



RISCO DE MERCADO

FUNDO	BENCHMARK	RENT. (%)		1VAR (%)		2VOL (%)		3TREYNOR		4DRAWDOWN		5SHARPE	
		MÉS	12M	MÉS	12M	MÉS	12M	MÉS	12M	MÉS	12M	MÉS	12M
CARTEIRA	=meta	1,05%	7,64%	0,13%	0,41%	0,24%	3,69%	-0,47	NaN	1,37%	1,83%	-1,87	NaN
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RF	IMA-B 5	0,57	-57,38	0,00%	53,66%	0,36%	48,02%	321,44	472,13	0,00	58,32	-1,40	-1,37
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	IMA Geral ex-C	1,88	4,01	0,00%	2,54%	1,56%	1,61%	32,34	-44,32	0,00	0,11	1,26	-1,17
BB TP IPCA III FI RF...	IPCA	1,27	10,74	0,00%	2,34%	0,12%	2,53%	4,48	-67,79	0,00	0,51	0,17	-1,21
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	IRF-M 1	1,21	11,96	0,00%	0,43%	0,42%	0,48%	1,07	-52,02	0,00	0,00	0,20	-0,90
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	IMA Geral ex-C	1,21	11,10	0,00%	1,82%	0,43%	1,33%	4,65	-49,70	0,00	0,00	0,33	-0,93
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	CDI	0,98	8,78	0,00%	0,03%	0,38%	0,29%	-15.884,62	-11.139,99	0,00	0,00	-360,57	-59,99
BRADESCO IRF-M 1 TP FI RF	IRF-M 1	1,09	12,24	0,00%	0,43%	0,40%	0,50%	0,20	-57,71	0,00	0,00	0,17	-0,99
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	IMA-B 5	1,49	4,79	0,00%	2,65%	0,15%	2,43%	11,66	-61,52	0,00	0,37	0,58	-1,37
TOWER BRIDGE II RF FI IMA-B...	IMA-B 5	0,43	3,95	0,00%	0,84%	0,17%	1,20%	-344,53	-2.093,06	0,00	0,22	-7,70	-11,53
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	IMA-B 5	-0,11	-18,57	0,00%	6,41%	0,69%	1,80%	-517,45	-1.142,88	0,11	0,67	-12,93	-1,80
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RF CURTO...	CDI	0,86	8,69	0,00%	0,05%	0,38%	0,31%	2.140,61	-18.434,13	0,00	0,00	-39,81	-53,49
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	IPCA	2,06	10,06	0,00%	3,15%	2,00%	2,02%	34,13	-44,21	0,00	0,34	1,36	-1,16
BRADESCO PREMIUM FI RF REF DI	CDI	1,16	7,98	0,00%	0,05%	0,50%	0,35%	6,33	4.309,38	0,00	0,00	-0,49	8,21
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B...	IMA-B 5	1,49	6,88	0,00%	2,66%	0,18%	2,42%	11,94	-64,39	0,00	0,36	0,59	-1,43
BB PERFIL FIC RF REF DI...	CDI	1,14	3,06	0,00%	0,09%	0,53%	0,39%	-204,56	-57,12	0,00	0,00	-0,82	-0,41
BNB INSTITUCIONAL FIC RF REF DI	CDI	1,14	2,74	0,00%	0,07%	0,40%	0,41%	62,25	-740,05	0,00	0,00	-1,71	-2,92
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	IPCA	-0,21	1,83	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-	-
BB FATORIAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	-3,71	-18,09	0,01%	22,19%	8,31%	20,29%	-5,08	-32,33	3,71	14,10	-0,96	-1,50
BB RETORNO TOTAL ESTILO FIC AÇÕES	IBOVESPA	-4,98	-19,47	0,01%	22,73%	5,36%	23,42%	-6,61	-34,95	4,98	17,75	-1,21	-1,55
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO...	125% do CDI	1,14	3,20	0,00%	0,52%	0,54%	0,64%	17,00	-84,05	0,00	0,00	-0,58	-0,03
ATICO FIC FIP FLORESTAL	IPCA	-0,06	-0,64	0,00%	0,08%	0,01%	0,07%	-159.806,74	76.525,64	0,06	0,58	-2.669,13	-182,74
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	IPCA	-0,44	-126,18	-	-	-	-	-	-	0,00	-	-	-
HAZ FII - ATCR11	IFIX	-0,00	3,10	0,00%	3,20%	0,19%	3,02%	115,89	1.506,02	0,00	0,29	-6,39	-3,28

