.571,92
DISP. FINANCEIRA	855.861,38
FIP	791.940,74

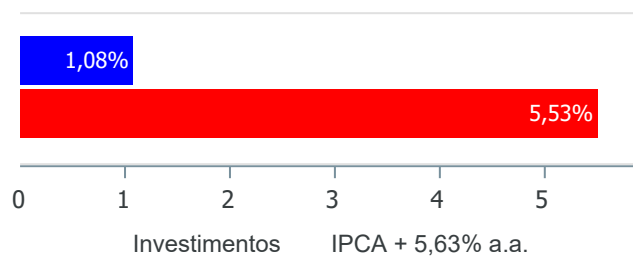
Documento Assinado Digitalmente por CLAYTON MORAES DE ANDRADE MORAIS PEREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epi/validarDocumento.aspx?CodigoDocumento=3c31dd912041b06380310897d2645e>



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	51.548.643,67	1.745.203,08	3.044.789,52	50.181.374,60	-67.682,63	-67.682,63	-0,13%	-0,13%	0,69%	0,69%	-19,12%	2,
Fevereiro	50.181.374,60	2.923.373,86	3.396.843,50	49.385.005,02	-322.899,94	-390.582,57	-0,64%	-0,77%	1,26%	1,95%	-39,67%	2,
Março	49.385.005,02	2.462.542,61	3.543.201,50	48.558.145,02	253.798,89	-136.783,68	0,51%	-0,26%	1,44%	3,41%	-7,73%	2,
Abril	48.558.145,02	3.610.764,05	3.274.894,15	49.363.602,01	469.587,09	332.803,41	0,96%	0,69%	0,75%	4,19%	16,57%	2,
Mai	49.363.602,01	3.387.660,62	2.799.779,76	50.142.400,97	190.918,10	523.721,51	0,38%	1,08%	1,29%	5,53%	19,50%	2,

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://pccs.leg.br/sv/bpp/vtdadoc/seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e

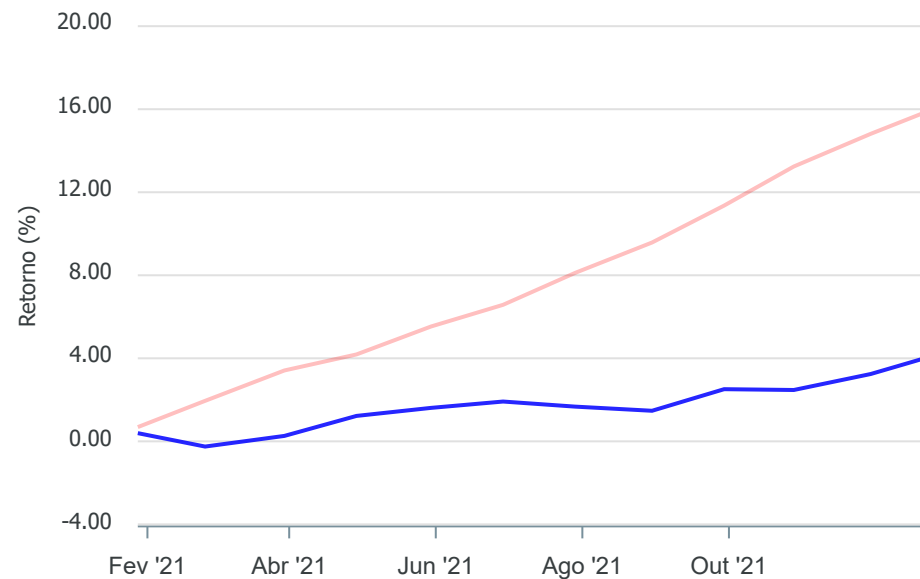


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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 -
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	261.346,50	0,00	0,00	263.130,55	1.784,05	0,68%	0,68%	0,89
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.099.811,20	0,00	0,00	8.148.520,69	48.709,49	0,60%	0,60%	1,19
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.399.000,71	0,00	0,00	2.409.873,00	10.872,29	0,45%	0,45%	0,55
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.867.987,28	0,00	0,00	6.897.109,34	29.122,06	0,42%	0,42%	1,27
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.835.756,03	0,00	0,00	1.840.854,47	5.098,44	0,28%	0,28%	0,03
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	278.477,67	0,00	0,00	279.155,81	678,14	0,24%	0,24%	0,05
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.790.010,96	0,00	0,00	4.801.444,20	11.433,24	0,24%	0,24%	1,14
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	51.141,57	0,00	0,00	51.239,51	97,94	0,19%	0,19%	0,01
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	240.645,86	0,00	0,00	241.095,46	449,60	0,19%	0,19%	0,51
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.657.106,93	0,00	0,00	7.670.141,51	13.034,58	0,17%	0,17%	0,14
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.809.451,69	0,00	0,00	1.812.327,34	2.875,65	0,16%	0,16%	1,19
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.733.399,37	0,00	0,00	1.734.481,12	1.081,75	0,06%	-	-
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.371.224,32	3.387.660,62	2.799.779,76	1.960.042,97	937,79	0,02%	0,13%	0,01
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	397.194,00	0,00	0,00	292.476,55	-104.717,45	-26,36%	-16,58%	26,55
Total Renda Fixa	37.792.554,09	3.387.660,62	2.799.779,76	38.401.892,52	21.457,57	0,06%		1,00

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinatura em: https://sccs.trfpe.gov.br/gp/validador.aspx?codigo_documento=36431dd9-f294-4369-b540-3947897d2645e



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
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.439.624,19	0,00	0,00	2.585.810,05	146.185,86	5,99%	5,99%	7,79%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.513.901,11	0,00	0,00	1.601.818,17	87.917,06	5,81%	5,81%	6,90%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.370.159,27	0,00	0,00	1.405.718,47	35.559,20	2,60%	2,60%	7,89%
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.502.741,37	0,00	0,00	1.508.314,61	5.573,24	0,37%	0,37%	1,01%
HAZ FII - ATCR11	1.144.954,23	0,00	0,00	1.146.572,92	1.618,69	0,14%	0,14%	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	761.971,04	0,00	0,00	761.219,22	-751,82	-0,10%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	30.870,16	0,00	0,00	30.727,52	-142,64	-0,46%	-	-
Total Renda Variável	8.764.221,37	0,00	0,00	9.040.180,96	275.959,59	3,15%		6,17%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinatura em: https://seccom.pe.gov.br/gov/validador/validadorDoc.seam Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.806.826,55	0,00	0,00	2.700.327,49	-106.499,06	-3,79%	-3,79%	5,87%
Total Exterior	2.806.826,55	0,00	0,00	2.700.327,49	-106.499,06	-3,79%		5,87%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinse em: https://sede.tcepe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 3e431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 nos 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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/quali/Doc/seam/Cod/890603003-1478970545e>



Relatório Analítico dos Investimentos

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

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <http://etcg.ce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/ppv/validarDoc.aspx?CodigoDoDocumento:3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e>
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	1.812.644,69	3,62%	992	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	263.510,31	0,53%	140	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.801.299,39	9,58%	974	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.535.994,84	9,05%	1.309	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	8.152.336,42	16,27%	572	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	51.354,48	0,10%	793	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	6.919.934,79	13,81%	196	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	4.784.217,77	9,55%	1.463	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	240.013,45	0,48%	26	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	289.175,32	0,58%	31	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.736.517,70	3,47%	70	2,44%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.589.033,69	3,17%	25.862	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.402.103,83	2,80%	56.940	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.639.891,14	5,27%	185	0,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.504.295,87	3,00%	32	0,49%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.291.114,29	4,57%	15.736	0,10%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	760.482,26	1,52%	17	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	77.809,39	0,16%	33	0,39%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.162.655,87	2,32%		1,60%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.668.234,88	5,33%	427	0,09%	Artigo 9º, Inciso III



Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2021)

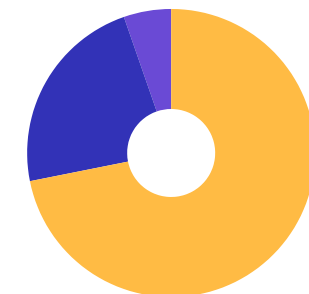
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.411.805,24	4,81%	5	11,70%	Desenquadrado - RF
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		608.605,36	1,21%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			50.094.425,62				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			608.605,36				Artigo 6º
PL Total			50.703.030,98				

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	100,00%	50.094.425,62
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	11.413.449,23	22,78%	11,00%	50,00%	60,00%	18.643.206,14
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	50.094.425,62
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.504.721,28
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	5.009.442,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	30.056.655,37
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	20.437.032,23	40,80%	4,00%	15,00%	30,00%	-5.408.704,54
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	20.037.770,25
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	10.018.885,12
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.514.163,84
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.514.163,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.736.517,70	3,47%	0,00%	5,00%	5,00%	768.203,58
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.504.721,28
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.504.721,28
Desenquadrado - RF	0,00%	2.411.805,24	4,81%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.411.805,24
Total Renda Fixa	100,00%	35.998.804,40	71,86%	15,00%	75,00%	470,00%	



■ RENDA FIXA 35.998.804,40
■ RENDA VARIÁVEL 11.427.386,34
■ EXTERIOR 2.668.234,88

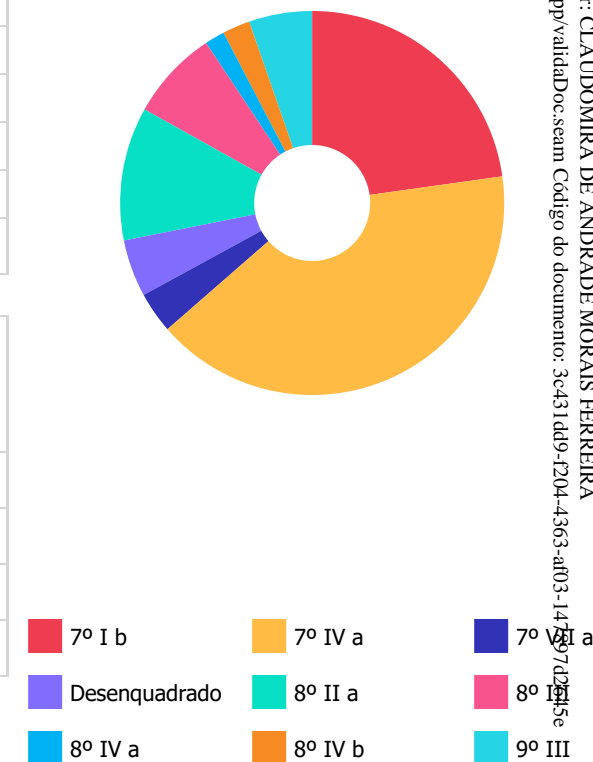
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	5,00%	2.504.721,28
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	15.028.327,69
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	5.631.028,66	11,24%	6,00%	16,00%	20,00%	4.387.856,46
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	10.018.885,12
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	3.795.410,16	7,58%	3,50%	3,69%	10,00%	1.214.032,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	838.291,65	1,67%	0,00%	2,00%	4,00%	1.165.485,37
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.162.655,87	2,32%	0,00%	3,00%	5,00%	1.342.065,41
Total Renda Variável	30,00%	11.427.386,34	22,81%	9,50%	24,69%	94,00%	

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%	5.009.442,56
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.504.721,28
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.668.234,88	5,33%	0,00%	0,31%	5,00%	-163.513,60
Total Exterior	10,00%	2.668.234,88	5,33%	0,00%	0,31%	20,00%	



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-142972215e



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	15.848.339,57	31,64	0,00
CAIXA DTVM	14.296.643,40	28,54	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.270.983,42	26,49	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.899.173,57	5,79	2,79
MULTINVEST CAPITAL	2.411.805,24	4,81	0,26
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	760.482,26	1,52	0,08
PLURAL	366.984,71	0,73	0,01
RJI CORRETORA DE VALORES	240.013,45	0,48	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 %		

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://sistema.pec.gov.br/epp/validarDoc>;seam Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,10%	7,25%	3,39%	7,25%	15,90%	26,69%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,12%	-2,10%	0,50%	-2,10%	-3,88%	-7,96%	-	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,21%	0,81%	0,68%	0,81%	2,04%	8,17%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,19%	0,70%	0,64%	0,70%	1,82%	7,71%	0,16%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,13%	1,29%	1,44%	1,29%	6,07%	15,42%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,45%	-0,75%	-0,10%	-0,75%	-23,82%	-36,67%	0,72%	0,22%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,15%	-23,56%	-16,90%	-23,56%	-66,87%	-75,85%	0,21%	0,54%
IRF-M (Benchmark)	0,21%	-1,58%	1,26%	-1,58%	0,14%	9,97%	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,08%	1,50%	0,77%	1,50%	3,76%	2,13%	0,70%	0,01%
CDI (Benchmark)	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%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,17%	0,49%	0,39%	0,49%	0,53%	2,50%	0,01%	0,00%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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
IPCA (Benchmark)	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%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,00%	0,72%	0,90%	0,72%	2,68%	12,77%	0,97%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,33%	-0,80%	1,29%	-0,80%	2,01%	8,38%	1,16%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,14%	1,56%	1,57%	1,56%	5,93%	14,11%	1,13%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etec.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,37%	8,95%	4,21%	8,95%	19,68%	35,11%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-3,29%	147,34%	150,42%	147,34%	136,01%	-92,57%	5,00%	0,03%
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,25%	8,22%	3,86%	8,22%	18,06%	31,47%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,10%	-0,66%	-0,30%	-0,66%	-1,67%	-	-	0,00%
Global BDRX (Benchmark)	-0,28%	10,06%	-3,18%	10,06%	27,98%	98,13%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,19%	8,36%	-4,36%	8,36%	26,23%	95,14%	5,33%	0,17%
Ibovespa (Benchmark)	0,46%	6,54%	8,72%	6,54%	33,40%	25,59%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,80%	5,81%	7,62%	5,81%	39,67%	43,84%	5,55%	0,25%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-0,26%	12,99%	10,48%	12,99%	34,12%	41,19%	4,50%	0,20%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2,09%	5,73%	11,88%	5,73%	34,96%	16,77%	4,46%	0,16%
CDI (Benchmark)	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-0,27%	0,28%	0,76%	0,28%	2,23%	10,48%	1,28%	0,02%
MSCI ACWI (Benchmark)	-3,25%	7,23%	-6,11%	7,23%	25,29%	79,54%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2,72%	16,15%	8,76%	16,15%	38,60%	43,45%	4,66%	0,15%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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
IFIX (Benchmark)	-2,19%	-4,02%	-3,23%	-4,02%	-1,83%	4,90%	-	-
HAZ FII - ATCR11	1,40%	1,06%	1,29%	1,06%	1,09%	390,54%	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



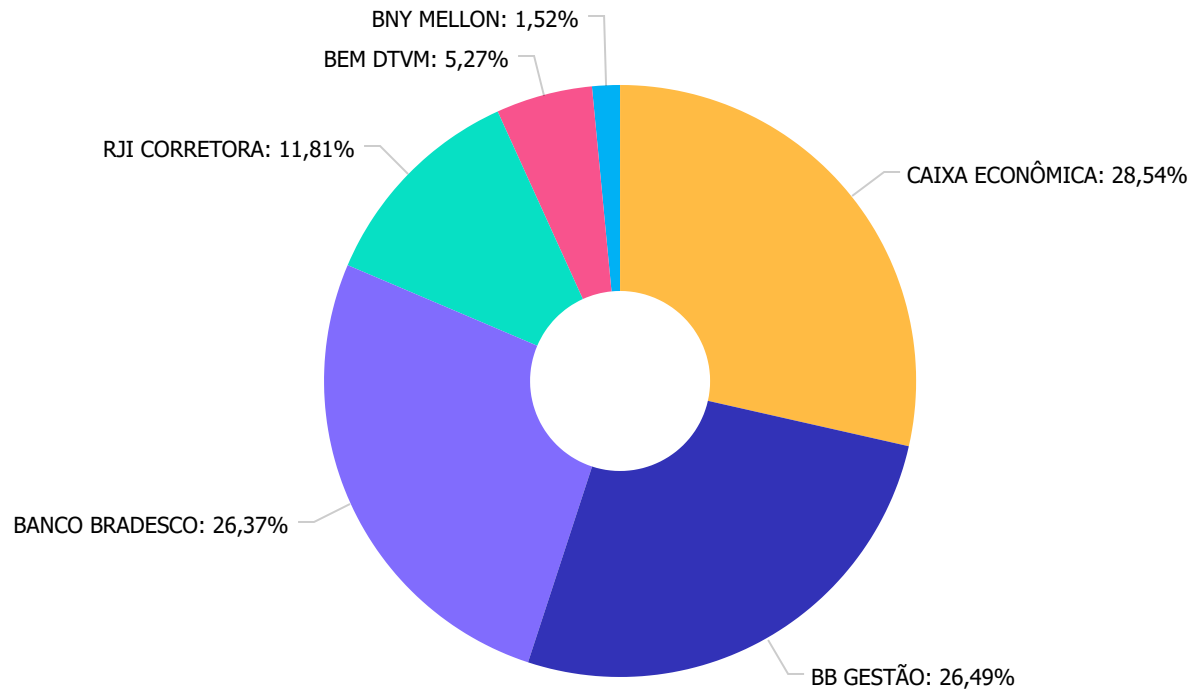
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-0,28%	10,06%	-3,18%	10,06%	27,98%	98,13%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,19%	8,36%	-4,36%	8,36%	26,23%	95,14%	5,33%	0,17%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

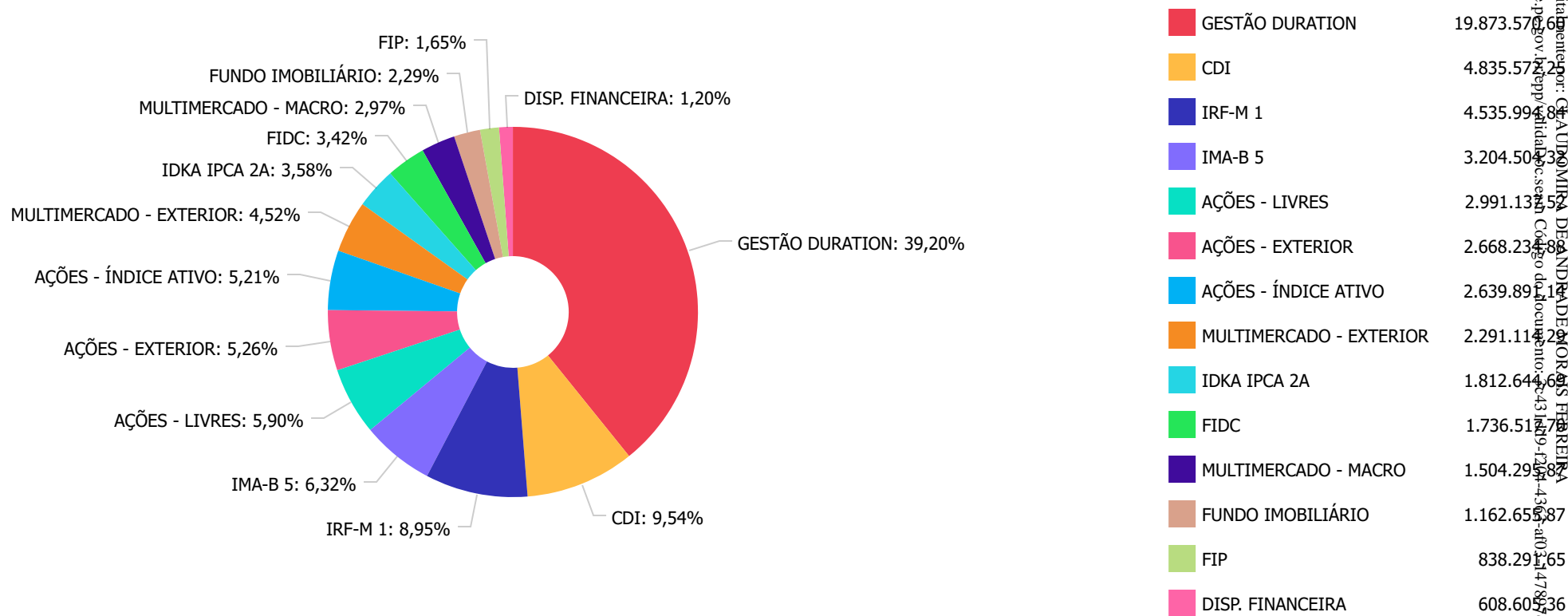


CAIXA ECONÔMICA	14.296.644,41
BB GESTÃO	13.270.988,44
BANCO BRADESCO	13.208.441,44
RJI CORRETORA	5.917.970,96
BEM DTVM	2.639.891,11
BNY MELLON	760.481,29

