

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <http://etcpe-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



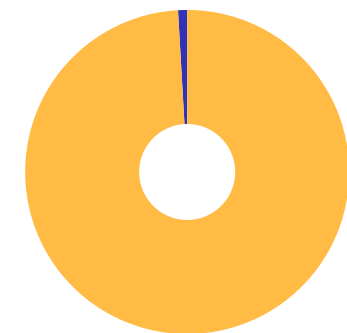
Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	9.686.034,37	14,14%	591	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	536.168,04	0,78%	926	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	12.200.627,56	17,81%	1.212	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	916.199,30	1,34%	112	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.545.218,05	12,47%	699	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	9.598.234,48	14,01%	1.348	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.655.267,18	11,18%	59	2,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	10.904.176,28	15,92%	634	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.843.135,30	11,45%	417	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	420.695,59	0,61%	901	0,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNB FI MULTIMERCADO LP	D+3 du	Não há	196.451,71	0,29%	228	3,41%	Artigo 8º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		977.719,09	1,43%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			68.502.207,86				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			977.719,09	Artigo 6º			
PL Total			69.479.926,95				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	68.502.207,86
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	41.482.481,80	60,56%	50,00%	62,00%	100,00%	27.019.726,06
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	20.550.662,36
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.425.110,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	13.700.441,57
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	41.101.324,72
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	26.402.578,76	38,54%	0,00%	33,00%	40,00%	998.304,38
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	27.400.883,14
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	13.700.441,57
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	10.275.331,18
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	10.275.331,18
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.425.110,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.425.110,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.425.110,39
Total Renda Fixa	100,00%	67.885.060,56	99,10%	50,00%	95,00%	460,00%	



RENTA FIXA 67.885.060,56
RENTA VARIÁVEL 617.147,30

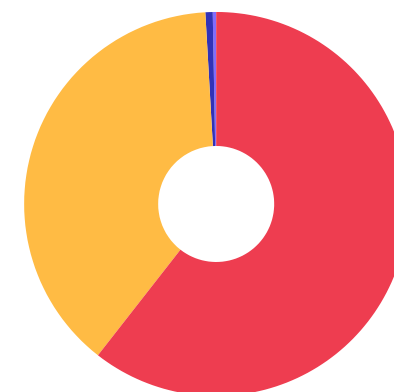
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afc7-3b85229d2c91



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	20.550.662,36
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	20.550.662,36
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	420.695,59	0,61%	0,00%	4,00%	6,00%	3.689.436,88
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	13.700.441,57
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	196.451,71	0,29%	0,00%	1,00%	2,00%	1.173.592,45
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.425.110,39
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.425.110,39
Total Renda Variável	30,00%	617.147,30	0,90%	0,00%	5,00%	98,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.850.220,79
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	1.370.044,16
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.850.220,79
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	22,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/pp/va/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	31.884.247,32	46,54	0,00
CAIXA DTVM	28.345.546,06	41,38	-
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	8.272.414,48	12,08	0,11

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Documento Assinado Digitalmente por: CARLOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: https://www.cvm.gov.br/validarassinatura/validarassinatura.do?documento=621d043b-12b1-40ff-ae7-2b55229d2691



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,44%	-0,44%	2,38%	0,96%	3,87%	15,36%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,55%	-0,55%	2,68%	0,93%	4,00%	15,84%	1,42%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,15%	0,15%	3,16%	4,28%	8,20%	20,12%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	0,18%	3,07%	4,24%	7,69%	18,77%	0,95%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-1,39%	-1,39%	2,09%	-0,60%	5,77%	20,12%	-	-
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,33%	-1,33%	2,16%	-0,83%	5,26%	-	2,53%	0,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,04%	0,04%	0,58%	1,02%	3,43%	10,27%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,03%	0,03%	0,54%	0,79%	3,07%	9,59%	0,15%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,03%	0,03%	0,53%	0,90%	3,22%	9,83%	0,15%	0,01%
IRF-M (Benchmark)	-0,80%	-0,80%	1,50%	-0,15%	4,92%	16,95%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,80%	-0,80%	1,50%	-0,30%	4,65%	16,40%	1,53%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,17%	0,17%	0,49%	0,54%	1,92%	-	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,16%	0,16%	0,68%	0,95%	2,20%	7,87%	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,20%	0,20%	0,55%	0,63%	2,27%	8,16%	0,03%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice-pe.gov.br/epyp/validarDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



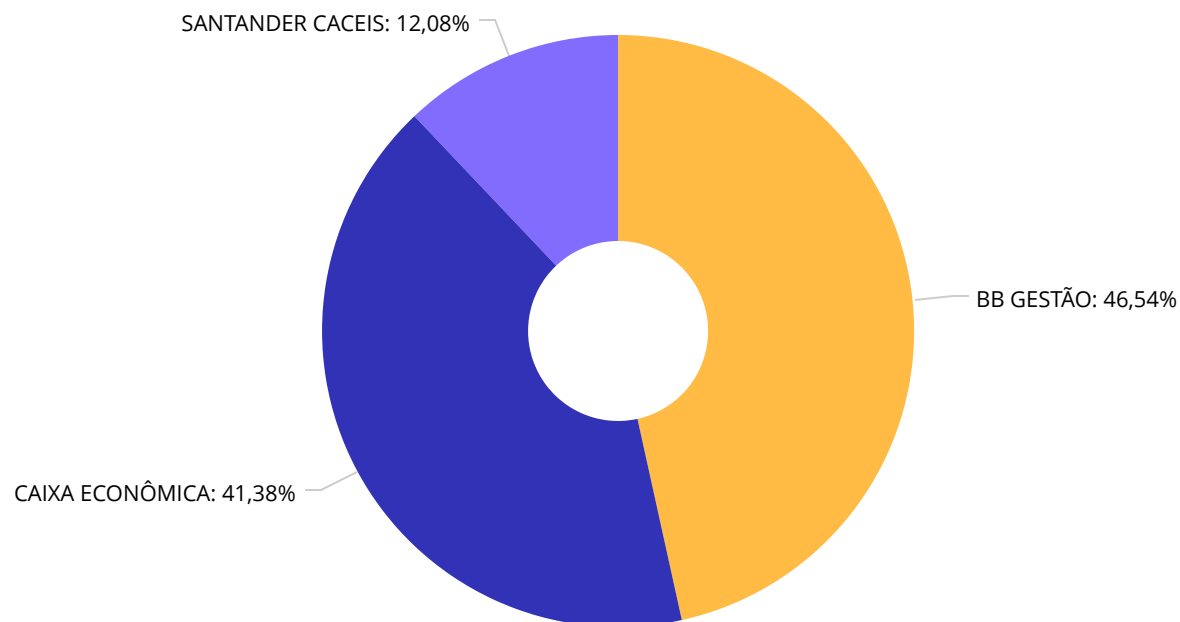
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-3,32%	-3,32%	22,47%	11,81%	1,15%	18,15%	-	-
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	-3,00%	-3,00%	18,14%	6,27%	10,44%	29,14%	10,25%	0,34%
CDI (Benchmark)	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
BNB FI MULTIMERCADO LP	0,10%	0,10%	1,57%	-0,16%	2,61%	7,90%	0,95%	-

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.itec.pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



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

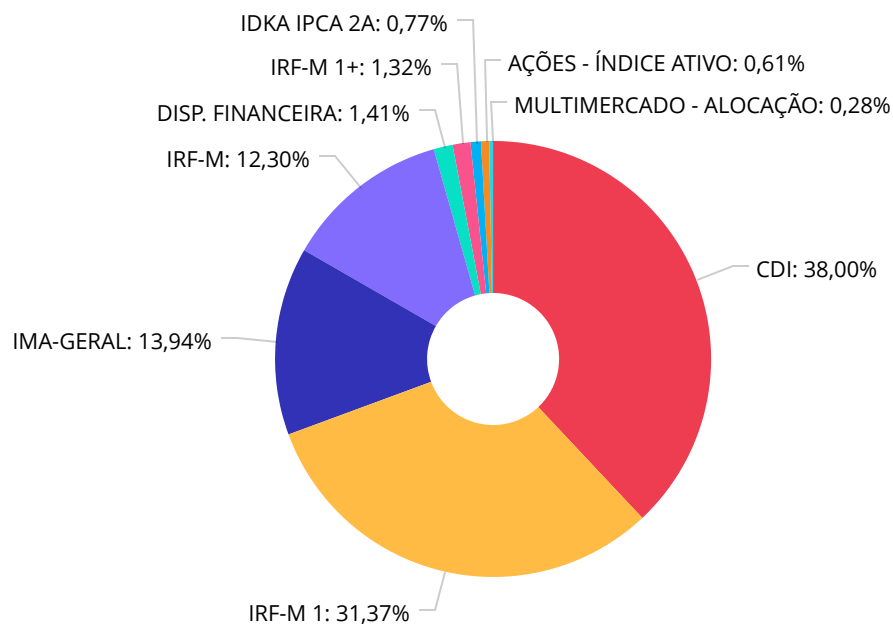


BB GESTÃO	31.884.243,73
CAIXA ECONÔMICA	28.345.540,00
SANTANDER CACEIS	8.272.411,48

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afc7-3b85229d2c91



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



CDI	26.402.577,77
IRF-M 1	21.798.860,00
IMA-GERAL	9.686.030,33
IRF-M	8.545.210,00
DISP. FINANCEIRA	977.710,00
IRF-M 1+	916.190,30
IDKA IPCA 2A	536.160,04
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	420.690,59
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	196.451,71

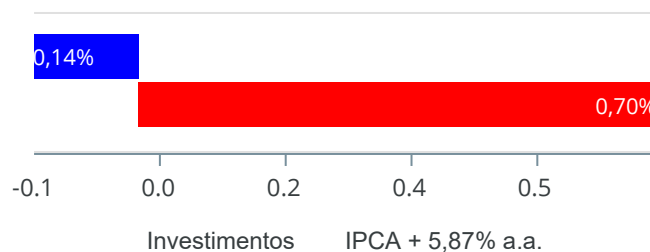
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validarDocumento>
Código do documento: 6780049102b140ff-afc7-3b85229d2c91



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	Variável
Janeiro	68.596.497,97	0,00	0,00	68.502.207,86	-94.290,11	-94.290,11	-0,14%	-0,14%	0,70%	0,70%	-19,50%	0,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://pccs.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91

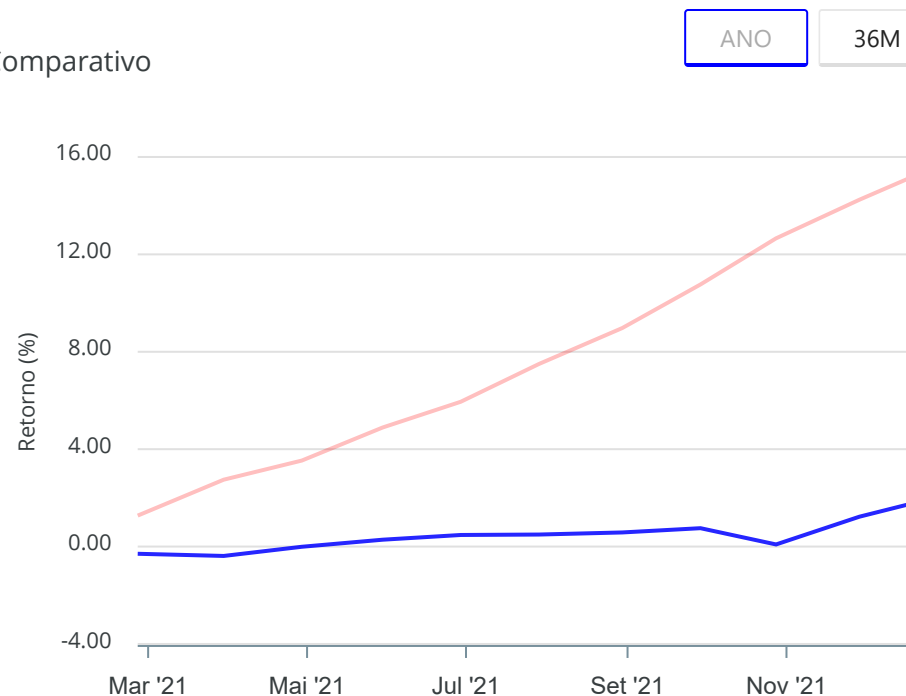


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b0f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.827.407,03	0,00	0,00	7.843.135,30	15.728,27	0,20%	0,20%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	535.220,75	0,00	0,00	536.168,04	947,29	0,18%	0,18%	0,95%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.642.289,93	0,00	0,00	7.655.267,18	12.977,25	0,17%	0,17%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.886.577,47	0,00	0,00	10.904.176,28	17.598,81	0,16%	0,16%	0,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	12.196.796,79	0,00	0,00	12.200.627,56	3.830,77	0,03%	0,03%	0,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.595.814,45	0,00	0,00	9.598.234,48	2.420,03	0,03%	0,03%	0,15%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.739.832,85	0,00	0,00	9.686.034,37	-53.798,48	-0,55%	-0,55%	1,42%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.614.024,12	0,00	0,00	8.545.218,05	-68.806,07	-0,80%	-0,80%	1,53%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	928.587,90	0,00	0,00	916.199,30	-12.388,60	-1,33%	-1,33%	2,53%
Total Renda Fixa	67.966.551,29	0,00	0,00	67.885.060,56	-81.490,73	-0,12%		0,50%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://secreto.gov.br/app/validacao.aspx?codigo=671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BNB FI MULTIMERCADO LP	196.256,69	0,00	0,00	196.451,71	195,02	0,10%	0,10%	0,95%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	433.689,99	0,00	0,00	420.695,59	-12.994,40	-3,00%	-3,00%	10,25%
Total Renda Variável	629.946,68	0,00	0,00	617.147,30	-12.799,38	-2,03%		7,29%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://etce.tec.pe.gov.br/pp/vaidadoc.seam Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



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: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tee.pb.gov.br/app/qualificaDoc/seam> Código do Documento: 67140696-b2b1-4016-b0fc-7-3b852299cc91

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.cfp-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



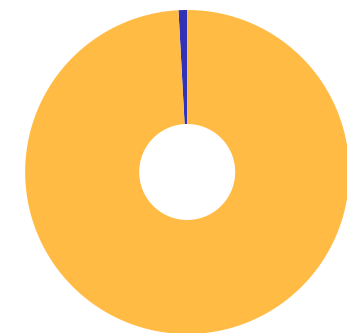
Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	9.597.510,20	13,74%	598	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	533.228,56	0,76%	933	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	12.201.142,62	17,47%	1.211	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	898.783,83	1,29%	103	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.443.480,27	12,09%	692	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	9.799.870,42	14,03%	1.341	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.660.597,25	10,97%	60	1,98%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	11.462.810,05	16,41%	630	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.649.073,74	12,38%	447	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	403.190,87	0,58%	910	0,60%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNB FI MULTIMERCADO LP	D+3 du	Não há	195.391,08	0,28%	229	3,47%	Artigo 8º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		74.840,16	0,11%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			69.845.078,89				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			74.840,16	Artigo 6º			
PL Total			69.919.919,05				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	69.845.078,89
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	41.474.015,90	59,38%	50,00%	62,00%	100,00%	28.371.062,99
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	20.953.523,67
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.492.253,94
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	13.969.015,78
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	41.907.047,33
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	27.772.481,04	39,76%	0,00%	33,00%	40,00%	165.550,52
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	27.938.031,56
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	13.969.015,78
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	10.476.761,83
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	10.476.761,83
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.492.253,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.492.253,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.492.253,94
Total Renda Fixa	100,00%	69.246.496,94	99,14%	50,00%	95,00%	460,00%	



RENDA FIXA 69.246.496,94
RENDA VARIÁVEL 598.581,95

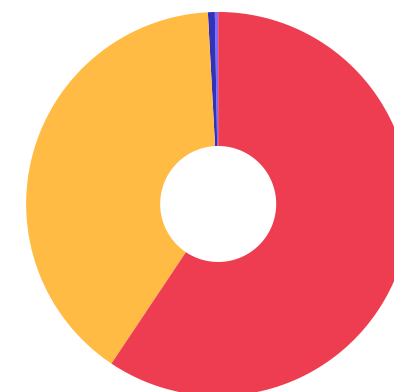
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	20.953.523,67
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	20.953.523,67
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	403.190,87	0,58%	0,00%	4,00%	6,00%	3.787.513,86
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	13.969.015,78
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	195.391,08	0,28%	0,00%	1,00%	2,00%	1.201.510,50
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.492.253,94
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.492.253,94
Total Renda Variável	30,00%	598.581,95	0,86%	0,00%	5,00%	98,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.984.507,89
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	1.396.901,58
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.984.507,89
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	22,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	31.674.145,48	45,35	-
CAIXA DTVM	29.911.754,21	42,83	-
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	8.259.179,20	11,82	-

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Documento Assinado Digitalmente por: CARLOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: https://www.cvm.gov.br/validarassinatura/validarassinatura.do?documento=6210043b-12b1-40ff-8c7-3b55239d2691



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,83%	-1,26%	0,83%	0,82%	2,55%	13,91%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,91%	-1,46%	0,88%	0,90%	2,59%	14,34%	1,11%	0,05%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,48%	-0,33%	1,40%	2,72%	6,95%	18,92%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,55%	-0,37%	1,15%	2,96%	6,43%	17,41%	1,09%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-2,01%	-3,37%	-0,43%	-1,48%	2,82%	17,44%	-	-
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,90%	-3,21%	-0,22%	-1,48%	2,46%	-	1,70%	0,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,04%	0,08%	0,39%	0,94%	3,08%	9,80%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,04%	0,35%	0,70%	2,71%	9,12%	0,10%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,02%	0,04%	0,33%	0,82%	2,87%	9,36%	0,10%	0,01%
IRF-M (Benchmark)	-1,18%	-1,97%	-0,06%	-0,58%	3,01%	15,23%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,19%	-1,98%	-0,05%	-0,68%	2,76%	14,70%	1,02%	0,04%
CDI (Benchmark)	0,13%	0,28%	0,45%	0,92%	2,36%	8,07%	-	-
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,07%	0,24%	0,49%	0,47%	1,75%	-	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08%	0,24%	0,60%	0,88%	2,00%	7,44%	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,08%	0,28%	0,53%	0,56%	2,05%	7,73%	0,03%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.gov.br/epyp/validadoc/seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
--	-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