1Var: O Value at Risk é uma medida estatística que indica a perda máxima potencial de determinado ativo ou determinada carteira em determinado período. Para o seu cálculo, utiliza-se o retorno esperado, o desvio padrão dos retornos diários e determinado nível de confiança probabilística supondo uma distribuição normal. Seu resultado pode ser interpretado como, quanto mais alto for, mais arriscado é o ativo ou a carteira. Dado o desempenho da Carteira nos últimos 12 meses, estima-se com 95% de confiança que, se houver uma perda de um dia para o outro, o prejuízo máximo será de **0,41%**.

2Volatilidade: Volatilidade é uma variável que representa a intensidade e a frequência que acontecem as movimentações do valor de um determinado ativo, dentro de um período. De uma forma mais simples, podemos dizer que volatilidade é a forma de medir a variação do ativo. Assim sendo, uma Volatilidade alta representa maior risco, visto que os preços do ativo tendem a se afastar mais de seu valor médio. Estima-se que os retornos diários da Carteira, em média, se afastam em **3,69%** do retorno diário médio dos últimos 12 meses.

3Treydor: Similar ao Sharpe, porém, utiliza o risco do mercado (Beta) no cálculo em vez da volatilidade da Carteira. A leitura é a mesma feita no sharpe, quanto maior seu valor, melhor performa o ativo ou a carteira. Valores negativos indicam que a carteira teve rentabilidade menor do que a alcançada pelo mercado. Em 12 meses, cada 100 pontos de risco a que a Carteira se expôs foram convertidos em uma rentabilidade **NaN** menor que a do mercado.

4DrawDown: Auxilia a determinar o risco de um investimento, indicando quão estável é determinado ativo, ao medir seu declínio desde o valor máximo alcançado pelo ativo, até o valor mínimo atingido em determinado



Documento Assinado Digitalmente por: JOAO GU ALBERTO COMIBE GOMES, CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://etec.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 562e40be-be42-4ffe-a297-d85db6a92bd5