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRO DE ANDRADE MENORAS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam?CodigoDoc=131219-f204-4363-a003-147897d2645e>



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



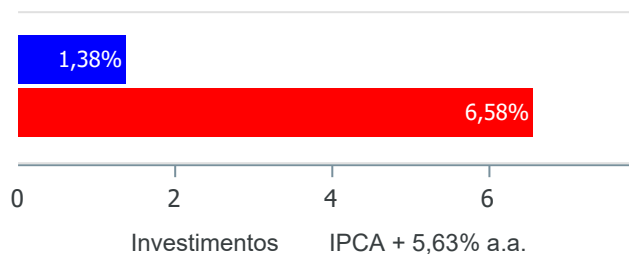
Documento Assinado Digitalmente por: CAVALDOMIRIA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesso em: https://etc.ce.gov.br/pepp/auditoria/ver-segno-do-documento-43119-f214-436-a011-478102645e



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	51.548.643,67	1.745.203,08	3.044.789,52	50.181.374,60	-67.682,63	-67.682,63	-0,13%	-0,13%	0,69%	0,69%	-19,12%	2
Fevereiro	50.181.374,60	2.923.373,86	3.396.843,50	49.385.005,02	-322.899,94	-390.582,57	-0,64%	-0,77%	1,26%	1,95%	-39,67%	2
Março	49.385.005,02	2.462.542,61	3.543.201,50	48.558.145,02	253.798,89	-136.783,68	0,51%	-0,26%	1,44%	3,41%	-7,73%	2
Abril	48.558.145,02	3.610.764,05	3.274.894,15	49.363.602,01	469.587,09	332.803,41	0,96%	0,69%	0,75%	4,19%	16,57%	2
Mai	49.363.602,01	3.387.660,62	2.799.779,76	50.142.400,97	190.918,10	523.721,51	0,38%	1,08%	1,29%	5,53%	19,50%	2
Junho	50.142.400,97	9.979.176,60	10.178.203,74	50.094.425,62	151.051,79	674.773,30	0,30%	1,38%	0,99%	6,58%	21,03%	1

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDIMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://pccs.tce-pe.gov.br/sgp/validador/validador.jspx?docId=353431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e>

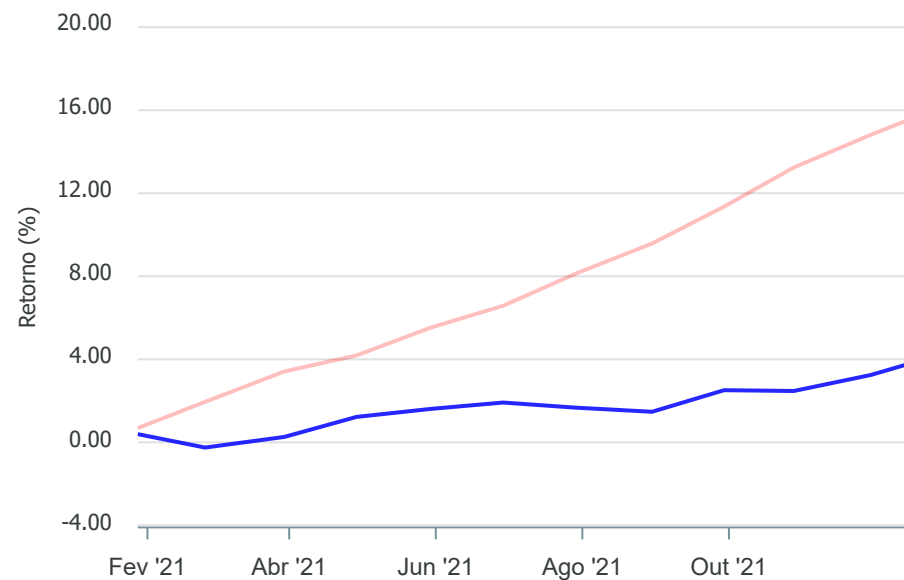


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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 - Início
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.897.109,34	0,00	0,00	6.919.934,79	22.825,45	0,33%	0,33%	1,16%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	51.239,51	0,00	0,00	51.354,48	114,97	0,22%	0,22%	0,01%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.812.327,34	0,00	1.815.785,53	0,00	3.458,19	0,19%	0,17%	1,14%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.840.854,47	130.325,21	1.974.886,43	0,00	3.706,75	0,19%	0,30%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	263.130,55	0,00	0,00	263.510,31	379,76	0,14%	0,14%	1,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.670.141,51	0,00	3.144.478,31	4.535.994,84	10.331,64	0,13%	0,19%	0,16%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.734.481,12	0,00	0,00	1.736.517,70	2.036,58	0,12%	-	-
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.960.042,97	5.781.703,25	2.963.736,14	4.784.217,77	6.207,69	0,08%	0,17%	0,01%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.409.873,00	0,00	0,00	2.411.805,24	1.932,24	0,08%	0,08%	0,70%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	279.155,81	0,00	279.317,33	0,00	161,52	0,06%	0,31%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.148.520,69	0,00	0,00	8.152.336,42	3.815,73	0,05%	0,05%	1,46%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.801.444,20	0,00	0,00	4.801.299,39	-144,81	0,00%	0,00%	0,97%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	0,00	1.815.785,53	0,00	1.812.644,69	-3.140,84	-0,17%	-0,09%	1,36%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	241.095,46	0,00	0,00	240.013,45	-1.082,01	-0,45%	-0,45%	0,72%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	292.476,55	0,00	0,00	289.175,32	-3.301,23	-1,13%	-0,15%	0,21%
Total Renda Fixa	38.401.892,52	7.727.813,99	10.178.203,74	35.998.804,40	47.301,63	0,12%		0,88%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinse em: https://sccs.ccepe.gov.br/va/validador/assinamCodigo do documento: 3643149-f294-4368-4034-47897d2645e



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
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	30.727,52	0,00	0,00	77.809,39	47.081,87	153,22%	-3,29%	5,00
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.585.810,05	0,00	0,00	2.639.891,14	54.081,09	2,09%	2,09%	4,46
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	2.251.362,61	0,00	2.291.114,29	39.751,68	1,77%	2,71%	4,66
HAZ FII - ATCR11	1.146.572,92	0,00	0,00	1.162.655,87	16.082,95	1,40%	1,40%	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	761.219,22	0,00	0,00	760.482,26	-736,96	-0,10%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.405.718,47	0,00	0,00	1.402.103,83	-3.614,64	-0,26%	-0,26%	4,50
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.508.314,61	0,00	0,00	1.504.295,87	-4.018,74	-0,27%	-0,27%	1,28
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.601.818,17	0,00	0,00	1.589.033,69	-12.784,48	-0,80%	-0,80%	5,55
Total Renda Variável	9.040.180,96	2.251.362,61	0,00	11.427.386,34	135.842,77	1,20%		4,20

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinatura em: https://seccom.br/validador/validarDocumento?codigo=3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.700.327,49	0,00	0,00	2.668.234,88	-32.092,61	-1,19%	-1,19%	5,33%
Total Exterior	2.700.327,49	0,00	0,00	2.668.234,88	-32.092,61	-1,19%		5,33%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinse em: https://sede.tce.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 3e431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 (%)	(%) Int...
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.042.905,14	0,00	0,00	8.152.336,42	109.431,28	1,36%	1,36%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.831.578,07	0,00	0,00	6.919.934,79	88.356,72	1,29%	1,29%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.635.541,34	0,00	3.144.478,31	4.535.994,84	44.931,81	0,59%	0,64%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.758.390,12	0,00	0,00	4.801.299,39	42.909,27	0,90%	0,90%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.794.842,42	0,00	1.815.785,53	0,00	20.943,11	1,17%	1,15%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.393.295,66	0,00	0,00	2.411.805,24	18.509,58	0,77%	0,77%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.833.290,74	130.325,21	1.974.886,43	0,00	11.270,48	0,57%	0,71%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.727.952,47	0,00	0,00	1.736.517,70	8.565,23	0,50%	0,50%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	572.019,05	12.780.127,92	8.575.181,60	4.784.217,77	7.252,40	0,05%	0,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	259.442,49	0,00	0,00	263.510,31	4.067,82	1,57%	1,57%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	277.744,98	0,00	279.317,33	0,00	1.572,35	0,57%	0,82%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	462.423,62	0,00	463.228,45	0,00	804,83	0,17%	0,60%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	51.086,13	0,00	0,00	51.354,48	268,35	0,53%	0,53%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	240.256,35	0,00	0,00	240.013,45	-242,90	-0,10%	-0,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	0,00	1.815.785,53	0,00	1.812.644,69	-3.140,84	-0,17%	1,42%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	348.000,53	0,00	0,00	289.175,32	-58.825,21	-16,90%	-16,90%
				Total Renda Fixa	296.674,28	0,57%	

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinatura em: https://seccom.pe.gov.br/gpp/validarDocumentoCodigo do documento: 36431490-f294-4363-a033-417857d2645e



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 (%)	(%) Inicial
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.359.519,19	0,00	0,00	2.639.891,14	280.371,95	11,88%	11,88%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.269.152,11	0,00	0,00	1.402.103,83	132.951,72	10,48%	10,48%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.476.481,28	0,00	0,00	1.589.033,69	112.552,41	7,62%	7,62%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	31.018,16	0,00	0,00	77.809,39	46.791,23	150,85%	150,42%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	2.251.362,61	0,00	2.291.114,29	39.751,68	1,77%	8,76%
HAZ FII - ATCR11	1.147.817,68	0,00	0,00	1.162.655,87	14.838,19	1,29%	1,29%
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.492.884,88	0,00	0,00	1.504.295,87	11.410,99	0,76%	0,76%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	762.758,66	0,00	0,00	760.482,26	-2.276,40	-0,30%	-0,30%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.789.743,95	0,00	0,00	2.668.234,88	-121.509,07	-4,36%	-4,36%
Total Renda Variável					514.882,70	3,79%	

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinatura em: https://seccom.sp.gov.br/seccom/validarDocumentoCodigo do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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...
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	3.634.813,41	15.301.439,74	14.206.017,48	4.784.217,77	53.982,10	0,29%	0,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.624.048,23	7.494,86	3.144.478,31	4.535.994,84	48.930,06	0,64%	0,70%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.376.246,45	0,00	0,00	2.411.805,24	35.558,79	1,50%	1,50%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.767.103,56	0,00	0,00	4.801.299,39	34.195,83	0,72%	0,72%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	183.883,39	2.895.536,44	3.095.211,64	0,00	15.791,81	0,51%	1,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	266.232,29	0,00	6.964,30	263.510,31	4.242,32	1,59%	1,56%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	276.807,17	0,00	279.317,33	0,00	2.510,16	0,91%	1,16%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.808.985,61	0,00	2.811.275,59	0,00	2.289,98	0,08%	0,62%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	50.968,42	0,00	0,00	51.354,48	386,06	0,76%	0,76%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	511.598,41	337.161,64	847.019,15	0,00	-1.740,90	-0,21%	0,42%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	241.827,29	0,00	0,00	240.013,45	-1.813,84	-0,75%	-0,75%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	0,00	1.815.785,53	0,00	1.812.644,69	-3.140,84	-0,17%	1,42%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.846.616,93	0,00	1.815.785,53	0,00	-30.831,40	-1,67%	-1,70%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.184.141,61	0,00	0,00	8.152.336,42	-31.805,19	-0,39%	-0,39%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.773.808,10	0,00	0,00	1.736.517,70	-37.290,40	-2,10%	-2,10%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.975.647,39	0,00	0,00	6.919.934,79	-55.712,60	-0,80%	-0,80%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	378.322,40	0,00	31.642,84	289.175,32	-57.504,24	-15,20%	-23,50%
				Total Renda Fixa	-21.952,30	-0,04%	

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinatura em: https://seccat.cepe.gov.br/vigilantadoc.aspx?codigo_documento:3643140-f204-4363-8039-47897d2628e



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 (%)	(%) Inicial
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.462.400,72	0,00	0,00	2.668.234,88	205.834,16	8,36%	8,36%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.240.970,34	0,00	0,00	1.402.103,83	161.133,49	12,98%	12,99%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.496.755,63	0,00	0,00	2.639.891,14	143.135,51	5,73%	5,73%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	1.499.940,00	0,00	1.589.033,69	89.093,69	5,94%	5,81%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	31.404,77	0,00	0,00	77.809,39	46.404,62	147,76%	147,33%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	2.251.362,61	0,00	2.291.114,29	39.751,68	1,77%	16,15%
HAZ FII - ATCR11	1.150.415,83	0,00	0,00	1.162.655,87	12.240,04	1,06%	1,06%
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.500.120,05	0,00	0,00	1.504.295,87	4.175,82	0,28%	0,28%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	765.525,67	0,00	0,00	760.482,26	-5.043,41	-0,66%	-0,66%
				Total Renda Variável	696.725,60	5,20%	

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinado em: https://sede.tcepe.gov.br/qr/validar/validarAssinatura.do?assinaturaCodigoDocumento:3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 nos 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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE RIBEIRO DE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/quali/Doc.seam?CodigoDoc=343019-F204-2063-003-147897-0545e>



Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <http://etcg.cpf-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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	1.814.157,52	4,14%	1.007	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	264.569,23	0,60%	140	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.764.059,52	10,87%	984	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.057.737,96	4,70%	1.303	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	8.143.273,28	18,59%	582	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	51.481,02	0,12%	797	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	6.906.082,56	15,76%	197	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	1.118.179,28	2,55%	1.466	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	239.153,84	0,55%	26	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	288.805,91	0,66%	31	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.741.214,72	3,97%	70	2,44%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.544.834,26	3,53%	27.293	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.339.699,89	3,06%	59.091	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.511.267,93	5,73%	182	0,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.498.120,16	3,42%	32	0,49%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.351.331,11	5,37%	17.306	0,09%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	759.643,37	1,73%	17	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	77.431,34	0,18%	33	0,39%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.159.230,09	2,65%		1,60%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.812.863,21	6,42%	454	0,09%	Artigo 9º, Inciso III

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/ppv/validarDoc?seamCodigoDoDocumento:3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e>



Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2021)

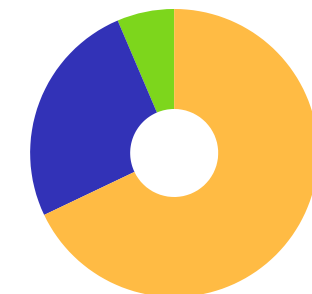
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.371.268,02	5,41%	5	11,70%	Desenquadrado - RF
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		615.938,71	1,41%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			43.814.404,22				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			615.938,71				Artigo 6º
PL Total			44.430.342,93				

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	100,00%	43.814.404,22
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	8.900.524,23	20,31%	11,00%	50,00%	60,00%	17.388.118,30
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	43.814.404,22
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.190.720,21
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.381.440,42
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	26.288.642,53
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	16.746.975,89	38,22%	4,00%	15,00%	30,00%	-3.602.654,62
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	17.525.761,69
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	8.762.880,84
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	6.572.160,63
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	6.572.160,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.741.214,72	3,97%	0,00%	5,00%	5,00%	449.505,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.190.720,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.190.720,21
Desenquadrado - RF	0,00%	2.371.268,02	5,41%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.371.268,02
Total Renda Fixa	100,00%	29.759.982,86	67,92%	15,00%	75,00%	470,00%	



■ RENDA FIXA 29.759.982,86
■ RENDA VARIÁVEL 11.241.558,15
■ EXTERIOR 2.812.863,21

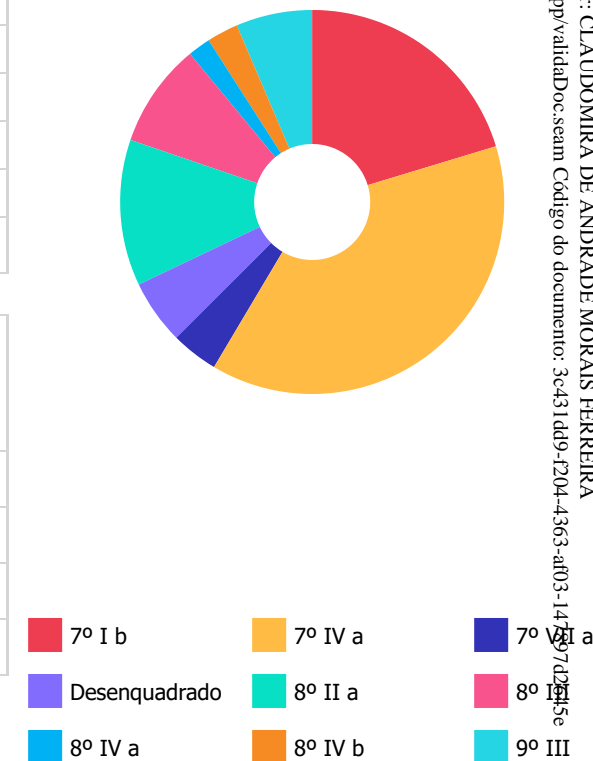
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	5,00%	2.190.720,21
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	13.144.321,27
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	5.395.802,08	12,32%	6,00%	16,00%	20,00%	3.367.078,76
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	8.762.880,84
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	3.849.451,27	8,79%	3,50%	3,69%	10,00%	531.989,15
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	837.074,71	1,91%	0,00%	2,00%	4,00%	915.501,46
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.159.230,09	2,65%	0,00%	3,00%	5,00%	1.031.490,12
Total Renda Variável	30,00%	11.241.558,15	25,66%	9,50%	24,69%	94,00%	

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%	4.381.440,42
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.190.720,21
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.812.863,21	6,42%	0,00%	0,31%	5,00%	-622.143,00
Total Exterior	10,00%	2.812.863,21	6,42%	0,00%	0,31%	20,00%	



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-142972215e



Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.158.015,20	30,03	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	12.033.649,93	27,47	0,00
CAIXA DTVM	11.985.991,80	27,36	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.900.444,81	6,62	0,88
MULTINVEST CAPITAL	2.371.268,02	5,41	0,26
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	759.643,37	1,73	0,08
PLURAL	366.237,25	0,84	0,01
RJI CORRETORA DE VALORES	239.153,84	0,55	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 %		