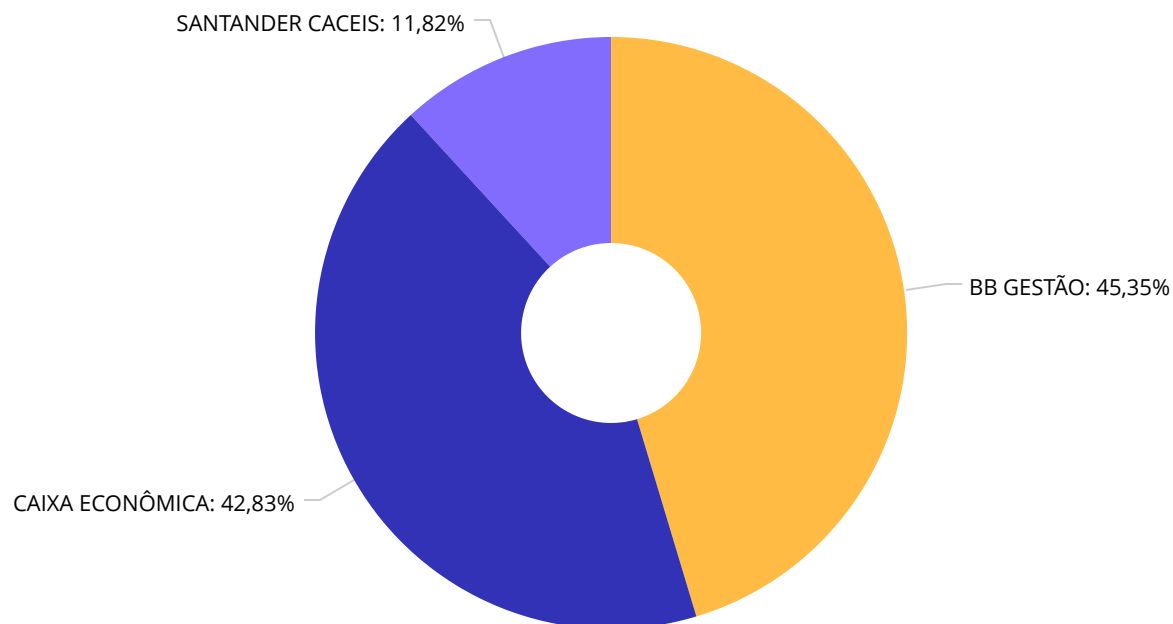
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-4,37%	-7,55%	1,05%	10,73%	5,63%	15,12%	-	-
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	-4,16%	-7,03%	-0,37%	5,91%	10,85%	24,15%	11,24%	0,34%
CDI (Benchmark)	0,13%	0,28%	0,45%	0,92%	2,36%	8,07%	-	-
BNB FI MULTIMERCADO LP	-0,54%	-0,44%	0,24%	-0,17%	2,34%	6,98%	0,98%	-

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice-pe.gov.br/ep/vai/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



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

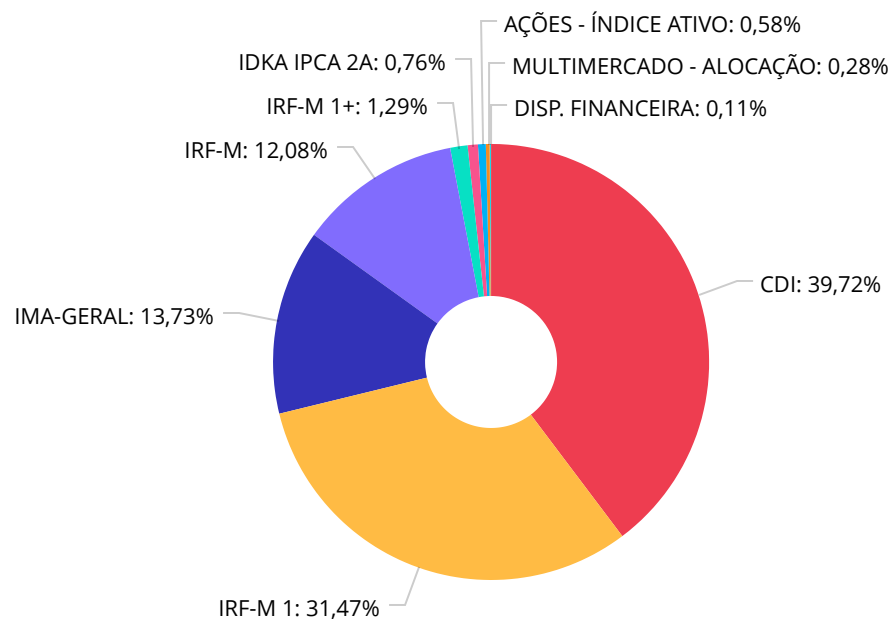


BB GESTÃO	31.674.144,44
CAIXA ECONÔMICA	29.911.755,22
SANTANDER CACEIS	8.259.170,20

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



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



CDI	27.772.480,00
IRF-M 1	22.001.010,00
IMA-GERAL	9.597.512,22
IRF-M	8.443.482,22
IRF-M 1+	898.788,88
IDKA IPCA 2A	533.220,56
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	403.190,87
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	195.390,08
DISP. FINANCEIRA	74.841,16

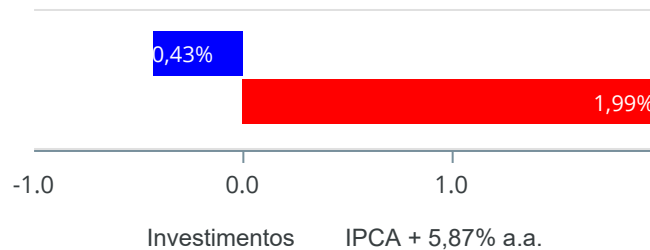
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validarDocumento.aspx?CodigoDocumento=6780491402b1e0ff-afc7-3b85229d2c91>



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V.R.
Janeiro	68.596.497,97	0,00	0,00	68.502.207,86	-94.290,11	-94.290,11	-0,14%	-0,14%	0,70%	0,70%	-19,50%	0,56%
Fevereiro	68.502.207,86	2.000.000,00	450.000,00	69.845.078,89	-207.128,97	-301.419,08	-0,30%	-0,43%	1,27%	1,99%	-21,79%	0,29%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://pcc.ic.gov.br/ppv/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



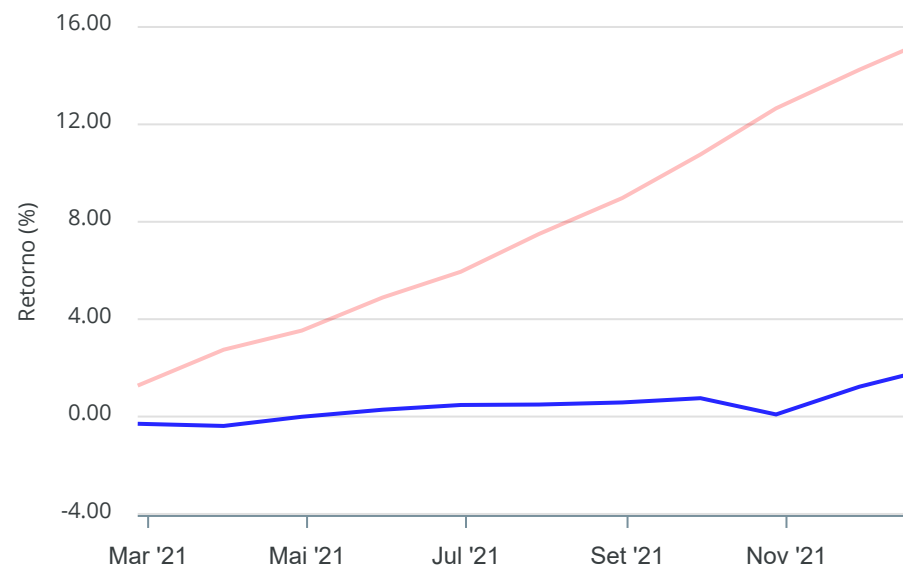
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b0f-a1c7-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.904.176,28	1.000.000,00	450.000,00	11.462.810,05	8.633,77	0,07%	0,08%	0,02%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.655.267,18	0,00	0,00	7.660.597,25	5.330,07	0,07%	0,07%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.843.135,30	800.000,00	0,00	8.649.073,74	5.938,44	0,07%	0,07%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.598.234,48	200.000,00	0,00	9.799.870,42	1.635,94	0,02%	0,02%	0,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	12.200.627,56	0,00	0,00	12.201.142,62	515,06	0,00%	0,00%	0,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	536.168,04	0,00	0,00	533.228,56	-2.939,48	-0,55%	-0,55%	1,09%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.686.034,37	0,00	0,00	9.597.510,20	-88.524,17	-0,91%	-0,91%	1,11%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.545.218,05	0,00	0,00	8.443.480,27	-101.737,78	-1,19%	-1,19%	1,02%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	916.199,30	0,00	0,00	898.783,83	-17.415,47	-1,90%	-1,90%	1,70%
Total Renda Fixa	67.885.060,56	2.000.000,00	450.000,00	69.246.496,94	-188.563,62	-0,27%		0,35%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://seccapoe.gov.br/app/validadoc.aspx?codigo_documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BNB FI MULTIMERCADO LP	196.451,71	0,00	0,00	195.391,08	-1.060,63	-0,54%	-0,54%	0,98%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	420.695,59	0,00	0,00	403.190,87	-17.504,72	-4,16%	-4,16%	11,24%
Total Renda Variável	617.147,30	0,00	0,00	598.581,95	-18.565,35	-3,01%		7,89%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://etec.ce.gov.br/pp/vaidadoc/seam Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tee.pe.gov.br/app/qualificaDoc/seam> Código do Documento: 67140696-b2b1-4016-b0fc7-3b852799cc91

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <http://etcpe.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



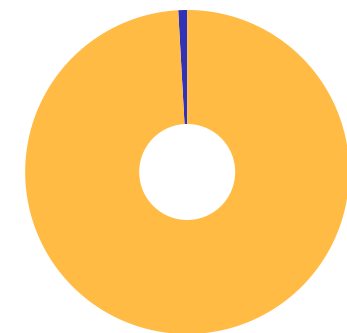
Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	9.557.090,78	13,47%	607	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	535.201,64	0,75%	946	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	12.203.194,32	17,20%	1.205	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	885.268,77	1,25%	101	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.371.408,12	11,80%	682	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.695.809,23	2,39%	917	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	9.800.770,10	13,81%	1.345	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.670.302,43	10,81%	59	1,96%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	11.474.146,32	16,17%	630	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.132.303,64	11,46%	455	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	431.263,14	0,61%	910	0,60%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNB FI MULTIMERCADO LP	D+3 du	Não há	195.416,29	0,28%	226	3,33%	Artigo 8º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		896.363,35	1,26%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			70.952.174,78				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			896.363,35	Artigo 6º			
PL Total			71.848.538,13				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	70.952.174,78
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	43.048.742,96	60,67%	50,00%	62,00%	100,00%	27.903.431,82
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	21.285.652,43
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.547.608,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	14.190.434,96
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	42.571.304,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	27.276.752,39	38,44%	0,00%	33,00%	40,00%	1.104.117,52
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	28.380.869,91
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	14.190.434,96
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	10.642.826,22
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	10.642.826,22
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.547.608,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.547.608,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.547.608,74
Total Renda Fixa	100,00%	70.325.495,35	99,12%	50,00%	95,00%	460,00%	



RENTA FIXA 70.325.495,35
RENTA VARIÁVEL 626.679,43

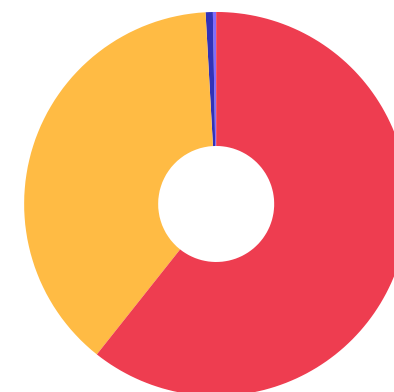
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	21.285.652,43
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	21.285.652,43
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	431.263,14	0,61%	0,00%	4,00%	6,00%	3.825.867,35
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	14.190.434,96
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	195.416,29	0,28%	0,00%	1,00%	2,00%	1.223.627,21
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.547.608,74
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.547.608,74
Total Renda Variável	30,00%	626.679,43	0,88%	0,00%	5,00%	98,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.095.217,48
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	1.419.043,50
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.095.217,48
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	22,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



Enquadramento por Gestores - base (Março / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	31.552.163,63	44,47	0,00
CAIXA DTVM	31.103.029,29	43,84	-
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	8.296.981,86	11,69	0,11

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Documento Assinado Digitalmente por: CARLOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: https://repositorio.cepa.br/handle/documento/62100430-1201-40ff-8c7-3085229d2691



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,38%	-1,64%	-1,64%	1,15%	4,18%	12,86%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,42%	-1,88%	-1,88%	1,24%	4,35%	13,27%	1,70%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,29%	-0,05%	-0,05%	3,00%	8,57%	18,47%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,37%	0,00%	0,00%	3,22%	8,63%	17,08%	1,69%	0,02%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-1,45%	-4,77%	-4,77%	-2,02%	1,81%	15,01%	-	-
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,50%	-4,67%	-4,67%	-1,83%	1,36%	13,97%	3,19%	0,06%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,04%	0,13%	0,13%	0,83%	2,51%	9,33%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,02%	0,05%	0,05%	0,68%	2,12%	8,66%	0,21%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,01%	0,05%	0,05%	0,70%	2,27%	8,88%	0,21%	0,00%
IRF-M (Benchmark)	-0,84%	-2,80%	-2,80%	-0,87%	2,25%	13,59%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,85%	-2,82%	-2,82%	-0,88%	1,99%	13,08%	1,90%	0,04%
CDI (Benchmark)	0,20%	0,49%	0,49%	0,96%	2,22%	7,78%	-	-
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,13%	0,37%	0,37%	0,76%	1,57%	-	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,10%	0,34%	0,34%	0,98%	1,96%	7,05%	0,06%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,16%	0,43%	0,43%	0,90%	1,84%	7,41%	0,02%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://efcfece.pe.gov.br/epyp/validarDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,93%	2,05%	2,05%	5,25%	6,10%	9,60%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,30%	-0,18%	-0,18%	1,86%	5,09%	19,24%	1,36%	0,03%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



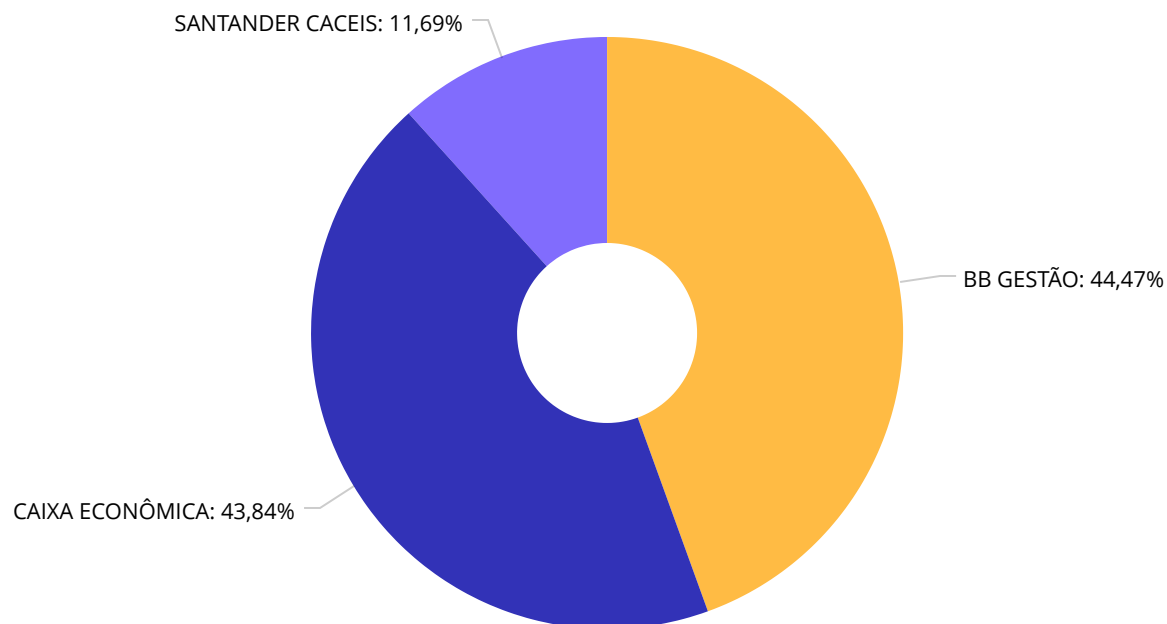
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	6,00%	-2,00%	-2,00%	23,29%	59,73%	22,24%	-	-
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	6,96%	-0,56%	-0,56%	19,88%	50,67%	32,14%	8,96%	0,23%
CDI (Benchmark)	0,20%	0,49%	0,49%	0,96%	2,22%	7,78%	-	-
BNB FI MULTIMERCADO LP	0,01%	-0,43%	-0,43%	0,80%	4,67%	6,84%	0,82%	-

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ite.pe.gov.br/ep/vvalidadoc/seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afc7-3b85229d2c91



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

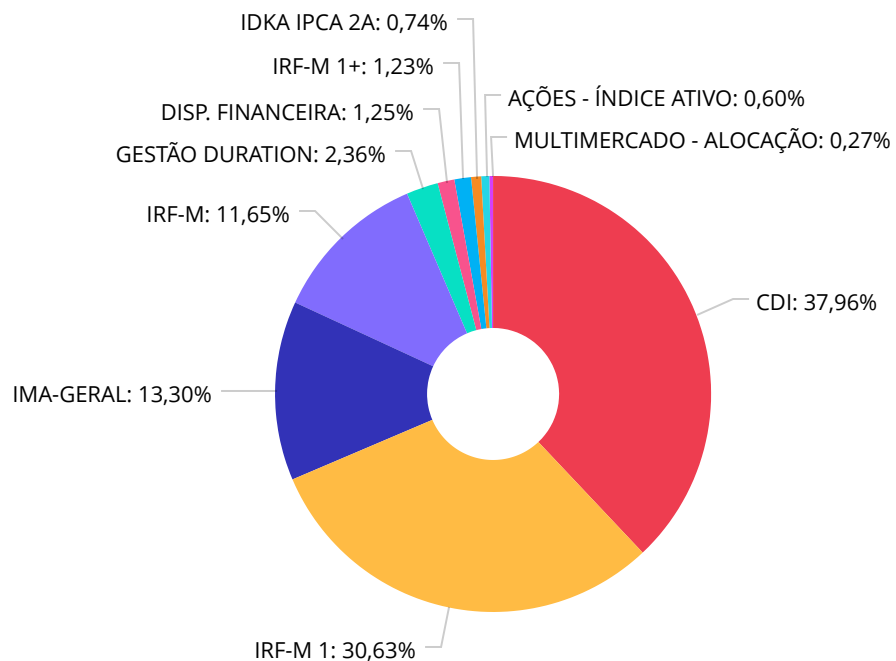


BB GESTÃO	31.552.166,00
CAIXA ECONÔMICA	31.103.022,22
SANTANDER CACEIS	8.296.980,86

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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