ADERÊNCIA AOS BENCHMARKS

FUNDO	SALDO	BENCHMARK	MÊS	RENTABILIDADE (%)			MÊS	RENT. VS BENCHMARKS (%)		
				3M	6M	12M		3M	6M	12M
BB PERFIL FIC RF REF...	R\$ 4.451.990,13	CDI	1,14%	2,91%	-	-	96,95%	90,86%	-	66,11%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	R\$ 2.914.139,18	CDI	0,98%	2,50%	4,41%	8,78%	83,05%	78,13%	67,83%	66,11%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI...	R\$ 8.403.302,34	IMA Geral ex-C	1,21%	3,22%	5,22%	11,10%	64,35%	81,81%	94,86%	105,45%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP...	R\$ 10.856.363,26	IRF-M 1	1,21%	3,27%	5,58%	11,96%	98,37%	99,45%	85,26%	99,23%
BRADERCO PODER PÚBLICO FIC RF...	R\$ 3.849.946,96	CDI	0,86%	2,35%	4,20%	8,69%	73,36%	73,43%	64,65%	66,66%
BB IMA-B 5 FIC RF...	R\$ 5.239.646,66	IMA-B 5	1,49%	4,32%	-	-	98,04%	92,14%	-	66,66%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF...	R\$ 9.594.658,63	IMA-B 5	1,49%	4,31%	6,82%	-	98,51%	91,81%	98,71%	66,66%
BB TP IPCA III FI...	R\$ 84.017,36	IPCA	1,27%	4,04%	6,85%	10,74%	178,86%	195,39%	183,85%	239,00%
BRADERCO IRF-M 1 TP FI...	R\$ 7.459.367,77	IRF-M 1	1,09%	3,18%	6,34%	12,24%	88,61%	96,50%	96,83%	96,57%
BRADERCO PREMIUM FI RF REF...	R\$ 10.091.053,76	CDI	1,16%	3,20%	6,45%	-	98,84%	100,08%	99,23%	66,66%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	R\$ -33.192,88	IPCA	-0,44%	-19,92%	-21,60%	-126,18%	-61,37%	-962,52%	-579,59%	-2,74%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL...	R\$ 1.817.798,60	IPCA	-0,21%	-0,06%	0,36%	1,83%	-30,23%	-3,09%	9,77%	36,11%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI...	R\$ 1.039.767,83	IMA-B 5	0,57%	-8,82%	-8,15%	-57,38%	37,72%	-187,94%	-117,95%	-57,99%
BNB INSTITUCIONAL FIC RF REF...	R\$ 2.364.042,98	CDI	1,14%	2,74%	-	-	97,37%	85,62%	-	66,66%
TOWER BRIDGE II RF FI...	R\$ 251.632,09	IMA-B 5	0,43%	1,36%	3,07%	3,95%	28,61%	29,01%	44,48%	36,77%
HAZ FII - ATRC11	R\$ 1.197.215,36	IFIX	-0,00%	-0,04%	-0,00%	3,10%	0,26%	1,06%	0,05%	-22,40%
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	R\$ 2.853.131,23	IPCA	2,06%	3,57%	5,10%	10,06%	290,18%	172,50%	136,76%	216,17%
BB RETORNO TOTAL ESTILO FIC...	R\$ 903.405,93	IBOVESPA	-4,98%	-6,82%	-12,67%	-19,47%	171,53%	161,47%	103,27%	126,24%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	R\$ 749.467,63	IPCA	-0,06%	-0,16%	-0,32%	-0,64%	-8,13%	-7,77%	-8,57%	-16,83%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL...	R\$ 2.810.016,56	IMA Geral ex-C	1,88%	3,54%	-	-	99,59%	89,76%	-	66,66%
BB FATORIAL FIC AÇÕES	R\$ 1.285.706,95	IBOVESPA	-3,71%	-7,97%	-10,17%	-18,09%	127,58%	188,65%	82,85%	111,87%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA...	R\$ 209.480,79	IMA-B 5	-0,11%	-4,95%	-4,56%	-18,57%	-7,08%	-105,61%	-65,96%	-18,74%

Documento Assinado Digitalmente por: JOAO GU ALBERTO COMBE GOMES, CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://eccc.org.br/ppp/validacao>
 Código do documento: 662409e-bcd1-418e-a297-d85d6a692bd5



ADERÊNCIA Á POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

TIPO DE ATIVO	CARTEIRA (R\$)	(%)	LIM. 4.963	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO		
				INFERIOR (%)	ALVO (%)	SUPERIOR (%)
Renda Fixa						
Títulos Tesouro Nacional – SELIC	R\$ 0,00	0,00%	100,00%	0,00%	5,00%	10,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN	R\$ 37.766.853,13	45,59%	100,00%	20,00%	40,00%	50,00%
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN	R\$ 0,00	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Operações Compromissadas	R\$ 0,00	0,00%	5,00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa	R\$ 33.665.936,57	40,64%	60,00%	10,00%	30,00%	50,00%
FI de Índices Renda Fixa	R\$ 0,00	0,00%	60,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Ativos Bancários	R\$ 0,00	0,00%	20,00%	0,00%	1,00%	10,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior	R\$ 1.817.798,60	2,19%	5,00%	0,00%	1,00%	0,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado"	R\$ 0,00	0,00%	5,00%	0,00%	0,00%	4,00%
FI Debêntures	R\$ 0,00	0,00%	5,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Desenquadrado	R\$ 1.039.767,83	1,26%	0,00%	-	-	-
Renda Variável						
FI Ações	R\$ 2.189.112,88	2,64%	30,00%	0,00%	4,00%	10,00%
FI de Índices Ações	R\$ 0,00	0,00%	30,00%	0,00%	1,00%	5,00%
Desenquadrado	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	-	-	-
Exterior						
FI Renda Fixa - Dívida Externa	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Investimento no Exterior	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	0,00%	1,00%	5,00%
FI Ações – BDR Nível I	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	0,00%	4,00%	10,00%
Desenquadrado	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	-	-	-
Estruturados						
FI Multimercado - aberto	R\$ 4.442.656,89	5,36%	10,00%	0,00%	6,00%	10,00%
FI em Participações	R\$ 716.274,75	0,86%	5,00%	0,00%	2,00%	5,00%
FI "Ações - Mercado de Acesso"	R\$ 0,00	0,00%	5,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Desenquadrado	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	-	-	-
Fundos Imobiliários						
FI Imobiliário	R\$ 1.197.215,36	1,45%	5,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Desenquadrado	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	-	-	-
Emprést. Consignado						
Empréstimos Consignados	R\$ 0,00	0,00%	5,00%	0,00%	5,00%	5,00%
Desenquadrado	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	-	-	-
Imóveis						
Imóveis	R\$ 0,00	0,00%	100,00%	-	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: JOÃO GUILHERME DOS SANTOS GOMES, C/IA IDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://eccc.pec.br/epv/validaDoc.seam/CodigoDocumento:562e40be-bcd2-4ffe-a297-d85db6a92b45>