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://scte.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,56%	8,92%	4,11%	8,07%	16,56%	27,63%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,27%	-1,84%	0,45%	-1,87%	-3,22%	-8,08%	0,42%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,19%	1,00%	0,60%	0,96%	1,99%	7,60%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,17%	0,86%	0,53%	0,84%	1,75%	7,14%	0,23%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,03%	1,31%	0,59%	1,21%	5,06%	14,34%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,36%	-1,11%	-0,62%	-0,98%	-24,56%	-37,04%	0,47%	0,22%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,13%	-23,66%	-16,82%	-16,59%	-66,89%	-76,65%	0,25%	0,54%
IRF-M (Benchmark)	-0,47%	-2,04%	-0,06%	-1,25%	-1,40%	8,27%	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-1,68%	-0,21%	-1,16%	-0,85%	2,29%	-0,10%	6,28%	0,02%
CDI (Benchmark)	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%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,16%	0,65%	0,47%	0,63%	0,69%	2,33%	0,01%	0,00%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12
IPCA (Benchmark)	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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	1,97%	1,23%	1,82%	5,59%	13,55%	0,63%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,78%	-0,06%	-0,54%	-0,09%	0,90%	10,67%	1,68%	0,02%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,20%	-1,00%	0,56%	-0,42%	0,10%	7,17%	1,03%	0,03%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,84%	10,96%	4,97%	9,81%	20,34%	36,10%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,31%	146,56%	150,83%	147,70%	-	-92,59%	0,02%	0,03%
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,72%	10,09%	4,60%	9,06%	18,72%	32,44%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,11%	-0,77%	-0,31%	-0,61%	-1,61%	30,50%	-	0,00%
Global BDRX (Benchmark)	5,91%	16,57%	1,55%	9,86%	33,20%	107,01%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,42%	14,23%	0,22%	7,98%	30,62%	103,08%	7,99%	0,17%
Ibovespa (Benchmark)	-3,94%	2,34%	2,44%	5,85%	18,35%	19,63%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,78%	2,87%	2,04%	8,25%	23,66%	34,95%	8,28%	0,24%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-4,45%	7,96%	-2,22%	11,50%	18,84%	30,73%	8,76%	0,20%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	-4,87%	0,58%	2,94%	3,14%	16,66%	9,20%	8,64%	0,15%
CDI (Benchmark)	0,36%	1,64%	0,94%	1,49%	2,44%	6,76%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-0,41%	-0,13%	-0,31%	-0,07%	1,21%	9,36%	1,04%	0,02%
MSCI ACWI (Benchmark)	2,99%	10,44%	-2,20%	5,36%	29,16%	87,89%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2,63%	19,20%	5,92%	19,27%	34,66%	45,15%	5,66%	0,14%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.gov.br/epp/validarDoc?seamCodigoDocumento:3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e>



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
IFIX (Benchmark)	2,51%	-1,60%	-1,29%	-1,92%	3,33%	6,19%	-	-
HAZ FII - ATCR11	-0,30%	0,77%	1,25%	1,23%	0,76%	389,09%	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



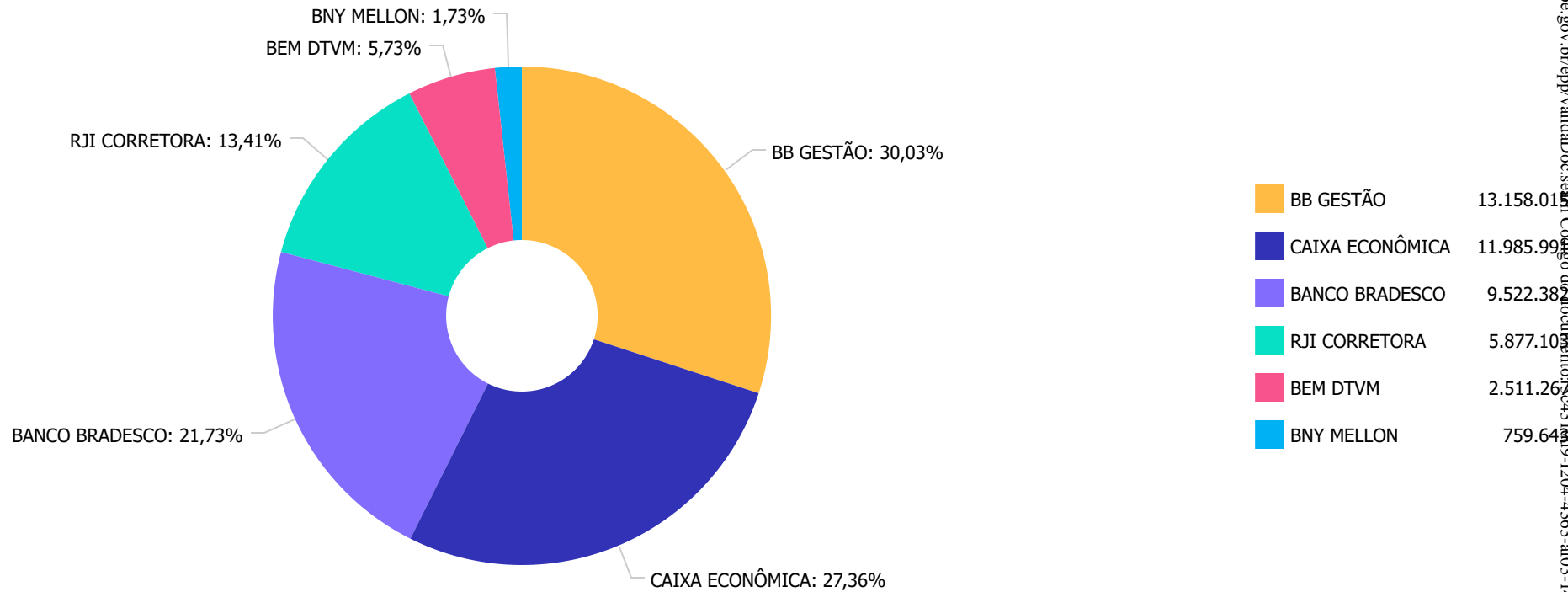
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	5,91%	16,57%	1,55%	9,86%	33,20%	107,01%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,42%	14,23%	0,22%	7,98%	30,62%	103,08%	7,99%	0,17%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



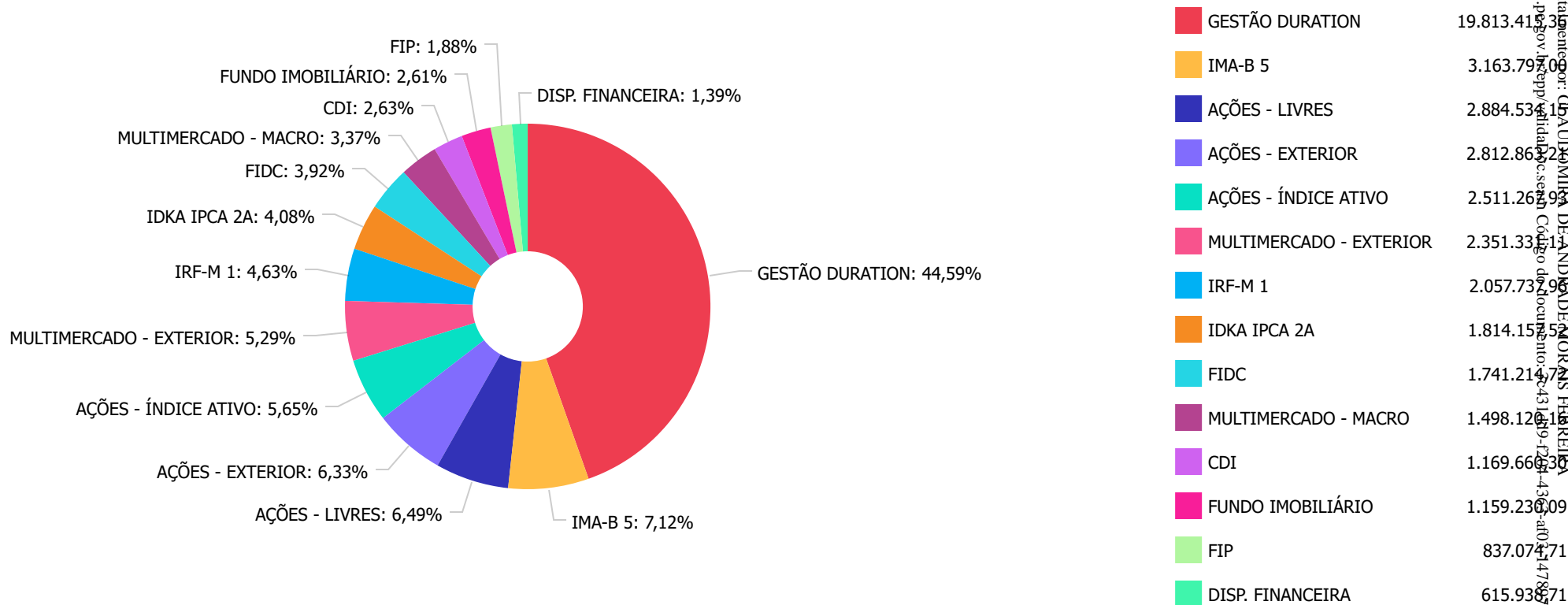
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Julho / 2021)



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRO DE ANDRADE MORAES FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.aspx?CodigoDoc=431419-f204-4363-a003-147897d2645e>



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



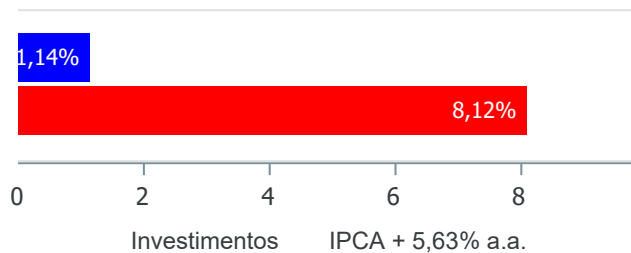
Documento Assinado Digitalmente por: CAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesso em: https://etc.ce.gov.br/cepp/validar?csc=senaiCodigo do documento: 431319-f2b-43b-a00-1478b-d2645e



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	51.548.643,67	1.745.203,08	3.044.789,52	50.181.374,60	-67.682,63	-67.682,63	-0,13%	-0,13%	0,69%	0,69%	-19,12%	2
Fevereiro	50.181.374,60	2.923.373,86	3.396.843,50	49.385.005,02	-322.899,94	-390.582,57	-0,64%	-0,77%	1,26%	1,95%	-39,67%	2
Março	49.385.005,02	2.462.542,61	3.543.201,50	48.558.145,02	253.798,89	-136.783,68	0,51%	-0,26%	1,44%	3,41%	-7,73%	2
Abril	48.558.145,02	3.610.764,05	3.274.894,15	49.363.602,01	469.587,09	332.803,41	0,96%	0,69%	0,75%	4,19%	16,57%	2
Mai	49.363.602,01	3.387.660,62	2.799.779,76	50.142.400,97	190.918,10	523.721,51	0,38%	1,08%	1,29%	5,53%	19,50%	2
Junho	50.142.400,97	9.979.176,60	10.178.203,74	50.094.425,62	151.051,79	674.773,30	0,30%	1,38%	0,99%	6,58%	21,03%	1
Julho	50.094.425,62	3.045.596,41	9.205.234,32	43.814.404,22	-120.383,49	554.389,81	-0,24%	1,14%	1,44%	8,12%	14,04%	3

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDIMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: https://pccs.tce-pe.gov.br/sgp/validador/validador.jspx?Codigo do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e

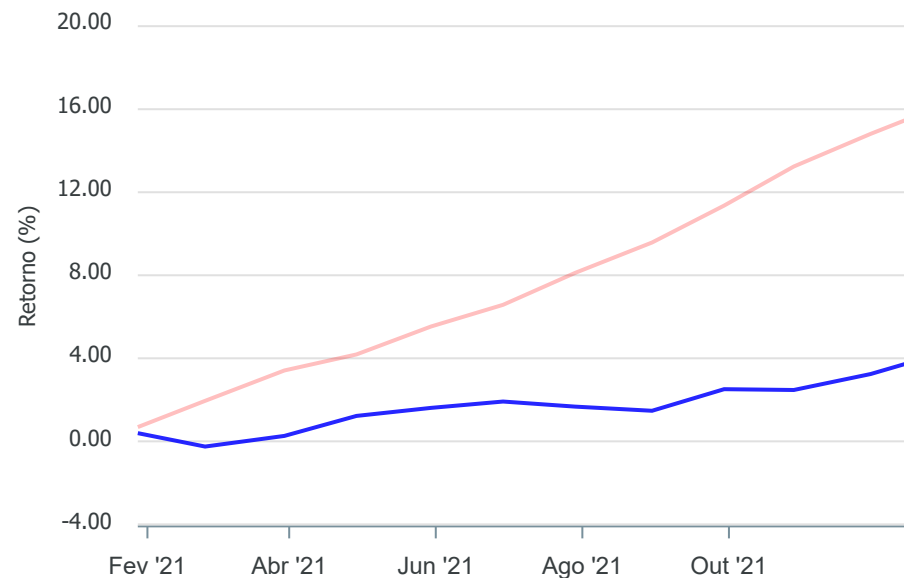


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 - In
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	263.510,31	0,00	0,00	264.569,23	1.058,92	0,40%	0,40%	0,63
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.736.517,70	0,00	0,00	1.741.214,72	4.697,02	0,27%	0,27%	0,42
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	51.354,48	0,00	0,00	51.481,02	126,54	0,25%	0,25%	0,01
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.535.994,84	0,00	2.487.978,91	2.057.737,96	9.722,03	0,21%	0,17%	0,23
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.812.644,69	0,00	0,00	1.814.157,52	1.512,83	0,08%	0,08%	0,88
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	4.784.217,77	3.045.596,41	6.717.255,41	1.118.179,28	5.620,51	0,07%	0,16%	0,01
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.152.336,42	0,00	0,00	8.143.273,28	-9.063,14	-0,11%	-0,11%	1,10
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	289.175,32	0,00	0,00	288.805,91	-369,41	-0,13%	-0,13%	0,25
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.919.934,79	0,00	0,00	6.906.082,56	-13.852,23	-0,20%	-0,20%	1,03
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	240.013,45	0,00	0,00	239.153,84	-859,61	-0,36%	-0,36%	0,47
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.801.299,39	0,00	0,00	4.764.059,52	-37.239,87	-0,78%	-0,78%	1,68
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.411.805,24	0,00	0,00	2.371.268,02	-40.537,22	-1,68%	-1,68%	6,28
Total Renda Fixa	35.998.804,40	3.045.596,41	9.205.234,32	29.759.982,86	-79.183,63	-0,22%		1,42

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinatura em: https://sccs.trfpe.gov.br/gp/validador/assinatura/validador.asp?codigo_documento=36431489-f298-4363-a003-147897d2645e



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
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.291.114,29	0,00	0,00	2.351.331,11	60.216,82	2,63%	2,63%	5,66%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	760.482,26	0,00	0,00	759.643,37	-838,89	-0,11%	-	-
HAZ FII - ATCR11	1.162.655,87	0,00	0,00	1.159.230,09	-3.425,78	-0,29%	-0,29%	-
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.504.295,87	0,00	0,00	1.498.120,16	-6.175,71	-0,41%	-0,41%	1,04%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	77.809,39	0,00	0,00	77.431,34	-378,05	-0,49%	-0,31%	0,02%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.589.033,69	0,00	0,00	1.544.834,26	-44.199,43	-2,78%	-2,78%	8,28%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.402.103,83	0,00	0,00	1.339.699,89	-62.403,94	-4,45%	-4,45%	8,76%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.639.891,14	0,00	0,00	2.511.267,93	-128.623,21	-4,87%	-4,87%	8,64%
Total Renda Variável	11.427.386,34	0,00	0,00	11.241.558,15	-185.828,19	-1,63%		6,55%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinse em: https://sccs.ce.gov.br/validador/validador.do?codigo_documento=3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.668.234,88	0,00	0,00	2.812.863,21	144.628,33	5,42%	5,42%	7,99%
Total Exterior	2.668.234,88	0,00	0,00	2.812.863,21	144.628,33	5,42%		7,99%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinse em: https://sede.tce.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 3e431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 nos 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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qualificaDoc.seam> Código do Documento: 343.019-F204-2063-003-147897-545e



Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <http://etcg.cpf-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/ppp/validadoc.aspx?Codigo-do-documento:3c431dd9f2044363a003147897d2645e>

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	8.110.266,19	16,46%	585	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.503.685,63	5,08%	1.007	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	258.398,98	0,52%	140	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.436.845,94	4,95%	241	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.695.000,49	9,53%	976	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.359.809,84	2,76%	1.278	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	51.634,54	0,10%	802	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	12.476.620,61	25,32%	195	0,92%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	1.132.190,08	2,30%	1.459	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	239.036,13	0,49%	26	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	276.039,60	0,56%	31	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.737.016,84	3,53%	70	2,44%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.513.024,83	3,07%	27.324	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.301.238,46	2,64%	58.072	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.500.246,25	3,04%	31	0,53%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.429.838,02	4,93%	18.650	0,08%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	758.864,66	1,54%	17	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIELABRÁTÉGIA	Não se ...	Não se aplica	77.196,05	0,16%	33	0,39%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.160.079,93	2,35%		1,60%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.881.367,63	5,85%	478	0,09%	Artigo 9º, Inciso III



Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2021)

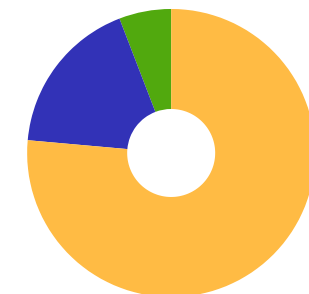
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.378.468,20	4,83%	5	11,70%	Desenquadrado - RF
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		521.897,69	1,06%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			49.276.868,90				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			521.897,69				Artigo 6º
PL Total			49.798.766,59				

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	100,00%	49.276.868,90
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	19.364.007,07	39,30%	11,00%	50,00%	60,00%	10.202.114,27
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	49.276.868,90
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.463.843,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.927.686,89
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	29.566.121,34
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	14.175.520,96	28,77%	4,00%	15,00%	30,00%	607.539,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	19.710.747,56
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	9.855.373,78
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.391.530,34
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.391.530,34
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.737.016,84	3,53%	0,00%	5,00%	5,00%	726.826,61
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.463.843,45
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.463.843,45
Desenquadrado - RF	0,00%	2.378.468,20	4,83%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.378.468,20
Total Renda Fixa	100,00%	37.655.013,07	76,42%	15,00%	75,00%	470,00%	



■ RENDA FIXA 37.655.013,07
■ RENDA VARIÁVEL 8.740.488,20
■ EXTERIOR 2.881.367,63

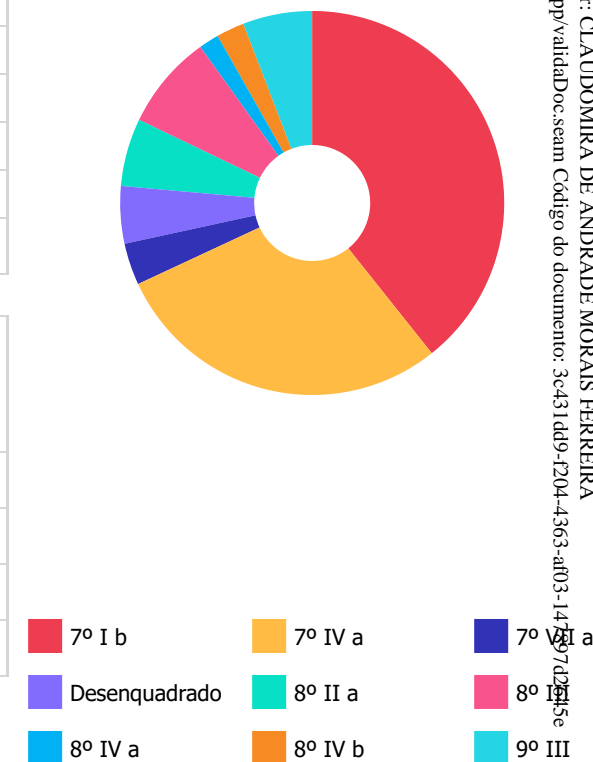
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	5,00%	2.463.843,45
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	14.783.060,67
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	2.814.263,29	5,71%	6,00%	16,00%	20,00%	7.041.110,49
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	9.855.373,78
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	3.930.084,27	7,98%	3,50%	3,69%	10,00%	997.602,62
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	836.060,71	1,70%	0,00%	2,00%	4,00%	1.135.014,05
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.160.079,93	2,35%	0,00%	3,00%	5,00%	1.303.763,52
Total Renda Variável	30,00%	8.740.488,20	17,74%	9,50%	24,69%	94,00%	

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%	4.927.686,89
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.463.843,45
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.881.367,63	5,85%	0,00%	0,31%	5,00%	-417.524,19
Total Exterior	10,00%	2.881.367,63	5,85%	0,00%	0,31%	20,00%	



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-142972215e



Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	17.545.902,88	35,61	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.738.248,63	27,88	0,00
CAIXA DTVM	11.366.015,98	23,07	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.897.096,77	5,88	0,92
MULTINVEST CAPITAL	2.378.468,20	4,83	0,26
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	758.864,66	1,54	0,08
PLURAL	353.235,65	0,72	0,00
RJI CORRETORA DE VALORES	239.036,13	0,49	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 %		