CDI	27.276.754,33
IRF-M 1	22.003.964,41
IMA-GERAL	9.557.091,70
IRF-M	8.371.401,11
GESTÃO DURATION	1.695.801,21
DISP. FINANCEIRA	896.361,35
IRF-M 1+	885.261,77
IDKA IPCA 2A	535.201,64
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	431.261,14
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	195.411,29

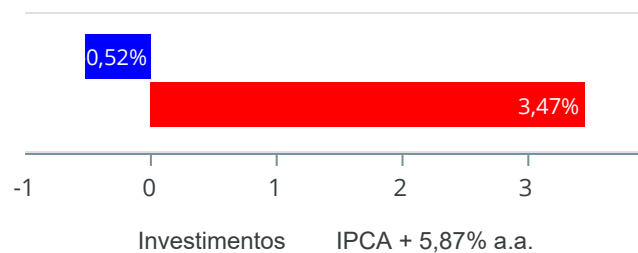
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validar/csc/secao/Código do documento: 6710049b-b211-4b6a-fc7-3b85229d2c91>



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V.R.
Janeiro	68.596.497,97	0,00	0,00	68.502.207,86	-94.290,11	-94.290,11	-0,14%	-0,14%	0,70%	0,70%	-19,50%	0,00%
Fevereiro	68.502.207,86	2.000.000,00	450.000,00	69.845.078,89	-207.128,97	-301.419,08	-0,30%	-0,43%	1,27%	1,99%	-21,79%	0,00%
Março	69.845.078,89	1.700.471,70	530.000,00	70.952.174,78	-63.375,81	-364.794,89	-0,09%	-0,52%	1,46%	3,47%	-15,03%	0,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://pcc-ufpe.br/pe/bv/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91

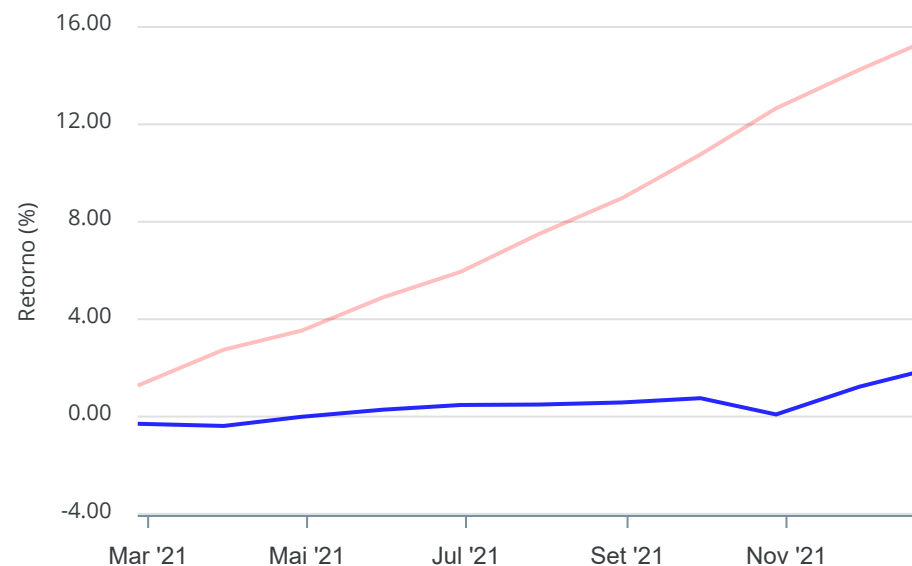


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b0f-a1c7-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	533.228,56	0,00	0,00	535.201,64	1.973,08	0,37%	0,37%	1,69%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.649.073,74	0,00	530.000,00	8.132.303,64	13.229,90	0,15%	0,16%	0,02%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.660.597,25	0,00	0,00	7.670.302,43	9.705,18	0,13%	0,13%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.462.810,05	0,00	0,00	11.474.146,32	11.336,27	0,10%	0,10%	0,06%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	12.201.142,62	0,00	0,00	12.203.194,32	2.051,70	0,02%	0,02%	0,21%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.799.870,42	0,00	0,00	9.800.770,10	899,68	0,01%	0,01%	0,21%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,00	1.700.471,70	0,00	1.695.809,23	-4.662,47	-0,27%	0,30%	1,36%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.597.510,20	0,00	0,00	9.557.090,78	-40.419,42	-0,42%	-0,42%	1,70%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.443.480,27	0,00	0,00	8.371.408,12	-72.072,15	-0,85%	-0,85%	1,90%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	898.783,83	0,00	0,00	885.268,77	-13.515,06	-1,50%	-1,50%	3,19%
Total Renda Fixa	69.246.496,94	1.700.471,70	530.000,00	70.325.495,35	-91.473,29	-0,13%		0,62%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://seccrce.gov.br/validador/validarCodigo do documento: 61d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	403.190,87	0,00	0,00	431.263,14	28.072,27	6,96%	6,96%	8,96%
BNB FI MULTIMERCADO LP	195.391,08	0,00	0,00	195.416,29	25,21	0,01%	0,01%	0,82%
Total Renda Variável	598.581,95	0,00	0,00	626.679,43	28.097,48	4,69%		6,42%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://etec.ce.gov.br/ppv/validaDoc.seam Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	46.590,91	0,00	0,00	896.363,35	849.772,44	1.823,90%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.886.577,47	1.000.000,00	450.000,00	11.474.146,32	37.568,85	0,32%	0,34%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.827.407,03	800.000,00	530.000,00	8.132.303,64	34.896,61	0,40%	0,43%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.642.289,93	0,00	0,00	7.670.302,43	28.012,50	0,37%	0,37%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	12.196.796,79	0,00	0,00	12.203.194,32	6.397,53	0,05%	0,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.595.814,45	200.000,00	0,00	9.800.770,10	4.955,65	0,05%	0,05%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	535.220,75	0,00	0,00	535.201,64	-19,11	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,00	1.700.471,70	0,00	1.695.809,23	-4.662,47	-0,27%	-0,18%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	928.587,90	0,00	0,00	885.268,77	-43.319,13	-4,67%	-4,67%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.739.832,85	0,00	0,00	9.557.090,78	-182.742,07	-1,88%	-1,88%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.614.024,12	0,00	0,00	8.371.408,12	-242.616,00	-2,82%	-2,82%
				Total Renda Fixa	488.244,80	0,69%	

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinatura em: https://etec-recepo.gov.br/gov/validador/validarDocumento?codigo_documento=621d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instituição
BNB FI MULTIMERCADO LP	196.256,69	0,00	0,00	195.416,29	-840,40	-0,43%	-0,43%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	433.689,99	0,00	0,00	431.263,14	-2.426,85	-0,56%	-0,56%
Total Renda Variável					-3.267,25	-0,52%	

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://etce.ice-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tee.pb.gov.br/app/qualificaDoc/seam> Código do Documento: 67140696-b2b1-4016-b0fc-7-3b852299cc91

Relatório Analítico dos Investimentos

em abril de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <http://etcpe.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afc7-3b85229d2c91



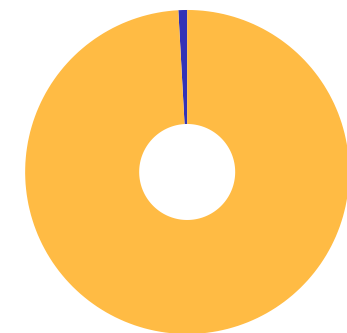
Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	9.616.484,58	13,27%	608	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	539.696,69	0,74%	959	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	12.232.821,25	16,89%	1.191	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	894.618,48	1,23%	94	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.439.547,88	11,65%	661	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.936.096,07	4,05%	941	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	9.828.451,12	13,57%	1.333	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.677.683,10	10,60%	58	2,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	11.504.415,12	15,88%	656	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.142.436,36	11,24%	477	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	435.759,50	0,60%	908	0,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNB FI MULTIMERCADO LP	D+3 du	Não há	195.018,64	0,27%	226	3,03%	Artigo 8º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		73.002,00	0,10%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			72.443.028,79				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			73.002,00	Artigo 6º			
PL Total			72.516.030,79				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	72.443.028,79
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	44.487.716,07	61,41%	50,00%	62,00%	100,00%	27.955.312,72
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	21.732.908,64
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.622.151,44
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	14.488.605,76
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	43.465.817,27
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	27.324.534,58	37,72%	0,00%	33,00%	40,00%	1.652.676,94
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	28.977.211,52
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	14.488.605,76
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	10.866.454,32
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	10.866.454,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.622.151,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.622.151,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.622.151,44
Total Renda Fixa	100,00%	71.812.250,65	99,13%	50,00%	95,00%	460,00%	



RENDA FIXA 71.812.250,65
RENDA VARIÁVEL 630.778,14

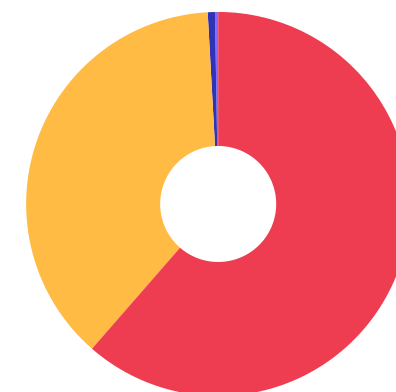
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afc7-3b85229d2c91



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	21.732.908,64
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	21.732.908,64
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	435.759,50	0,60%	0,00%	4,00%	6,00%	3.910.822,23
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	14.488.605,76
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	195.018,64	0,27%	0,00%	1,00%	2,00%	1.253.841,94
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.622.151,44
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.622.151,44
Total Renda Variável	30,00%	630.778,14	0,87%	0,00%	5,00%	98,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.244.302,88
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	1.448.860,58
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.244.302,88
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	22,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/ppv/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



Enquadramento por Gestores - base (Abril / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	32.411.398,67	44,74	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	31.723.168,88	43,79	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	8.308.461,24	11,47	0,11

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Documento Assinado Digitalmente por: CARLOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: https://repositorio.capiabari.org.br/validar/ocorrencia/validar_documento/62100430-1201-40ff-8c7-3b55239d2691



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,49%	-1,16%	-0,72%	1,64%	3,81%	12,47%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,62%	-1,27%	-0,72%	1,94%	4,05%	12,99%	1,37%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,35%	1,30%	1,16%	4,35%	9,41%	18,84%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,84%	0,84%	0,66%	3,75%	9,19%	16,78%	1,37%	0,02%
IRF-M 1+ (Benchmark)	1,12%	-3,70%	-2,35%	-0,31%	1,43%	15,56%	-	-
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	-3,66%	-2,36%	-0,24%	1,14%	14,55%	2,31%	0,06%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,27%	0,40%	0,36%	0,94%	2,33%	9,09%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	0,30%	0,26%	0,81%	1,95%	8,38%	0,17%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,28%	0,34%	0,31%	0,84%	2,12%	8,65%	0,16%	0,00%
IRF-M (Benchmark)	0,84%	-1,98%	-1,19%	0,30%	1,94%	13,86%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	-2,03%	-1,24%	0,24%	1,73%	13,33%	1,55%	0,04%
CDI (Benchmark)	0,21%	0,69%	0,54%	1,01%	2,14%	7,45%	-	-
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,10%	0,46%	0,29%	0,79%	1,42%	-	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,26%	0,60%	0,44%	1,13%	2,22%	6,79%	0,08%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,13%	0,56%	0,36%	0,91%	1,65%	6,99%	0,02%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.gov.br/epyp/validarDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,31%	2,37%	2,11%	4,67%	6,76%	9,32%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,67%	0,48%	0,46%	2,64%	4,63%	18,72%	1,03%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ite.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



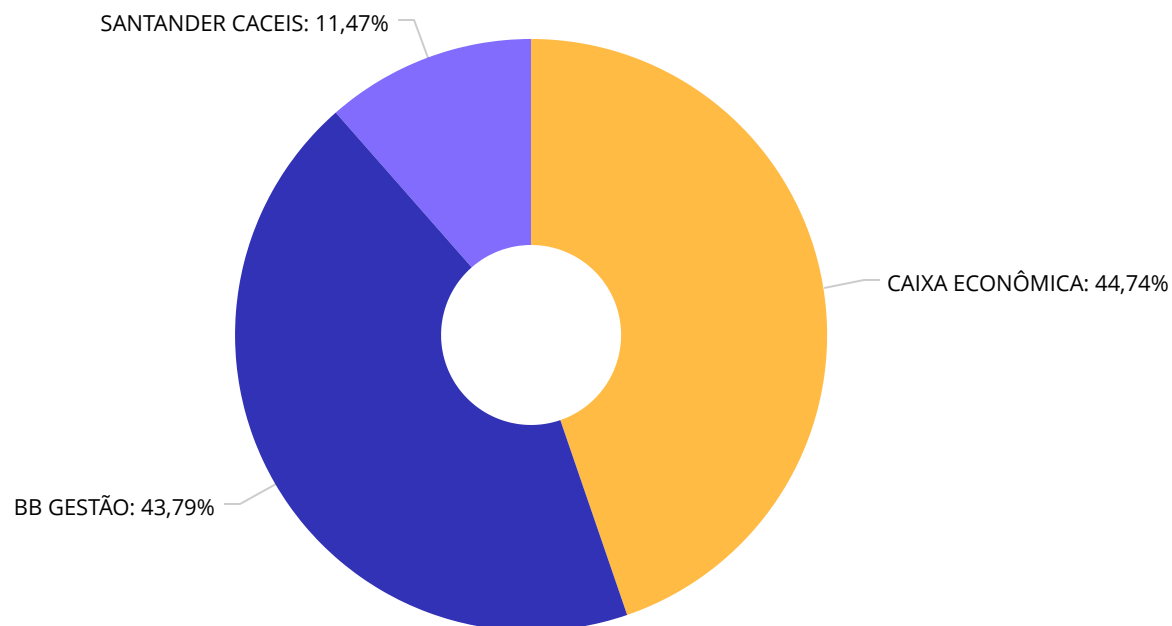
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	1,94%	-0,10%	3,33%	26,55%	47,68%	23,39%	-	-
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	1,04%	0,48%	3,58%	22,37%	39,83%	33,03%	5,50%	0,22%
CDI (Benchmark)	0,21%	0,69%	0,54%	1,01%	2,14%	7,45%	-	-
BNB FI MULTIMERCADO LP	-0,20%	-0,63%	-0,73%	0,83%	3,28%	6,26%	0,52%	-

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afc7-3b85229d2c91



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

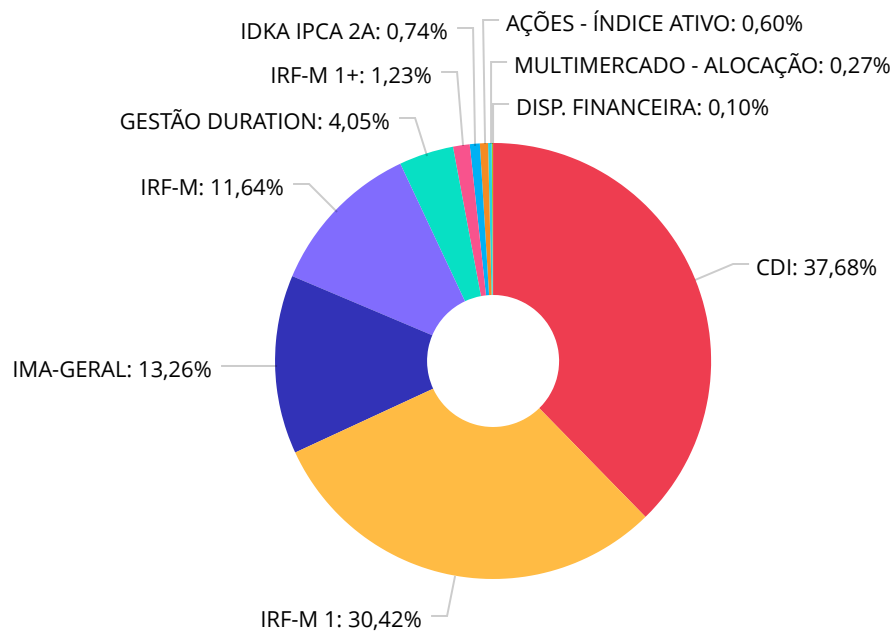


CAIXA ECONÔMICA	32.411.390,00
BB GESTÃO	31.723.160,00
SANTANDER CACEIS	8.308.460,00

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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



CDI	27.324.531,55
IRF-M 1	22.061.270,33
IMA-GERAL	9.616.481,59
IRF-M	8.439.541,88
GESTÃO DURATION	2.936.090,00
IRF-M 1+	894.611,48
IDKA IPCA 2A	539.691,69
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	435.751,50
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	195.011,64
DISP. FINANCEIRA	73.001,00

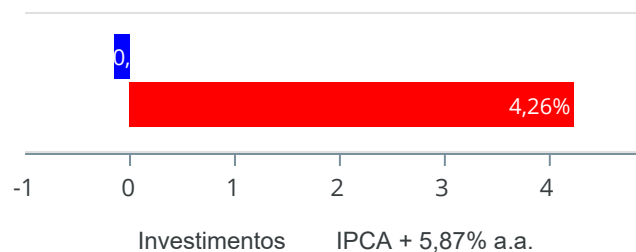
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validarDoc.aspx?CodigoDocumento=6710050-b21-4b4e-afcf-3b85229d2c91>



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V.R.
Janeiro	68.596.497,97	0,00	0,00	68.502.207,86	-94.290,11	-94.290,11	-0,14%	-0,14%	0,70%	0,70%	-19,50%	0,00%
Fevereiro	68.502.207,86	2.000.000,00	450.000,00	69.845.078,89	-207.128,97	-301.419,08	-0,30%	-0,43%	1,27%	1,99%	-21,79%	0,00%
Março	69.845.078,89	1.700.471,70	530.000,00	70.952.174,78	-63.375,81	-364.794,89	-0,09%	-0,52%	1,46%	3,47%	-15,03%	0,00%
Abril	70.952.174,78	1.218.000,00	0,00	72.443.028,79	272.854,01	-91.940,88	0,38%	-0,15%	0,77%	4,26%	-3,41%	0,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://pfe.cpf.br/pe-br/ppv/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