SIM



RISCO DE MERCADO

FUNDO	BENCHMARK	RENT. (%)		1VAR (%)		2VOL (%)		3TREYNOR		4DRAWDOWN		5SHARPE	
		MÊS	12M	MÊS	12M	MÊS	12M	MÊS	12M	MÊS	12M	MÊS	12M
CARTEIRA	=meta	0,84%	9,08%	0,13%	0,41%	0,23%	3,62%	-0,37	NaN	1,31%	1,83%	-1,56	NaN
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RF	IMA-B 5	0,36	-57,77	0,00%	53,66%	0,37%	46,44%	136,96	495,86	0,00	58,32	-2,07	-1,38
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	IMA Geral ex-C	1,27	5,33	0,00%	2,54%	1,05%	1,59%	12,41	-31,32	0,00	0,11	0,75	-0,80
BB TP IPCA III FI RF...	IPCA	0,51	9,33	0,00%	2,32%	1,31%	2,45%	-15,75	-101,53	0,00	0,51	-1,25	-1,81
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	IRF-M 1	0,84	12,08	0,00%	0,41%	0,64%	0,49%	-9,26	-43,21	0,00	0,00	-1,07	-0,75
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	IMA Geral ex-C	0,87	11,06	0,00%	1,81%	0,59%	1,28%	-2,74	-54,35	0,00	0,00	-0,42	-0,98
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	CDI	0,77	8,96	0,00%	0,02%	0,38%	0,30%	-8.918,82	-24.600,23	0,00	0,00	-100,01	-89,27
BRDESCO IRF-M 1 TP FI RF	IRF-M 1	0,77	12,34	0,00%	0,41%	0,66%	0,51%	-12,31	-45,64	0,00	0,00	-1,32	-0,78
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	IMA-B 5	0,89	5,73	0,00%	2,60%	1,03%	2,34%	-1,57	-72,10	0,00	0,37	-0,07	-1,57
TOWER BRIDGE II RF FI IMA-B...	IMA-B 5	0,34	3,39	0,00%	0,80%	0,16%	1,15%	182,31	-2.638,49	0,00	0,22	-14,23	-12,92
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	IMA-B 5	-0,21	-20,04	0,00%	6,10%	0,18%	1,77%	-493,98	-1.101,63	0,21	0,70	-12,01	-2,23
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RF CURTO...	CDI	0,66	8,80	0,00%	0,04%	0,38%	0,31%	925,69	-74.976,14	0,00	0,00	-42,14	-65,76
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	IPCA	1,38	10,99	0,00%	3,17%	1,18%	2,01%	12,93	-30,95	0,00	0,34	0,77	-0,79
BRDESCO PREMIUM FI RF REF DI	CDI	0,90	8,94	0,00%	0,05%	0,47%	0,38%	39,93	-7.537,40	0,00	0,00	-1,87	7,88
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B...	IMA-B 5	0,88	7,81	0,00%	2,61%	1,07%	2,32%	-2,18	-75,04	0,00	0,36	-0,12	-1,63
BB PERFIL FIC RF REF DI...	CDI	0,87	3,96	0,00%	0,08%	0,48%	0,40%	-183,96	-27,89	0,00	0,00	-4,17	-0,14
BNB INSTITUCIONAL FIC RF REF DI	CDI	0,86	3,62	0,00%	0,04%	0,49%	0,42%	413,73	6.797,35	0,00	0,00	-8,18	-3,08
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	IPCA	-0,32	0,83	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	-	-
BB FATORIAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	1,74	-9,39	0,01%	22,32%	9,44%	19,72%	0,67	-22,99	0,00	14,10	0,15	-1,06
BB RETORNO TOTAL ESTILO FIC AÇÕES	IBOVESPA	0,68	-12,06	0,01%	22,91%	9,81%	22,60%	-0,57	-26,20	0,00	17,75	-0,04	-1,15
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO...	125% do CDI	0,76	3,98	0,00%	0,52%	0,66%	0,67%	-37,03	-584,63	0,00	0,00	-2,04	-0,62
ATICO FIC FIP FLORESTAL	IPCA	-0,05	-0,64	0,00%	0,08%	0,01%	0,07%	-438.034,56	76.546,07	0,05	0,64	-2.981,00	-184,65
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	IPCA	-0,49	-24,65	-	-	-	-	-	-	0,00	-	-	-
HAZ FII - ATCR11	IFIX	0,04	3,38	0,00%	3,18%	0,07%	2,91%	181,00	1.335,90	0,00	0,29	-4,12	-3,26