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://ste.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,34%	-0,78%	-0,12%	0,49%	1,31%	7,55%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,45%	-1,37%	-0,59%	0,09%	0,99%	7,11%	1,38%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,47%	10,52%	4,18%	8,19%	17,33%	28,60%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,24%	-2,07%	0,15%	0,60%	-3,26%	-8,33%	0,54%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,37%	1,37%	0,77%	1,29%	2,24%	7,41%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,34%	1,21%	0,70%	1,17%	2,00%	6,95%	0,15%	0,00%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,35%	1,17%	0,75%	1,15%	1,87%	6,72%	0,15%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,15%	1,47%	0,05%	1,97%	4,77%	14,45%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,05%	-1,15%	-0,85%	-0,54%	-22,83%	-36,83%	0,44%	0,22%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-4,42%	-27,04%	-4,69%	-20,21%	-66,85%	-77,59%	5,12%	0,54%
IRF-M (Benchmark)	-0,60%	-2,63%	-0,86%	-0,67%	-1,25%	7,35%	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,30%	0,09%	-1,30%	-0,31%	1,99%	-0,18%	0,49%	0,02%



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
CDI (Benchmark)	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%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,22%	0,87%	0,55%	0,83%	0,93%	2,27%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,87%	5,67%	2,38%	4,51%	9,68%	12,35%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	2,29%	0,86%	2,60%	5,47%	13,77%	0,74%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-1,45%	-1,51%	-2,22%	-1,04%	-0,01%	9,20%	1,87%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,50%	-1,50%	-0,37%	0,04%	0,46%	6,52%	1,57%	0,03%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,75%	12,90%	5,05%	9,99%	21,15%	37,13%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,30%	145,81%	-3,89%	147,77%	136,75%	-92,64%	0,00%	0,03%
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,63%	11,88%	4,68%	9,22%	19,51%	33,44%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,10%	-0,87%	-0,31%	-0,62%	-1,49%	30,58%	-	0,00%
Global BDRX (Benchmark)	2,28%	19,22%	8,02%	8,11%	18,86%	99,63%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,44%	17,02%	6,70%	6,83%	16,19%	96,21%	6,20%	0,11%
Ibovespa (Benchmark)	-2,48%	-0,20%	-5,89%	7,95%	19,54%	17,45%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,06%	0,75%	-5,54%	11,42%	22,72%	32,58%	7,26%	0,24%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-2,87%	4,86%	-7,43%	9,79%	19,41%	20,87%	8,64%	0,20%
CDI (Benchmark)	0,43%	2,07%	1,10%	1,78%	2,72%	6,68%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,14%	0,01%	-0,54%	0,75%	1,57%	10,13%	0,61%	0,02%
MSCI ACWI (Benchmark)	2,79%	13,52%	2,42%	4,91%	19,14%	80,33%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,34%	23,18%	8,93%	20,01%	30,11%	52,19%	3,86%	0,14%
IFIX (Benchmark)	-2,63%	-4,19%	-2,37%	-4,74%	-1,16%	3,51%	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a0f3-147897d2645e



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
HAZ FII - ATCR11	0,07%	0,84%	1,18%	0,84%	0,81%	389,45%	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



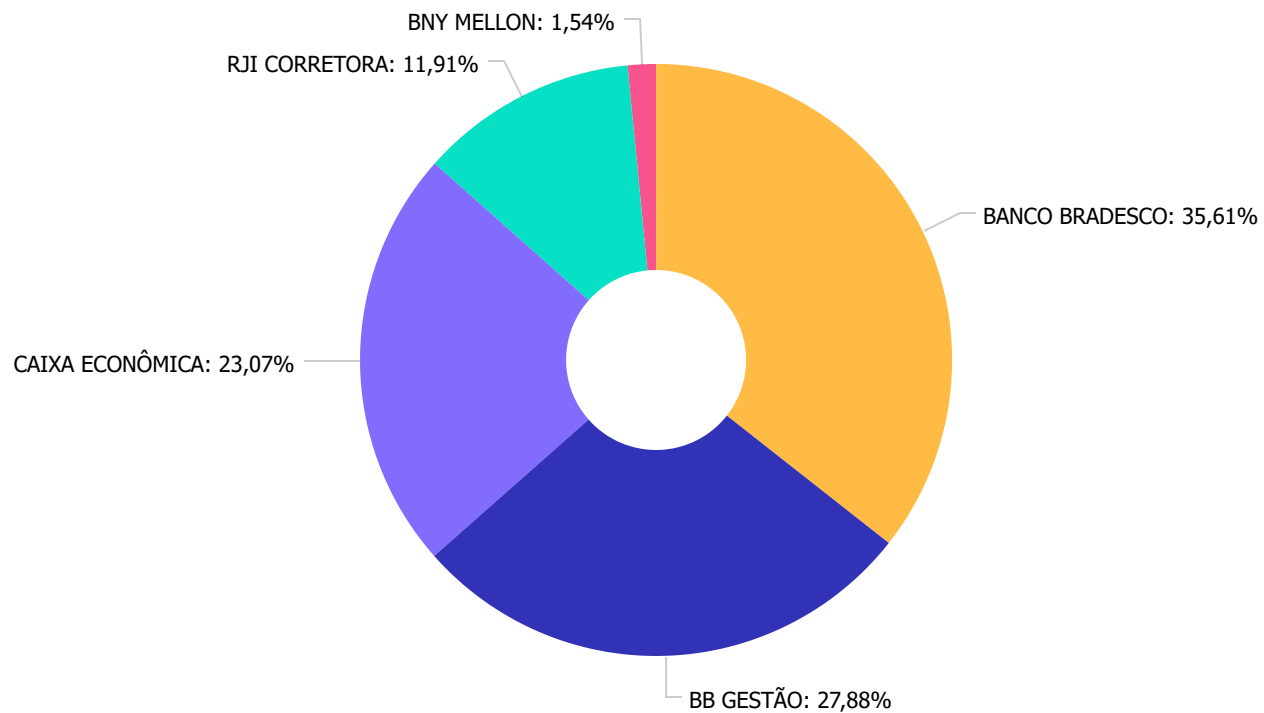
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,28%	19,22%	8,02%	8,11%	18,86%	99,63%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,44%	17,02%	6,70%	6,83%	16,19%	96,21%	6,20%	0,11%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

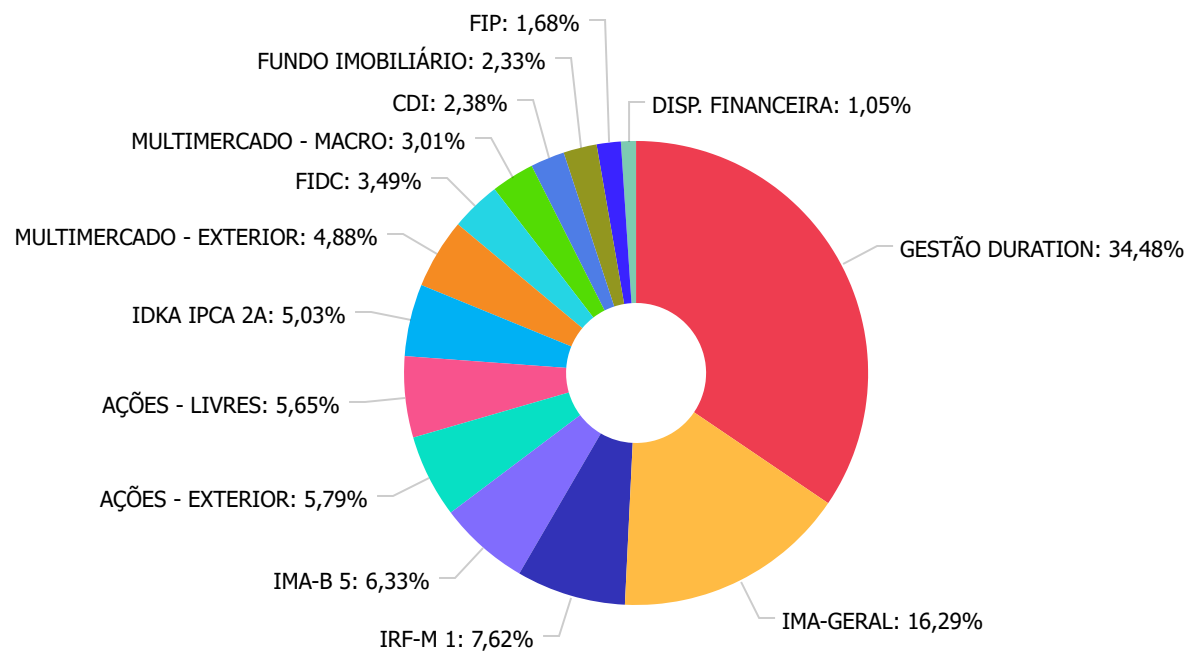


BANCO BRADESCO	17.545.902,88
BB GESTÃO	13.738.240,90
CAIXA ECONÔMICA	11.366.010,99
RJI CORRETORA	5.867.830,10
BNY MELLON	758.864,66

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam>
 Edição do documento: 3c951dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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



GESTÃO DURATION	17.171.621,11
IMA-GERAL	8.110.261,11
IRF-M 1	3.796.651,77
IMA-B 5	3.151.949,99
AÇÕES - EXTERIOR	2.881.366,66
AÇÕES - LIVRES	2.814.266,22
IDKA IPCA 2A	2.503.681,69
MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.429.830,00
FIDC	1.737.011,88
MULTIMERCADO - MACRO	1.500.241,22
CDI	1.183.821,91
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.160.071,93
FIP	836.061,71
DISP. FINANCEIRA	521.891,69

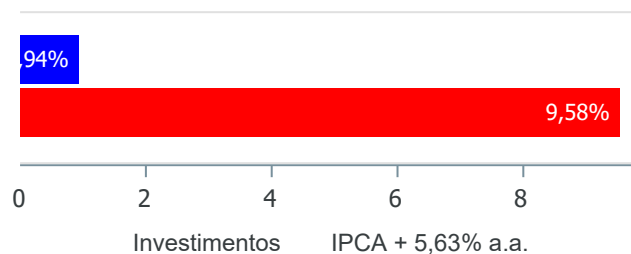
Documento Assinado Digitalmente por: CAUDOMIRA DE ANDRADE NORAS FERREIRA
 Acesso em: https://etc.ce.gov.br/pepp/validador/consultarDocumento.do?documento=0431919-f21-43b-40b-0000-000000000000



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	51.548.643,67	1.745.203,08	3.044.789,52	50.181.374,60	-67.682,63	-67.682,63	-0,13%	-0,13%	0,69%	0,69%	-19,12%	2
Fevereiro	50.181.374,60	2.923.373,86	3.396.843,50	49.385.005,02	-322.899,94	-390.582,57	-0,64%	-0,77%	1,26%	1,95%	-39,67%	2
Março	49.385.005,02	2.462.542,61	3.543.201,50	48.558.145,02	253.798,89	-136.783,68	0,51%	-0,26%	1,44%	3,41%	-7,73%	2
Abril	48.558.145,02	3.610.764,05	3.274.894,15	49.363.602,01	469.587,09	332.803,41	0,96%	0,69%	0,75%	4,19%	16,57%	2
Mai	49.363.602,01	3.387.660,62	2.799.779,76	50.142.400,97	190.918,10	523.721,51	0,38%	1,08%	1,29%	5,53%	19,50%	2
Junho	50.142.400,97	9.979.176,60	10.178.203,74	50.094.425,62	151.051,79	674.773,30	0,30%	1,38%	0,99%	6,58%	21,03%	1
Julho	50.094.425,62	3.045.596,41	9.205.234,32	43.814.404,22	-120.383,49	554.389,81	-0,24%	1,14%	1,44%	8,12%	14,04%	3
Agosto	43.814.404,22	19.648.316,10	14.088.871,51	49.276.868,90	-96.979,91	457.409,90	-0,20%	0,94%	1,35%	9,58%	9,82%	2

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://pse.gov.br/imp/vizualizacao/validacao.aspx>
 Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e

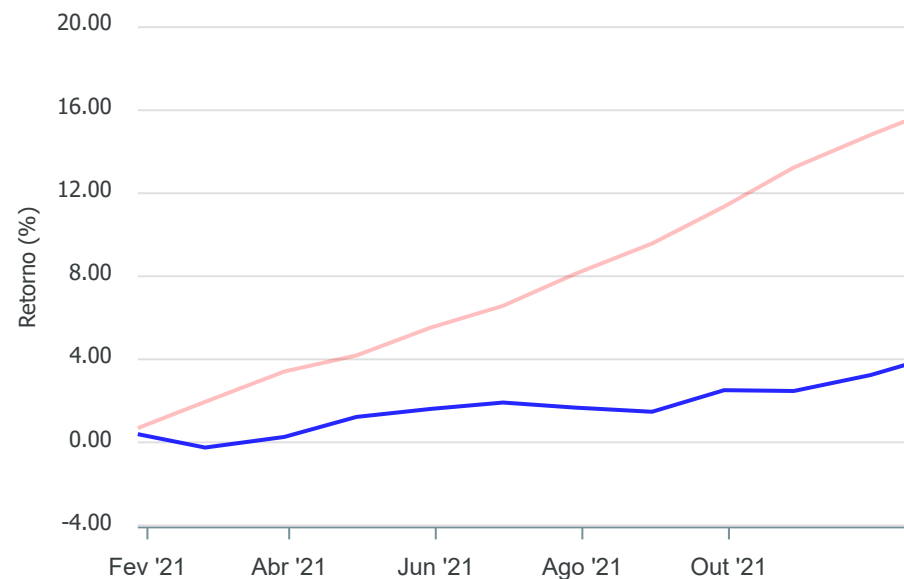


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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 (%)	(%) Instit	Var - In
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.814.157,52	681.701,52	0,00	2.503.685,63	7.826,59	0,31%	0,18%	1,09%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.371.268,02	0,00	0,00	2.378.468,20	7.200,18	0,30%	0,30%	0,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	264.569,23	0,00	6.963,79	258.398,98	793,54	0,30%	0,31%	0,74%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	51.481,02	0,00	0,00	51.634,54	153,52	0,30%	0,30%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.057.737,96	0,00	703.895,19	1.359.809,84	5.967,07	0,29%	0,34%	0,15%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	2.433.400,49	0,00	2.436.845,94	3.445,45	0,14%	0,35%	0,15%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.118.179,28	2.828.782,96	2.818.747,29	1.132.190,08	3.975,13	0,10%	0,22%	0,01%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	239.153,84	0,00	0,00	239.036,13	-117,71	-0,05%	-0,05%	0,44%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.906.082,56	5.578.566,38	0,00	12.476.620,61	-8.028,33	-0,06%	-0,50%	1,57%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	8.125.864,75	0,00	8.110.266,19	-15.598,56	-0,19%	-0,45%	1,38%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.143.273,28	0,00	8.125.864,75	0,00	-17.408,53	-0,21%	-0,45%	1,34%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.741.214,72	0,00	0,00	1.737.016,84	-4.197,88	-0,24%	-0,24%	0,54%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.764.059,52	0,00	0,00	4.695.000,49	-69.059,03	-1,45%	-1,45%	1,87%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	288.805,91	0,00	0,00	276.039,60	-12.766,31	-4,42%	-4,42%	5,12%
Total Renda Fixa	29.759.982,86	19.648.316,10	11.655.471,02	37.655.013,07	-97.814,87	-0,26%		1,24%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinatura em: https://sica.trfpe.gov.br/validador/assinatura.do?documento=26431489-f294-4368-4039-3947897d2645e



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
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.351.331,11	0,00	0,00	2.429.838,02	78.506,91	3,34%	3,34%	3,86%
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.498.120,16	0,00	0,00	1.500.246,25	2.126,09	0,14%	0,14%	0,61%
HAZ FII - ATCR11	1.159.230,09	0,00	0,00	1.160.079,93	849,84	0,07%	0,07%	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	759.643,37	0,00	0,00	758.864,66	-778,71	-0,10%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	77.431,34	0,00	0,00	77.196,05	-235,29	-0,30%	-0,30%	0,00%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.544.834,26	0,00	0,00	1.513.024,83	-31.809,43	-2,06%	-2,06%	7,26%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.339.699,89	0,00	0,00	1.301.238,46	-38.461,43	-2,87%	-2,87%	8,64%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.511.267,93	0,00	2.433.400,49	0,00	-77.867,44	-3,10%	-2,27%	8,05%
Total Renda Variável	11.241.558,15	0,00	2.433.400,49	8.740.488,20	-67.669,46	-0,60%		4,77%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinse em: https://seccom.br.gov.br/epi/validador/validador.aspx?Codigo=documento:3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.812.863,21	0,00	0,00	2.881.367,63	68.504,42	2,44%	2,44%	6,20%
Total Exterior	2.812.863,21	0,00	0,00	2.881.367,63	68.504,42	2,44%		6,20%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinse em: https://sede.tcepe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 3e431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 nos 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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE RIBEIRO DE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/quali/Doc.seam?CodigoDoc=343019-f204-5063-4003-147897-d545e>



Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <http://etcg.ce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: https://etce.tce.pe.gov.br/ppv/validadoc/seam/Código.do_documento:3c431dd9f2044363a003147897d2645e
Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	8.109.835,37	17,57%	578	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.529.559,88	5,48%	1.014	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	261.492,81	0,57%	140	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.446.382,30	5,30%	240	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.711.665,57	10,21%	964	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.392.915,69	3,02%	1.264	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	51.814,23	0,11%	800	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	9.556.211,87	20,70%	193	0,75%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	1.156.663,27	2,51%	1.444	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	239.755,89	0,52%	26	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	275.687,92	0,60%	31	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.745.413,90	3,78%	70	2,44%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.452.775,91	3,15%	27.215	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.200.867,77	2,60%	56.614	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.499.795,92	3,25%	30	0,55%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.317.134,71	5,02%	19.023	0,07%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	758.118,35	1,64%	17	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIELSTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	76.960,75	0,17%	33	0,39%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.161.740,27	2,52%		1,60%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.874.161,45	6,23%	494	0,09%	Artigo 9º, Inciso III



Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

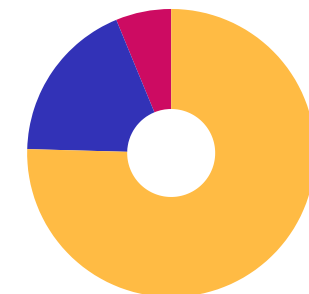
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.338.904,04	5,07%	5	11,70%	Desenquadrado - RF
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		3.424.986,95	7,42%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			46.157.857,87				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.424.986,95				Artigo 6º
PL Total			49.582.844,82				

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	100,00%	46.157.857,87
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	19.451.851,62	42,14%	11,00%	50,00%	60,00%	8.242.863,10
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	46.157.857,87
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.307.892,89
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.615.785,79
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	27.694.714,72
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	11.280.133,18	24,44%	4,00%	15,00%	30,00%	2.567.224,18
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	18.463.143,15
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	9.231.571,57
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	6.923.678,68
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	6.923.678,68
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.745.413,90	3,78%	0,00%	5,00%	5,00%	562.478,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.307.892,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.307.892,89
Desenquadrado - RF	0,00%	2.338.904,04	5,07%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.338.904,04
Total Renda Fixa	100,00%	34.816.302,74	75,43%	15,00%	75,00%	470,00%	



