

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2022

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <http://etcsp-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-251123220c340



Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

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	8.193.580,21	14,17%	549	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.786.047,06	4,82%	1.032	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	267.453,02	0,46%	140	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.586.543,07	7,93%	245	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	229.190,70	0,40%	306	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.641.941,67	6,30%	941	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.709.698,23	2,96%	1.237	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	52.976,78	0,09%	821	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	11.720.790,69	20,27%	191	1,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	8.504.766,27	14,71%	1.454	0,41%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	238.315,42	0,41%	26	0,46%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	274.373,16	0,47%	31	0,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.768.152,19	3,06%	70	2,44%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.498.971,81	2,59%	27.194	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.091.082,35	1,89%	50.229	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.900.432,73	5,01%	531	0,08%	Artigo 9º, Inciso III
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.524.601,44	2,64%	27	0,70%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.481.100,05	4,29%	18.800	0,07%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	755.055,83	1,31%	17	2,71%	Artigo 10º, Inciso II
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	76.014,47	0,13%	33	0,39%	Artigo 10º, Inciso II

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: https://etce.tce.pe.gov.br/epg/validaDoc.seam?codigo_documento:1a7d364f-8217-43ae-8582-25123220c340



Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.157.632,93	2,00%		1,60%	Artigo 11º
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.376.982,99	4,11%	3	24,60%	Desenquadrado - RF
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		596.169,61	1,03%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			57.835.703,07				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			596.169,61				Artigo 6º
PL Total			58.431.872,68				

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epv/validarDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2022)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

⚠ ATENÇÃO! Política de Investimentos de **2022** não está cadastrada !!!

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2022)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340



Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	26.336.701,47	45,54	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.890.111,23	24,02	0,00
CAIXA DTVM	10.962.363,38	18,95	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.925.785,12	5,06	1,64
MULTINVEST CAPITAL	2.376.982,99	4,11	0,24
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	755.055,83	1,31	0,15
PLURAL	350.387,63	0,61	0,01
RJI CORRETORA DE VALORES	238.315,42	0,41	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 - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://pcc.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b217-43ae-8582-25123220c340



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,10%	0,10%	2,87%	1,16%	1,16%	5,07%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04%	0,04%	2,70%	0,57%	0,19%	4,21%	1,02%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,05%	0,05%	3,41%	3,29%	4,87%	13,47%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	3,16%	3,11%	4,47%	12,51%	1,06%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,11%	1,11%	4,01%	9,29%	18,11%	32,03%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,50%	0,50%	1,29%	1,55%	-0,35%	-4,92%	0,67%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,63%	0,63%	2,31%	2,54%	3,53%	7,08%	-	-
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	0,62%	2,26%	2,46%	3,26%	6,44%	0,38%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	0,61%	2,25%	2,44%	3,30%	6,63%	0,37%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,42%	3,32%	4,57%	12,47%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,08%	-0,08%	0,80%	-0,35%	-1,33%	-38,04%	0,44%	0,02%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,11%	-0,11%	-0,38%	-5,00%	-20,76%	-78,46%	0,19%	0,17%
IRF-M (Benchmark)	-0,08%	-0,08%	3,63%	-0,03%	-1,28%	3,58%	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,32%	0,32%	2,58%	0,24%	-0,61%	-4,14%	0,61%	0,03%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.ce.gov.br/epp/validarDoc> Código do documento: 1a7d364f-b217-43ae-8582-25123220c340



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,61%	0,61%	1,72%	2,77%	3,83%	5,57%	0,00%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,65%	0,65%	1,84%	2,91%	3,86%	5,35%	0,00%	0,01%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,53%	0,53%	1,48%	2,30%	2,94%	3,37%	0,01%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,54%	0,54%	2,24%	5,63%	10,38%	15,41%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	0,39%	3,10%	3,83%	5,71%	12,72%	0,80%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,24%	0,24%	2,49%	1,09%	0,67%	4,30%	0,70%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,67%	0,67%	2,42%	0,62%	0,53%	6,39%	0,36%	0,03%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b217-43ae-8582-25123220c340



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,38%	1,38%	4,86%	11,08%	21,97%	40,75%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,32%	-0,32%	-0,93%	-1,83%	143,17%	-	0,01%	0,03%
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,26%	1,26%	4,50%	10,31%	20,31%	36,98%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,06%	-0,06%	-0,30%	-0,60%	-1,21%	-	-	0,00%
Global BDRX (Benchmark)	-9,83%	-9,83%	-8,91%	3,38%	13,57%	74,32%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-9,75%	-9,75%	-9,03%	3,11%	11,35%	71,14%	10,47%	0,18%
Ibovespa (Benchmark)	6,98%	6,98%	8,35%	-7,93%	-2,54%	-1,42%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,49%	6,49%	8,64%	-2,97%	5,03%	11,07%	8,38%	0,16%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1,12%	1,12%	-0,71%	-18,56%	-9,19%	-16,03%	9,76%	0,18%
CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,60%	0,60%	2,85%	1,77%	1,70%	7,64%	0,41%	0,02%
MSCI ACWI (Benchmark)	-8,76%	-8,76%	-8,61%	3,62%	9,17%	61,14%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-5,30%	-5,30%	-0,53%	5,52%	25,85%	39,39%	8,59%	0,14%
IFIX (Benchmark)	-0,99%	-0,99%	3,78%	-1,67%	-3,56%	-9,76%	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validarDoc> Código do documento: 1a7d364f-b217-43ae-8582-25123220340



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
HAZ FII - ATCR11	-0,26%	-0,26%	0,00%	-0,14%	1,09%	3,10%	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340



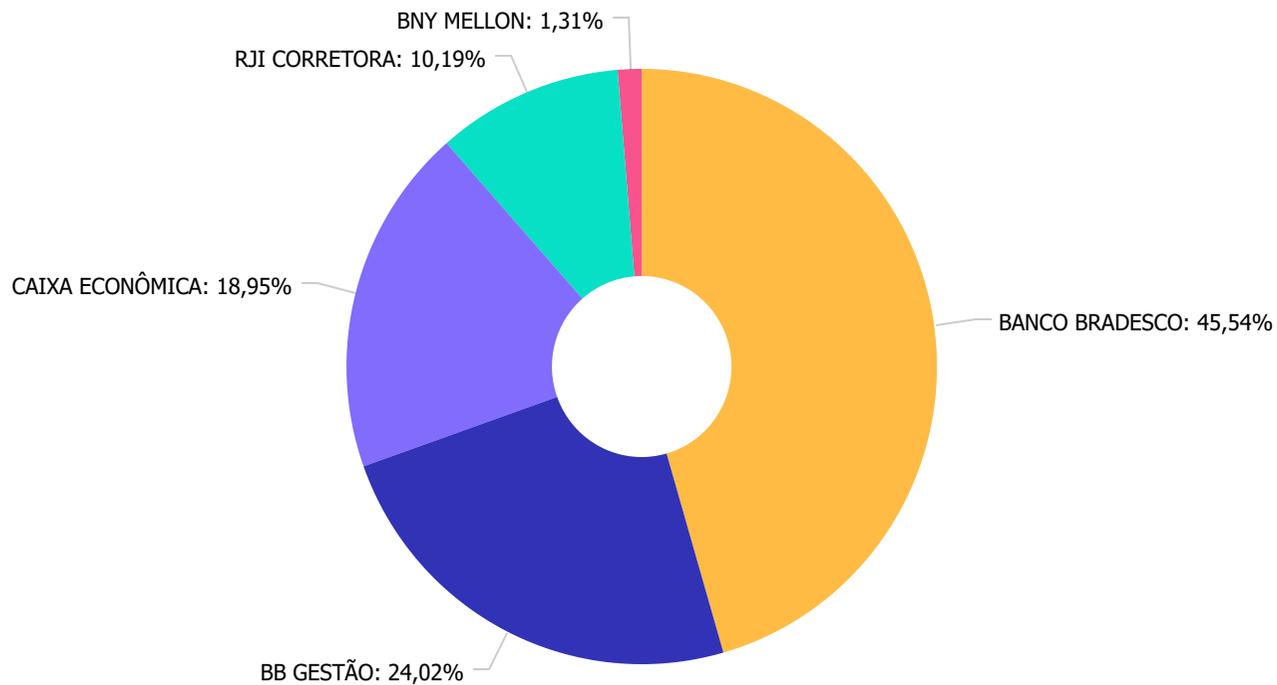
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-9,83%	-9,83%	-8,91%	3,38%	13,57%	74,32%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-9,75%	-9,75%	-9,03%	3,11%	11,35%	71,14%	10,47%	0,18%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340



Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2022)

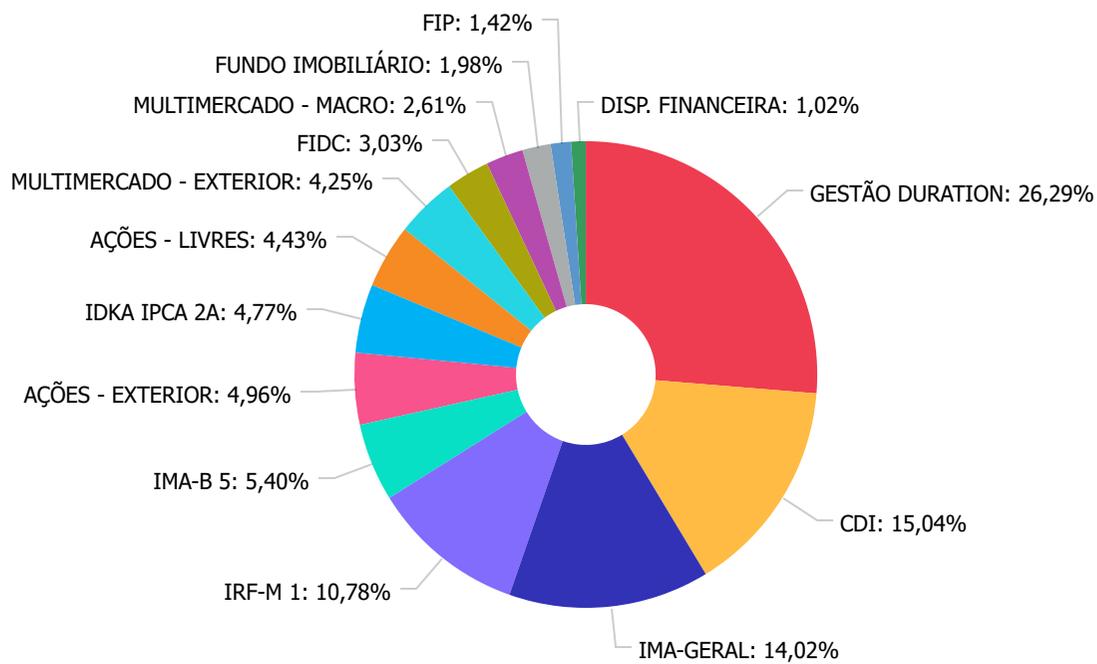


BANCO BRADESCO	26.336.700,42
BB GESTÃO	13.890.112,20
CAIXA ECONÔMICA	10.962.360,33
RJI CORRETORA	5.891.470,10
BNY MELLON	755.050,15

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam?odig=10&documento=1a26364f-b217-43ae-8582-25123220c340>



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2022)



GESTÃO DURATION	15.362.733,33
CDI	8.786.936,77
IMA-GERAL	8.193.580,22
IRF-M 1	6.296.240,33
IMA-B 5	3.157.120,55
AÇÕES - EXTERIOR	2.900.430,77
IDKA IPCA 2A	2.786.040,00
AÇÕES - LIVRES	2.590.050,11
MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.481.100,00
FIDC	1.768.150,11
MULTIMERCADO - MACRO	1.524.600,44
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.157.630,93
FIP	831.070,30
DISP. FINANCEIRA	596.169,61

Documento Assinado Digitalmente por: CHAULO MIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesso em: https://etc.ce.gov.br/pp/assinatura?idoc=seuCodigo do documento:5774364f-b274388580251220340



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum
-----	----------------	------------	----------	--------------	---------	--------------	-------------	--------------	----------	-----------	----------

⚠ ATENÇÃO! Meta de Rentabilidade de **2022** não está cadastrada !!!

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340


Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2022
FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - In
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.617.789,07	0,00	0,00	3.641.941,67	24.152,60	0,67%	0,67%	0,36
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	52.633,50	0,00	0,00	52.976,78	343,28	0,65%	0,65%	0,00
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.558.432,16	0,00	0,00	4.586.543,07	28.110,91	0,62%	0,62%	0,38
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.699.349,22	0,00	0,00	1.709.698,23	10.349,01	0,61%	0,61%	0,37
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	11.208.091,40	81.591,68	2.841.702,90	8.504.766,27	56.786,09	0,50%	0,53%	0,01
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.759.975,14	0,00	0,00	1.768.152,19	8.177,05	0,46%	0,50%	0,67
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	266.426,42	0,00	0,00	267.453,02	1.026,60	0,39%	0,39%	0,80
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.369.429,22	0,00	0,00	2.376.982,99	7.553,77	0,32%	0,32%	0,61
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	10.914.874,57	774.934,66	0,00	11.720.790,69	30.981,46	0,27%	0,24%	0,70
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,00	228.993,64	0,00	229.190,70	197,06	0,09%	0,61%	0,00
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.190.468,82	0,00	0,00	8.193.580,21	3.111,39	0,04%	0,04%	1,02
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.785.778,74	0,00	0,00	2.786.047,06	268,32	0,01%	0,01%	1,06
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	238.474,72	0,00	0,00	238.315,42	-159,30	-0,07%	-0,08%	0,44
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	274.696,99	0,00	0,00	274.373,16	-323,83	-0,12%	-0,11%	0,19
Total Renda Fixa	47.936.419,97	1.085.519,98	2.841.702,90	46.350.811,46	170.574,41	0,36%		0,57

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinatura em: https://seccat.cepe.gov.br/vpl/validador/assinatura/1674364f-b287-43e8-8562-925123220c340



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - M
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.407.677,66	0,00	0,00	1.498.971,81	91.294,15	6,49%	6,49%	8,38
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.079.018,37	0,00	0,00	1.091.082,35	12.063,98	1,12%	1,12%	9,76
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.515.481,79	0,00	0,00	1.524.601,44	9.119,65	0,60%	0,60%	0,41
HAZ FII - ATCR11	1.160.647,02	0,00	4.449,89	1.157.632,93	1.435,80	0,12%	-0,26%	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	755.513,01	0,00	0,00	755.055,83	-457,18	-0,06%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	76.254,86	0,00	0,00	76.014,47	-240,39	-0,32%	-0,32%	0,01
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.620.036,98	0,00	0,00	2.481.100,05	-138.936,93	-5,30%	-5,30%	8,59
Total Renda Variável	8.614.629,69	0,00	4.449,89	8.584.458,88	-25.720,92	-0,30%		6,77

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Assinse em: https://seccatopen.gov.br/epv/validarDocumentoCodigo do documento: 1a7d364f-b217-43ae-8582-25123220c340



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Janeiro / 2022)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.213.634,76	0,00	0,00	2.900.432,73	-313.202,03	-9,75%	-9,75%	10,47%
Total Exterior	3.213.634,76	0,00	0,00	2.900.432,73	-313.202,03	-9,75%		10,47%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinatura em: https://seccom.sp.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340



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: 1871454f-b217-43ae-8582-251122228340

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2022

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <http://etcdf-pc.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-251123220c340


Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2022)

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	8.244.053,68	13,78%	536	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.818.272,79	4,71%	1.027	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	262.966,59	0,44%	140	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.620.889,82	7,72%	245	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	319.899,26	0,53%	310	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.671.286,40	6,14%	931	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.722.090,04	2,88%	1.226	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	53.335,80	0,09%	822	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	12.592.705,16	21,05%	192	1,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	9.652.994,21	16,13%	1.457	0,44%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	239.616,43	0,40%	26	0,46%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	257.671,04	0,43%	31	0,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.774.639,77	2,97%	70	2,44%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.493.927,02	2,50%	27.275	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.063.268,92	1,78%	48.094	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.694.014,05	4,50%	530	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.535.891,87	2,57%	27	0,71%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.429.134,73	4,06%	16.268	0,08%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	754.703,16	1,26%	17	2,71%	Artigo 10º, Inciso II
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	75.737,73	0,13%	33	0,39%	Artigo 10º, Inciso II



Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.158.859,73	1,94%		1,60%	Artigo 11º
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.394.747,76	4,00%	3	24,60%	Desenquadrado - RF
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		110.702,57	0,19%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			59.830.705,96				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			110.702,57				Artigo 6º
PL Total			59.941.408,53				

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Fevereiro / 2022)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

⚠ ATENÇÃO! Política de Investimentos de **2022** não está cadastrada !!!