1Var: O Value at Risk é uma medida estatística que indica a perda máxima potencial de determinado ativo ou determinada carteira em determinado período. Para o seu cálculo, utiliza-se o retorno esperado, o desvio padrão dos retornos diários e determinado nível de confiança probabilística supondo uma distribuição normal. Seu resultado pode ser interpretado como, quanto mais alto for, mais arriscado é o ativo ou a carteira. Dado o desempenho da Carteira nos últimos 12 meses, estima-se com 95% de confiança que, se houver uma perda de um dia para o outro, o prejuízo máximo será de **0,41%**.

2Volatilidade: Volatilidade é uma variável que representa a intensidade e a frequência que acontecem as movimentações do valor de um determinado ativo, dentro de um período. De uma forma mais simples, podemos dizer que volatilidade é a forma de medir a variação do ativo. Assim sendo, uma Volatilidade alta representa maior risco, visto que os preços do ativo tendem a se afastar mais de seu valor médio. Estima-se que os retornos diários da Carteira, em média, se afastam em **3,62%** do retorno diário médio dos últimos 12 meses.

3Treydor: Similar ao Sharpe, porém, utiliza o risco do mercado (Beta) no cálculo em vez da volatilidade da Carteira. A leitura é a mesma feita no sharpe, quanto maior seu valor, melhor performa o ativo ou a carteira. Valores negativos indicam que a carteira teve rentabilidade menor do que a alcançada pelo mercado. Em 12 meses, cada 100 pontos de risco a que a Carteira se expôs foram convertidos em uma rentabilidade **NaN** menor que a do mercado.

4DrawDown: Auxilia a determinar o risco de um investimento, indicando quão estável é determinado ativo, ao medir seu declínio desde o valor máximo alcançado pelo ativo, até o valor mínimo atingido em determinado



período de tempo. Para determinar o percentual de queda, o Draw-Down é medido desde que a desvalorização começa até se atingir um novo ponto de máximo, garantindo, dessa forma, que a mínima da série representa a maior queda ocorrida no período. Quanto mais negativo o número, maior a perda ocorrida e, conseqüentemente, maior o risco do ativo. Já um Draw-Down igual a zero, indica que não houve desvalorização do ativo ao longo do período avaliado.