■ RENDA FIXA 34.816.302,74
■ RENDA VARIÁVEL 8.467.393,68
■ EXTERIOR 2.874.161,45

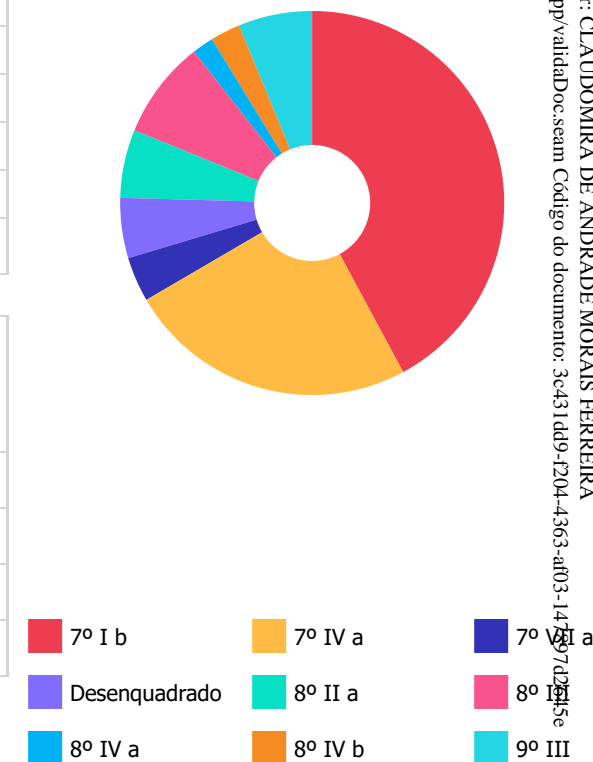
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	5,00%	2.307.892,89
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	13.847.357,36
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	2.653.643,68	5,75%	6,00%	16,00%	20,00%	6.577.927,89
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	9.231.571,57
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	3.816.930,63	8,27%	3,50%	3,69%	10,00%	798.855,16
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	835.079,10	1,81%	0,00%	2,00%	4,00%	1.011.235,21
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.161.740,27	2,52%	0,00%	3,00%	5,00%	1.146.152,62
Total Renda Variável	30,00%	8.467.393,68	18,34%	9,50%	24,69%	94,00%	

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%	4.615.785,79
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.307.892,89
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.874.161,45	6,23%	0,00%	0,31%	5,00%	-566.268,56
Total Exterior	10,00%	2.874.161,45	6,23%	0,00%	0,31%	20,00%	



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-142972215e



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	14.659.053,36	31,76	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.606.345,97	29,48	0,00
CAIXA DTVM	11.295.877,42	24,47	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.907.154,17	6,30	1,63
MULTINVEST CAPITAL	2.338.904,04	5,07	0,24
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	758.118,35	1,64	0,08
PLURAL	352.648,67	0,76	0,01
RJI CORRETORA DE VALORES	239.755,89	0,52	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 %		

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://ste.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,02%	-0,76%	-0,42%	0,89%	2,05%	6,02%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	-1,38%	-0,70%	0,51%	1,75%	5,52%	0,80%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,73%	12,43%	4,83%	8,38%	17,93%	30,14%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,48%	-1,60%	0,51%	1,01%	-0,54%	-7,02%	0,62%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,40%	1,78%	0,96%	1,65%	2,49%	7,15%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,38%	1,59%	0,89%	1,54%	2,25%	6,68%	0,29%	0,00%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,39%	1,56%	0,94%	1,55%	2,24%	6,47%	0,29%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,00%	2,48%	1,18%	2,64%	5,95%	13,62%	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,13%	-27,13%	-4,66%	-20,78%	-66,79%	-77,82%	0,25%	0,54%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,30%	-0,86%	-0,11%	-0,21%	-22,60%	-37,21%	0,34%	0,22%
IRF-M (Benchmark)	-0,33%	-2,95%	-1,39%	-0,15%	-1,02%	5,48%	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-1,66%	-1,57%	-3,02%	-2,27%	0,19%	-3,26%	2,99%	0,03%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a0f3-147897d2645e



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
CDI (Benchmark)	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%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,27%	1,14%	0,65%	1,05%	1,21%	2,29%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	1,16%	6,90%	3,02%	4,75%	10,25%	13,70%	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,15%	-1,65%	-0,86%	0,43%	1,30%	4,80%	1,07%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,20%	3,51%	1,92%	3,52%	6,84%	13,46%	0,57%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,36%	-1,16%	-1,87%	-0,98%	0,86%	7,32%	0,48%	0,03%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	2,01%	15,17%	5,71%	10,15%	21,77%	38,78%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,31%	145,06%	-0,92%	148,12%	137,05%	-	0,00%	0,03%
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,89%	14,00%	5,34%	9,40%	20,13%	35,04%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,10%	-0,97%	-0,31%	-0,61%	-1,43%	-	-	0,00%
Global BDRX (Benchmark)	-0,17%	19,02%	8,14%	4,70%	21,04%	94,03%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,25%	16,72%	7,72%	3,03%	18,26%	90,64%	6,75%	0,10%
Ibovespa (Benchmark)	-6,57%	-6,75%	-12,48%	-4,85%	17,31%	5,95%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-7,71%	-3,23%	-14,35%	-5,38%	16,49%	8,55%	12,73%	0,21%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,98%	-3,26%	-8,58%	-1,61%	23,96%	25,09%	11,83%	0,24%
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-0,03%	-0,02%	-0,30%	0,46%	1,92%	8,14%	0,85%	0,02%
MSCI ACWI (Benchmark)	1,23%	14,91%	7,16%	0,61%	21,06%	78,00%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,64%	17,47%	1,14%	9,99%	30,72%	42,05%	6,15%	0,13%
IFIX (Benchmark)	-1,24%	-5,38%	-1,42%	-4,61%	-2,83%	1,17%	-	-

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validarDoc> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a0f3-147897d2645e



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
HAZ FII - ATCR11	0,14%	0,98%	-0,08%	1,21%	0,82%	390,15%	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



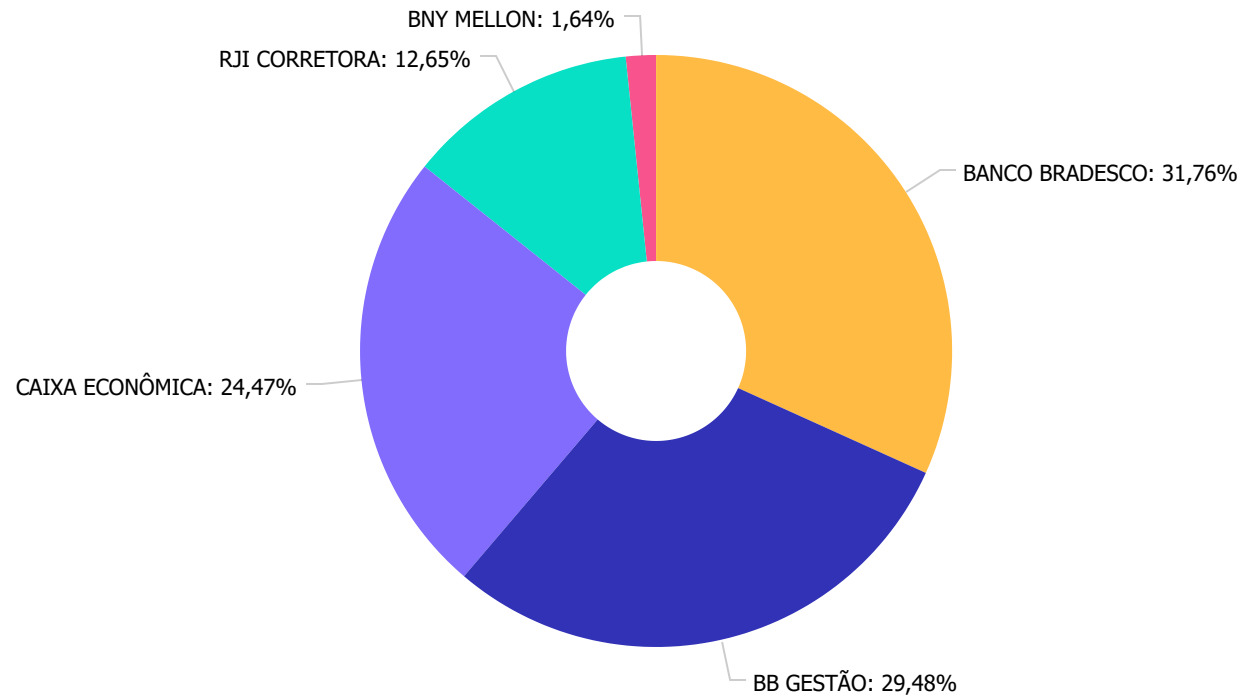
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-0,17%	19,02%	8,14%	4,70%	21,04%	94,03%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,25%	16,72%	7,72%	3,03%	18,26%	90,64%	6,75%	0,10%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

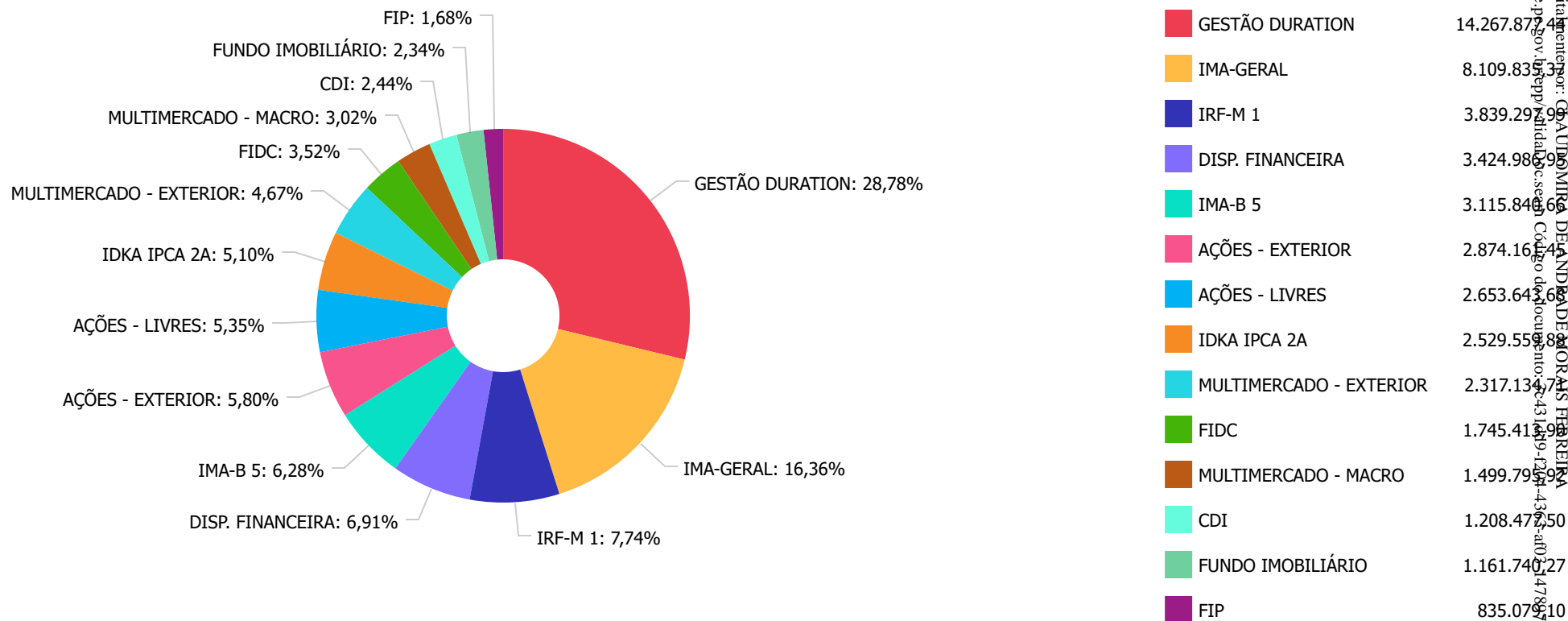


BANCO BRADESCO	14.659.050,33
BB GESTÃO	13.606.340,41
CAIXA ECONÔMICA	11.295.872,49
RJI CORRETORA	5.838.460,33
BNY MELLON	758.119,33

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam?odid=141410&numero=3681dd9-f204-4363-a003-147897d2645e>



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



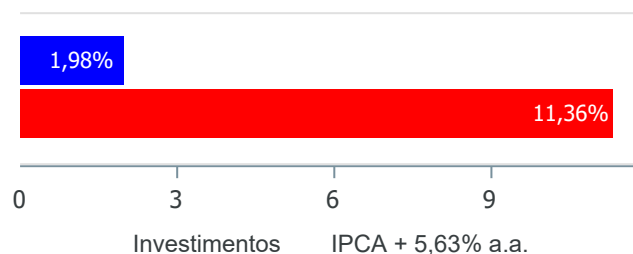
Documento Assinado Digitalmente por: GABRIEL DOMINGOS DE ANDRADE JUNIOR AS FERREIRA
 Acesso em: https://etc.ce.gov.br/pepp/validarDocumento.aspx?CodigoDocumento=431419-F24-432-400-014789702645e



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	51.548.643,67	1.745.203,08	3.044.789,52	50.181.374,60	-67.682,63	-67.682,63	-0,13%	-0,13%	0,69%	0,69%	-19,12%	2
Fevereiro	50.181.374,60	2.923.373,86	3.396.843,50	49.385.005,02	-322.899,94	-390.582,57	-0,64%	-0,77%	1,26%	1,95%	-39,67%	2
Março	49.385.005,02	2.462.542,61	3.543.201,50	48.558.145,02	253.798,89	-136.783,68	0,51%	-0,26%	1,44%	3,41%	-7,73%	2
Abril	48.558.145,02	3.610.764,05	3.274.894,15	49.363.602,01	469.587,09	332.803,41	0,96%	0,69%	0,75%	4,19%	16,57%	2
Mai	49.363.602,01	3.387.660,62	2.799.779,76	50.142.400,97	190.918,10	523.721,51	0,38%	1,08%	1,29%	5,53%	19,50%	2
Junho	50.142.400,97	9.979.176,60	10.178.203,74	50.094.425,62	151.051,79	674.773,30	0,30%	1,38%	0,99%	6,58%	21,03%	1
Julho	50.094.425,62	3.045.596,41	9.205.234,32	43.814.404,22	-120.383,49	554.389,81	-0,24%	1,14%	1,44%	8,12%	14,04%	3
Agosto	43.814.404,22	19.648.316,10	14.088.871,51	49.276.868,90	-96.979,91	457.409,90	-0,20%	0,94%	1,35%	9,58%	9,82%	2
Setembro	49.276.868,90	2.133.733,87	5.757.646,97	46.157.857,87	504.902,07	962.311,97	1,02%	1,98%	1,62%	11,36%	17,39%	2

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://cscs.ufpe.br/sv/bpp/validarDoc.aspx?CodigoDoc=3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e>

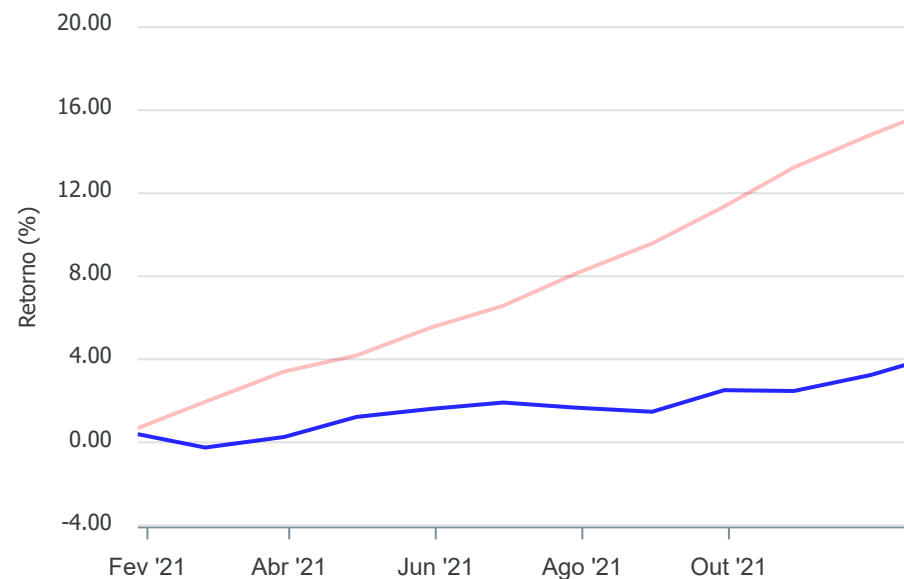


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.476.620,61	0,00	3.670.998,78	9.556.211,87	750.590,04	6,02%	-0,15%	1,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	258.398,98	0,00	0,00	261.492,81	3.093,83	1,20%	1,20%	0,57%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.503.685,63	0,00	0,00	2.529.559,88	25.874,25	1,03%	1,03%	0,73%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.737.016,84	0,00	0,00	1.745.413,90	8.397,06	0,48%	0,48%	0,62%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.436.845,94	0,00	0,00	2.446.382,30	9.536,36	0,39%	0,39%	0,29%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.359.809,84	27.923,37	0,00	1.392.915,69	5.182,48	0,37%	0,38%	0,29%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.695.000,49	0,00	0,00	4.711.665,57	16.665,08	0,35%	0,35%	0,48%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	51.634,54	0,00	0,00	51.814,23	179,69	0,35%	0,35%	0,01%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	239.036,13	0,00	0,00	239.755,89	719,76	0,30%	0,30%	0,34%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.132.190,08	2.105.810,50	2.086.648,19	1.156.663,27	5.310,88	0,16%	0,27%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.110.266,19	0,00	0,00	8.109.835,37	-430,82	-0,01%	-0,01%	0,80%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	276.039,60	0,00	0,00	275.687,92	-351,68	-0,13%	-0,13%	0,25%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.378.468,20	0,00	0,00	2.338.904,04	-39.564,16	-1,66%	-1,66%	2,99%
Total Renda Fixa	37.655.013,07	2.133.733,87	5.757.646,97	34.816.302,74	785.202,77	2,09%		0,87%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinatura em: https://seccat.cepe.gov.br/vizualizacao/assinatura/3e431409-f204-4368-8e403-147897d2645e



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
HAZ FII - ATCR11	1.160.079,93	0,00	0,00	1.161.740,27	1.660,34	0,14%	0,14%	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.500.246,25	0,00	0,00	1.499.795,92	-450,33	-0,03%	-0,03%	0,85
BRASIL FLORESTAL FICFIP	758.864,66	0,00	0,00	758.118,35	-746,31	-0,10%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	77.196,05	0,00	0,00	76.960,75	-235,30	-0,30%	-0,30%	0,00
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.513.024,83	0,00	0,00	1.452.775,91	-60.248,92	-3,98%	-3,98%	11,83
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.429.838,02	0,00	0,00	2.317.134,71	-112.703,31	-4,64%	-4,64%	6,15
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.301.238,46	0,00	0,00	1.200.867,77	-100.370,69	-7,71%	-7,71%	12,73
Total Renda Variável	8.740.488,20	0,00	0,00	8.467.393,68	-273.094,52	-3,12%		7,33

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinse em: https://etce.tcepe.gov.br/gpp/validaDocumentoCodigo do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.881.367,63	0,00	0,00	2.874.161,45	-7.206,18	-0,25%	-0,25%	6,75%
Total Exterior	2.881.367,63	0,00	0,00	2.874.161,45	-7.206,18	-0,25%		6,75%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinse em: https://sede.tce.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 3e431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 (%)	(%) Int...
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.919.934,79	5.578.566,38	3.670.998,78	9.556.211,87	728.709,48	5,83%	-0,86%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.812.644,69	681.701,52	0,00	2.529.559,88	35.213,67	1,41%	1,30%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.535.994,84	27.923,37	3.191.874,10	1.392.915,69	20.871,58	0,46%	0,89%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	4.784.217,77	7.980.189,87	11.622.650,89	1.156.663,27	14.906,52	0,12%	0,65%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	2.433.400,49	0,00	2.446.382,30	12.981,81	0,53%	0,94%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.736.517,70	0,00	0,00	1.745.413,90	8.896,20	0,51%	0,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	263.510,31	0,00	6.963,79	261.492,81	4.946,29	1,88%	1,92%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	51.354,48	0,00	0,00	51.814,23	459,75	0,90%	0,90%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	240.013,45	0,00	0,00	239.755,89	-257,56	-0,11%	-0,11%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	289.175,32	0,00	0,00	275.687,92	-13.487,40	-4,66%	-4,66%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	8.125.864,75	0,00	8.109.835,37	-16.029,38	-0,20%	-0,70%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.152.336,42	0,00	8.125.864,75	0,00	-26.471,67	-0,32%	-0,46%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.411.805,24	0,00	0,00	2.338.904,04	-72.901,20	-3,02%	-3,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.801.299,39	0,00	0,00	4.711.665,57	-89.633,82	-1,87%	-1,87%
Total Renda Fixa					608.204,27	1,00%	