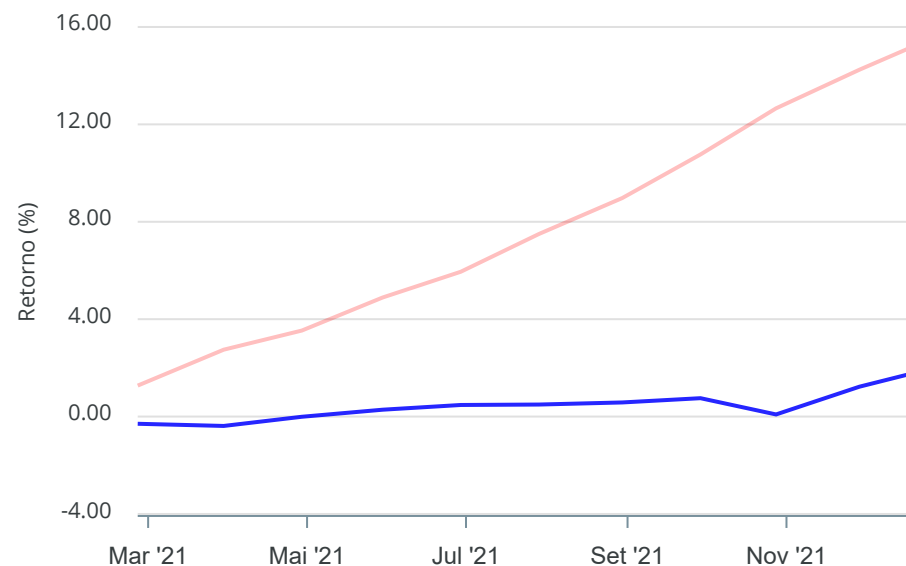
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b0f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	885.268,77	0,00	0,00	894.618,48	9.349,71	1,06%	1,06%	2,31%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	535.201,64	0,00	0,00	539.696,69	4.495,05	0,84%	0,84%	1,37%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.371.408,12	0,00	0,00	8.439.547,88	68.139,76	0,81%	0,81%	1,55%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.695.809,23	1.218.000,00	0,00	2.936.096,07	22.286,84	0,76%	0,66%	1,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.557.090,78	0,00	0,00	9.616.484,58	59.393,80	0,62%	0,62%	1,37%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.800.770,10	0,00	0,00	9.828.451,12	27.681,02	0,28%	0,28%	0,16%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.474.146,32	0,00	0,00	11.504.415,12	30.268,80	0,26%	0,26%	0,08%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	12.203.194,32	0,00	0,00	12.232.821,25	29.626,93	0,24%	0,24%	0,17%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.132.303,64	0,00	0,00	8.142.436,36	10.132,72	0,12%	0,12%	0,02%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.670.302,43	0,00	0,00	7.677.683,10	7.380,67	0,10%	0,10%	0,02%
Total Renda Fixa	70.325.495,35	1.218.000,00	0,00	71.812.250,65	268.755,30	0,38%		0,51%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://seccap.gov.br/app/validador/assinatura/621d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	431.263,14	0,00	0,00	435.759,50	4.496,36	1,04%	1,04%	5,50%
BNB FI MULTIMERCADO LP	195.416,29	0,00	0,00	195.018,64	-397,65	-0,20%	-0,20%	0,52%
Total Renda Variável	626.679,43	0,00	0,00	630.778,14	4.098,71	0,65%		3,96%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://etec.ce.gov.br/pp/vaiadaDoc.seam Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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 das outras providências.

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tee.pb.gov.br/app/qualificaDoc/seam> Código do Documento: 67140696-b2b1-4016-b0fc7-3b852299cc91

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <http://etcpe.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afc7-3b85229d2c91



Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.itec.pe.gov.br/ep/vvalidadoc/seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91

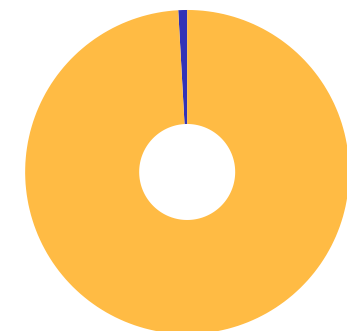
Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	9.662.721,96	13,09%	600	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	543.317,61	0,74%	977	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	12.254.579,85	16,60%	1.184	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	895.740,41	1,21%	91	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.452.960,36	11,45%	644	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.943.104,21	3,99%	966	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.694.256,13	2,30%	1.034	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	9.845.181,92	13,34%	1.316	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.700.669,05	10,43%	58	2,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	10.994.306,52	14,90%	672	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.165.778,80	11,06%	476	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	453.070,91	0,61%	895	0,60%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNB FI MULTIMERCADO LP	D+3 du	Não há	195.975,13	0,27%	216	3,24%	Artigo 8º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		95.080,73	0,13%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			73.801.662,86				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			95.080,73	Artigo 6º			
PL Total			73.896.743,59				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	73.801.662,86
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	46.291.862,45	62,72%	50,00%	62,00%	100,00%	27.509.800,41
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	22.140.498,86
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.690.083,14
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	14.760.332,57
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	44.280.997,72
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	26.860.754,37	36,40%	0,00%	33,00%	40,00%	2.659.910,77
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	29.520.665,14
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	14.760.332,57
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	11.070.249,43
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	11.070.249,43
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.690.083,14
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.690.083,14
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.690.083,14
Total Renda Fixa	100,00%	73.152.616,82	99,12%	50,00%	95,00%	460,00%	



RENDA FIXA 73.152.616,82
RENDA VARIÁVEL 649.046,04

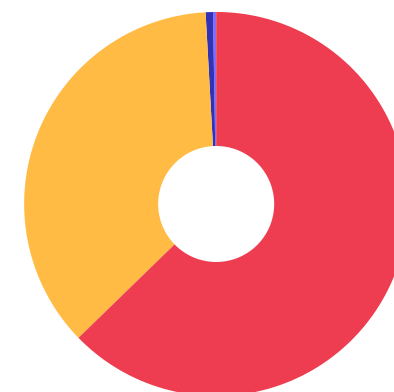
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	22.140.498,86
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	22.140.498,86
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	453.070,91	0,61%	0,00%	4,00%	6,00%	3.975.028,86
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	14.760.332,57
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	195.975,13	0,27%	0,00%	1,00%	2,00%	1.280.058,13
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.690.083,14
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.690.083,14
Total Renda Variável	30,00%	649.046,04	0,88%	0,00%	5,00%	98,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.380.166,29
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	1.476.033,26
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.380.166,29
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	22,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/pp/va/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	33.642.627,58	45,59	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	31.809.320,19	43,10	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	8.349.715,09	11,31	0,11

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Documento Assinado Digitalmente por: CARLOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: https://repositorio.capiabari.org.br/validar/ocorrencia/validar_documento/62100430-1201-40ff-8c7-3b55239d2691



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,50%	-0,66%	0,61%	1,45%	3,33%	11,00%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	-0,79%	0,68%	1,57%	3,44%	11,29%	1,07%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,88%	2,19%	2,53%	3,96%	8,47%	18,26%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67%	1,51%	1,89%	3,06%	7,77%	16,46%	0,98%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,84%	1,85%	2,25%	3,53%	7,95%	16,84%	1,07%	0,02%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,20%	-3,51%	-0,14%	-0,57%	-0,28%	13,33%	-	-
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,13%	-3,54%	-0,34%	-0,56%	-0,50%	12,30%	1,75%	0,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,20%	0,60%	0,52%	0,91%	2,11%	8,57%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	0,47%	0,44%	0,79%	1,73%	7,88%	0,14%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,17%	0,51%	0,46%	0,79%	1,89%	8,12%	0,14%	0,00%
IRF-M (Benchmark)	0,20%	-1,79%	0,19%	0,13%	0,71%	12,10%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,16%	-1,87%	0,11%	0,06%	0,51%	11,56%	1,19%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,27%	0,97%	0,68%	1,13%	2,18%	7,16%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,29%	0,85%	0,57%	1,10%	1,69%	6,69%	0,03%	0,00%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,30%	0,76%	0,52%	1,02%	1,50%	-	0,04%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,24%	0,85%	0,61%	1,21%	2,14%	6,48%	0,05%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,83%	3,22%	2,08%	4,61%	8,06%	10,08%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,24%	0,72%	1,21%	2,05%	3,45%	15,85%	1,14%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice-pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



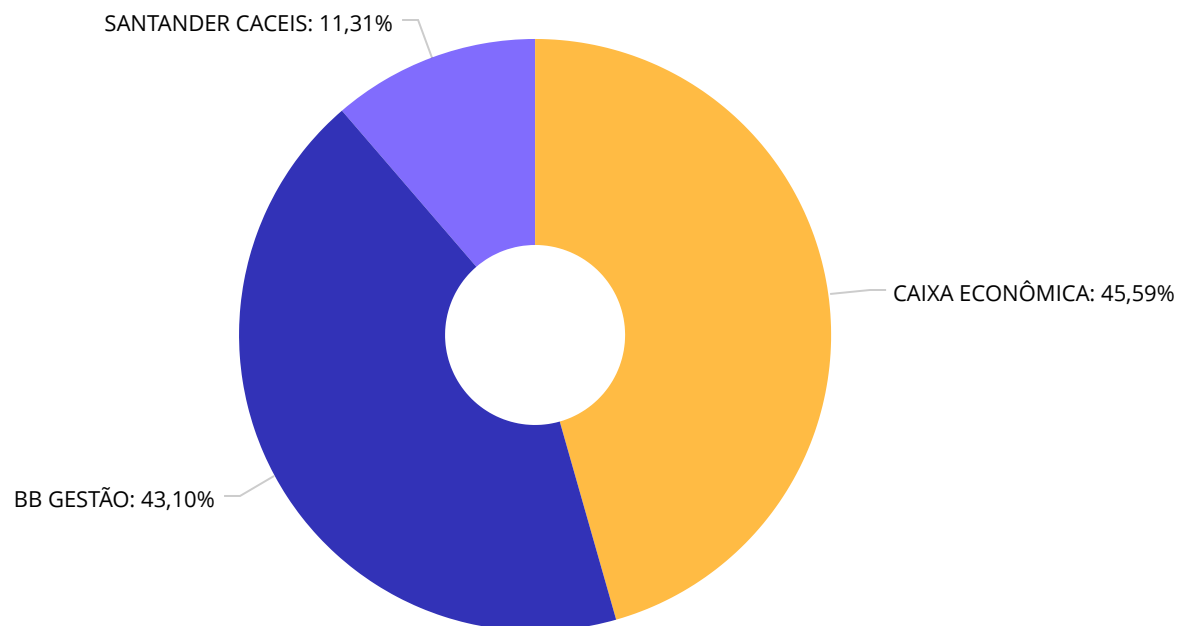
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	6,16%	6,05%	14,70%	15,91%	44,41%	30,08%	-	-
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	3,97%	4,47%	12,37%	11,95%	33,60%	37,79%	6,62%	0,22%
CDI (Benchmark)	0,27%	0,97%	0,68%	1,13%	2,18%	7,16%	-	-
BNB FI MULTIMERCADO LP	0,49%	-0,14%	0,30%	0,54%	2,44%	6,45%	0,62%	0,03%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



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

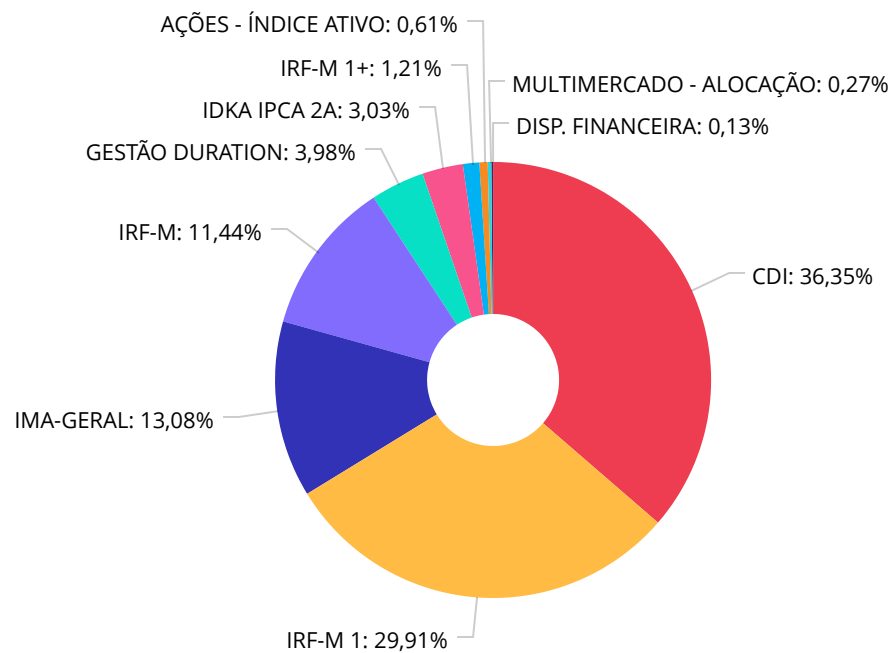


CAIXA ECONÔMICA	33.642.624,55
BB GESTÃO	31.809.320,11
SANTANDER CACEIS	8.349.710,09

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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



CDI	26.860.751,33
IRF-M 1	22.099.767,70
IMA-GERAL	9.662.721,99
IRF-M	8.452.963,30
GESTÃO DURATION	2.943.102,21
IDKA IPCA 2A	2.237.571,74
IRF-M 1+	895.741,41
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	453.071,91
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	195.971,13
DISP. FINANCEIRA	95.081,73

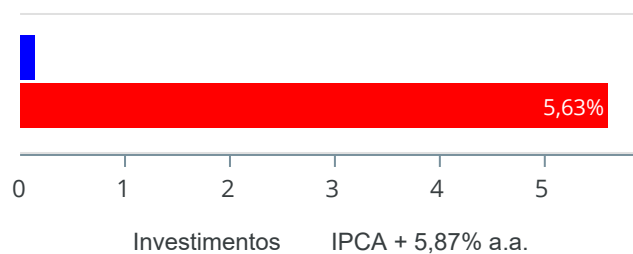
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
 Acesso em: https://etce.ite.gov.br/epd/validaDoc.seam?codigo_documento=671d0590-b261-4b05-afc7-3b85229d2c91



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V.R.
Janeiro	68.596.497,97	0,00	0,00	68.502.207,86	-94.290,11	-94.290,11	-0,14%	-0,14%	0,70%	0,70%	-19,50%	0,00%
Fevereiro	68.502.207,86	2.000.000,00	450.000,00	69.845.078,89	-207.128,97	-301.419,08	-0,30%	-0,43%	1,27%	1,99%	-21,79%	0,00%
Março	69.845.078,89	1.700.471,70	530.000,00	70.952.174,78	-63.375,81	-364.794,89	-0,09%	-0,52%	1,46%	3,47%	-15,03%	0,00%
Abril	70.952.174,78	1.218.000,00	0,00	72.443.028,79	272.854,01	-91.940,88	0,38%	-0,15%	0,77%	4,26%	-3,41%	0,00%
Maio	72.443.028,79	1.683.000,00	538.000,00	73.801.662,86	213.634,07	121.693,19	0,29%	0,14%	1,31%	5,63%	2,57%	0,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: [https://pccs.cpf.br/pe/88v-br/peppv/validadoc/seam/Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91](https://pccs.cpf.br/pe/88v-br/peppv/validadoc/seam/Código%20do%20documento:671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91)

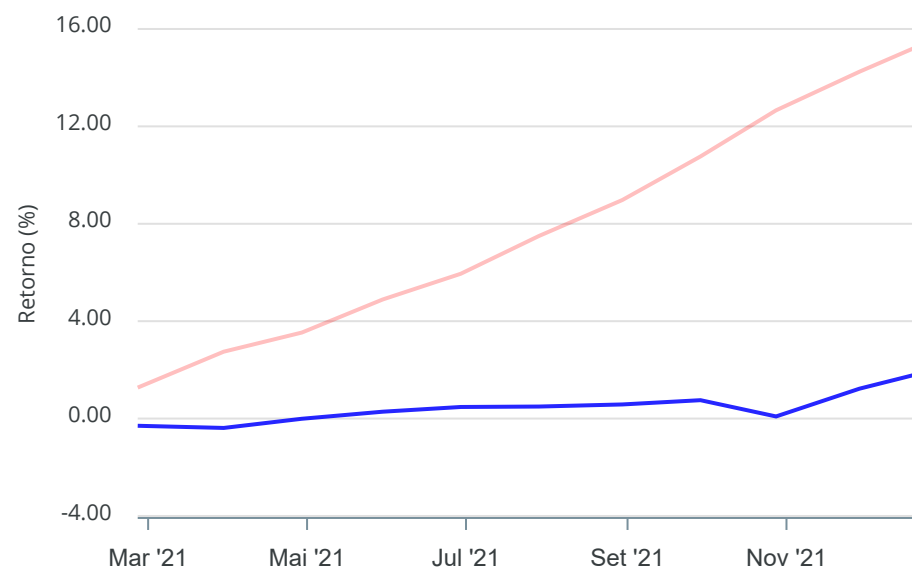


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b0f-a1c7-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	539.696,69	0,00	0,00	543.317,61	3.620,92	0,67%	0,67%	0,98%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,00	1.683.000,00	0,00	1.694.256,13	11.256,13	0,67%	0,84%	1,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.616.484,58	0,00	0,00	9.662.721,96	46.237,38	0,48%	0,48%	1,07%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.677.683,10	0,00	0,00	7.700.669,05	22.985,95	0,30%	0,30%	0,04%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.142.436,36	0,00	0,00	8.165.778,80	23.342,44	0,29%	0,29%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.504.415,12	0,00	538.000,00	10.994.306,52	27.891,40	0,24%	0,24%	0,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.936.096,07	0,00	0,00	2.943.104,21	7.008,14	0,24%	0,24%	1,14%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	12.232.821,25	0,00	0,00	12.254.579,85	21.758,60	0,18%	0,18%	0,14%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.828.451,12	0,00	0,00	9.845.181,92	16.730,80	0,17%	0,17%	0,14%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.439.547,88	0,00	0,00	8.452.960,36	13.412,48	0,16%	0,16%	1,19%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	894.618,48	0,00	0,00	895.740,41	1.121,93	0,13%	0,13%	1,75%
Total Renda Fixa	71.812.250,65	1.683.000,00	538.000,00	73.152.616,82	195.366,17	0,27%		0,43%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://seccap.gov.br/validador/validarCodigo do documento: 621d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	435.759,50	0,00	0,00	453.070,91	17.311,41	3,97%	3,97%	6,62%
BNB FI MULTIMERCADO LP	195.018,64	0,00	0,00	195.975,13	956,49	0,49%	0,49%	0,62%
Total Renda Variável	630.778,14	0,00	0,00	649.046,04	18.267,90	2,90%		4,81%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://etce.te.pe.gov.br/pp/va/validaDoc.seam Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



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: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pb.org.br/app/qualificaDoc/seam/CódigoDocumento:67140696-b2b1-4016-b0fc7-3b852299cc91>

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <http://etcpe.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf7-afc7-3b85229d2c91