⁵Sharpe: Trata-se de um indicador de performance utilizado no mercado financeiro para avaliar a relação risco-retorno de um ativo através da diferença entre o retorno do ativo e o ativo livre de risco, com o CDI sendo comumente utilizado como proxy deste, dividido pela volatilidade. Portanto, quanto maior o índice de Sharpe de um ativo, melhor a sua performance. Em 12 meses, o indicador apontou que para cada 100 pontos de risco a que a Carteira se expôs, houve uma rentabilidade **NaN** menor que aquela realizada pelo CDI.

Documento Assinado Digitalmente por: JOAO GU ALBERTO COMBE GOMES, CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Certificado de Assinatura: https://cert.br/ass/validarDoc?doc=seamCodigo_documento:562e40be-be02-4ffe-a297-d85db6a92bd5



Documento Assinado Digitalmente por: JOAO GU ALBERTO COMBE GOMES, CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
Acesse em: <https://stc.ce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 562e40be-be42-4ffe-a297-d85db6a92bd5



ADERÊNCIA AOS BENCHMARKS

FUNDO	SALDO	BENCHMARK	MÊS	RENTABILIDADE (%)			MÊS	RENT. VS BENCHMARKS (%)		
				3M	6M	12M		3M	6M	12M
BB PERFIL FIC RF REF...	R\$ 4.651.506,29	CDI	0,87%	2,86%	-	-	94,76%	92,38%	-	122,44%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	R\$ 3.214.810,96	CDI	0,77%	2,52%	4,38%	8,96%	83,87%	81,34%	68,01%	66,66%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI...	R\$ 8.476.664,28	IMA Geral ex-C	0,87%	3,08%	5,10%	11,06%	68,14%	70,73%	86,84%	92,81%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP...	R\$ 10.947.283,10	IRF-M 1	0,84%	3,04%	5,43%	12,08%	97,90%	96,19%	84,13%	90,83%
BRADERSCO PODER PÚBLICO FIC RF...	R\$ 2.895.744,50	CDI	0,66%	2,16%	4,20%	8,80%	71,35%	69,80%	65,12%	66,44%
BB IMA-B 5 FIC RF...	R\$ 5.286.488,74	IMA-B 5	0,89%	3,83%	-	-	99,09%	97,80%	-	222,44%
BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF...	R\$ 9.678.658,17	IMA-B 5	0,88%	3,81%	5,81%	-	97,03%	97,23%	97,48%	90,57%
BB TP IPCA III FI...	R\$ 84.447,66	IPCA	0,51%	3,15%	5,41%	9,33%	83,96%	143,20%	143,22%	222,44%
BRADERSCO IRF-M 1 TP FI...	R\$ 8.549.690,63	IRF-M 1	0,77%	2,85%	6,13%	12,34%	89,63%	90,14%	95,02%	90,57%
BRADERSCO PREMIUM FI RF REF...	R\$ 10.181.515,42	CDI	0,90%	2,96%	6,26%	-	97,64%	95,84%	97,16%	90,57%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	R\$ -33.354,08	IPCA	-0,49%	-1,45%	-21,47%	-24,65%	-79,61%	-65,80%	-568,23%	-58,11%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL...	R\$ 1.811.992,00	IPCA	-0,32%	-0,82%	0,11%	0,83%	-52,37%	-37,27%	3,00%	182,26%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI...	R\$ 1.043.502,42	IMA-B 5	0,36%	1,30%	-8,11%	-57,77%	39,81%	33,20%	-136,08%	-59,26%
BNB INSTITUCIONAL FIC RF REF...	R\$ 2.384.419,35	CDI	0,86%	2,95%	-	-	93,88%	95,35%	-	302,26%
TOWER BRIDGE II RF FI...	R\$ 252.488,70	IMA-B 5	0,34%	1,12%	2,40%	3,39%	37,73%	28,55%	40,30%	302,26%
HAZ FII - ATRC11	R\$ 1.197.664,31	IFIX	0,04%	0,14%	0,30%	3,38%	1,06%	7,78%	-6,70%	214,99%
BRADERSCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	R\$ 2.892.453,53	IPCA	1,38%	4,40%	5,40%	10,99%	225,94%	200,20%	142,94%	262,70%
BB RETORNO TOTAL ESTILO FIC...	R\$ 909.534,47	IBOVESPA	0,68%	-12,07%	-17,19%	-12,06%	27,11%	172,80%	171,87%	372,88%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	R\$ 749.081,74	IPCA	-0,05%	-0,16%	-0,32%	-0,64%	-8,44%	-7,23%	-8,55%	-140,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL...	R\$ 2.845.717,59	IMA Geral ex-C	1,27%	4,18%	-	-	99,16%	95,91%	-	293,88%
BB FATORIAL FIC AÇÕES	R\$ 1.308.134,72	IBOVESPA	1,74%	-10,36%	-12,42%	-9,39%	69,72%	148,33%	124,17%	293,88%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA...	R\$ 209.041,29	IMA-B 5	-0,21%	-1,14%	-4,67%	-20,04%	-23,25%	-29,06%	-78,37%	-204,77%