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinatura em: https://sica.tcepe.gov.br/validarDocumentoCodigo do documento: 3643149-f294-4368-a03-147897d2645e



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 (%)	(%) Inicial
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.668.234,88	0,00	0,00	2.874.161,45	205.926,57	7,72%	7,72%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.291.114,29	0,00	0,00	2.317.134,71	26.020,42	1,14%	1,14%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	77.809,39	0,00	0,00	76.960,75	-848,64	-1,09%	-0,92%
HAZ FII - ATCR11	1.162.655,87	0,00	0,00	1.161.740,27	-915,60	-0,08%	-0,08%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	760.482,26	0,00	0,00	758.118,35	-2.363,91	-0,31%	-0,31%
BRADERCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.504.295,87	0,00	0,00	1.499.795,92	-4.499,95	-0,30%	-0,30%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.589.033,69	0,00	0,00	1.452.775,91	-136.257,78	-8,57%	-8,57%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.402.103,83	0,00	0,00	1.200.867,77	-201.236,06	-14,35%	-14,35%
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	2.639.891,14	0,00	2.433.400,49	0,00	-206.490,65	-7,82%	-14,73%
Total Renda Variável					-320.665,60	-2,27%	

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinado em: 30/09/2021
 URL para verificar a validade das assinaturas: https://br.scribd.com/document/3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 nos 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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE RIBEIRO DE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qualificaDoc.seam> Código do Documento: 343019-F204-2063-003-147897-545e



Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <http://etcg.cpf-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/ppp/validadoc.aspx?Codigo-do-documento=3c431dd9f2044363a003147897d2645e>
Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	7.977.942,49	16,33%	569	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.700.640,04	5,53%	1.026	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	259.411,44	0,53%	140	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.216.308,67	10,68%	238	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.555.947,50	7,28%	959	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.385.454,30	2,84%	1.252	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	52.020,67	0,11%	810	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	10.251.567,36	20,98%	195	0,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	1.252.146,00	2,56%	1.436	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	236.426,84	0,48%	26	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	275.412,30	0,56%	31	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.748.176,77	3,58%	70	2,44%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.379.811,43	2,82%	27.718	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.098.824,82	2,25%	55.292	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.482.379,51	3,03%	29	0,58%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.494.221,30	5,10%	19.129	0,07%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	757.307,00	1,55%	17	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	76.725,46	0,16%	33	0,39%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.157.289,50	2,37%		1,60%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.188.274,04	6,52%	509	0,09%	Artigo 9º, Inciso III



Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2021)

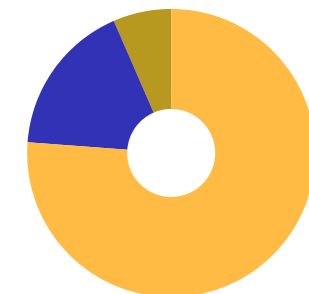
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.317.278,88	4,74%	4	16,47%	Desenquadrado - RF
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		716.400,85	1,47%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			48.863.566,32				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			716.400,85				Artigo 6º
PL Total			49.579.967,17				

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	100,00%	48.863.566,32
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	21.095.704,44	43,17%	11,00%	50,00%	60,00%	8.222.435,35
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	48.863.566,32
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.443.178,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.886.356,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	29.318.139,79
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	12.067.573,17	24,70%	4,00%	15,00%	30,00%	2.591.496,73
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	19.545.426,53
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	9.772.713,26
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.329.534,95
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.329.534,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.748.176,77	3,58%	0,00%	5,00%	5,00%	695.001,55
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.443.178,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.443.178,32
Desenquadrado - RF	0,00%	2.317.278,88	4,74%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.317.278,88
Total Renda Fixa	100,00%	37.228.733,26	76,19%	15,00%	75,00%	470,00%	



■ RENDA FIXA 37.228.733,26
■ RENDA VARIÁVEL 8.446.559,02
■ EXTERIOR 3.188.274,04

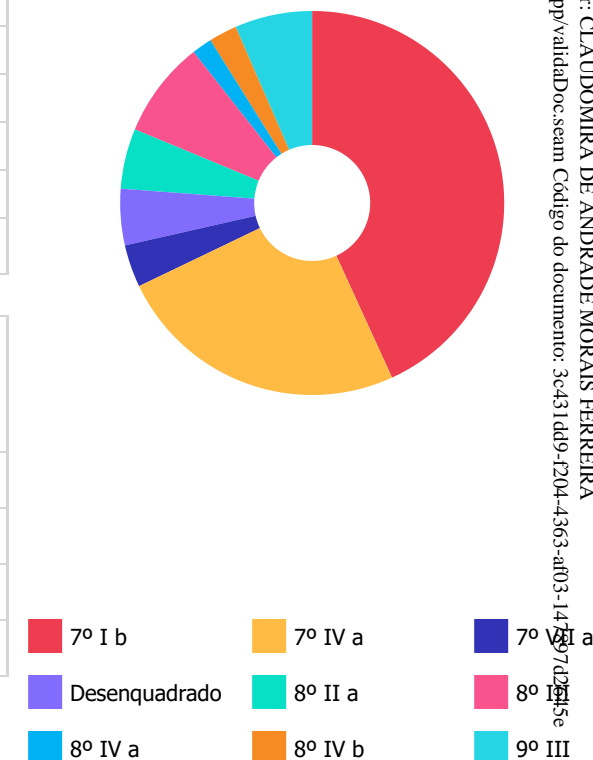
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	5,00%	2.443.178,32
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	14.659.069,90
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	2.478.636,25	5,07%	6,00%	16,00%	20,00%	7.294.077,01
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	9.772.713,26
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	3.976.600,81	8,14%	3,50%	3,69%	10,00%	909.755,82
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	834.032,46	1,71%	0,00%	2,00%	4,00%	1.120.510,19
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.157.289,50	2,37%	0,00%	3,00%	5,00%	1.285.888,82
Total Renda Variável	30,00%	8.446.559,02	17,29%	9,50%	24,69%	94,00%	

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%	4.886.356,63
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.443.178,32
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.188.274,04	6,52%	0,00%	0,31%	5,00%	-745.095,72
Total Exterior	10,00%	3.188.274,04	6,52%	0,00%	0,31%	20,00%	



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-142972215e



Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	18.202.401,54	37,25	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.468.650,89	27,56	0,00
CAIXA DTVM	10.623.897,14	21,74	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.905.466,27	5,95	1,67
MULTINVEST CAPITAL	2.317.278,88	4,74	0,24
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	757.307,00	1,55	0,08
PLURAL	352.137,76	0,72	0,00
RJI CORRETORA DE VALORES	236.426,84	0,48	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 %		

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://scte.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-1,35%	-2,10%	-1,67%	-0,96%	0,67%	2,85%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,63%	-2,98%	-2,07%	-1,74%	0,17%	1,97%	1,99%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,80%	14,45%	5,08%	9,40%	18,36%	31,53%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,01%	-1,59%	0,25%	0,71%	-1,51%	-6,80%	0,29%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	-0,54%	1,23%	0,23%	0,83%	1,78%	5,91%	-	-
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,55%	1,01%	0,19%	0,79%	1,54%	5,26%	0,73%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,54%	1,05%	0,18%	0,71%	1,56%	5,47%	0,73%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	-1,24%	1,22%	-0,10%	0,49%	4,43%	10,39%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-1,39%	-2,23%	-1,14%	-1,75%	-23,45%	-38,86%	1,25%	0,22%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,10%	-27,20%	-4,64%	-20,68%	-66,79%	-78,00%	0,70%	0,54%
IRF-M (Benchmark)	-2,63%	-5,50%	-3,53%	-3,59%	-3,30%	0,99%	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,93%	-2,48%	-2,28%	-3,41%	-0,78%	-5,11%	1,12%	0,03%


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
CDI (Benchmark)	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%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,31%	1,46%	0,80%	1,27%	1,51%	2,36%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	1,25%	8,24%	3,32%	5,73%	10,67%	15,01%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,80%	2,69%	0,70%	1,95%	5,69%	10,94%	1,20%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,66%	-1,82%	-1,75%	-2,29%	0,30%	4,82%	0,96%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,72%	-2,35%	-1,37%	-0,82%	0,85%	2,10%	1,48%	0,03%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	2,06%	17,53%	5,93%	11,19%	22,20%	40,21%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,31%	144,31%	-0,91%	148,54%	137,37%	-92,68%	0,00%	0,03%
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,94%	16,21%	5,57%	10,42%	20,55%	36,46%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,11%	-1,07%	-0,31%	-0,61%	-1,38%	30,94%	-	0,00%
Global BDRX (Benchmark)	11,15%	32,29%	13,49%	15,25%	36,93%	118,76%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10,93%	29,48%	13,35%	13,59%	33,55%	114,42%	7,94%	0,13%
Ibovespa (Benchmark)	-6,74%	-13,04%	-15,02%	-12,95%	10,16%	-3,47%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-5,02%	-8,12%	-10,68%	-8,86%	18,52%	15,82%	10,48%	0,25%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-8,50%	-11,45%	-17,98%	-19,80%	6,81%	-2,61%	12,19%	0,23%
CDI (Benchmark)	0,48%	3,00%	1,35%	2,29%	3,32%	6,65%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-1,16%	-1,18%	-1,05%	-1,36%	1,09%	6,18%	1,73%	0,02%
MSCI ACWI (Benchmark)	8,97%	25,22%	13,38%	10,89%	32,23%	96,53%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,64%	26,45%	6,08%	12,36%	44,33%	49,77%	5,83%	0,13%
IFIX (Benchmark)	-1,47%	-6,78%	-5,26%	-6,48%	-3,29%	-4,17%	-	-

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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
HAZ FII - ATCR11	-0,35%	0,63%	-0,13%	1,11%	0,77%	388,44%	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



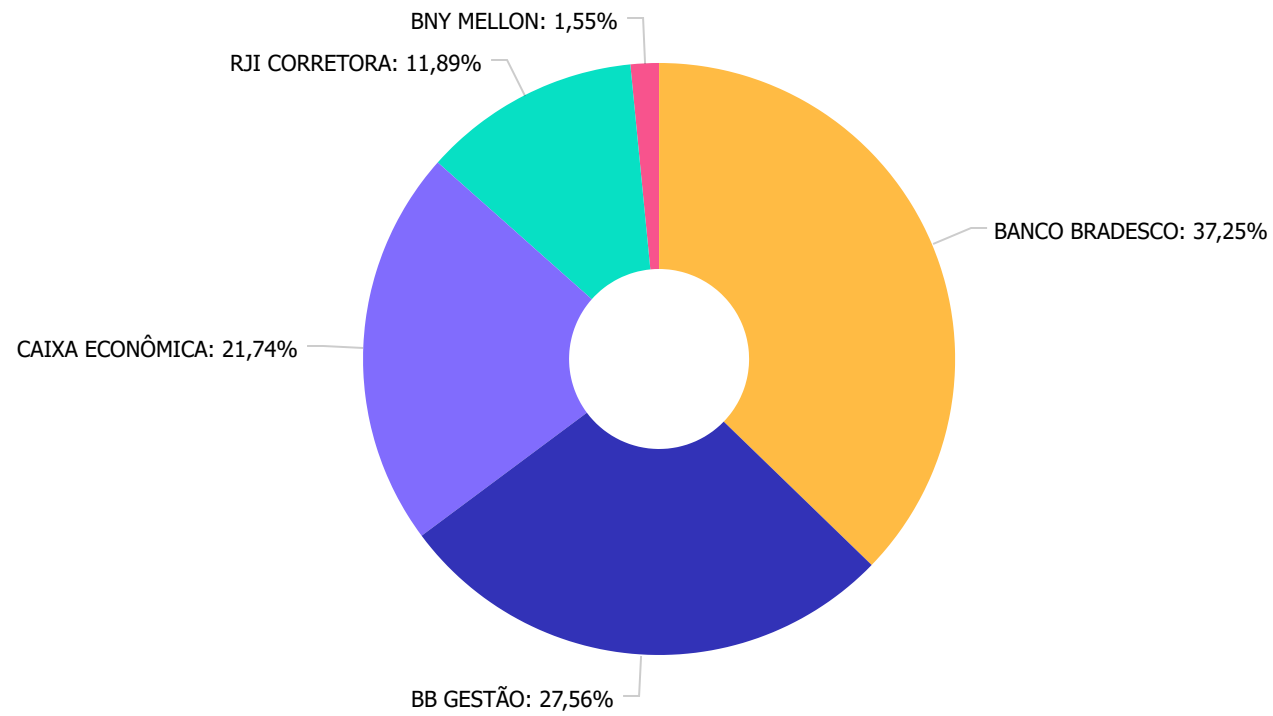
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	11,15%	32,29%	13,49%	15,25%	36,93%	118,76%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10,93%	29,48%	13,35%	13,59%	33,55%	114,42%	7,94%	0,13%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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



BANCO BRADESCO	18.202.400,58
BB GESTÃO	13.468.650,18
CAIXA ECONÔMICA	10.623.892,11
RJI CORRETORA	5.811.300,00
BNY MELLON	757.300,00

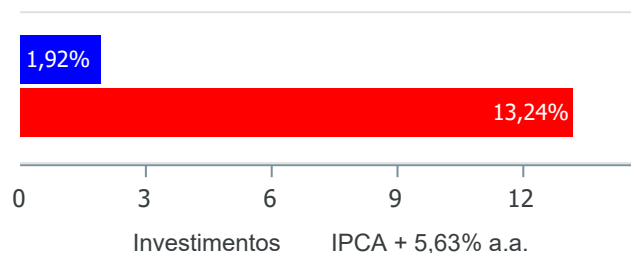
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS PEREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam>
 Odiário do Município de Garanhuns - Número: 3081dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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	51.548.643,67	1.745.203,08	3.044.789,52	50.181.374,60	-67.682,63	-67.682,63	-0,13%	-0,13%	0,69%	0,69%	-19,12%	2
Fevereiro	50.181.374,60	2.923.373,86	3.396.843,50	49.385.005,02	-322.899,94	-390.582,57	-0,64%	-0,77%	1,26%	1,95%	-39,67%	2
Março	49.385.005,02	2.462.542,61	3.543.201,50	48.558.145,02	253.798,89	-136.783,68	0,51%	-0,26%	1,44%	3,41%	-7,73%	2
Abril	48.558.145,02	3.610.764,05	3.274.894,15	49.363.602,01	469.587,09	332.803,41	0,96%	0,69%	0,75%	4,19%	16,57%	2
Maio	49.363.602,01	3.387.660,62	2.799.779,76	50.142.400,97	190.918,10	523.721,51	0,38%	1,08%	1,29%	5,53%	19,50%	2
Junho	50.142.400,97	9.979.176,60	10.178.203,74	50.094.425,62	151.051,79	674.773,30	0,30%	1,38%	0,99%	6,58%	21,03%	1
Julho	50.094.425,62	3.045.596,41	9.205.234,32	43.814.404,22	-120.383,49	554.389,81	-0,24%	1,14%	1,44%	8,12%	14,04%	3
Agosto	43.814.404,22	19.648.316,10	14.088.871,51	49.276.868,90	-96.979,91	457.409,90	-0,20%	0,94%	1,35%	9,58%	9,82%	2
Setembro	49.276.868,90	2.133.733,87	5.757.646,97	46.157.857,87	504.902,07	962.311,97	1,02%	1,98%	1,62%	11,36%	17,39%	2
Outubro	46.157.857,87	5.968.042,51	3.233.823,36	48.863.566,32	-28.510,70	933.801,27	-0,06%	1,92%	1,69%	13,24%	14,47%	2

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: https://pccs.tce-pe.gov.br/sgp/vizualizacao.do?acao=detalhe_documento:3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e

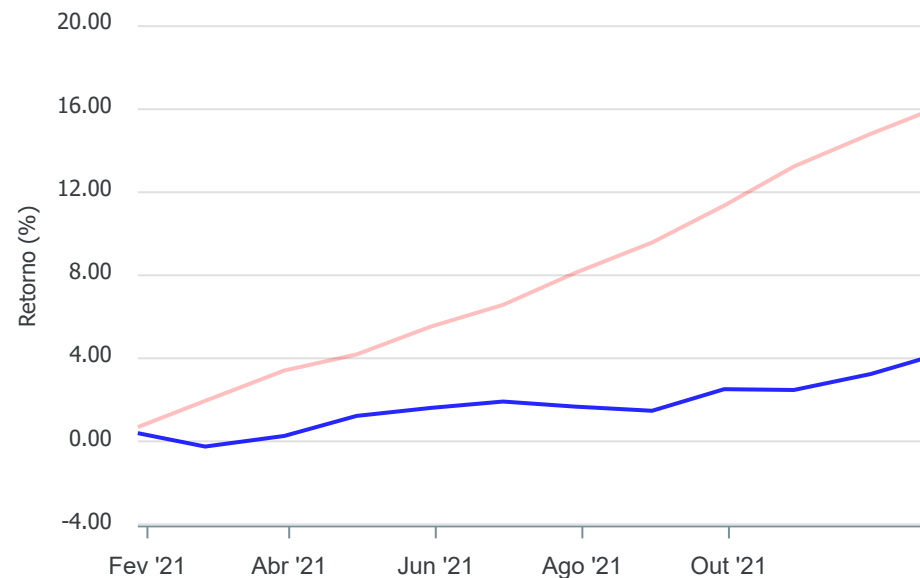


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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 FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	51.814,23	0,00	0,00	52.020,67	206,44	0,40%	0,40%	0,01
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.156.663,27	2.193.995,21	2.105.033,84	1.252.146,00	6.521,36	0,19%	0,31%	0,01
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.745.413,90	0,00	0,00	1.748.176,77	2.762,87	0,16%	0,01%	0,29
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	275.687,92	0,00	0,00	275.412,30	-275,62	-0,10%	-0,10%	0,70
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.392.915,69	0,00	0,00	1.385.454,30	-7.461,39	-0,54%	-0,54%	0,73
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.711.665,57	0,00	1.128.789,52	3.555.947,50	-26.928,55	-0,57%	-0,66%	0,96
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.446.382,30	2.800.000,00	0,00	5.216.308,67	-30.073,63	-0,57%	-0,55%	0,73
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.556.211,87	768.746,52	0,00	10.251.567,36	-73.391,03	-0,71%	-0,72%	1,48
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	261.492,81	0,00	0,00	259.411,44	-2.081,37	-0,80%	-0,80%	1,20
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.338.904,04	0,00	0,00	2.317.278,88	-21.625,16	-0,92%	-0,92%	1,12
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.529.559,88	205.300,78	0,00	2.700.640,04	-34.220,62	-1,25%	-1,25%	1,89
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	239.755,89	0,00	0,00	236.426,84	-3.329,05	-1,39%	-1,39%	1,25
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.109.835,37	0,00	0,00	7.977.942,49	-131.892,88	-1,63%	-1,63%	1,99
Total Renda Fixa	34.816.302,74	5.968.042,51	3.233.823,36	37.228.733,26	-321.788,63	-0,86%		1,30

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinatura em: https://seccat.cepe.gov.br/vl/validador.aspx?CodigoDocumento=3643149-f294-4368-af03-147897d2645e