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 2022)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340



Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	28.402.481,06	47,47	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.935.824,80	23,29	0,00
CAIXA DTVM	10.836.424,48	18,11	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.933.499,50	4,90	1,64
MULTINVEST CAPITAL	2.394.747,76	4,00	0,23
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	754.703,16	1,26	0,15
PLURAL	333.408,77	0,56	0,01
RJI CORRETORA DE VALORES	239.616,43	0,40	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 - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://pcc.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b217-43ae-8582-25123220c340


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,72%	0,81%	1,76%	2,23%	2,73%	5,35%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,62%	0,65%	1,57%	1,65%	1,74%	4,37%	0,87%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,26%	1,31%	2,15%	4,31%	6,70%	14,12%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	1,17%	1,88%	4,11%	6,26%	13,10%	1,13%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,53%	2,65%	4,04%	9,35%	18,31%	33,07%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,37%	0,87%	1,00%	2,17%	2,78%	-3,91%	0,11%	0,01%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,74%	1,38%	2,27%	2,93%	4,26%	7,47%	-	-
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,75%	1,37%	2,23%	2,87%	4,05%	6,86%	0,32%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,73%	1,34%	2,20%	2,83%	4,03%	7,01%	0,32%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,06%	1,18%	1,97%	4,26%	6,32%	12,94%	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,75%	1,07%	1,64%	0,68%	0,37%	-4,12%	0,81%	0,03%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,55%	0,46%	0,57%	0,24%	-0,30%	-37,76%	0,35%	0,02%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-6,09%	-6,19%	-6,38%	-6,65%	-25,52%	-78,94%	10,15%	0,17%
CDI (Benchmark)	0,75%	1,49%	2,26%	3,81%	5,65%	8,15%	-	-
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,57%	1,10%	1,65%	2,66%	3,50%	3,85%	0,01%	0,01%



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,68%	1,33%	2,01%	3,30%	4,51%	5,83%	0,02%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,63%	1,25%	1,88%	3,10%	4,41%	6,00%	0,01%	0,01%
IPCA (Benchmark)	1,01%	1,56%	2,30%	5,77%	10,54%	16,29%	-	-
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,67%	0,91%	1,70%	2,28%	2,32%	4,59%	0,61%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	1,50%	2,17%	4,65%	7,36%	13,34%	0,58%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,81%	1,48%	2,32%	2,93%	1,86%	6,59%	0,35%	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: 1a7d364f-b217-43ae-8582-25123220c340


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,77%	3,18%	4,88%	11,10%	22,20%	41,88%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,36%	-0,68%	-0,98%	-1,89%	143,09%	-	0,07%	0,03%
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,67%	2,95%	4,52%	10,35%	20,53%	38,07%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,05%	-0,11%	-0,21%	-0,55%	-1,16%	-	-	0,00%
Global BDRX (Benchmark)	-6,82%	-15,98%	-14,54%	-5,81%	1,83%	72,27%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,12%	-16,17%	-14,74%	-6,50%	-0,12%	68,54%	13,05%	0,19%
Ibovespa (Benchmark)	0,89%	7,94%	11,02%	-4,75%	2,82%	8,61%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-2,55%	-1,46%	0,02%	-18,29%	-10,29%	-11,18%	5,91%	0,18%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,34%	6,13%	9,91%	-1,26%	10,01%	20,93%	6,00%	0,15%
CDI (Benchmark)	0,75%	1,49%	2,26%	3,81%	5,65%	8,15%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,74%	1,35%	2,60%	2,38%	3,14%	8,08%	0,28%	0,02%
MSCI ACWI (Benchmark)	-6,59%	-14,77%	-12,07%	-5,84%	-1,21%	55,63%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-2,09%	-7,29%	-2,13%	-0,03%	19,98%	47,75%	10,42%	0,14%
IFIX (Benchmark)	-1,29%	-2,27%	6,31%	-0,32%	-5,04%	-7,51%	-	-



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
HAZ FII - ATCR11	0,11%	-0,15%	-0,07%	-0,11%	0,73%	3,04%	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340



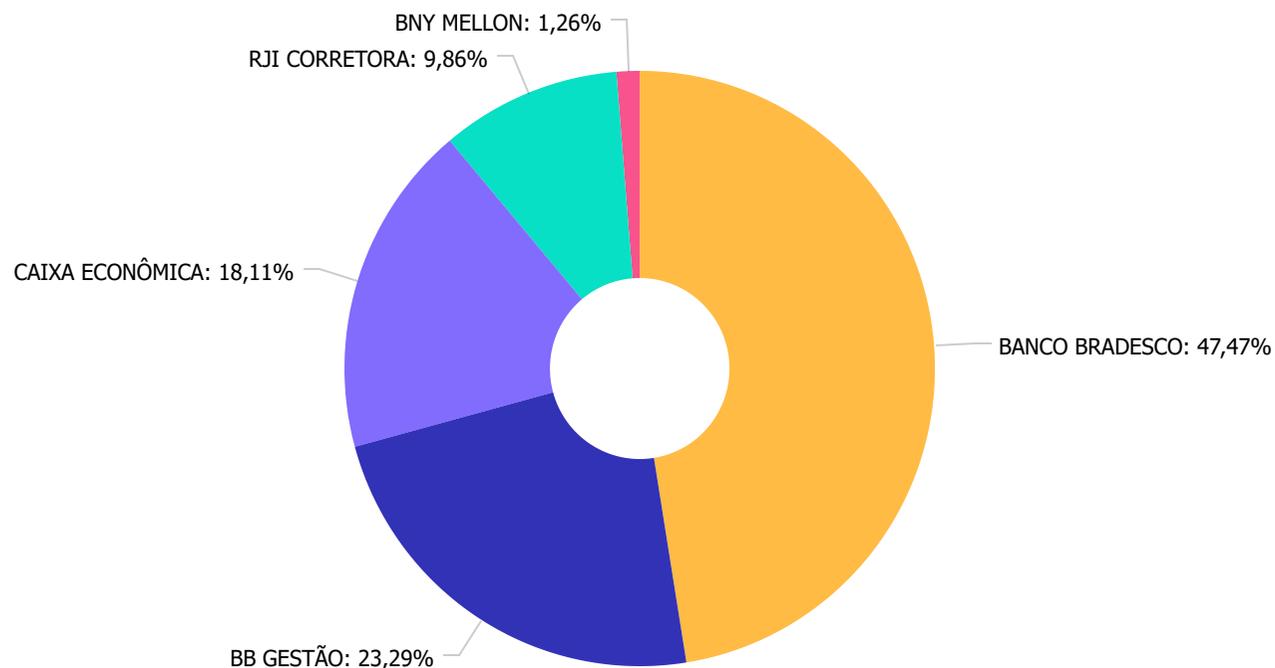
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-6,82%	-15,98%	-14,54%	-5,81%	1,83%	72,27%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,12%	-16,17%	-14,74%	-6,50%	-0,12%	68,54%	13,05%	0,19%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340



Distribuição dos ativos por Administradores - base (Fevereiro / 2022)