Documento Assinado Digitalmente por: JOAO GU ALBERTO COMBE GOMES, CLAUDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://etecidp2021brapp/validacao/622409e-bcd41f0-a297-d85d6a692bd5>



ADERÊNCIA Á POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

TIPO DE ATIVO	CARTEIRA (R\$)	(%)	LIM. 4.963	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO		
				INFERIOR (%)	ALVO (%)	SUPERIOR (%)
Renda Fixa						
Títulos Tesouro Nacional – SELIC	R\$ 0,00	0,00%	100,00%	0,00%	5,00%	10,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN	R\$ 39.405.102,96	46,90%	100,00%	20,00%	40,00%	50,00%
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN	R\$ 0,00	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Operações Compromissadas	R\$ 0,00	0,00%	5,00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa	R\$ 33.145.827,25	39,45%	60,00%	10,00%	30,00%	50,00%
FI de Índices Renda Fixa	R\$ 0,00	0,00%	60,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Ativos Bancários	R\$ 0,00	0,00%	20,00%	0,00%	1,00%	10,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior	R\$ 1.811.992,00	2,16%	5,00%	0,00%	1,00%	0,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado"	R\$ 0,00	0,00%	5,00%	0,00%	0,00%	4,00%
FI Debêntures	R\$ 0,00	0,00%	5,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Desenquadrado	R\$ 1.043.502,42	1,24%	0,00%	-	-	-
Renda Variável						
FI Ações	R\$ 2.217.669,19	2,64%	30,00%	0,00%	4,00%	10,00%
FI de Índices Ações	R\$ 0,00	0,00%	30,00%	0,00%	1,00%	5,00%
Desenquadrado	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	-	-	-
Exterior						
FI Renda Fixa - Dívida Externa	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Investimento no Exterior	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	0,00%	1,00%	5,00%
FI Ações – BDR Nível I	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	0,00%	4,00%	10,00%
Desenquadrado	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	-	-	-
Estruturados						
FI Multimercado - aberto	R\$ 4.476.235,19	5,33%	10,00%	0,00%	6,00%	10,00%
FI em Participações	R\$ 715.727,66	0,85%	5,00%	0,00%	2,00%	5,00%
FI "Ações - Mercado de Acesso"	R\$ 0,00	0,00%	5,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Desenquadrado	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	-	-	-
Fundos Imobiliários						
FI Imobiliário	R\$ 1.197.664,31	1,43%	5,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Desenquadrado	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	-	-	-
Emprést. Consignado						
Empréstimos Consignados	R\$ 0,00	0,00%	5,00%	0,00%	5,00%	5,00%
Desenquadrado	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	-	-	-
Imóveis						
Imóveis	R\$ 0,00	0,00%	100,00%	-	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: JOÃO GUILHERME DOS SANTOS GOMES, C/IA IDOMIRA DE ANDRADE MORAIS FERREIRA
 Acesse em: <https://eccc.pec.br/epv/validaDoc.seam?codigoDocumento=562e40be-bcd2-4ffe-a297-d85db6a92b45>

SIM