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
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.317.134,71	0,00	0,00	2.494.221,30	177.086,59	7,64%	7,64%	5,83%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	758.118,35	0,00	0,00	757.307,00	-811,35	-0,11%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	76.960,75	0,00	0,00	76.725,46	-235,29	-0,31%	-0,31%	0,00%
HAZ FII - ATCR11	1.161.740,27	0,00	0,00	1.157.289,50	-4.450,77	-0,38%	-0,35%	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.499.795,92	0,00	0,00	1.482.379,51	-17.416,41	-1,16%	-1,16%	1,73%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.452.775,91	0,00	0,00	1.379.811,43	-72.964,48	-5,02%	-5,02%	10,48%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.200.867,77	0,00	0,00	1.098.824,82	-102.042,95	-8,50%	-8,50%	12,19%
Total Renda Variável	8.467.393,68	0,00	0,00	8.446.559,02	-20.834,66	-0,25%		6,88%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinado em: 29/10/2021
 URL para validação do documento: https://br.sic.gov.br/validar/3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.874.161,45	0,00	0,00	3.188.274,04	314.112,59	10,93%	10,93%	7,94%
Total Exterior	2.874.161,45	0,00	0,00	3.188.274,04	314.112,59	10,93%		7,94%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinse em: https://sede.tcepe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 3e431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 nos 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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE RIBEIRO DE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/qualificaDoc.seam> Código do Documento: 343.019-F204-2063-003-147897-545e



Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <http://etcg.cpf.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	8.116.277,89	16,81%	560	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.766.243,48	5,73%	1.026	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	264.669,95	0,55%	140	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.519.930,66	9,36%	240	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.588.162,13	7,43%	952	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.396.261,77	2,89%	1.240	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	52.283,58	0,11%	815	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	9.672.421,53	20,03%	194	0,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	1.726.779,93	3,58%	1.436	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	238.251,23	0,49%	26	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	275.238,73	0,57%	31	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.757.139,00	3,64%	70	2,44%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.359.245,05	2,82%	27.327	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.063.035,46	2,20%	53.508	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.496.995,02	3,10%	27	0,62%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.482.000,26	5,14%	19.656	0,07%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	756.307,23	1,57%	17	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	76.490,16	0,16%	33	0,39%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.159.683,42	2,40%		1,60%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.159.832,61	6,54%	518	0,08%	Artigo 9º, Inciso III

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/ppv/validarDoc?seamCodigoDoDocumento:3c431dd9f2044363a003147897d2645e>



Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2021)

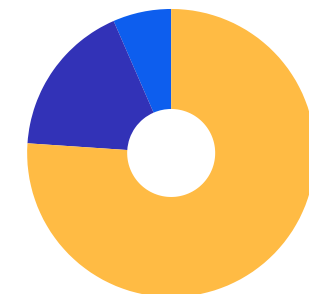
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.356.095,20	4,88%	4	16,47%	Desenquadrado - RF
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		573.665,96	1,19%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			48.283.344,29				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			573.665,96				Artigo 6º
PL Total			48.857.010,25				

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	100,00%	48.283.344,29
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	20.651.545,88	42,77%	11,00%	50,00%	60,00%	8.318.460,69
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	48.283.344,29
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.414.167,21
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.828.334,43
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	28.970.006,57
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	11.964.975,00	24,78%	4,00%	15,00%	30,00%	2.520.028,29
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	19.313.337,72
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	9.656.668,86
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.242.501,64
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.242.501,64
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.757.139,00	3,64%	0,00%	5,00%	5,00%	657.028,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.414.167,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.414.167,21
Desenquadrado - RF	0,00%	2.356.095,20	4,88%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.356.095,20
Total Renda Fixa	100,00%	36.729.755,08	76,07%	15,00%	75,00%	470,00%	



■ RENDA FIXA 36.729.755,08
■ RENDA VARIÁVEL 8.393.756,60
■ EXTERIOR 3.159.832,61

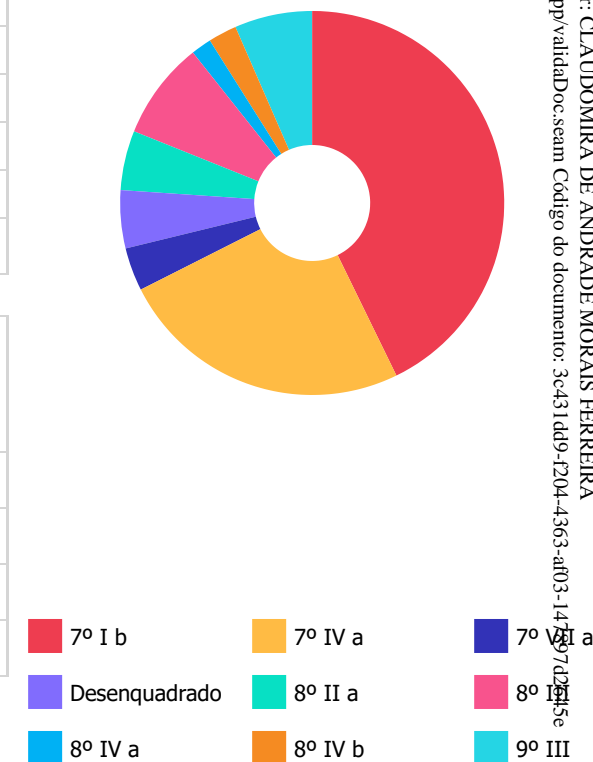
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	5,00%	2.414.167,21
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	14.485.003,29
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	2.422.280,51	5,02%	6,00%	16,00%	20,00%	7.234.388,35
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	9.656.668,86
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	3.978.995,28	8,24%	3,50%	3,69%	10,00%	849.339,15
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	832.797,39	1,72%	0,00%	2,00%	4,00%	1.098.536,38
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.159.683,42	2,40%	0,00%	3,00%	5,00%	1.254.483,79
Total Renda Variável	30,00%	8.393.756,60	17,38%	9,50%	24,69%	94,00%	

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%	4.828.334,43
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.414.167,21
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.159.832,61	6,54%	0,00%	0,31%	5,00%	-745.665,40
Total Exterior	10,00%	3.159.832,61	6,54%	0,00%	0,31%	20,00%	



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-142972215e



Enquadramento por Gestores - base (Novembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	17.416.127,14	36,07	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.621.755,41	28,21	0,00
CAIXA DTVM	10.626.256,77	22,01	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.916.822,42	6,04	1,48
MULTINVEST CAPITAL	2.356.095,20	4,88	0,24
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	756.307,23	1,57	0,15
PLURAL	351.728,89	0,73	0,00
RJI CORRETORA DE VALORES	238.251,23	0,49	0,05

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 %		

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://scte.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	1,82%	-0,32%	0,46%	0,34%	1,79%	5,46%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,73%	-1,30%	0,07%	-0,51%	1,05%	4,72%	1,45%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,49%	16,16%	5,10%	9,50%	18,43%	32,11%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,66%	-0,94%	1,16%	1,31%	-0,46%	-6,02%	1,14%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,79%	2,03%	0,65%	1,42%	2,35%	6,40%	-	-
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,78%	1,79%	0,62%	1,37%	2,12%	5,75%	0,32%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,78%	1,84%	0,62%	1,32%	2,13%	5,96%	0,32%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	2,50%	3,75%	2,25%	2,30%	5,65%	13,47%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,77%	-1,48%	-0,33%	-1,18%	-0,89%	-37,83%	0,43%	0,02%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,06%	-27,25%	-0,29%	-4,97%	-27,45%	-77,87%	0,16%	0,18%
IRF-M (Benchmark)	1,79%	-3,81%	-1,21%	-2,06%	-1,93%	3,27%	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,68%	-0,85%	-0,94%	-2,23%	0,41%	-3,54%	0,61%	0,04%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.tee.pe.gov.br/epp/validarDoc> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a0f3-147897d2645e



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

	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 FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,51%	2,58%	1,26%	2,04%	2,69%	4,56%	0,00%	0,00%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,41%	1,87%	0,99%	1,55%	1,89%	2,59%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,95%	9,26%	3,40%	5,86%	10,74%	15,51%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,03%	4,77%	2,43%	3,31%	6,46%	13,24%	0,90%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,91%	-0,93%	0,60%	-1,64%	0,38%	6,30%	0,40%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,46%	-0,93%	0,57%	0,20%	1,53%	4,57%	1,14%	0,03%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,75%	19,59%	5,93%	11,28%	22,27%	40,82%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,31%	143,56%	-0,91%	-4,77%	137,69%	-	0,00%	0,03%
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,64%	18,12%	5,58%	10,52%	20,62%	37,05%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,13%	-1,20%	-0,34%	-0,65%	-1,37%	-	-	0,00%
Global BDRX (Benchmark)	-0,67%	31,40%	10,22%	19,05%	32,63%	99,29%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,89%	28,32%	9,66%	17,02%	29,21%	95,10%	9,33%	0,14%
Ibovespa (Benchmark)	-1,53%	-14,37%	-14,20%	-19,25%	-6,41%	-5,84%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-1,49%	-9,49%	-10,16%	-15,14%	-0,06%	13,16%	9,51%	0,19%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-3,26%	-14,33%	-18,31%	-24,38%	-7,49%	-9,26%	10,49%	0,20%
CDI (Benchmark)	0,59%	3,60%	1,51%	2,62%	3,77%	6,87%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,99%	-0,21%	-0,22%	-0,75%	1,20%	7,24%	0,70%	0,02%
MSCI ACWI (Benchmark)	-2,91%	21,57%	7,09%	9,69%	23,86%	76,81%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-0,49%	25,83%	2,15%	11,27%	29,78%	43,53%	7,09%	0,11%
IFIX (Benchmark)	-3,64%	-10,16%	-6,23%	-8,45%	-8,19%	-10,79%	-	-

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.ce.gov.br/epp/validarDoc> Doc:seam Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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
HAZ FII - ATCR11	0,17%	0,81%	-0,03%	1,14%	0,95%	389,28%	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-0,67%	31,40%	10,22%	19,05%	32,63%	99,29%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,89%	28,32%	9,66%	17,02%	29,21%	95,10%	9,33%	0,14%

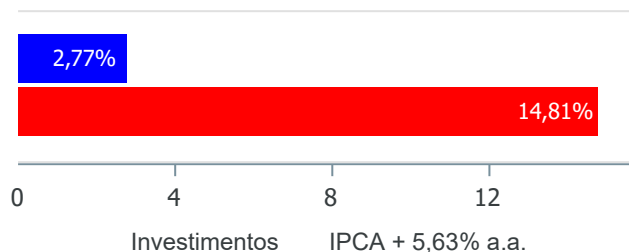
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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	51.548.643,67	1.745.203,08	3.044.789,52	50.181.374,60	-67.682,63	-67.682,63	-0,13%	-0,13%	0,69%	0,69%	-19,12%	2
Fevereiro	50.181.374,60	2.923.373,86	3.396.843,50	49.385.005,02	-322.899,94	-390.582,57	-0,64%	-0,77%	1,26%	1,95%	-39,67%	2
Março	49.385.005,02	2.462.542,61	3.543.201,50	48.558.145,02	253.798,89	-136.783,68	0,51%	-0,26%	1,44%	3,41%	-7,73%	2
Abril	48.558.145,02	3.610.764,05	3.274.894,15	49.363.602,01	469.587,09	332.803,41	0,96%	0,69%	0,75%	4,19%	16,57%	2
Mai	49.363.602,01	3.387.660,62	2.799.779,76	50.142.400,97	190.918,10	523.721,51	0,38%	1,08%	1,29%	5,53%	19,50%	2
Junho	50.142.400,97	9.979.176,60	10.178.203,74	50.094.425,62	151.051,79	674.773,30	0,30%	1,38%	0,99%	6,58%	21,03%	1
Julho	50.094.425,62	3.045.596,41	9.205.234,32	43.814.404,22	-120.383,49	554.389,81	-0,24%	1,14%	1,44%	8,12%	14,04%	3
Agosto	43.814.404,22	19.648.316,10	14.088.871,51	49.276.868,90	-96.979,91	457.409,90	-0,20%	0,94%	1,35%	9,58%	9,82%	2
Setembro	49.276.868,90	2.133.733,87	5.757.646,97	46.157.857,87	504.902,07	962.311,97	1,02%	1,98%	1,62%	11,36%	17,39%	2
Outubro	46.157.857,87	5.968.042,51	3.233.823,36	48.863.566,32	-28.510,70	933.801,27	-0,06%	1,92%	1,69%	13,24%	14,47%	2
Novembro	48.863.566,32	4.787.107,13	5.777.804,25	48.283.344,29	410.475,09	1.344.276,36	0,84%	2,77%	1,39%	14,81%	18,71%	2

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesso em: https://cve.ic.gov.br/gpp/vtdalDoc.aspx?CodigoDoc=36431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e

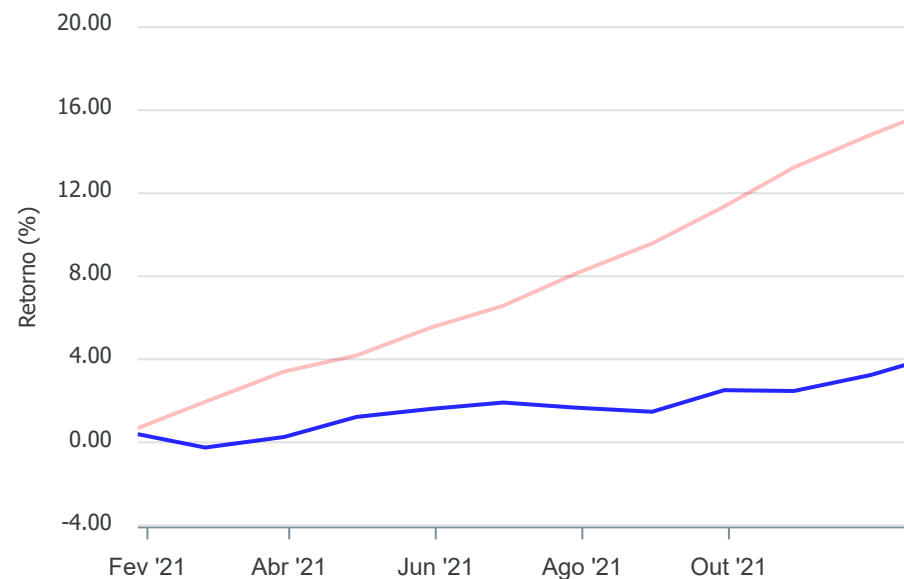


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 - In
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.700.640,04	0,00	0,00	2.766.243,48	65.603,44	2,43%	2,43%	1,11
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	259.411,44	0,00	0,00	264.669,95	5.258,51	2,03%	2,03%	0,90
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.977.942,49	0,00	0,00	8.116.277,89	138.335,40	1,73%	1,73%	1,45
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.317.278,88	0,00	0,00	2.356.095,20	38.816,32	1,68%	1,68%	0,61
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	10.251.567,36	772.939,17	1.500.000,00	9.672.421,53	147.915,00	1,34%	1,45%	1,14
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.555.947,50	0,00	0,00	3.588.162,13	32.214,63	0,91%	0,91%	0,40
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.385.454,30	0,00	0,00	1.396.261,77	10.807,47	0,78%	0,78%	0,32
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	236.426,84	0,00	0,00	238.251,23	1.824,39	0,77%	0,77%	0,43
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.748.176,77	0,00	0,00	1.757.139,00	8.962,23	0,51%	0,66%	1,14
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	52.020,67	0,00	0,00	52.283,58	262,91	0,51%	0,51%	0,00
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.216.308,67	1.500.000,00	2.230.280,61	4.519.930,66	33.902,60	0,50%	0,78%	0,32
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.252.146,00	2.514.167,96	2.047.523,64	1.726.779,93	7.989,61	0,21%	0,40%	0,01
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	275.412,30	0,00	0,00	275.238,73	-173,57	-0,06%	-0,06%	0,16
Total Renda Fixa	37.228.733,26	4.787.107,13	5.777.804,25	36.729.755,08	491.718,94	1,32%		0,90

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinatura em: https://seccor.gov.br/validador/validador.aspx?codigo_documento=3643149-f294-4368-a03-147897d2645e



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
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.482.379,51	0,00	0,00	1.496.995,02	14.615,51	0,99%	0,99%	0,70%
HAZ FII - ATCR11	1.157.289,50	0,00	0,00	1.159.683,42	2.393,92	0,21%	0,17%	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	757.307,00	0,00	0,00	756.307,23	-999,77	-0,13%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	76.725,46	0,00	0,00	76.490,16	-235,30	-0,31%	-0,31%	0,00%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.494.221,30	0,00	0,00	2.482.000,26	-12.221,04	-0,49%	-0,49%	7,09%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.379.811,43	0,00	0,00	1.359.245,05	-20.566,38	-1,49%	-1,49%	9,51%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.098.824,82	0,00	0,00	1.063.035,46	-35.789,36	-3,26%	-3,26%	10,49%
Total Renda Variável	8.446.559,02	0,00	0,00	8.393.756,60	-52.802,42	-0,63%		6,59%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinse em: https://sccs.ce.gov.br/validador/validador.do?assinseCodigo=3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.188.274,04	0,00	0,00	3.159.832,61	-28.441,43	-0,89%	-0,89%	9,33%
Total Exterior	3.188.274,04	0,00	0,00	3.159.832,61	-28.441,43	-0,89%		9,33%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinse em: https://sede.tce.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 3e431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 nos 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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/quali/Doc/seam/Cod/890603003-1478970545e>



Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <http://etcg.cpf-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/ppp/validarDoc.aspx?Codigo-do-documento:3c431dd9f2044363a003147897d2645e>
Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	8.190.468,82	13,77%	553	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.785.778,74	4,68%	1.035	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	266.426,42	0,45%	140	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.558.432,16	7,66%	243	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.617.789,07	6,08%	945	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.408.109,76	2,37%	1.241	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	52.633,50	0,09%	803	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	10.914.874,57	18,35%	193	0,95%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	11.208.091,40	18,85%	1.424	0,68%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	238.474,72	0,40%	26	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	274.696,99	0,46%	31	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.759.975,14	2,96%	70	2,44%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.407.677,66	2,37%	27.197	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.079.018,37	1,81%	52.320	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.515.481,79	2,55%	28	0,62%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.620.036,98	4,41%	19.787	0,07%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	755.513,01	1,27%	17	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIELABRÁTÉGIA	Não se ...	Não se aplica	76.254,86	0,13%	33	0,39%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.160.647,02	1,95%		1,60%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.213.634,76	5,40%	529	0,08%	Artigo 9º, Inciso III



Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

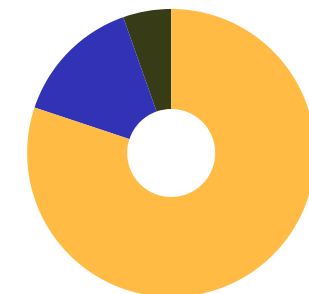
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.369.429,22	3,98%	4	16,47%	Desenquadrado - RF
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		12.678,32	0,02%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			59.473.444,96				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			12.678,32				Artigo 6º
PL Total			59.486.123,28				

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	100,00%	59.473.444,96
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	20.827.004,97	35,02%	11,00%	50,00%	60,00%	14.857.062,01
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	59.473.444,96
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.973.672,25
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	5.947.344,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	35.684.066,98
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	22.688.771,18	38,15%	4,00%	15,00%	30,00%	-4.846.737,69
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	23.789.377,98
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	11.894.688,99
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	8.921.016,74
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	8.921.016,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.759.975,14	2,96%	0,00%	5,00%	5,00%	1.213.697,11
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.973.672,25
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.973.672,25
Desenquadrado - RF	0,00%	2.369.429,22	3,98%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.369.429,22
Total Renda Fixa	100,00%	47.645.180,51	80,11%	15,00%	75,00%	470,00%	