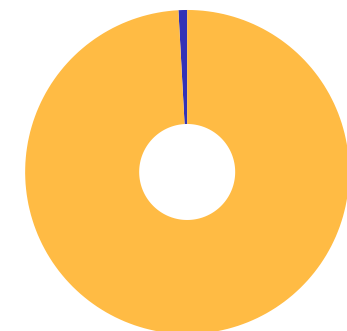
Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	9.673.495,52	12,88%	595	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	542.809,56	0,72%	992	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	12.276.643,97	16,35%	1.169	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	897.123,09	1,19%	87	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.467.571,86	11,28%	634	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.630.147,88	6,17%	974	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.689.557,98	2,25%	1.044	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	9.325.343,24	12,42%	1.309	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.723.943,70	10,29%	59	2,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	11.027.926,64	14,69%	691	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.191.122,58	10,91%	483	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	450.748,83	0,60%	899	0,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNB FI MULTIMERCADO LP	D+3 du	Não há	196.353,07	0,26%	214	2,97%	Artigo 8º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		99.946,31	0,13%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			75.092.787,92				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			99.946,31	Artigo 6º			
PL Total			75.192.734,23				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	75.092.787,92
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	47.502.693,10	63,26%	50,00%	62,00%	100,00%	27.590.094,82
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	22.527.836,38
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.754.639,40
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	15.018.557,58
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	45.055.672,75
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	26.942.992,92	35,88%	0,00%	33,00%	40,00%	3.094.122,25
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	30.037.115,17
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	15.018.557,58
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	11.263.918,19
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	11.263.918,19
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.754.639,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.754.639,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.754.639,40
Total Renda Fixa	100,00%	74.445.686,02	99,14%	50,00%	95,00%	460,00%	



RENDA FIXA 74.445.686,02
RENDA VARIÁVEL 647.101,90

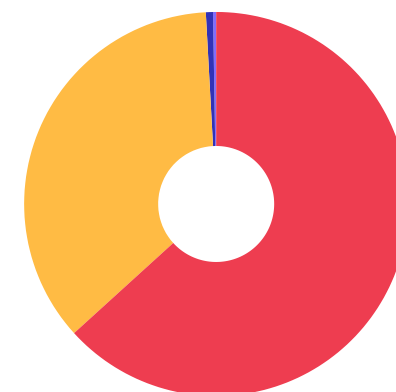
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afc7-3b85229d2c91



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	22.527.836,38
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	22.527.836,38
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	450.748,83	0,60%	0,00%	4,00%	6,00%	4.054.818,45
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	15.018.557,58
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	196.353,07	0,26%	0,00%	1,00%	2,00%	1.305.502,69
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.754.639,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.754.639,40
Total Renda Variável	30,00%	647.101,90	0,86%	0,00%	5,00%	98,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.509.278,79
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	1.501.855,76
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.509.278,79
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	22,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	34.864.098,32	46,43	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	31.857.644,00	42,42	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	8.371.045,60	11,15	0,11

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Documento Assinado Digitalmente por: CARLOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: https://repositorio.bcb.gov.br/pt/validar-ocorrencia-ocorrencia-do-documento:621d043b-12b1-40ff-8c7-3b55239d2691



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,32%	-0,34%	1,32%	-0,34%	2,74%	9,23%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	-0,68%	1,22%	-0,68%	2,58%	9,05%	1,23%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,32%	1,87%	1,91%	1,87%	7,06%	16,45%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,28%	1,56%	1,59%	1,56%	6,40%	15,12%	1,53%	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,09%	1,42%	1,42%	1,42%	6,38%	15,08%	1,36%	0,02%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,22%	-3,30%	1,54%	-3,30%	-1,09%	10,57%	-	-
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,15%	-3,39%	1,34%	-3,39%	-1,37%	9,65%	1,66%	0,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,21%	0,81%	0,68%	0,81%	2,04%	8,17%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	0,66%	0,60%	0,66%	1,65%	7,46%	0,16%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,19%	0,70%	0,64%	0,70%	1,82%	7,71%	0,16%	0,00%
IRF-M (Benchmark)	0,21%	-1,58%	1,26%	-1,58%	0,14%	9,97%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,17%	-1,70%	1,15%	-1,70%	-0,09%	9,41%	1,14%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,31%	1,16%	0,72%	1,16%	1,78%	6,51%	0,02%	0,00%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,30%	1,07%	0,70%	1,07%	1,61%	-	0,01%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice-pe.gov.br/epyp/validarDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b0f-afcf-3b85229d2c91



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,31%	1,16%	0,82%	1,16%	2,20%	6,32%	0,04%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,53%	3,77%	1,68%	3,77%	8,35%	10,66%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,00%	0,72%	0,90%	0,72%	2,68%	12,77%	0,97%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.etc-pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



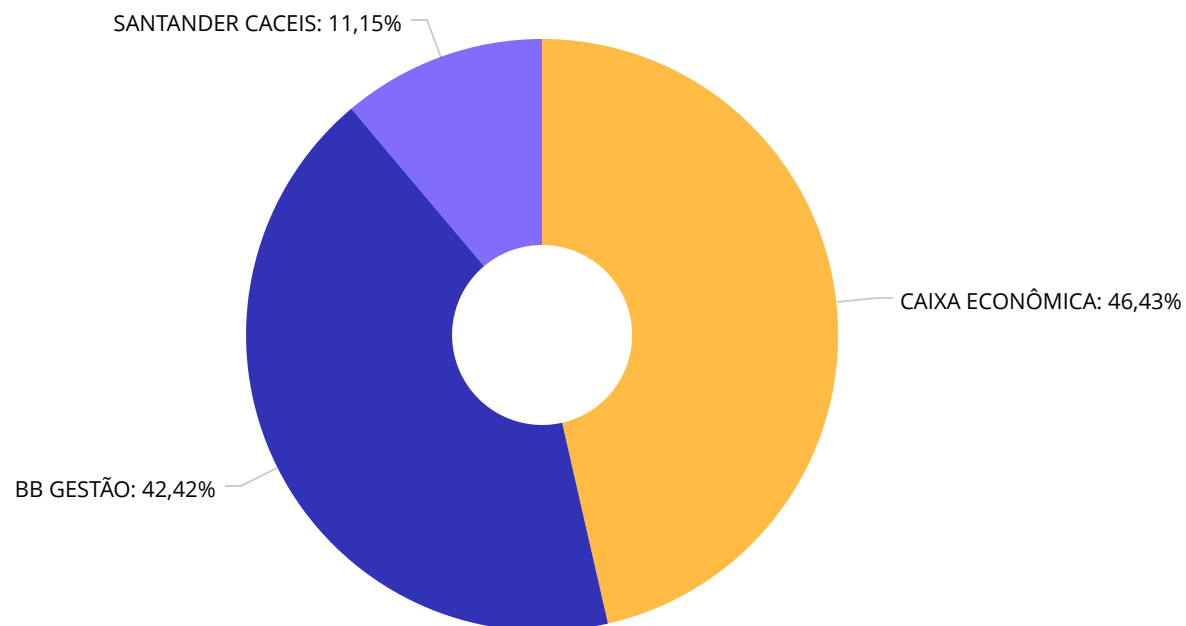
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	0,46%	6,54%	8,72%	6,54%	33,40%	25,59%	-	-
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	-0,51%	3,93%	4,52%	3,93%	22,02%	31,32%	4,80%	0,21%
CDI (Benchmark)	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
BNB FI MULTIMERCADO LP	0,19%	0,05%	0,48%	0,05%	1,18%	6,06%	0,68%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ite.pe.gov.br/ep/vvalidadoc/seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afc7-3b85229d2c91



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

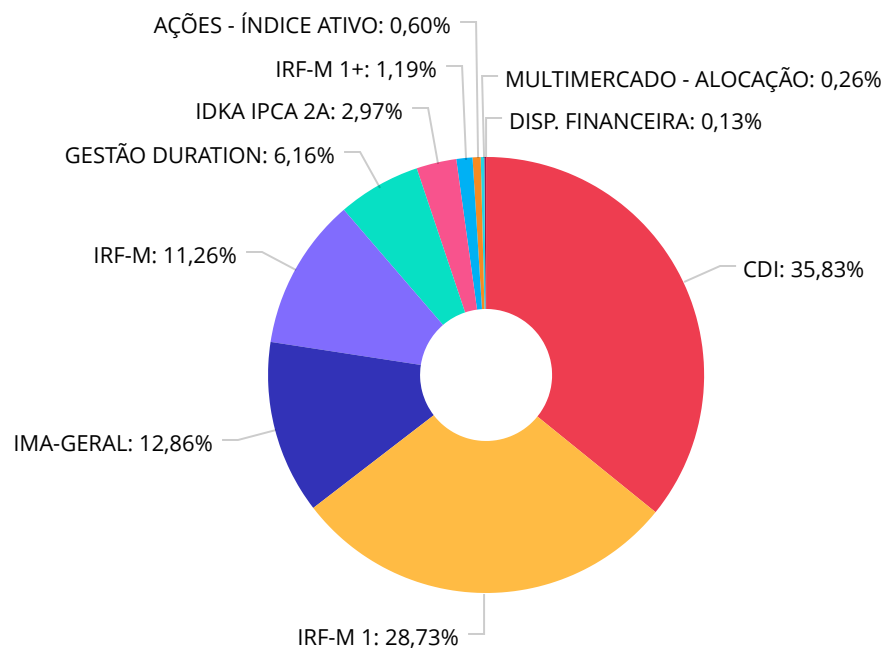


CAIXA ECONÔMICA	34.864.093,33
BB GESTÃO	31.857.644,00
SANTANDER CACEIS	8.371.040,60

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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



CDI	26.942.999,99
IRF-M 1	21.601.982,25
IMA-GERAL	9.673.491,55
IRF-M	8.467.571,88
GESTÃO DURATION	4.630.141,88
IDKA IPCA 2A	2.232.361,54
IRF-M 1+	897.121,09
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	450.741,83
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	196.351,07
DISP. FINANCEIRA	99.941,31

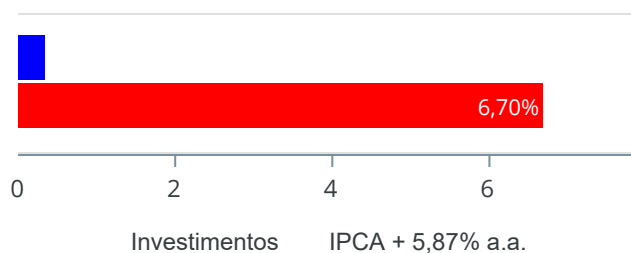
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validarDoc.aspx?CodigoDocumento=6710090b-b814-b6-afcf-3b85229d2c91>



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V.R.
Janeiro	68.596.497,97	0,00	0,00	68.502.207,86	-94.290,11	-94.290,11	-0,14%	-0,14%	0,70%	0,70%	-19,50%	0,00%
Fevereiro	68.502.207,86	2.000.000,00	450.000,00	69.845.078,89	-207.128,97	-301.419,08	-0,30%	-0,43%	1,27%	1,99%	-21,79%	0,00%
Março	69.845.078,89	1.700.471,70	530.000,00	70.952.174,78	-63.375,81	-364.794,89	-0,09%	-0,52%	1,46%	3,47%	-15,03%	0,00%
Abril	70.952.174,78	1.218.000,00	0,00	72.443.028,79	272.854,01	-91.940,88	0,38%	-0,15%	0,77%	4,26%	-3,41%	0,00%
Mai	72.443.028,79	1.683.000,00	538.000,00	73.801.662,86	213.634,07	121.693,19	0,29%	0,14%	1,31%	5,63%	2,57%	0,00%
Junho	73.801.662,86	1.685.000,00	538.300,00	75.092.787,92	144.425,06	266.118,25	0,19%	0,34%	1,01%	6,70%	5,04%	0,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://pcc.icf-pe.gov.br/ipp/viabilidade/assam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



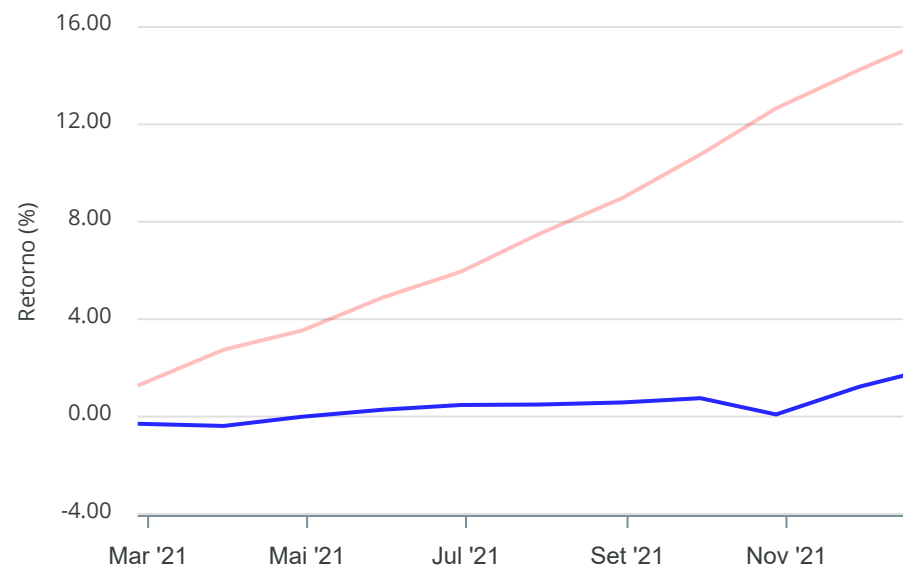
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b0f-a1c7-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.165.778,80	0,00	0,00	8.191.122,58	25.343,78	0,31%	0,31%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.994.306,52	0,00	0,00	11.027.926,64	33.620,12	0,31%	0,31%	0,04%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.700.669,05	0,00	0,00	7.723.943,70	23.274,65	0,30%	0,30%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.845.181,92	0,00	538.250,00	9.325.343,24	18.411,32	0,19%	0,19%	0,16%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	12.254.579,85	0,00	0,00	12.276.643,97	22.064,12	0,18%	0,18%	0,16%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.452.960,36	0,00	0,00	8.467.571,86	14.611,50	0,17%	0,17%	1,14%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	895.740,41	0,00	0,00	897.123,09	1.382,68	0,15%	0,15%	1,66%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.662.721,96	0,00	0,00	9.673.495,52	10.773,56	0,11%	0,11%	1,23%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.943.104,21	1.685.000,00	50,00	4.630.147,88	2.093,67	0,05%	0,00%	0,97%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	543.317,61	0,00	0,00	542.809,56	-508,05	-0,09%	-0,09%	1,36%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.694.256,13	0,00	0,00	1.689.557,98	-4.698,15	-0,28%	-0,28%	1,53%
Total Renda Fixa	73.152.616,82	1.685.000,00	538.300,00	74.445.686,02	146.369,20	0,20%		0,47%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://seccap.gov.br/app/validador.aspx?codigo_documento=621d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BNB FI MULTIMERCADO LP	195.975,13	0,00	0,00	196.353,07	377,94	0,19%	0,19%	0,68%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	453.070,91	0,00	0,00	450.748,83	-2.322,08	-0,51%	-0,51%	4,80%
Total Renda Variável	649.046,04	0,00	0,00	647.101,90	-1.944,14	-0,30%		3,55%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://etec.ce.gov.br/pp/vaidadoc.seam Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.557.090,78	0,00	0,00	9.673.495,52	116.404,74	1,22%	1,22%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.371.408,12	0,00	0,00	8.467.571,86	96.163,74	1,15%	1,15%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.474.146,32	0,00	538.000,00	11.027.926,64	91.780,32	0,80%	0,82%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	12.203.194,32	0,00	0,00	12.276.643,97	73.449,65	0,60%	0,60%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.800.770,10	0,00	538.250,00	9.325.343,24	62.823,14	0,64%	0,64%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.132.303,64	0,00	0,00	8.191.122,58	58.818,94	0,72%	0,72%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.670.302,43	0,00	0,00	7.723.943,70	53.641,27	0,70%	0,70%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.695.809,23	2.903.000,00	50,00	4.630.147,88	31.388,65	0,68%	0,90%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	885.268,77	0,00	0,00	897.123,09	11.854,32	1,34%	1,34%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	535.201,64	0,00	0,00	542.809,56	7.607,92	1,42%	1,42%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,00	1.683.000,00	0,00	1.689.557,98	6.557,98	0,39%	1,59%
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	896.363,35	0,00	0,00	99.946,31	-796.417,04	-88,85%	-
Total Renda Fixa					-185.926,37	-0,25%	

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://secretope.gov.br/gov/validadocessamCodigo do documento: 621d049b-b2b1-4bff-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instituição
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	431.263,14	0,00	0,00	450.748,83	19.485,69	4,52%	4,52%
BNB FI MULTIMERCADO LP	195.416,29	0,00	0,00	196.353,07	936,78	0,48%	0,48%
Total Renda Variável					20.422,47	3,26%	

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://etce.ice-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.886.577,47	1.000.000,00	988.000,00	11.027.926,64	129.349,17	1,09%	1,16%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.827.407,03	800.000,00	530.000,00	8.191.122,58	93.715,55	1,09%	1,16%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.642.289,93	0,00	0,00	7.723.943,70	81.653,77	1,07%	1,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENC...	12.196.796,79	0,00	0,00	12.276.643,97	79.847,18	0,65%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.595.814,45	200.000,00	538.250,00	9.325.343,24	67.778,79	0,69%	0,70%
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	46.590,91	0,00	0,00	99.946,31	53.355,40	114,52%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,00	4.603.471,70	50,00	4.630.147,88	26.726,18	0,58%	0,72%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	535.220,75	0,00	0,00	542.809,56	7.588,81	1,42%	1,42%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,00	1.683.000,00	0,00	1.689.557,98	6.557,98	0,39%	1,56%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	928.587,90	0,00	0,00	897.123,09	-31.464,81	-3,39%	-3,39%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.739.832,85	0,00	0,00	9.673.495,52	-66.337,33	-0,68%	-0,68%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.614.024,12	0,00	0,00	8.467.571,86	-146.452,26	-1,70%	-1,70%
				Total Renda Fixa	302.318,43	0,41%	

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://brasil.scribd.com/document/62140499-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instituição
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	433.689,99	0,00	0,00	450.748,83	17.058,84	3,93%	3,93%
BNB FI MULTIMERCADO LP	196.256,69	0,00	0,00	196.353,07	96,38	0,05%	0,05%
Total Renda Variável					17.155,22	2,72%	

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



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: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pb.org.br/app/qualificaDoc/seam> Código do Documento: 67140696-b2b1-4016-b0fc7-3b852299cc91

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce-ccf-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: [https://etce.tce-pe.gov.br/ep/vvalidaDoc/seam/Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91](https://etce.tce-pe.gov.br/ep/vvalidaDoc/seam/Código%20do%20documento:671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91)