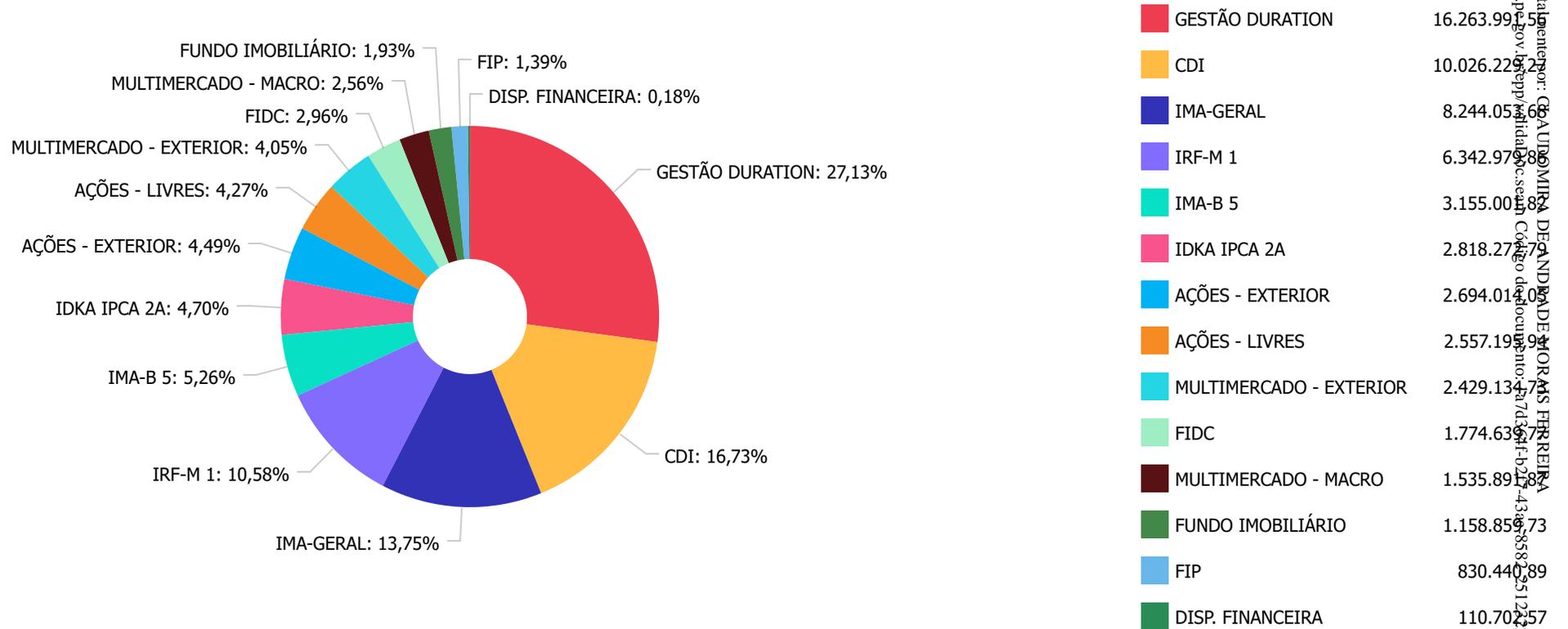


■ BANCO BRADESCO	28.402.480,00
■ BB GESTÃO	13.935.820,00
■ CAIXA ECONÔMICA	10.836.420,00
■ RJI CORRETORA	5.901.270,00
■ BNY MELLON	754.700,00

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam>
 Código de Verificação do Documento: 1a62364f-b217-43ae-8582-25123220c340



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Fevereiro / 2022)



Documento Assinado Digitalmente por: GAYLINDOMIRA DE ANDRADE FERREIRA
 Acesso em: https://etc.ce.gov.br/sepp/midat/DocAssinado/713541-17438858-0512220340



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum
-----	----------------	------------	----------	--------------	---------	--------------	-------------	--------------	----------	-----------	----------

⚠ ATENÇÃO! Meta de Rentabilidade de **2022** não está cadastrada !!!

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340


Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2022
FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.786.047,06	0,00	0,00	2.818.272,79	32.225,73	1,16%	1,16%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	267.453,02	0,00	7.408,64	262.966,59	2.922,21	1,09%	1,11%	0,58%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.641.941,67	0,00	0,00	3.671.286,40	29.344,73	0,81%	0,81%	0,35%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.586.543,07	0,00	0,00	4.620.889,82	34.346,75	0,75%	0,75%	0,32%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.376.982,99	0,00	0,00	2.394.747,76	17.764,77	0,75%	0,75%	0,81%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.709.698,23	0,00	0,00	1.722.090,04	12.391,81	0,72%	0,72%	0,32%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	52.976,78	0,00	0,00	53.335,80	359,02	0,68%	0,68%	0,02%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.720.790,69	790.459,34	0,00	12.592.705,16	81.455,13	0,65%	0,67%	0,61%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.193.580,21	0,00	0,00	8.244.053,68	50.473,47	0,62%	0,62%	0,87%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	238.315,42	0,00	0,00	239.616,43	1.301,01	0,55%	0,55%	0,35%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	8.504.766,27	3.558.667,59	2.468.919,56	9.652.994,21	58.479,91	0,48%	0,57%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	229.190,70	277.789,82	189.244,64	319.899,26	2.163,38	0,43%	0,63%	0,01%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.768.152,19	0,00	0,00	1.774.639,77	6.487,58	0,37%	0,37%	0,11%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	274.373,16	0,00	15.821,41	257.671,04	-880,71	-0,32%	-6,09%	10,15%
Total Renda Fixa	46.350.811,46	4.626.916,75	2.681.394,25	48.625.168,75	328.834,79	0,68%		0,54%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinatura em: https://seccat.ce.gov.br/vl/validador.aspx?codigo_documento=16713641-b27-43-858-2-251232200340


Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2022
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.524.601,44	0,00	0,00	1.535.891,87	11.290,43	0,74%	0,74%	0,28%
HAZ FII - ATCR11	1.157.632,93	0,00	0,00	1.158.859,73	1.226,80	0,11%	0,11%	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	755.055,83	0,00	0,00	754.703,16	-352,67	-0,05%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.498.971,81	0,00	0,00	1.493.927,02	-5.044,79	-0,34%	-0,34%	6,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	76.014,47	0,00	0,00	75.737,73	-276,74	-0,36%	-0,36%	0,07%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.481.100,05	0,00	0,00	2.429.134,73	-51.965,32	-2,09%	-2,09%	10,42%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.091.082,35	0,00	0,00	1.063.268,92	-27.813,43	-2,55%	-2,55%	5,91%
Total Renda Variável	8.584.458,88	0,00	0,00	8.511.523,16	-72.935,72	-0,85%		6,21%

 Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinado em: 2022/02/25
 URL para verificar a validade do documento: 1a7d364f-b217-43ae-8582-25123220c340


Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Fevereiro / 2022)
FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.900.432,73	0,00	0,00	2.694.014,05	-206.418,68	-7,12%	-7,12%	13,05%
Total Exterior	2.900.432,73	0,00	0,00	2.694.014,05	-206.418,68	-7,12%		13,05%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinse em: https://seccom.sp.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 1a7d364f-b217-43ae-8582-25123220c340



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:1871054f-b217-43ae-8582-251122228340>



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://eic.ice.pe.gov.br/epj/validarDoc.seam> Código do Documento: 1a7d3641-9217-438e-8582-35123220c340



IPSG

 Março/2022



<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 59.952.060,64</p>	<p>Rentabilidade</p> <p>Mês: 1,17%</p> <p>Acum.: 0,98%</p>	<p>Meta</p> <p>Mês: 2,01%</p> <p>Acum.: 4,41%</p>	<p>Gap</p> <p>Mês: -0,84%</p> <p>Acum.: -3,43%</p>	<p>VaR</p> <p>0,28%</p>
---	--	---	--	-------------------------

Evolução do Patrimônio



Comparativo (Rentabilidade | Metas)



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340

As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.



ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RF	R\$ 2.439.565,82	4.11%	D+1461	D - RF	R\$ 44.818,06	1,84%
BB TP IPCA III FI RF PREVID	R\$ 269.285,48	0.45%	D+0	7, I "b"	R\$ 6.318,89	2,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	R\$ 1.736.999,62	2.92%	D+0	7, I "b"	R\$ 14.909,58	0,87%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	R\$ 3.701.544,71	6.23%	D+0	7, I "b"	R\$ 30.258,31	0,82%
BRADESCO IRF-M 1 TP FI RF	R\$ 4.661.257,24	7.85%	D+0	7, I "b"	R\$ 40.367,42	0,86%
BB IDKA 2 TP FI RF PREVID	R\$ 2.892.116,12	4.87%	D+1	7, I "b"	R\$ 73.843,33	2,54%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	R\$ 8.354.720,52	14.07%	D+1	7, I "b"	R\$ 110.666,84	1,31%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	R\$ 413.106,63	0.70%	D+0	7, I "b"	R\$ 2.924,23	0,71%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 53.780,00	0.09%	D+0	7, III "a"	R\$ 444,20	0,83%
TOWER BRIDGE II RF FI IMA-B 5	R\$ 242.081,34	0.41%	D+1471	7, III "a"	R\$ 2.464,91	1,02%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	R\$ 257.245,76	0.43%	D+1471	7, III "a"	R\$ -425,28	-0,16%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	R\$ 13.578.854,76	22.86%	D+4	7, III "a"	R\$ 191.675,66	1,41%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RF CURTO PRAZO	R\$ 7.664.411,88	12.90%	D+0	7, III "a"	R\$ 72.364,09	0,94%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	R\$ 1.774.639,77	2.99%	D+1260	7, V "a"	R\$ 0,00	0,00%
BB MULTISSETORIAL QUANTITATIVO FIC AÇÕES	R\$ 1.569.564,94	2.64%	D+3	8, I	R\$ 75.637,92	4,82%
BB RETORNO TOTAL ESTILO FIC AÇÕES	R\$ 1.121.860,34	1.89%	D+3	8, I	R\$ 58.591,42	5,21%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	R\$ 2.583.241,77	4.35%	D+3	9, III	R\$ -110.772,28	-4,31%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	R\$ 1.550.830,61	2.61%	D+1	10, I	R\$ 14.938,74	0,97%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	R\$ 2.540.130,88	4.28%	D+1	10, I	R\$ 110.996,15	4,37%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	R\$ 754.258,60	1.27%	-	10, II	R\$ -444,56	-0,06%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	R\$ 75.497,01	0.13%	-	10, II	R\$ -240,72	-0,32%

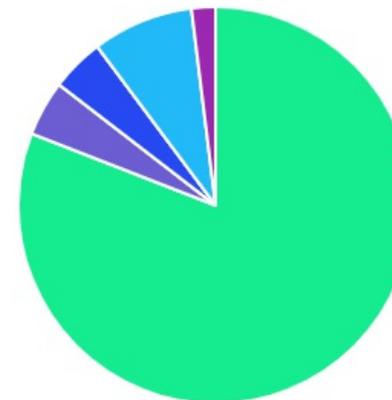


HAZ FII - ATCR11	R\$ 1.161.195,31	1.95%	11	R\$ 2.335,58	0,20%
Total investimentos	R\$ 59.396.189,11	100.00%		R\$ 741.672,49	1,23%
Disponibilidade	R\$ 555.871,46	-		-	-
Total patrimônio	R\$ 59.952.060,57	100.00%			

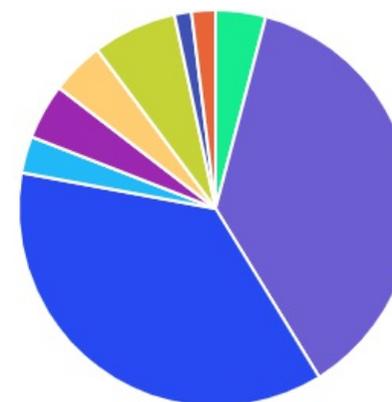
Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesso em: https://eic.eic.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340



CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	80,88%	R\$ 48.039.609,65	
Renda Variável	4,53%	R\$ 2.691.425,28	
Exterior	4,35%	R\$ 2.583.241,77	
Estruturados	8,28%	R\$ 4.920.717,10	
Fundos Imobiliários	1,95%	R\$ 1.161.195,31	
Total	100,00%	R\$ 59.396.189,11	



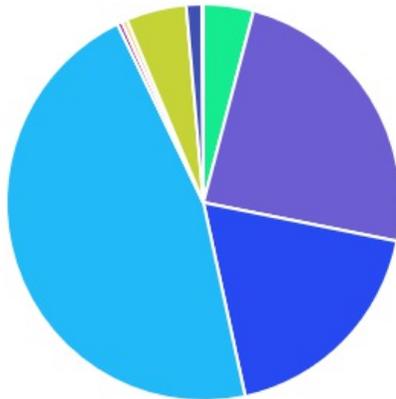
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Desenquadrado - RF	4,11%	R\$ 2.439.565,82	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	37,09%	R\$ 22.029.030,32	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	36,70%	R\$ 21.796.373,74	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	2,99%	R\$ 1.774.639,77	
Artigo 8º, Inciso I	4,53%	R\$ 2.691.425,28	
Artigo 9º, Inciso III	4,35%	R\$ 2.583.241,77	
Artigo 10º, Inciso I	6,89%	R\$ 4.090.961,49	
Artigo 10º, Inciso II	1,40%	R\$ 829.755,61	
Artigo 11º	1,95%	R\$ 1.161.195,31	
Total	100,00%	R\$ 59.396.189,11	



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b217-43ae-8582-25123220c340



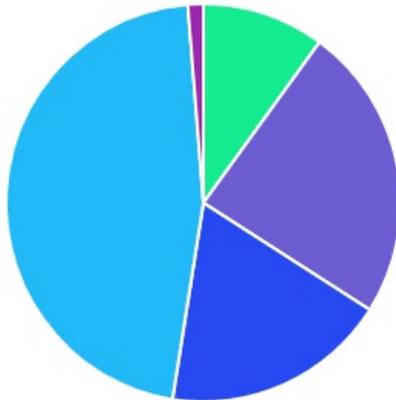
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR LEG.
MULTINVEST CAPITAL ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA	4,11%	R\$ 2.439.565,82
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	24,01%	R\$ 14.261.327,40
CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	18,48%	R\$ 10.975.023,61
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS	46,22%	R\$ 27.455.354,49
RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA	0,41%	R\$ 242.081,34
GENIAL GESTÃO LTDA.	0,43%	R\$ 257.245,76
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA.	4,94%	R\$ 2.935.835,08
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	1,27%	R\$ 754.258,60
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA.	0,13%	R\$ 75.497,01
Total	100,00%	R\$ 59.396.189,11





Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340

ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR LEG.
RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA	10,02%	R\$ 5.950.225,01
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	24,01%	R\$ 14.261.327,40
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	18,48%	R\$ 10.975.023,61
BANCO BRADESCO S.A.	46,22%	R\$ 27.455.354,49
BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A.	1,27%	R\$ 754.258,60
Total	100,00%	R\$ 59.396.189,11



As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA-B 5	4,95%	R\$ 2.938.892,92	
IPCA	27,70%	R\$ 16.452.535,62	
IRF-M 1	10,77%	R\$ 6.398.256,86	
IMA Geral ex-C	20,30%	R\$ 12.056.265,23	
IDKA IPCA 2A	4,87%	R\$ 2.892.116,12	
CDI	16,30%	R\$ 9.682.129,12	
IBOVESPA	4,53%	R\$ 2.691.425,28	
GLOBAL BDRX	4,35%	R\$ 2.583.241,77	
S&P 500	4,28%	R\$ 2.540.130,88	
IFIX	1,95%	R\$ 1.161.195,31	
Total	100,00%	R\$ 59.396.189,11	



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340

As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.



RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional – SELIC - 7, I "a"	100%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 22.029.030,32	37.09%	-	-	-
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c"	100%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Operações Compromissadas - 7, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
FI Renda Fixa - 7, III "a"	60%	R\$ 21.796.373,74	36.70%	-	-	-
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Ativos Bancários - 7, IV	20%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a"	5%	R\$ 1.774.639,77	2.99%	-	-	-
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Desenquadrado	0%	2439565.82	%			
Total Renda Fixa		R\$ 48.039.609,65	80,88%			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 2.691.425,28	4.53%	-	-	-
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Total Renda Variável		R\$ 2.691.425,28	4,53%			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
FI Renda Fixa - Dívida Externa - 9, I	10%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 1a736419217-43ae-8582-25123220340



FI Investimento no Exterior - 9, II	10%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
FI Ações – BDR Nível I - 9, III	10%	R\$ 2.583.241,77	4.35%	-	-	-
Total Investimentos no Exterior		R\$ 2.583.241,77	4,35%			

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340

As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.



FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 4.090.961,49	6.89%	-	-	-
FI em Participações - 10, II	5%	R\$ 829.755,61	1.40%	-	-	-
FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III	5%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Total Fundos Estruturados		R\$ 4.920.717,10	8,28%			
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Imobiliário - 11	5%	R\$ 1.161.195,31	1.95%	-	-	-
Total Fundos Imobiliários		R\$ 1.161.195,31	1,95%			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Total Empréstimos Consignados		R\$ 0,00	0,00%			
Total Global		R\$ 59.396.189,11	100,00%			

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam?codigo_documento=1a73364f-b217-43ae-8582-25123220c340

As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.



PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENTABILIDADE	GP
2022			IPCA + 4.79% a.a.		
Janeiro	R\$ 59.764.054,54	R\$ 57.835.703,08	0,93%	-0,28%	-12,91%
Fevereiro	R\$ 57.835.703,08	R\$ 59.830.705,99	1,40%	0,08%	-13,22%
Março	R\$ 59.830.705,99	R\$ 59.396.189,18	2,01%	1,17%	-0,84%
Total	R\$ 59.830.705,99	R\$ 59.396.189,18	21,39%	0,98%	-20,41%
2021			IPCA + 5.63% a.a.		
Janeiro	R\$ 53.139.641,34	R\$ 50.231.959,76	0,71%	-0,35%	-10,90%
Fevereiro	R\$ 50.231.959,76	R\$ 49.434.599,33	1,32%	-0,63%	-10,44%
Março	R\$ 49.434.599,33	R\$ 48.607.738,19	1,39%	0,53%	-0,80%
Abril	R\$ 48.607.738,19	R\$ 49.363.195,14	0,77%	0,84%	0,00%
Maiο	R\$ 49.363.195,14	R\$ 50.189.138,59	1,29%	0,48%	-0,88%
Junho	R\$ 50.189.138,59	R\$ 50.095.152,87	0,99%	0,23%	-0,70%
Julho	R\$ 50.095.152,87	R\$ 43.814.404,30	1,42%	-0,32%	-1,74%
Agosto	R\$ 43.814.404,30	R\$ 49.276.868,96	1,33%	-0,23%	-1,50%
Setembro	R\$ 49.276.868,96	R\$ 46.174.704,37	1,62%	-0,55%	-2,15%
Outubro	R\$ 46.174.704,37	R\$ 48.878.172,76	1,71%	-0,02%	-1,73%
Novembro	R\$ 48.878.172,76	R\$ 48.300.231,35	1,41%	0,84%	-0,57%
Dezembro	R\$ 48.300.231,35	R\$ 59.764.054,54	1,19%	1,15%	-0,03%
Total	R\$ 48.300.231,35	R\$ 59.764.054,54	16,26%	1,96%	-14,00%

Documento Assinado Digitalmente por CLAUDIO DO CARVALHO JUNIOR, Diretor de Operações, em 17/03/2023 às 14:58:52. Para mais informações, acesse em: https://efc.ace.gov.br/vpp/vpp_valido.do?docId=122320340

As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.



ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE				
		Mês (%)	Ano (%)	12 meses (%)	24 meses (%)	Início (%)
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,83%	2,18%	5,27%	-	5,52%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI LP	03.737.206/0001-97	-	-	-	-	-
BB IDKA 2 TP FI RF PREVID	13.322.205/0001-35	2,62%	3,82%	-	-	7,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	14.508.643/0001-55	0,67%	1,24%	-	-	0,83%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	1,34%	2,01%	-	-	2,82%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	23.215.097/0001-55	0,82%	2,32%	2,39%	-	2,20%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	10.740.670/0001-06	0,87%	2,22%	4,75%	-	4,35%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RF CURTO PRAZO	13.397.466/0001-14	0,65%	1,70%	3,05%	-	1,36%
CAIXA PRÁTICO FIC RF CURTO PRAZO	00.834.074/0001-23	-	-	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	17.502.937/0001-68	-4,11%	-19,62%	-7,40%	-	4,91%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	07.111.384/0001-69	-	-	-	-	-
BB TP IPCA III FI RF PREVID	19.303.795/0001-35	2,40%	3,93%	9,62%	-	9,62%
BRDESCO IRF-M 1 TP FI RF	11.484.558/0001-06	0,87%	2,26%	3,84%	-	3,44%
CAIXA ALIANÇA TP FI RF	05.164.358/0001-73	-	-	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	11.490.580/0001-69	-0,32%	-0,99%	-6,34%	-	-6,79%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	03.660.879/0001-96	-	-	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	12.440.789/0001-80	-	0,87%	2,78%	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RF	21.937.782/0001-60	1,87%	2,96%	1,93%	-	2,66%
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	21.287.421/0001-15	0,97%	2,33%	3,88%	-	3,38%
TOWER BRIDGE II RF FI IMA-B 5	23.954.899/0001-87	1,03%	1,50%	0,77%	-	0,11%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7f364f-b2f7-43ae-8582-25123220340



CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	30.036.235/0001-02	4,57%	-3,05%	-	-	12,83%
HAZ FII - ATCR11	14.631.148/0001-39	0,20%	0,05%	1,17%	-	0,94%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	28.515.874/0001-09	1,43%	2,36%	4,70%	-	2,97%
BB RETORNO TOTAL ESTILO FIC AÇÕES	09.005.805/0001-00	5,51%	3,97%	-11,61%	-	-9,59%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	15.190.417/0001-31	-0,06%	-0,17%	-1,11%	-	-1,47%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RF PREVID.	35.292.588/0001-89	-	-	-	-	-
BB MULTISSETORIAL QUANTITATIVO FIC AÇÕES	07.882.792/0001-14	5,06%	11,50%	6,30%	-	4,64%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	12.845.801/0001-37	-0,17%	-6,34%	-26,08%	-	-32,00%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: [https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validarDoc:seam/Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340](https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validarDoc:seam/Código%20do%20documento:1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340)



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://eic.ice.pe.gov.br/emp/validarDoc.seam> Código do Documento: 1a7d3641-9217-438e-8582-35123220c340



IPSG

 Abril/2022

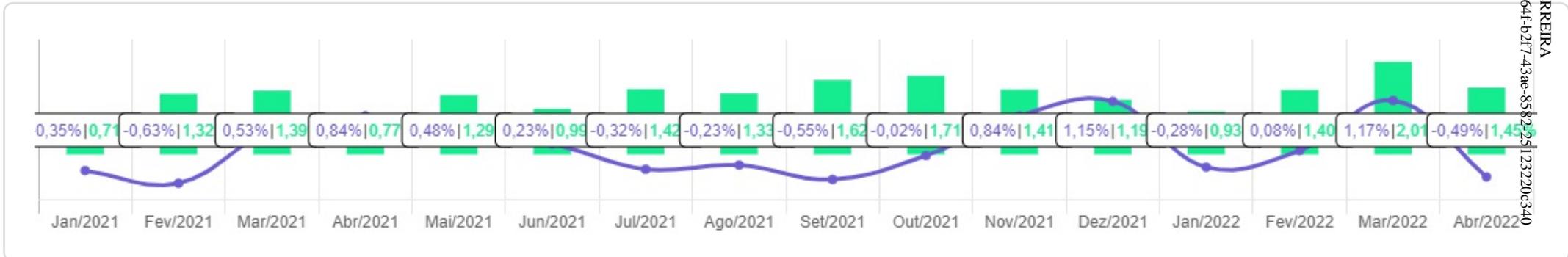


<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 61.342.360,77</p>	<p>Rentabilidade</p> <p>Mês: -0,49%</p> <p>Acum.: 2,45%</p>	<p>Meta</p> <p>Mês: 1,45%</p> <p>Acum.: 23,16%</p>	<p>Gap</p> <p>Mês: -1,94%</p> <p>Acum.: -20,71%</p>	<p>VaR</p> <p>0,28%</p>
---	---	--	---	-------------------------

Evolução do Patrimônio



Comparativo (Rentabilidade | Metas)



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam?codigo_documento:1a7d364f-b217-43ae-8562-251232200340

As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.



ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RF	R\$ 2.471.283,88	4.03%	D+1461	D - RF	R\$ 31.718,06	1,30%
BB TP IPCA III FI RF PREVID	R\$ 274.151,03	0.45%	D+0	7, I "b"	R\$ 4.865,55	1,80%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	R\$ 1.749.566,86	2.85%	D+0	7, I "b"	R\$ 12.567,24	0,72%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	R\$ 3.735.266,05	6.09%	D+0	7, I "b"	R\$ 33.721,34	0,90%
BRADESCO IRF-M 1 TP FI RF	R\$ 4.692.921,39	7.65%	D+0	7, I "b"	R\$ 31.664,15	0,68%
BB IDKA 2 TP FI RF PREVID	R\$ 2.935.031,79	4.78%	D+1	7, I "b"	R\$ 42.915,67	1,46%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	R\$ 8.405.441,89	13.70%	D+3	7, I "b"	R\$ 43.312,73	0,51%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	R\$ 243.200,59	0.40%	D+0	7, I "b"	R\$ 2.670,22	0,60%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 54.171,16	0.09%	D+0	7, III "a"	R\$ 391,16	0,72%
TOWER BRIDGE II RF FI IMA-B 5	R\$ 244.215,75	0.40%	D+1471	7, III "a"	R\$ 2.134,41	0,88%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	R\$ 261.431,88	0.43%	D+1471	7, III "a"	R\$ 4.186,12	1,59%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	R\$ 13.650.390,75	22.25%	D+4	7, III "a"	R\$ 71.535,99	0,52%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RF CURTO PRAZO	R\$ 10.175.780,72	16.59%	D+0	7, III "a"	R\$ 71.608,47	0,50%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	R\$ 1.797.013,51	2.93%	D+1260	7, V "a"	R\$ 22.373,74	0,66%
BB MULTISSETORIAL QUANTITATIVO FIC AÇÕES	R\$ 1.443.618,64	2.35%	D+3	8, I	R\$ -125.946,30	-8,06%
BB RETORNO TOTAL ESTILO FIC AÇÕES	R\$ 1.034.280,10	1.69%	D+3	8, I	R\$ -87.580,24	-7,81%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	R\$ 2.407.073,46	3.92%	D+3	9, III	R\$ -176.168,31	-6,82%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	R\$ 1.562.012,39	2.55%	D+1	10, I	R\$ 11.181,78	0,72%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	R\$ 2.319.281,61	3.78%	D+1	10, I	R\$ -220.849,27	-8,69%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	R\$ 753.877,49	1.23%	-	10, II	R\$ -381,11	-0,05%
HAZ FII - ATCR11	R\$ 1.158.453,38	1.89%	VR	11	R\$ 965,10	-0,24%



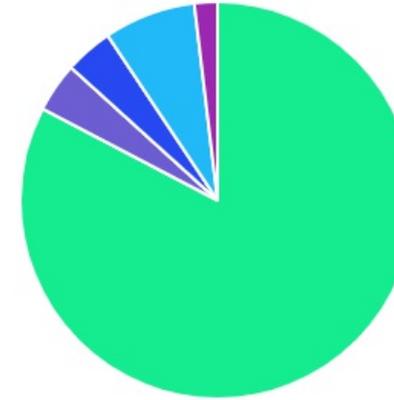
Total investimentos	R\$ 61.368.464,32	100.00%	R\$ -223.113,50	-0,36%
Disponibilidade	R\$ 568.445,45	-	-	-
Total patrimônio	R\$ 61.936.909,77	100.00%	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Assinado em: https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc;seam Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340

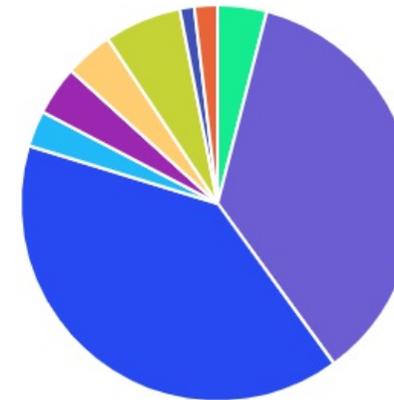
As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.



CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	82,63%	R\$ 50.689.867,25	
Renda Variável	4,04%	R\$ 2.477.898,74	
Exterior	3,92%	R\$ 2.407.073,46	
Estruturados	7,51%	R\$ 4.609.067,90	
Fundos Imobiliários	1,89%	R\$ 1.158.453,38	
Total	100,00%	R\$ 61.342.360,73	



ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Desenquadrado - RF	4,03%	R\$ 2.471.283,88	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	35,92%	R\$ 22.035.579,60	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	39,75%	R\$ 24.385.990,26	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	2,93%	R\$ 1.797.013,51	
Artigo 8º, Inciso I	4,04%	R\$ 2.477.898,74	
Artigo 9º, Inciso III	3,92%	R\$ 2.407.073,46	
Artigo 10º, Inciso I	6,33%	R\$ 3.881.294,00	
Artigo 10º, Inciso II	1,19%	R\$ 727.773,90	
Artigo 11º	1,89%	R\$ 1.158.453,38	
Total	100,00%	R\$ 61.342.360,73	

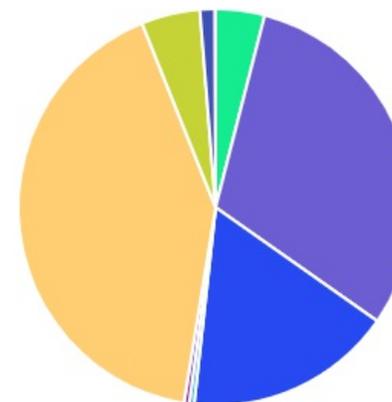


Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b217-43ae-8582-25123220c340

As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.



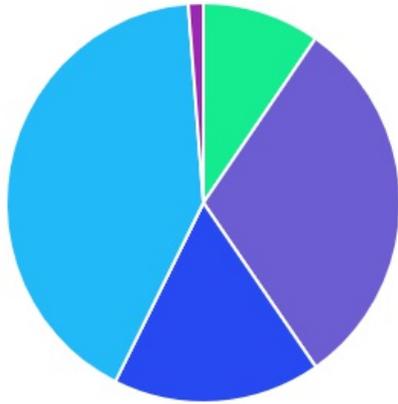
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR LEG.
MULTINVEST CAPITAL	4,03%	R\$ 2.471.283,88
BB GESTAO	30,71%	R\$ 18.839.616,00
CAIXA DISTRIBUIDORA	17,04%	R\$ 10.454.388,57
RJI CORRETORA	0,40%	R\$ 244.215,75
GENIAL GESTÃO	0,43%	R\$ 261.431,88
BRAM - BRADESCO	41,39%	R\$ 25.388.183,86
GRAPHEN INVESTIMENTOS	4,82%	R\$ 2.955.466,89
QUELUZ GESTÃO	1,23%	R\$ 753.877,49
BRPP GESTÃO	-0,04%	R\$ -26.103,59
Total	100,00%	R\$ 61.342.360,73



ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR LEG.
RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA	9,63%	R\$ 5.906.294,81
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	30,71%	R\$ 18.839.616,00
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	17,04%	R\$ 10.454.388,57
BANCO BRADESCO S.A.	41,39%	R\$ 25.388.183,86
BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A.	1,23%	R\$ 753.877,49
Total	100,00%	R\$ 61.342.360,73

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b217-43ae-8582-25123220c340

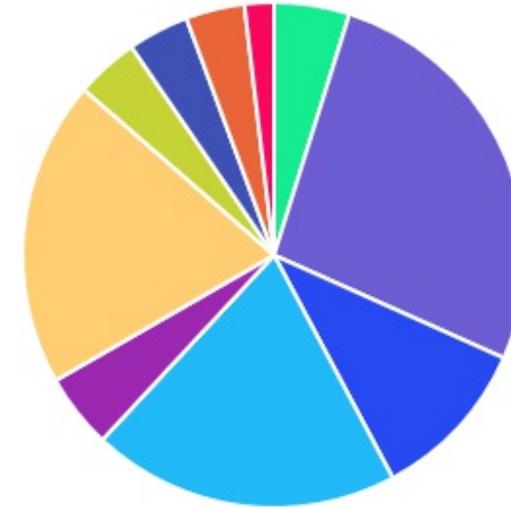
As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etc.etc.pe.gov.br/epp/validaDoc;seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA-B 5	4,85%	R\$ 2.976.931,51	
IPCA	26,82%	R\$ 16.449.329,19	
IRF-M 1	10,50%	R\$ 6.442.488,25	
IMA Geral ex-C	19,79%	R\$ 12.140.707,94	
IDKA IPCA 2A	4,78%	R\$ 2.935.031,79	
CDI	19,62%	R\$ 12.035.164,86	
IBOVESPA	4,04%	R\$ 2.477.898,74	
GLOBAL BDRX	3,92%	R\$ 2.407.073,46	
S&P 500	3,78%	R\$ 2.319.281,61	
IFIX	1,89%	R\$ 1.158.453,38	
Total	100,00%	R\$ 61.342.360,73	



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340

As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.



RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional – SELIC - 7, I "a"	100%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 22.035.579,60	35.92%	-	-	-
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c"	100%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Operações Compromissadas - 7, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
FI Renda Fixa - 7, III "a"	60%	R\$ 24.385.990,26	39.75%	-	-	-
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Ativos Bancários - 7, IV	20%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a"	5%	R\$ 1.797.013,51	2.93%	-	-	-
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Desenquadrado	0%	2471283.88	%			
Total Renda Fixa		R\$ 50.689.867,25	82,63%			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 2.477.898,74	4.04%	-	-	-
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Total Renda Variável		R\$ 2.477.898,74	4,04%			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
FI Renda Fixa - Dívida Externa - 9, I	10%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam Código do documento: 1a736419217-43ae-8582-25123220340



FI Investimento no Exterior - 9, II	10%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
FI Ações – BDR Nível I - 9, III	10%	R\$ 2.407.073,46	3.92%	-	-	-
Total Investimentos no Exterior		R\$ 2.407.073,46	3,92%			

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340



FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 3.881.294,00	6.33%	-	-	-
FI em Participações - 10, II	5%	R\$ 727.773,90	1.19%	-	-	-
FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III	5%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Total Fundos Estruturados		R\$ 4.609.067,90	7,51%			
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Imobiliário - 11	5%	R\$ 1.158.453,38	1.89%	-	-	-
Total Fundos Imobiliários		R\$ 1.158.453,38	1,89%			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0.00%	-	-	-
Total Empréstimos Consignados		R\$ 0,00	0,00%			
Total Global		R\$ 61.342.360,73	100,00%			

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam?codigoDocumento: 1a73364f-b217-43ae-8582-25123220c340

As informações deste relatório foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela LEMA, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.



PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENTABILIDADE	GP
2022			IPCA + 4.79% a.a.		
Janeiro	R\$ 59.764.054,54	R\$ 57.835.703,08	0,93%	-0,28%	-1,22%
Fevereiro	R\$ 57.835.703,08	R\$ 59.830.705,99	1,40%	0,08%	-1,32%
Março	R\$ 59.830.705,99	R\$ 59.396.189,18	2,01%	1,17%	-0,84%
Abril	R\$ 59.396.189,18	R\$ 61.342.360,77	1,45%	-0,49%	-1,04%
Total	R\$ 59.396.189,18	R\$ 61.342.360,77	23,16%	0,48%	-22,60%
2021			IPCA + 5.63% a.a.		
Janeiro	R\$ 53.139.641,34	R\$ 50.231.959,76	0,71%	-0,35%	-1,06%
Fevereiro	R\$ 50.231.959,76	R\$ 49.434.599,33	1,32%	-0,63%	-1,07%
Março	R\$ 49.434.599,33	R\$ 48.607.738,19	1,39%	0,53%	-0,88%
Abril	R\$ 48.607.738,19	R\$ 49.363.195,14	0,77%	0,84%	0,00%
Maiο	R\$ 49.363.195,14	R\$ 50.189.138,59	1,29%	0,48%	-0,81%
Junho	R\$ 50.189.138,59	R\$ 50.095.152,87	0,99%	0,23%	-0,76%
Julho	R\$ 50.095.152,87	R\$ 43.814.404,30	1,42%	-0,32%	-1,54%
Agosto	R\$ 43.814.404,30	R\$ 49.276.868,96	1,33%	-0,23%	-1,57%
Setembro	R\$ 49.276.868,96	R\$ 46.174.704,37	1,62%	-0,55%	-2,16%
Outubro	R\$ 46.174.704,37	R\$ 48.878.172,76	1,71%	-0,02%	-1,73%
Novembro	R\$ 48.878.172,76	R\$ 48.300.231,35	1,41%	0,84%	-0,57%
Dezembro	R\$ 48.300.231,35	R\$ 59.764.054,54	1,19%	1,15%	-0,03%
Total	R\$ 48.300.231,35	R\$ 59.764.054,54	16,26%	1,96%	-14,30%



ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE				
		Mês (%)	Ano (%)	12 meses (%)	24 meses (%)	Início (%)
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,73%	2,92%	5,92%	-	6,28%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI LP	03.737.206/0001-97	-	-	-	-	-
BB IDKA 2 TP FI RF PREVID	13.322.205/0001-35	1,48%	5,36%	-	-	8,59%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	14.508.643/0001-55	0,60%	1,85%	-	-	1,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	0,52%	2,53%	-	-	3,35%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	23.215.097/0001-55	0,91%	3,25%	2,64%	-	3,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF	10.740.670/0001-06	0,72%	2,96%	5,21%	-	5,10%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RF CURTO PRAZO	13.397.466/0001-14	0,56%	2,26%	3,60%	-	1,31%
CAIXA PRÁTICO FIC RF CURTO PRAZO	00.834.074/0001-23	-	-	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	17.502.937/0001-68	-6,82%	-25,10%	-14,24%	-	-2,25%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	07.111.384/0001-69	-	-	-	-	-
BB TP IPCA III FI RF PREVID	19.303.795/0001-35	1,81%	5,81%	10,79%	-	11,60%
BRDESCO IRF-M 1 TP FI RF	11.484.558/0001-06	0,68%	2,95%	4,52%	-	4,14%
CAIXA ALIANÇA TP FI RF	05.164.358/0001-73	-	-	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	11.490.580/0001-69	-134,58%	-134,23%	-132,44%	-	-132,23%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	03.660.879/0001-96	-	-	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	12.440.789/0001-80	0,66%	2,14%	3,69%	-	1,31%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RF	21.937.782/0001-60	1,30%	4,30%	3,01%	-	4,00%
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	21.287.421/0001-15	0,72%	3,07%	3,94%	-	4,13%
TOWER BRIDGE II RF FI IMA-B 5	23.954.899/0001-87	0,88%	2,39%	1,50%	-	0,99%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 1a7f364f-b2f7-43ae-8582-25123220340



CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	30.036.235/0001-02	-8,69%	-11,48%	-	-	3,02%
HAZ FII - ATCR11	14.631.148/0001-39	-0,24%	-0,18%	1,18%	-	0,70%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	28.515.874/0001-09	0,53%	2,90%	4,70%	-	3,51%
BB RETORNO TOTAL ESTILO FIC AÇÕES	09.005.805/0001-00	-7,81%	-4,15%	-24,51%	-	-16,65%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	15.190.417/0001-31	-0,05%	-0,22%	-1,06%	-	-1,52%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RF PREVID.	35.292.588/0001-89	-	-	-	-	-
BB MULTISSETORIAL QUANTITATIVO FIC AÇÕES	07.882.792/0001-14	-8,02%	2,55%	-4,64%	-	-3,75%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	12.845.801/0001-37	1,63%	-4,82%	-24,70%	-	-30,90%

Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.aspx?validaDoc=seamCodigo.do.documento:1a7d364f-b2f7-43ae-8582-25123220c340>



Documento Assinado Digitalmente por: CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://eic.ice.pe.gov.br/epj/validarDoc.seam> Código do Documento: 1a7d3641-9217-438e-8582-35123220c340



IPSG

 Maio/2022