■ RENDA FIXA 47.645.180,51
■ RENDA VARIÁVEL 8.614.629,69
■ EXTERIOR 3.213.634,76

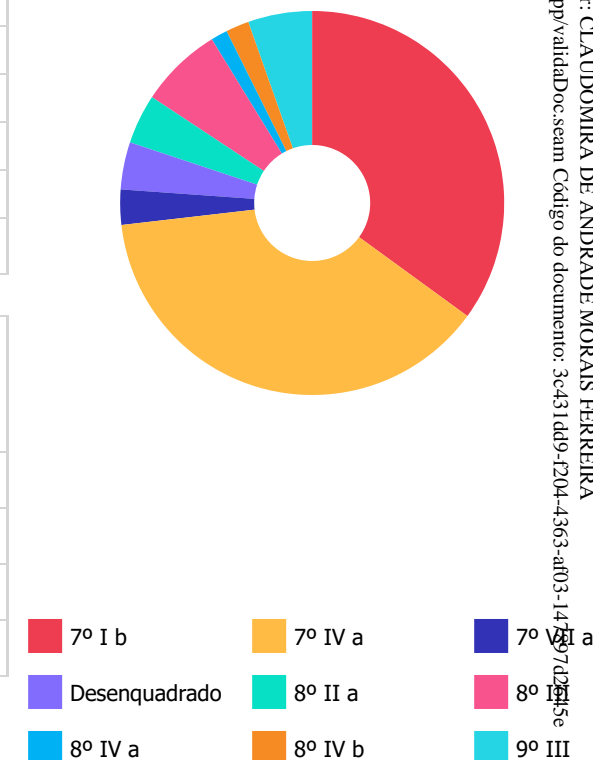
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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%	0,00%	5,00%	2.973.672,25
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	17.842.033,49
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	2.486.696,03	4,18%	6,00%	16,00%	20,00%	9.407.992,96
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	11.894.688,99
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.135.518,77	6,95%	3,50%	3,69%	10,00%	1.811.825,73
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	831.767,87	1,40%	0,00%	2,00%	4,00%	1.547.169,93
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.160.647,02	1,95%	0,00%	3,00%	5,00%	1.813.025,23
Total Renda Variável	30,00%	8.614.629,69	14,48%	9,50%	24,69%	94,00%	

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%	5.947.344,50
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.973.672,25
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.213.634,76	5,40%	0,00%	0,31%	5,00%	-239.962,51
Total Exterior	10,00%	3.213.634,76	5,40%	0,00%	0,31%	20,00%	



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-1429702915e



Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	28.196.879,92	47,41	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.782.003,51	23,17	0,00
CAIXA DTVM	10.859.570,57	18,26	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.920.622,16	4,91	2,67
MULTINVEST CAPITAL	2.369.429,22	3,98	0,24
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	755.513,01	1,27	0,15
PLURAL	350.951,85	0,59	0,00
RJI CORRETORA DE VALORES	238.474,72	0,40	0,04

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 %		

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://ste.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,94%	0,61%	1,38%	0,96%	0,61%	5,49%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	-0,40%	0,99%	0,29%	-0,40%	4,67%	1,00%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,35%	17,73%	4,71%	9,78%	17,73%	31,63%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,13%	-0,81%	0,80%	1,32%	-0,81%	-5,49%	0,50%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,88%	2,93%	1,13%	2,10%	2,93%	6,88%	-	-
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,85%	2,66%	1,08%	2,03%	2,66%	6,23%	0,20%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,85%	2,70%	1,09%	1,99%	2,70%	6,43%	0,20%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,79%	4,57%	2,03%	3,24%	4,57%	12,97%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,11%	-1,37%	-0,52%	-0,63%	-1,37%	-37,97%	0,48%	0,02%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,21%	-27,40%	-0,37%	-5,02%	-27,40%	-78,36%	0,17%	0,18%
IRF-M (Benchmark)	1,89%	-1,99%	0,98%	-0,42%	-1,99%	4,57%	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,57%	-0,29%	1,31%	-1,76%	-0,29%	-3,88%	0,51%	0,03%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: https://etec.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam?codigo_documento=3c431dd9-f204-4363-a0f3-147897d2645e


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
CDI (Benchmark)	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%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,55%	2,42%	1,26%	1,93%	2,42%	2,99%	0,02%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,73%	10,06%	2,96%	6,07%	10,06%	15,03%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	5,47%	1,89%	3,84%	5,47%	12,76%	0,57%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,83%	-0,11%	1,07%	-0,82%	-0,11%	6,55%	0,23%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,78%	-0,16%	1,52%	0,65%	-0,16%	4,50%	0,70%	0,02%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,65%	21,57%	5,56%	11,58%	21,57%	40,35%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,31%	142,81%	-0,92%	-1,83%	142,81%	-	0,00%	0,03%
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,53%	19,93%	5,20%	10,81%	19,93%	36,58%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,11%	-1,31%	-0,34%	-0,65%	-1,31%	-	-	0,00%
Global BDRX (Benchmark)	1,71%	33,65%	12,29%	21,44%	33,65%	105,84%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,70%	30,51%	11,81%	20,44%	30,51%	101,98%	8,95%	0,14%
Ibovespa (Benchmark)	2,85%	-11,93%	-5,55%	-17,33%	-11,93%	-9,36%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3,56%	-6,27%	-3,10%	-11,41%	-6,27%	6,89%	9,21%	0,16%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1,50%	-13,05%	-10,15%	-23,04%	-13,05%	-16,06%	8,94%	0,18%
CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1,24%	1,02%	1,05%	0,74%	1,02%	7,56%	0,68%	0,02%
MSCI ACWI (Benchmark)	3,17%	25,42%	9,15%	16,96%	25,42%	84,89%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,56%	32,83%	13,07%	14,36%	32,83%	47,69%	7,98%	0,11%
IFIX (Benchmark)	8,78%	-2,28%	3,28%	1,81%	-2,28%	-12,28%	-	-

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.gov.br/epp/validarDoc> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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
HAZ FII - ATCR11	0,08%	0,89%	-0,10%	-0,18%	0,89%	3,29%	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

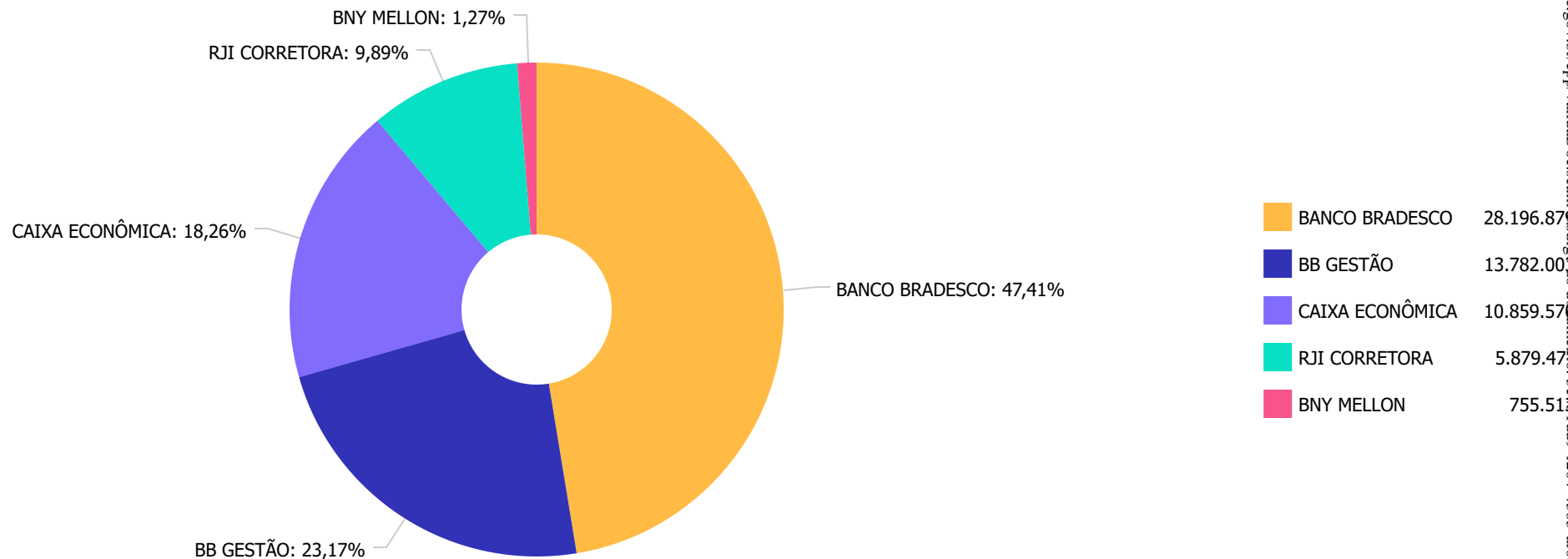
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	1,71%	33,65%	12,29%	21,44%	33,65%	105,84%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,70%	30,51%	11,81%	20,44%	30,51%	101,98%	8,95%	0,14%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



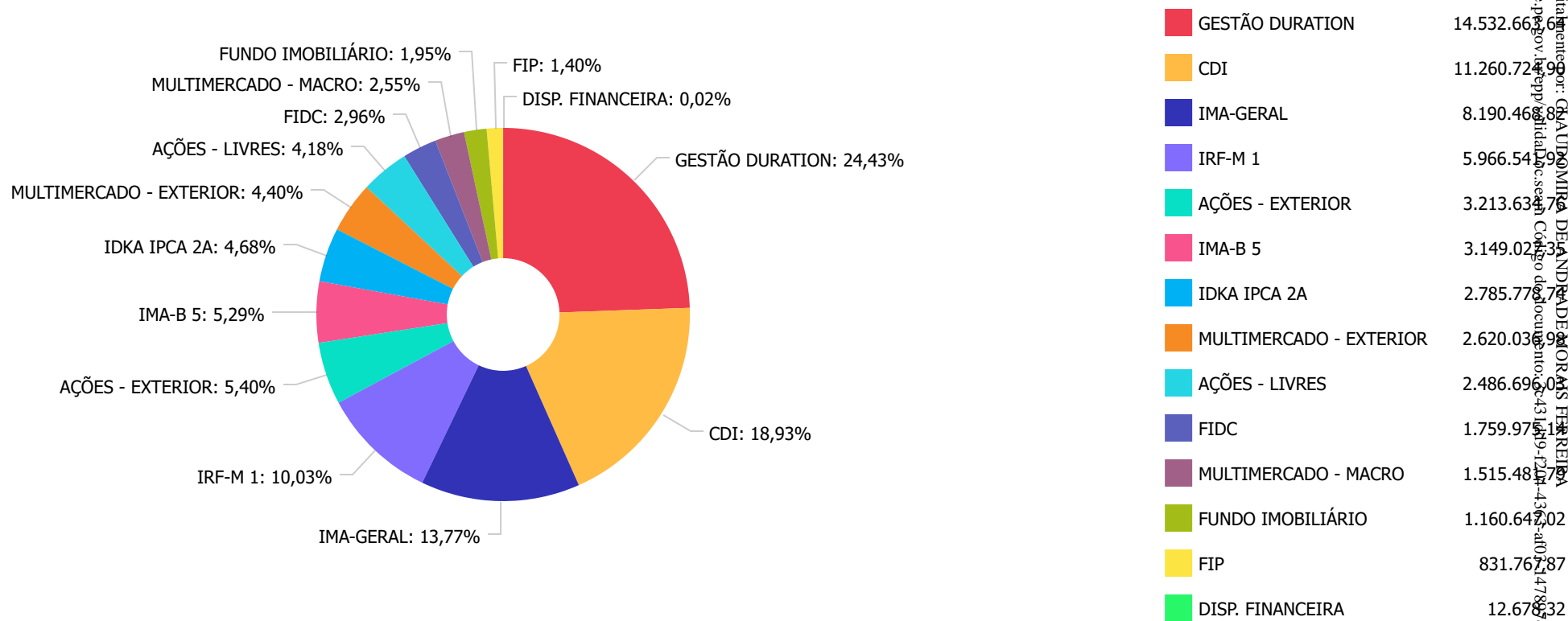
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS-FERREIRA
 Acesse em: [https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam](https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam?modulos=10&documento=3c491dd9-f204-4363-a003-147897d2645e)

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





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



Documento Assinado Digitalmente por: GEA UDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesso em: https://etc.ce.gov.br/eppp/sigilada/DocAssinado.do?documento=043119-f21-431-002645e

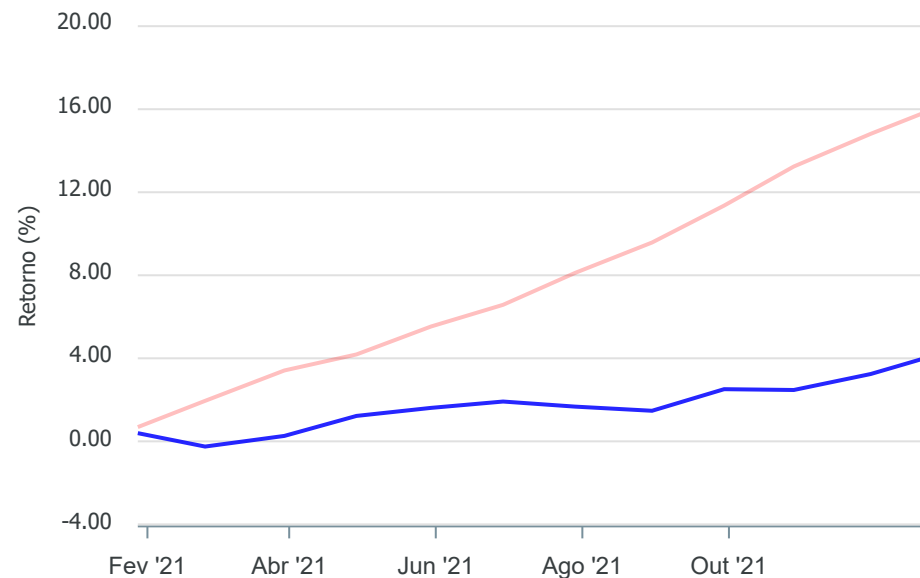


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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 (%)	(%) Instit	Var - In
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.116.277,89	0,00	0,00	8.190.468,82	74.190,93	0,91%	0,91%	1,00%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.519.930,66	0,00	0,00	4.558.432,16	38.501,50	0,85%	0,85%	0,20%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.396.261,77	0,00	0,00	1.408.109,76	11.847,99	0,85%	0,85%	0,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.588.162,13	0,00	0,00	3.617.789,07	29.626,94	0,83%	0,83%	0,23%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.672.421,53	1.164.304,06	0,00	10.914.874,57	78.148,98	0,72%	0,78%	0,70%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.766.243,48	0,00	0,00	2.785.778,74	19.535,26	0,71%	0,71%	1,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	52.283,58	0,00	0,00	52.633,50	349,92	0,67%	0,67%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	264.669,95	0,00	0,00	266.426,42	1.756,47	0,66%	0,66%	0,57%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.356.095,20	0,00	0,00	2.369.429,22	13.334,02	0,57%	0,57%	0,51%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.757.139,00	0,00	0,00	1.759.975,14	2.836,14	0,16%	0,16%	0,50%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.726.779,93	14.112.819,49	4.656.976,25	11.208.091,40	25.468,23	0,16%	0,55%	0,02%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	238.251,23	0,00	0,00	238.474,72	223,49	0,09%	0,11%	0,48%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	275.238,73	0,00	0,00	274.696,99	-541,74	-0,20%	-0,21%	0,17%
Total Renda Fixa	36.729.755,08	15.277.123,55	4.656.976,25	47.645.180,51	295.278,13	0,62%		0,49%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinse em: https://sica.trfpe.gov.br/vlba/DadosAssinCódigo do Documento: 36431469-f294-4368-8e-af03-147897d2645e



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
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.482.000,26	0,00	0,00	2.620.036,98	138.036,72	5,56%	5,56%	7,98%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.359.245,05	0,00	0,00	1.407.677,66	48.432,61	3,56%	3,56%	9,21%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.063.035,46	0,00	0,00	1.079.018,37	15.982,91	1,50%	1,50%	8,94%
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.496.995,02	0,00	0,00	1.515.481,79	18.486,77	1,23%	1,23%	0,68%
HAZ FII - ATCR11	1.159.683,42	0,00	0,00	1.160.647,02	963,60	0,08%	0,08%	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	756.307,23	0,00	0,00	755.513,01	-794,22	-0,11%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	76.490,16	0,00	0,00	76.254,86	-235,30	-0,31%	-0,31%	0,00%
Total Renda Variável	8.393.756,60	0,00	0,00	8.614.629,69	220.873,09	2,63%		6,65%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinse em: https://seccom.pe.gov.br/gpp/validaDoc.seam?Codigo do documento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.159.832,61	0,00	0,00	3.213.634,76	53.802,15	1,70%	1,70%	8,95%
Total Exterior	3.159.832,61	0,00	0,00	3.213.634,76	53.802,15	1,70%		8,95%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinse em: https://sede.tce.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 3e431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.556.211,87	2.705.989,75	1.500.000,00	10.914.874,57	152.672,95	1,25%	1,52%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.109.835,37	0,00	0,00	8.190.468,82	80.633,45	0,99%	0,99%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.529.559,88	205.300,78	0,00	2.785.778,74	50.918,08	1,86%	1,86%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.446.382,30	4.300.000,00	2.230.280,61	4.558.432,16	42.330,47	0,63%	1,08%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.156.663,27	18.820.982,66	8.809.533,73	11.208.091,40	39.979,20	0,20%	1,26%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.711.665,57	0,00	1.128.789,52	3.617.789,07	34.913,02	0,74%	1,07%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.338.904,04	0,00	0,00	2.369.429,22	30.525,18	1,31%	1,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.392.915,69	0,00	0,00	1.408.109,76	15.194,07	1,09%	1,09%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.745.413,90	0,00	0,00	1.759.975,14	14.561,24	0,83%	0,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	261.492,81	0,00	0,00	266.426,42	4.933,61	1,89%	1,89%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	51.814,23	0,00	0,00	52.633,50	819,27	1,58%	1,58%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	275.687,92	0,00	0,00	274.696,99	-990,93	-0,36%	-0,37%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	239.755,89	0,00	0,00	238.474,72	-1.281,17	-0,53%	-0,52%
				Total Renda Fixa	465.208,44	0,99%	

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinatura em: https://seccom.sp.gov.br/gov/validador/validador.do?codigo_documento=3643149-f204-4363-a003-147897d2645e



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 (%)	(%) Inicial
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.874.161,45	0,00	0,00	3.213.634,76	339.473,31	11,81%	11,81%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.317.134,71	0,00	0,00	2.620.036,98	302.902,27	13,07%	13,07%
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.499.795,92	0,00	0,00	1.515.481,79	15.685,87	1,05%	1,05%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	76.960,75	0,00	0,00	76.254,86	-705,89	-0,92%	-0,92%
HAZ FII - ATCR11	1.161.740,27	0,00	0,00	1.160.647,02	-1.093,25	-0,09%	-0,10%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	758.118,35	0,00	0,00	755.513,01	-2.605,34	-0,34%	-0,34%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.452.775,91	0,00	0,00	1.407.677,66	-45.098,25	-3,10%	-3,10%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.200.867,77	0,00	0,00	1.079.018,37	-121.849,40	-10,15%	-10,15%
				Total Renda Variável	486.709,32	4,29%	

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinatura em: https://scc.trsp.gov.br/gpp/validarDocumento.aspx?CodigoDoDocumento: 3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e


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 (%)	(%) Inicial
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.462.400,72	0,00	0,00	3.213.634,76	751.234,04	30,51%	30,51%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	2.251.362,61	0,00	2.620.036,98	368.674,37	16,38%	32,83%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	31.404,77	0,00	0,00	76.254,86	44.850,09	142,81%	142,81%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.500.120,05	0,00	0,00	1.515.481,79	15.361,74	1,02%	1,02%
HAZ FII - ATCR11	1.150.415,83	0,00	0,00	1.160.647,02	10.231,19	0,89%	0,89%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	765.525,67	0,00	0,00	755.513,01	-10.012,66	-1,31%	-1,31%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.496.755,63	0,00	2.433.400,49	0,00	-63.355,14	-2,54%	-17,61%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	1.499.940,00	0,00	1.407.677,66	-92.262,34	-6,15%	-6,26%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.240.970,34	0,00	0,00	1.079.018,37	-161.951,97	-13,05%	-13,05%
				Total Renda Variável	862.769,32	7,87%	

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinse em: https://scc.scc.gov.br/v/validarDocumento.aspx?Codigo=3c431dd9-f204-4363-a003-147897d2645e



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 nos 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: CLAUDOMIRA DE ANDRADE RIBEIRO DE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/quali/Doc/seam/Cod/180603003-1478970545e>