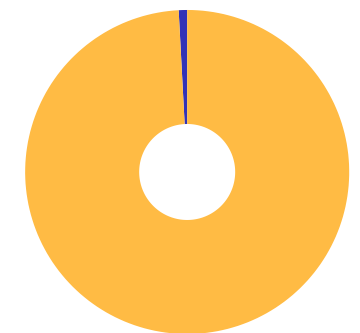
Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	9.649.345,16	12,71%	590	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	543.262,59	0,72%	1.007	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	12.296.819,68	16,20%	1.154	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	889.572,26	1,17%	85	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.425.341,28	11,10%	622	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.942.709,94	7,83%	984	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.688.460,82	2,22%	1.050	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	9.340.866,65	12,31%	1.303	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.754.295,51	10,21%	62	2,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	11.077.744,60	14,59%	709	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.667.073,54	10,10%	491	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	439.587,06	0,58%	904	0,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNB FI MULTIMERCADO LP	D+3 du	Não há	195.991,70	0,26%	196	3,13%	Artigo 8º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		162.084,23	0,21%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			75.911.070,79				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			162.084,23	Artigo 6º			
PL Total			76.073.155,02				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	75.911.070,79
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	48.776.378,38	64,25%	50,00%	62,00%	100,00%	27.134.692,41
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	22.773.321,24
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.795.553,54
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	15.182.214,16
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	45.546.642,47
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	26.499.113,65	34,91%	0,00%	33,00%	40,00%	3.865.314,67
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	30.364.428,32
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	15.182.214,16
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	11.386.660,62
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	11.386.660,62
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.795.553,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.795.553,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.795.553,54
Total Renda Fixa	100,00%	75.275.492,03	99,16%	50,00%	95,00%	460,00%	



RENTA FIXA 75.275.492,03
RENTA VARIÁVEL 635.578,76

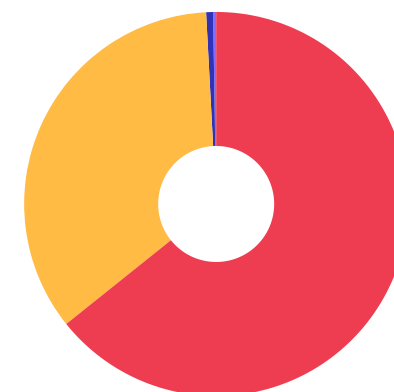
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	22.773.321,24
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	22.773.321,24
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	439.587,06	0,58%	0,00%	4,00%	6,00%	4.115.077,19
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	15.182.214,16
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	195.991,70	0,26%	0,00%	1,00%	2,00%	1.322.229,72
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.795.553,54
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.795.553,54
Total Renda Variável	30,00%	635.578,76	0,84%	0,00%	5,00%	98,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.591.107,08
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	1.518.221,42
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.591.107,08
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	22,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	35.716.855,55	47,05	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	31.804.340,97	41,90	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	8.389.874,27	11,05	0,11

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Documento Assinado Digitalmente por: CARLOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: https://repositorio.capiabari.org.br/validar/ocorrencia/validar_documento/621d043b-12b1-40ff-8c7-3b35229d2691



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,10%	-0,44%	0,72%	0,00%	0,96%	8,10%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,25%	-0,93%	0,34%	-0,38%	0,55%	7,68%	1,14%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,18%	1,68%	0,38%	1,54%	5,88%	15,07%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	1,50%	0,66%	1,32%	5,61%	14,05%	0,88%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,07%	1,50%	0,50%	1,36%	5,46%	14,00%	0,95%	0,02%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,83%	-4,11%	-0,42%	-2,76%	-3,34%	8,28%	-	-
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,84%	-4,20%	-0,56%	-2,91%	-3,71%	7,34%	1,87%	0,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,19%	1,00%	0,60%	0,96%	1,99%	7,60%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,16%	0,82%	0,52%	0,79%	1,58%	6,89%	0,23%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,17%	0,86%	0,53%	0,84%	1,75%	7,14%	0,23%	0,00%
IRF-M (Benchmark)	-0,47%	-2,04%	-0,06%	-1,25%	-1,40%	8,27%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,50%	-2,19%	-0,17%	-1,40%	-1,69%	7,71%	1,28%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,36%	1,64%	0,94%	1,49%	2,44%	6,76%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,38%	1,54%	0,98%	1,34%	1,98%	6,32%	0,02%	0,01%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,39%	1,47%	1,00%	1,29%	1,84%	-	0,01%	0,01%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.cef.gov.br/epv/validadoc/seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,45%	1,61%	1,00%	1,45%	2,41%	6,22%	0,05%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,96%	4,76%	2,34%	4,50%	8,99%	11,51%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,78%	-0,06%	-0,54%	-0,09%	0,90%	10,67%	1,68%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



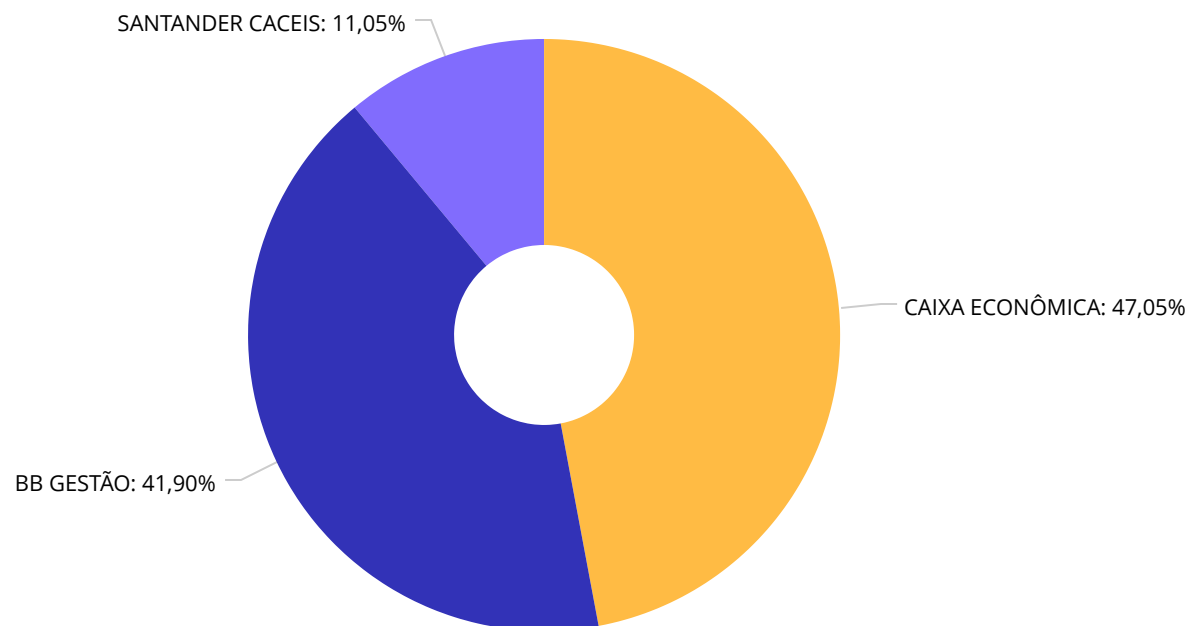
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-3,94%	2,34%	2,44%	5,85%	18,35%	19,63%	-	-
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	-2,48%	1,36%	0,88%	4,49%	11,04%	29,20%	7,37%	0,20%
CDI (Benchmark)	0,36%	1,64%	0,94%	1,49%	2,44%	6,76%	-	-
BNB FI MULTIMERCADO LP	-0,18%	-0,14%	0,50%	-0,23%	-0,40%	5,39%	0,74%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



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

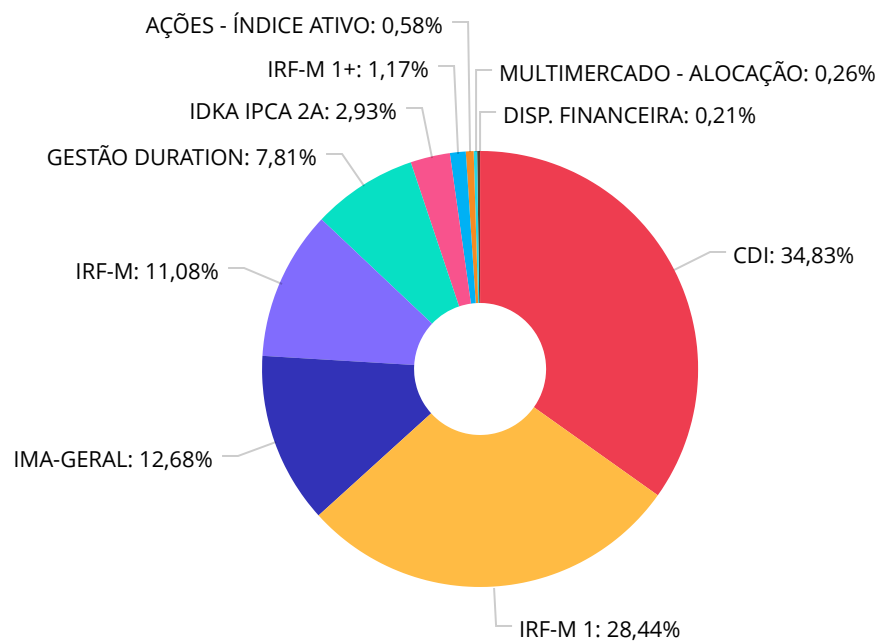


CAIXA ECONÔMICA	35.716.851,55
BB GESTÃO	31.804.340,99
SANTANDER CACEIS	8.389.870,27

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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



CDI	26.499.111,66
IRF-M 1	21.637.680,33
IMA-GERAL	9.649.341,10
IRF-M	8.425.341,20
GESTÃO DURATION	5.942.700,99
IDKA IPCA 2A	2.231.721,41
IRF-M 1+	889.571,26
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	439.581,06
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	195.991,70
DISP. FINANCEIRA	162.081,23

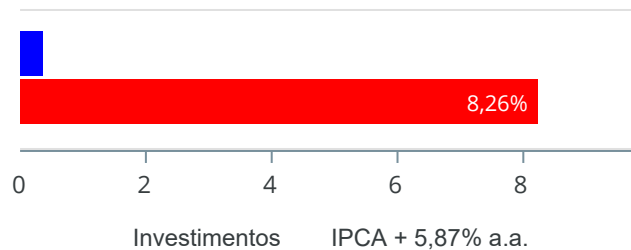
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etc.ce.gov.br/epp/validacao/searh/Código do documento: 67100489b-b761-4b45-afcf-3b85229d2c91>



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	Variação
Janeiro	68.596.497,97	0,00	0,00	68.502.207,86	-94.290,11	-94.290,11	-0,14%	-0,14%	0,70%	0,70%	-19,50%	0,56%
Fevereiro	68.502.207,86	2.000.000,00	450.000,00	69.845.078,89	-207.128,97	-301.419,08	-0,30%	-0,43%	1,27%	1,99%	-21,79%	0,42%
Março	69.845.078,89	1.700.471,70	530.000,00	70.952.174,78	-63.375,81	-364.794,89	-0,09%	-0,52%	1,46%	3,47%	-15,03%	0,39%
Abril	70.952.174,78	1.218.000,00	0,00	72.443.028,79	272.854,01	-91.940,88	0,38%	-0,15%	0,77%	4,26%	-3,41%	0,39%
Maiο	72.443.028,79	1.683.000,00	538.000,00	73.801.662,86	213.634,07	121.693,19	0,29%	0,14%	1,31%	5,63%	2,57%	0,39%
Junho	73.801.662,86	1.685.000,00	538.300,00	75.092.787,92	144.425,06	266.118,25	0,19%	0,34%	1,01%	6,70%	5,04%	0,39%
Julho	75.092.787,92	1.359.371,65	555.000,00	75.911.070,79	13.911,22	280.029,47	0,02%	0,36%	1,46%	8,26%	4,31%	0,39%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



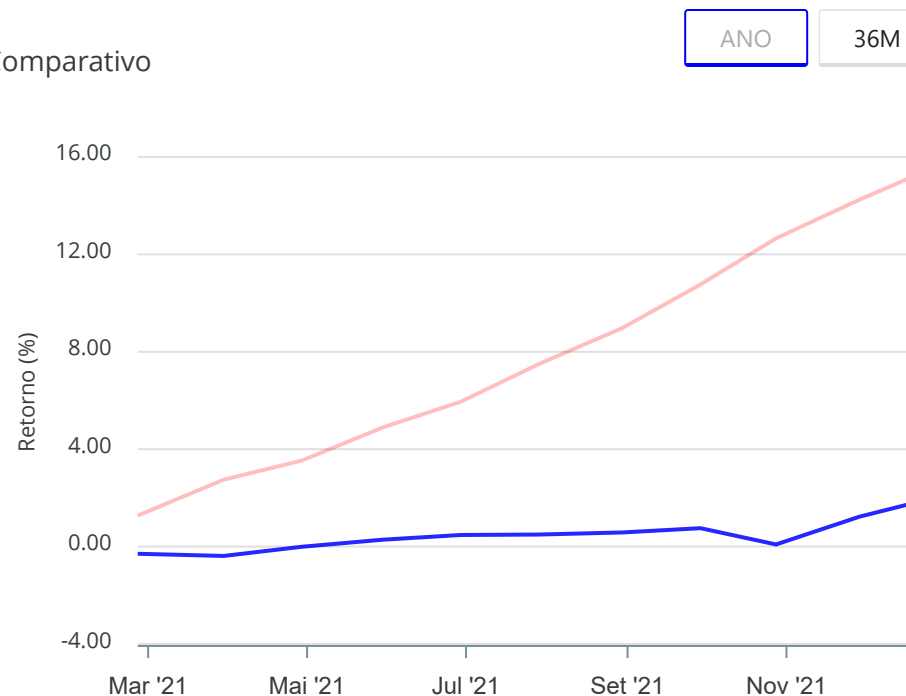


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.027.926,64	0,00	0,00	11.077.744,60	49.817,96	0,45%	0,45%	0,05%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.723.943,70	0,00	0,00	7.754.295,51	30.351,81	0,39%	0,39%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.191.122,58	0,00	555.000,00	7.667.073,54	30.950,96	0,38%	0,38%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.325.343,24	0,00	0,00	9.340.866,65	15.523,41	0,17%	0,17%	0,23%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	12.276.643,97	0,00	0,00	12.296.819,68	20.175,71	0,16%	0,16%	0,23%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	542.809,56	0,00	0,00	543.262,59	453,03	0,08%	0,08%	0,88%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.689.557,98	0,00	0,00	1.688.460,82	-1.097,16	-0,06%	-0,06%	0,95%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.673.495,52	0,00	0,00	9.649.345,16	-24.150,36	-0,25%	-0,25%	1,14%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.467.571,86	0,00	0,00	8.425.341,28	-42.230,58	-0,50%	-0,50%	1,28%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.630.147,88	1.359.371,65	0,00	5.942.709,94	-46.809,59	-0,78%	-0,78%	1,68%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	897.123,09	0,00	0,00	889.572,26	-7.550,83	-0,84%	-0,84%	1,87%
Total Renda Fixa	74.445.686,02	1.359.371,65	555.000,00	75.275.492,03	25.434,36	0,03%		0,55%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://seccap.gov.br/app/validador/validarCodigo do documento: 621d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BNB FI MULTIMERCADO LP	196.353,07	0,00	0,00	195.991,70	-361,37	-0,18%	-0,18%	0,74%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	450.748,83	0,00	0,00	439.587,06	-11.161,77	-2,48%	-2,48%	7,37%
Total Renda Variável	647.101,90	0,00	0,00	635.578,76	-11.523,14	-1,78%		5,33%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://etec.ce.gov.br/pp/vaidadoc/seam Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pia.gov.br/app/qualificaDoc/seam> Código do Documento: 67140696-b2b1-4016-b0fc-7-3b852799cc91

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <http://etcpe-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afc7-3b85229d2c91



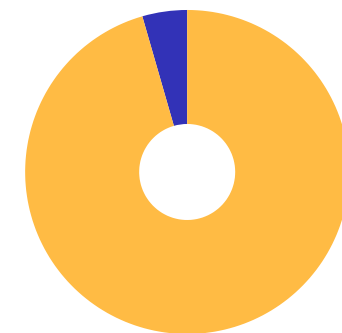
Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	13.635.558,93	17,32%	585	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.271.097,30	2,88%	1.007	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	6.325.693,83	8,03%	1.156	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.370.956,33	10,63%	599	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.272.857,00	6,70%	976	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.253.908,77	4,13%	1.048	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	9.483.697,69	12,04%	1.278	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	280,40	0,00%	297	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.787.741,73	9,89%	63	2,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	11.132.119,27	14,14%	750	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.697.934,30	9,78%	500	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3 du	Não há	1.029.753,44	1,31%	44.750	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.012.618,66	1,29%	27.324	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	429.923,29	0,55%	899	0,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNB FI MULTIMERCADO LP	D+3 du	Não há	1.044.130,10	1,33%	197	15,30%	Artigo 8º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		131.167,88	0,17%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			78.748.271,04				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			131.167,88	Artigo 6º			
PL Total			78.879.438,92				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	78.748.271,04
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	48.614.050,25	61,73%	50,00%	62,00%	100,00%	30.134.220,79
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	23.624.481,31
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.937.413,55
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	15.749.654,21
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	47.248.962,62
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	26.617.795,30	33,80%	0,00%	33,00%	40,00%	4.881.513,12
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	31.499.308,42
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	15.749.654,21
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	11.812.240,66
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	11.812.240,66
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.937.413,55
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.937.413,55
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.937.413,55
Total Renda Fixa	100,00%	75.231.845,55	95,53%	50,00%	95,00%	460,00%	



RENTA FIXA 75.231.845,55
RENTA VARIÁVEL 3.516.425,49

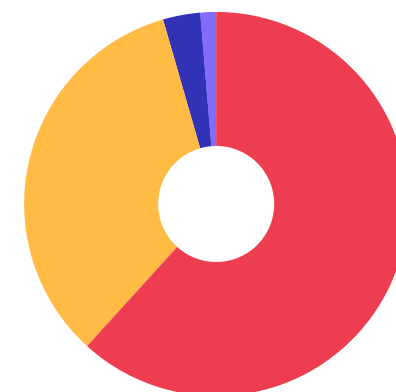
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	23.624.481,31
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	23.624.481,31
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	2.472.295,39	3,14%	0,00%	4,00%	6,00%	2.252.600,87
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	15.749.654,21
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.044.130,10	1,33%	0,00%	1,00%	2,00%	530.835,32
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.937.413,55
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.937.413,55
Total Renda Variável	30,00%	3.516.425,49	4,47%	0,00%	5,00%	98,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.874.827,10
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	1.574.965,42
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.874.827,10
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	22,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/ppv/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	36.840.797,43	46,78	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	32.645.678,49	41,46	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	9.261.795,12	11,76	0,11

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Documento Assinado Digitalmente por: CARLOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: https://repositorio.capiabari.org.br/validar/ocorrencia/validar_documento/62100430-1201-40ff-8c7-3b55239d2691



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,34%	-0,78%	-0,12%	0,49%	1,31%	7,55%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,45%	-1,37%	-0,59%	0,09%	0,99%	7,11%	1,38%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,26%	1,95%	-0,23%	2,29%	5,08%	15,28%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	1,68%	0,17%	2,06%	5,08%	14,20%	1,09%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,19%	1,70%	-0,15%	2,10%	4,83%	14,10%	1,13%	0,02%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-1,11%	-5,18%	-1,73%	-1,87%	-3,32%	6,96%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,16%	-5,38%	-1,85%	-2,10%	-3,58%	6,45%	2,20%	0,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,37%	1,37%	0,77%	1,29%	2,24%	7,41%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33%	1,16%	0,68%	1,12%	1,83%	6,69%	0,15%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,34%	1,21%	0,70%	1,17%	2,00%	6,95%	0,15%	0,00%
IRF-M (Benchmark)	-0,60%	-2,63%	-0,86%	-0,67%	-1,25%	7,35%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,65%	-2,82%	-0,97%	-0,86%	-1,54%	6,76%	1,47%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,43%	2,07%	1,10%	1,78%	2,72%	6,68%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,40%	1,95%	1,10%	1,67%	2,24%	6,23%	0,02%	0,01%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,43%	1,90%	1,13%	1,66%	2,13%	-	0,01%	0,01%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.gov.br/epv/validarDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,49%	2,11%	1,25%	1,87%	2,76%	6,22%	0,06%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,87%	5,67%	2,38%	4,51%	9,68%	12,35%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-1,45%	-1,51%	-2,22%	-1,04%	-0,01%	9,20%	1,87%	0,03%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.etc-pe.gov.br/ep/vaiadaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



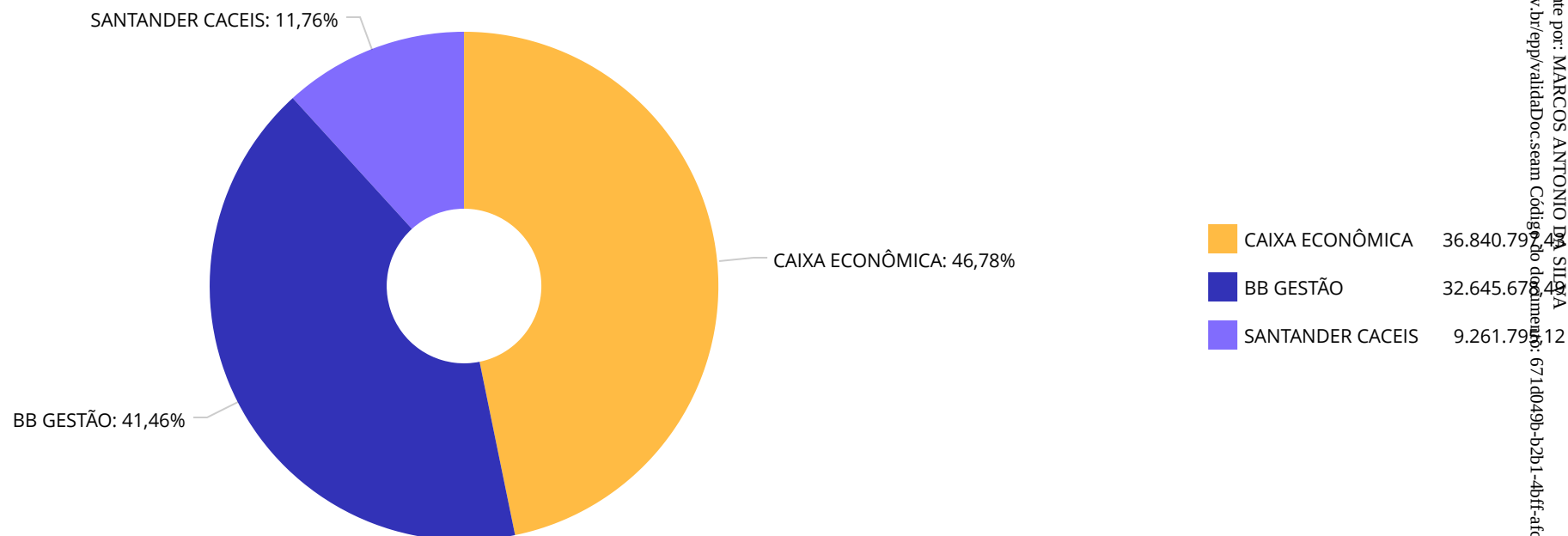
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	2,90%	20,41%	7,58%	18,67%	29,21%	54,54%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	3,26%	21,92%	8,58%	19,23%	29,64%	-	3,85%	0,13%
Ibovespa (Benchmark)	-2,48%	-0,20%	-5,89%	7,95%	19,54%	17,45%	-	-
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	-2,20%	-0,87%	-5,11%	6,63%	12,93%	25,99%	6,52%	0,20%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,06%	0,75%	-5,54%	11,42%	22,72%	32,58%	7,26%	0,24%
CDI (Benchmark)	0,43%	2,07%	1,10%	1,78%	2,72%	6,68%	-	-
BNB FI MULTIMERCADO LP	0,00%	-0,13%	0,01%	0,31%	0,14%	4,96%	0,53%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ite.pe.gov.br/ep/vai/validaDoc/seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



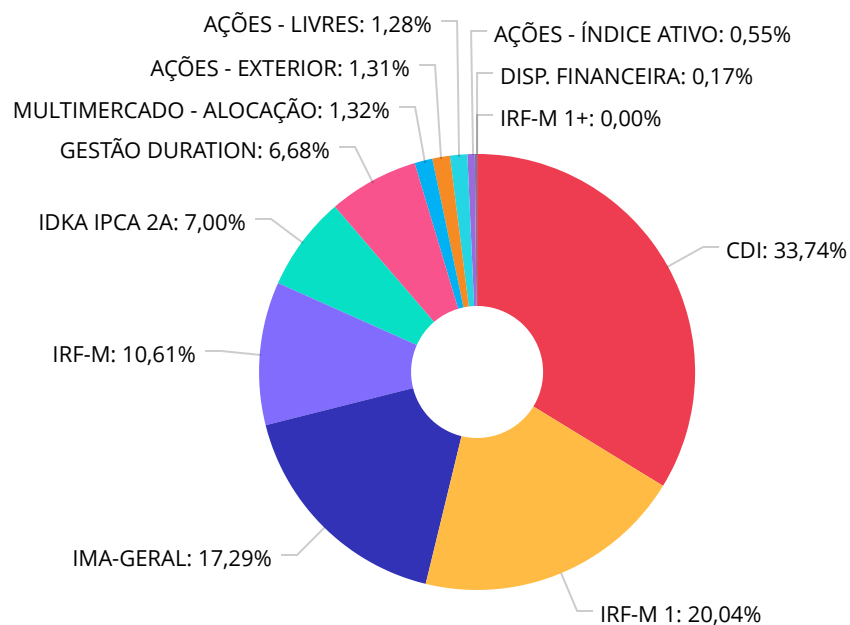
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Agosto / 2021)



Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-af7-3b85229d2c91



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



CDI	26.617.791,33
IRF-M 1	15.809.391,55
IMA-GERAL	13.635.559,99
IRF-M	8.370.951,33
IDKA IPCA 2A	5.525.000,00
GESTÃO DURATION	5.272.851,00
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.044.131,10
AÇÕES - EXTERIOR	1.029.751,44
AÇÕES - LIVRES	1.012.611,66
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	429.921,29
DISP. FINANCEIRA	131.161,88
IRF-M 1+	28,40

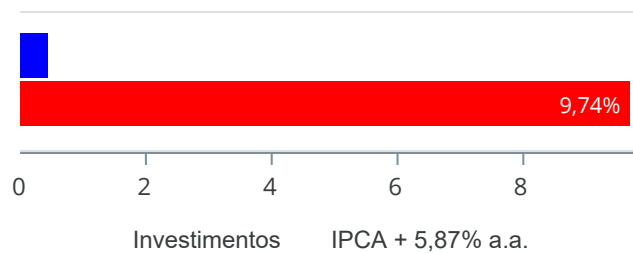
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/pepp/validador/secao/Código do documento: 6710080b-b811-4b45-a1c7-0b85229d2c91>



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V.R.
Janeiro	68.596.497,97	0,00	0,00	68.502.207,86	-94.290,11	-94.290,11	-0,14%	-0,14%	0,70%	0,70%	-19,50%	0,00%
Fevereiro	68.502.207,86	2.000.000,00	450.000,00	69.845.078,89	-207.128,97	-301.419,08	-0,30%	-0,43%	1,27%	1,99%	-21,79%	0,00%
Março	69.845.078,89	1.700.471,70	530.000,00	70.952.174,78	-63.375,81	-364.794,89	-0,09%	-0,52%	1,46%	3,47%	-15,03%	0,00%
Abril	70.952.174,78	1.218.000,00	0,00	72.443.028,79	272.854,01	-91.940,88	0,38%	-0,15%	0,77%	4,26%	-3,41%	0,00%
Mai	72.443.028,79	1.683.000,00	538.000,00	73.801.662,86	213.634,07	121.693,19	0,29%	0,14%	1,31%	5,63%	2,57%	0,00%
Junho	73.801.662,86	1.685.000,00	538.300,00	75.092.787,92	144.425,06	266.118,25	0,19%	0,34%	1,01%	6,70%	5,04%	0,00%
Julho	75.092.787,92	1.359.371,65	555.000,00	75.911.070,79	13.911,22	280.029,47	0,02%	0,36%	1,46%	8,26%	4,31%	0,00%
Agosto	75.911.070,79	10.368.962,14	7.599.496,61	78.748.271,04	67.734,72	347.764,19	0,09%	0,44%	1,37%	9,74%	4,54%	0,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://www.trepa.gov.br/portal/validar-assinatura>
Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91

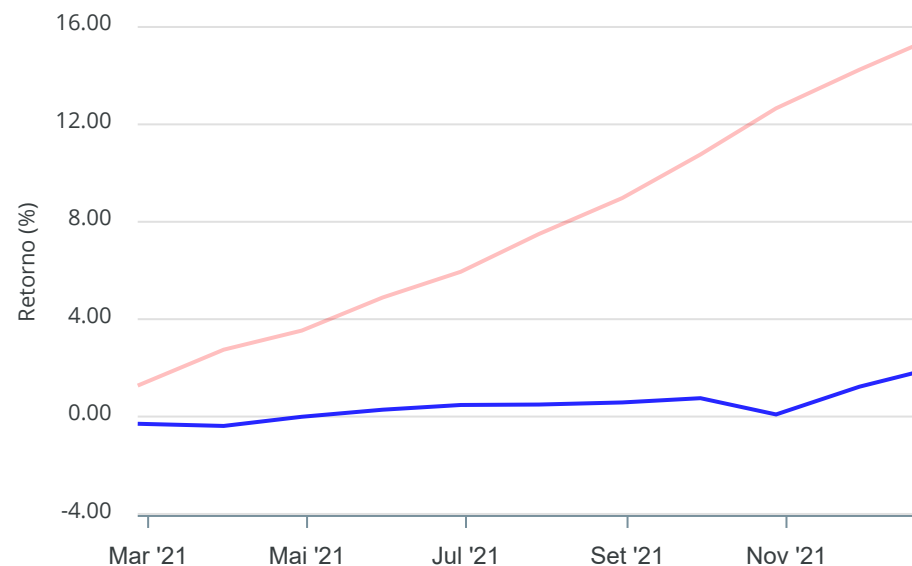


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos Meta de Rentabilidade

☐ CDI ☐ IMA-B

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

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b0f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.077.744,60	0,00	0,00	11.132.119,27	54.374,67	0,49%	0,49%	0,06%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	543.262,59	1.717.771,90	0,00	2.271.097,30	10.062,81	0,45%	0,18%	1,09%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.688.460,82	1.551.442,22	0,00	3.253.908,77	14.005,73	0,43%	0,19%	1,13%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.754.295,51	0,00	0,00	7.787.741,73	33.446,22	0,43%	0,43%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.667.073,54	0,00	0,00	7.697.934,30	30.860,76	0,40%	0,40%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.340.866,65	125.912,45	15.450,00	9.483.697,69	32.368,59	0,34%	0,34%	0,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	12.296.819,68	0,00	6.000.000,00	6.325.693,83	28.874,15	0,23%	0,33%	0,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	127.183,71	126.904,71	280,40	1,40	0,00%	-1,16%	2,20%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.649.345,16	4.000.000,00	0,00	13.635.558,93	-13.786,23	-0,10%	-0,45%	1,38%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.425.341,28	0,00	0,00	8.370.956,33	-54.384,95	-0,65%	-0,65%	1,47%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.942.709,94	0,00	583.800,00	5.272.857,00	-86.052,94	-1,45%	-1,45%	1,87%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	889.572,26	0,00	873.341,90	0,00	-16.230,36	-1,82%	-1,19%	2,20%
Total Renda Fixa	75.275.492,03	7.522.310,28	7.599.496,61	75.231.845,55	33.539,85	0,04%		0,67%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://eic.ice.gov.br/epi/validador.aspx?codigo_documento=671d049b-b291-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.029.753,44	29.753,44	2,98%	3,26%	3,85%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.012.618,66	12.618,66	1,26%	-2,06%	7,26%
BNB FI MULTIMERCADO LP	195.991,70	846.651,86	0,00	1.044.130,10	1.486,54	0,14%	0,00%	0,53%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	439.587,06	0,00	0,00	429.923,29	-9.663,77	-2,20%	-2,20%	6,52%
Total Renda Variável	635.578,76	2.846.651,86	0,00	3.516.425,49	34.194,87	0,98%		4,17%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://receita.faz.br/portal/validarDocumento?codigo=671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tee.pb.gov.br/app/qualificaDoc/seam> Código do Documento: 67140696-b2b1-4016-b0fc7-3b852299cc91

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.cpf-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



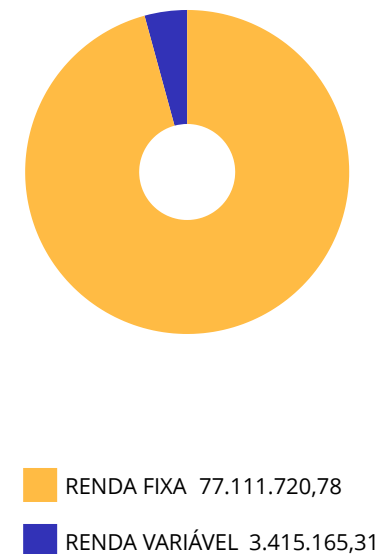
Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	13.634.834,60	16,93%	578	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.294.567,87	2,85%	1.014	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	6.348.865,88	7,88%	1.140	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.339.495,83	10,36%	581	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.703.315,38	5,84%	964	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	5.463.259,54	6,78%	1.057	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	9.581.994,14	11,90%	1.264	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	278,21	0,00%	294	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.822.912,82	9,71%	66	2,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	11.191.091,50	13,90%	790	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.731.105,01	9,60%	500	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3 du	Não há	980.506,77	1,22%	45.479	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	972.296,00	1,21%	27.215	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	416.880,08	0,52%	892	0,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNB FI MULTIMERCADO LP	D+3 du	Não há	1.045.482,46	1,30%	192	15,71%	Artigo 8º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		102.310,32	0,13%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			80.526.886,09				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			102.310,32				Artigo 6º
PL Total			80.629.196,41				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	80.526.886,09
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	50.366.611,45	62,55%	50,00%	62,00%	100,00%	30.160.274,64
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	24.158.065,83
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.026.344,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	16.105.377,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	48.316.131,65
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	26.745.109,33	33,21%	0,00%	33,00%	40,00%	5.465.645,11
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	32.210.754,44
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	16.105.377,22
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	12.079.032,91
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	12.079.032,91
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.026.344,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.026.344,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.026.344,30
Total Renda Fixa	100,00%	77.111.720,78	95,76%	50,00%	95,00%	460,00%	



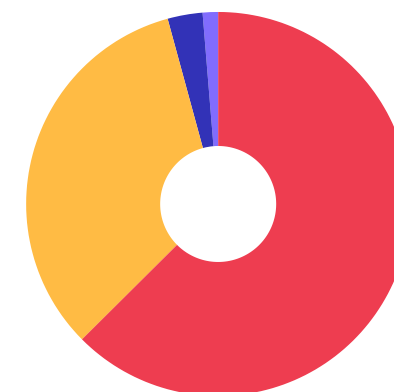
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	24.158.065,83
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	24.158.065,83
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	2.369.682,85	2,94%	0,00%	4,00%	6,00%	2.461.930,32
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	16.105.377,22
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.045.482,46	1,30%	0,00%	1,00%	2,00%	565.055,26
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.026.344,30
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.026.344,30
Total Renda Variável	30,00%	3.415.165,31	4,24%	0,00%	5,00%	98,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	8.052.688,61
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	1.610.537,72
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	8.052.688,61
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	22,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/ppv/validarDoc/seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	38.671.043,78	48,02	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	32.570.566,95	40,45	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	9.285.275,36	11,53	0,11

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Documento Assinado Digitalmente por: CARLOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: https://www.cvm.gov.br/validarassinatura/validarassinatura.do?documento=621d043b-12b1-40ff-8c7-3b55239d2691



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,02%	-0,76%	-0,42%	0,89%	2,05%	6,02%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	-1,38%	-0,70%	0,51%	1,75%	5,52%	0,80%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,10%	3,07%	1,18%	3,12%	6,21%	14,71%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08%	2,79%	1,21%	2,82%	5,92%	13,71%	0,78%	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	2,74%	1,30%	2,74%	6,05%	13,77%	0,73%	0,02%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,73%	-5,87%	-2,65%	-1,15%	-3,14%	4,23%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,78%	-6,12%	-2,78%	-1,40%	-3,39%	3,69%	2,06%	0,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,40%	1,78%	0,96%	1,65%	2,49%	7,15%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,38%	1,59%	0,89%	1,54%	2,25%	6,68%	0,29%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,37%	1,53%	0,87%	1,48%	2,16%	6,42%	0,30%	0,00%
IRF-M (Benchmark)	-0,33%	-2,95%	-1,39%	-0,15%	-1,02%	5,48%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,38%	-3,19%	-1,51%	-0,38%	-1,26%	4,87%	1,41%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,53%	2,65%	1,48%	2,31%	3,31%	6,30%	0,13%	0,01%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,45%	2,36%	1,28%	1,99%	2,76%	-	0,01%	0,01%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	2,39%	1,22%	1,95%	2,87%	6,17%	0,03%	0,00%
IPCA (Benchmark)	1,16%	6,90%	3,02%	4,75%	10,25%	13,70%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,36%	-1,16%	-1,87%	-0,98%	0,86%	7,32%	0,48%	0,03%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afc7-3b85229d2c91



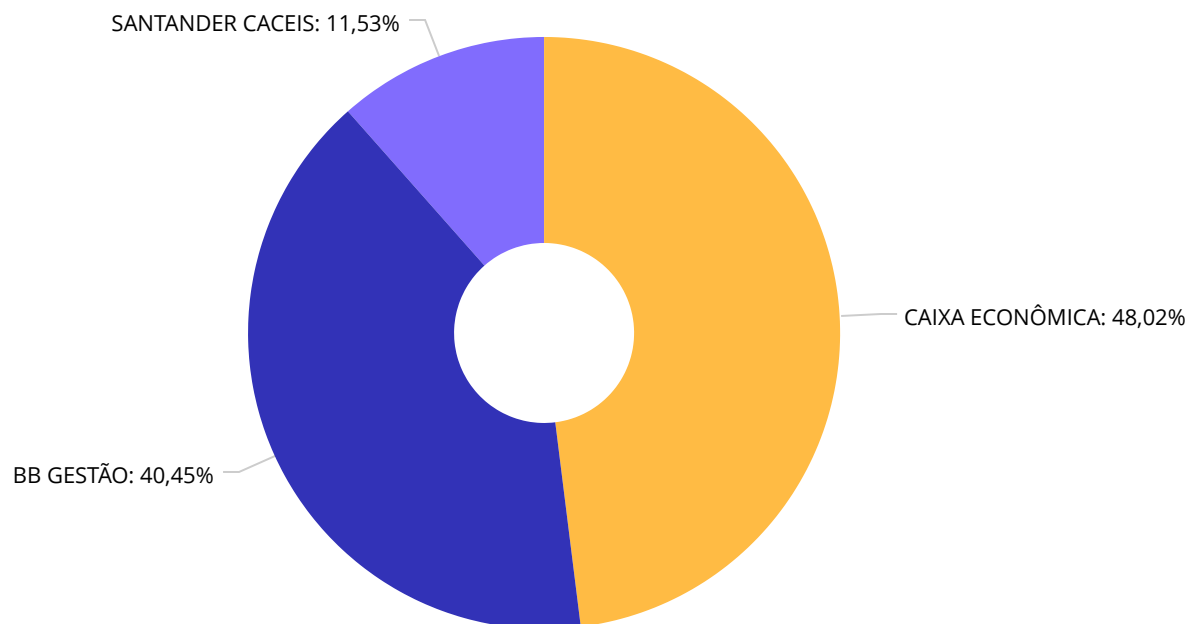
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	-4,76%	14,68%	0,23%	8,42%	28,09%	44,71%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-4,78%	16,09%	0,67%	9,26%	28,99%	-	5,97%	0,13%
Ibovespa (Benchmark)	-6,57%	-6,75%	-12,48%	-4,85%	17,31%	5,95%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,98%	-3,26%	-8,58%	-1,61%	23,96%	25,09%	11,83%	0,24%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	-3,03%	-3,88%	-7,51%	-3,34%	15,88%	18,96%	10,24%	0,19%
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
BNB FI MULTIMERCADO LP	0,13%	0,00%	-0,05%	0,43%	1,23%	4,48%	0,62%	0,01%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.itec.gov.br/ep/va/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

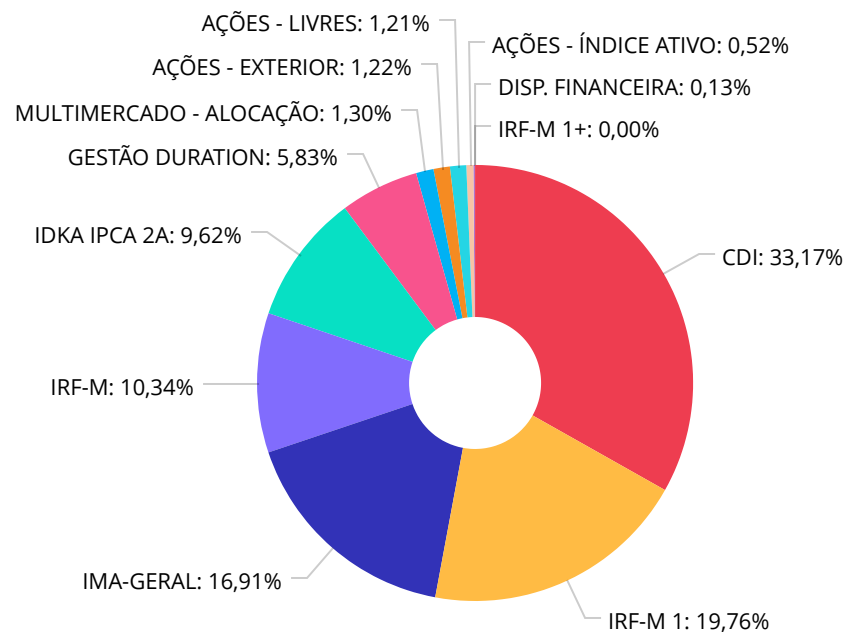


CAIXA ECONÔMICA	38.671.047,71
BB GESTÃO	32.570.569,99
SANTANDER CACEIS	9.285.270,36

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-af7-3b85229d2c91



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



CDI	26.745.101,33
IRF-M 1	15.930.860,00
IMA-GERAL	13.634.831,68
IRF-M	8.339.491,31
IDKA IPCA 2A	7.757.821,46
GESTÃO DURATION	4.703.311,33
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.045.481,46
AÇÕES - EXTERIOR	980.501,77
AÇÕES - LIVRES	972.291,00
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	416.881,08
DISP. FINANCEIRA	102.311,32
IRF-M 1+	27,21

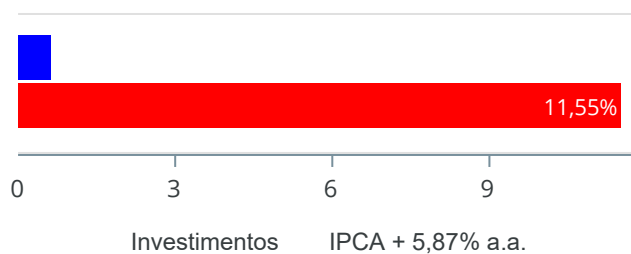
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/pepp/validarDoc.aspx?CodigoDocumento=611009b-b914b-4b0-a1c7-6b85229d2c91>



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V.R.
Janeiro	68.596.497,97	0,00	0,00	68.502.207,86	-94.290,11	-94.290,11	-0,14%	-0,14%	0,70%	0,70%	-19,50%	0,00%
Fevereiro	68.502.207,86	2.000.000,00	450.000,00	69.845.078,89	-207.128,97	-301.419,08	-0,30%	-0,43%	1,27%	1,99%	-21,79%	0,00%
Março	69.845.078,89	1.700.471,70	530.000,00	70.952.174,78	-63.375,81	-364.794,89	-0,09%	-0,52%	1,46%	3,47%	-15,03%	0,00%
Abril	70.952.174,78	1.218.000,00	0,00	72.443.028,79	272.854,01	-91.940,88	0,38%	-0,15%	0,77%	4,26%	-3,41%	0,00%
Maiο	72.443.028,79	1.683.000,00	538.000,00	73.801.662,86	213.634,07	121.693,19	0,29%	0,14%	1,31%	5,63%	2,57%	0,00%
Junho	73.801.662,86	1.685.000,00	538.300,00	75.092.787,92	144.425,06	266.118,25	0,19%	0,34%	1,01%	6,70%	5,04%	0,00%
Julho	75.092.787,92	1.359.371,65	555.000,00	75.911.070,79	13.911,22	280.029,47	0,02%	0,36%	1,46%	8,26%	4,31%	0,00%
Agosto	75.911.070,79	10.368.962,14	7.599.496,61	78.748.271,04	67.734,72	347.764,19	0,09%	0,44%	1,37%	9,74%	4,54%	0,00%
Setembro	78.748.271,04	2.244.737,81	605.917,23	80.526.886,09	139.794,47	487.558,66	0,17%	0,62%	1,64%	11,55%	5,34%	0,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://pccceia-pe.gov.br/npw/validar-segna> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b4f-afcf-3b85229d2c91



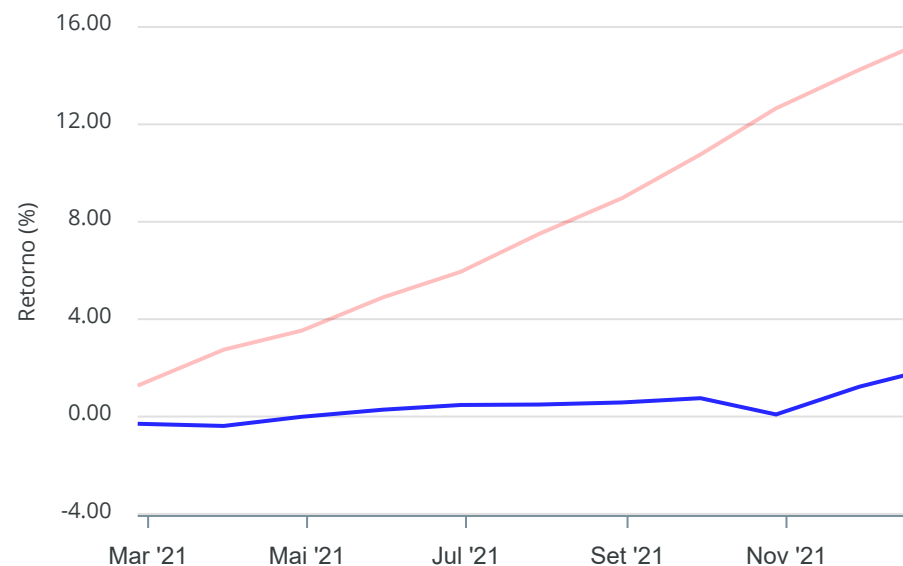
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b0f-a1c7-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.271.097,30	0,00	0,00	2.294.567,87	23.470,57	1,03%	1,03%	0,73%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.253.908,77	2.164.584,53	0,00	5.463.259,54	44.766,24	0,83%	1,08%	0,78%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.132.119,27	0,00	0,00	11.191.091,50	58.972,23	0,53%	0,53%	0,13%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.787.741,73	0,00	0,00	7.822.912,82	35.171,09	0,45%	0,45%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.697.934,30	0,00	0,00	7.731.105,01	33.170,71	0,43%	0,43%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.483.697,69	80.153,28	17.917,23	9.581.994,14	36.060,40	0,38%	0,38%	0,29%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	6.325.693,83	0,00	0,00	6.348.865,88	23.172,05	0,37%	0,37%	0,30%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.272.857,00	0,00	588.000,00	4.703.315,38	18.458,38	0,35%	0,35%	0,48%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.635.558,93	0,00	0,00	13.634.834,60	-724,33	-0,01%	-0,01%	0,80%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.370.956,33	0,00	0,00	8.339.495,83	-31.460,50	-0,38%	-0,38%	1,41%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	280,40	0,00	0,00	278,21	-2,19	-0,78%	-0,78%	2,06%
Total Renda Fixa	75.231.845,55	2.244.737,81	605.917,23	77.111.720,78	241.054,65	0,31%		0,48%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://seccrscpe.gov.br/cnp/validador.aspx?codigo_documento=621d04b0-b2b1-4b0f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BNB FI MULTIMERCADO LP	1.044.130,10	0,00	0,00	1.045.482,46	1.352,36	0,13%	0,13%	0,62%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	429.923,29	0,00	0,00	416.880,08	-13.043,21	-3,03%	-3,03%	10,24%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.012.618,66	0,00	0,00	972.296,00	-40.322,66	-3,98%	-3,98%	11,83%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.029.753,44	0,00	0,00	980.506,77	-49.246,67	-4,78%	-4,78%	5,97%
Total Renda Variável	3.516.425,49	0,00	0,00	3.415.165,31	-101.260,18	-2,88%		6,52%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: 30/09/2021 14:05:00
URL: https://efc.cnpj.gov.br/epi/validaDoc.seam Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.027.926,64	0,00	0,00	11.191.091,50	163.164,86	1,48%	1,48%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.723.943,70	0,00	0,00	7.822.912,82	98.969,12	1,28%	1,28%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.191.122,58	0,00	555.000,00	7.731.105,01	94.982,43	1,16%	1,22%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.325.343,24	206.065,73	33.367,23	9.581.994,14	83.952,40	0,88%	0,89%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	12.276.643,97	0,00	6.000.000,00	6.348.865,88	72.221,91	0,59%	0,87%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.689.557,98	3.716.026,75	0,00	5.463.259,54	57.674,81	1,07%	1,21%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	542.809,56	1.717.771,90	0,00	2.294.567,87	33.986,41	1,50%	1,30%
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	99.946,31	0,00	0,00	102.310,32	2.364,01	2,37%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	127.183,71	126.904,71	278,21	-0,79	0,00%	-2,78%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	897.123,09	0,00	873.341,90	0,00	-23.781,19	-2,65%	-2,82%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.673.495,52	4.000.000,00	0,00	13.634.834,60	-38.660,92	-0,28%	-0,70%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.630.147,88	1.359.371,65	1.171.800,00	4.703.315,38	-114.404,15	-1,91%	-1,87%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.467.571,86	0,00	0,00	8.339.495,83	-128.076,03	-1,51%	-1,51%
Total Renda Fixa					302.392,87	0,39%	

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://seccr.cape.gov.br/epg/validacao/assinatura/621d049b-b291-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inscrição
BNB FI MULTIMERCADO LP	196.353,07	846.651,86	0,00	1.045.482,46	2.477,53	0,24%	-0,05%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	980.506,77	-19.493,23	-1,95%	0,67%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	972.296,00	-27.704,00	-2,77%	-8,57%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	450.748,83	0,00	0,00	416.880,08	-33.868,75	-7,51%	-7,51%
				Total Renda Variável	-78.588,45	-2,25%	

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://brasil.gov.br/app/validarDoc/seam Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tee.pb.gov.br/app/validaDocumento.aspx?CodigoDocumento:67140696-b2b1-4016-b0fc7-3b852299cc91>

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <http://etcpe.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.cef.gov.br/ep/validarDoc.aspx?CodigoDoDocumento=671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91>

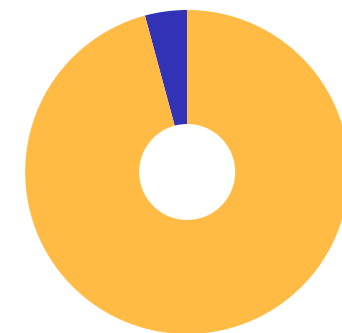
Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	13.413.086,88	16,44%	569	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.265.822,47	2,78%	1.026	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	6.315.931,62	7,74%	1.136	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.116.170,69	9,95%	562	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.060.877,73	4,98%	959	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	5.392.638,95	6,61%	1.062	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	9.603.920,28	11,77%	1.252	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	142,47	0,00%	282	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.864.354,14	9,64%	68	2,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.114.202,67	2,59%	195	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	11.247.364,09	13,79%	813	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.771.334,20	9,52%	508	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3 du	Não há	1.051.014,03	1,29%	45.754	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	923.463,23	1,13%	27.718	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	404.809,99	0,50%	873	0,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNB FI MULTIMERCADO LP	D+3 du	Não há	1.045.664,38	1,28%	186	16,83%	Artigo 8º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		109.328,90	0,13%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			81.590.797,82				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			109.328,90	Artigo 6º			
PL Total			81.700.126,72				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	81.590.797,82
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	49.168.591,09	60,26%	50,00%	62,00%	100,00%	32.422.206,73
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	24.477.239,35
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.079.539,89
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	16.318.159,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	48.954.478,69
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	28.997.255,10	35,54%	0,00%	33,00%	40,00%	3.639.064,03
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	32.636.319,13
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	16.318.159,56
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	12.238.619,67
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	12.238.619,67
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.079.539,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.079.539,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.079.539,89
Total Renda Fixa	100,00%	78.165.846,19	95,80%	50,00%	95,00%	460,00%	



RENDA FIXA 78.165.846,19
RENDA VARIÁVEL 3.424.951,63

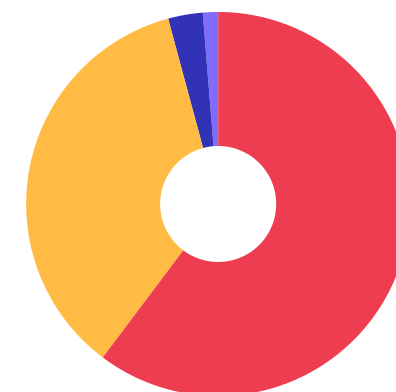
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	24.477.239,35
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	24.477.239,35
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	2.379.287,25	2,92%	0,00%	4,00%	6,00%	2.516.160,62
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	16.318.159,56
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.045.664,38	1,28%	0,00%	1,00%	2,00%	586.151,58
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.079.539,89
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.079.539,89
Total Renda Variável	30,00%	3.424.951,63	4,20%	0,00%	5,00%	98,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	8.159.079,78
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	1.631.815,96
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	8.159.079,78
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	22,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/ppv/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	38.076.277,72	46,67	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	32.085.488,92	39,32	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	9.314.828,51	11,42	0,11
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.114.202,67	2,59	0,00

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Documento Assinado Digitalmente por: CARLOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: https://www.fundoprevidencia.org.br/portal/validarassinatura/ocorrencia/62100430-1201-40ff-8c7-3b55239d2691



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-1,35%	-2,10%	-1,67%	-0,96%	0,67%	2,85%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,63%	-2,98%	-2,07%	-1,74%	0,17%	1,97%	1,99%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-1,47%	1,56%	-0,12%	0,25%	4,62%	11,66%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,29%	1,46%	-0,03%	0,47%	4,40%	10,83%	1,97%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,25%	1,45%	-0,05%	0,61%	4,38%	10,97%	1,89%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-3,44%	-9,10%	-5,21%	-5,61%	-5,90%	-1,54%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-3,49%	-9,40%	-5,35%	-5,88%	-6,24%	-2,10%	3,96%	0,06%
IRF-M 1 (Benchmark)	-0,54%	1,23%	0,23%	0,83%	1,78%	5,91%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,54%	1,05%	0,18%	0,71%	1,56%	5,47%	0,73%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,52%	1,00%	0,18%	0,70%	1,52%	5,24%	0,74%	0,01%
IRF-M (Benchmark)	-2,63%	-5,50%	-3,53%	-3,59%	-3,30%	0,99%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,68%	-5,78%	-3,67%	-3,83%	-3,60%	0,38%	3,02%	0,04%
CDI (Benchmark)	0,48%	3,00%	1,35%	2,29%	3,32%	6,65%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,50%	3,17%	1,53%	2,55%	3,70%	6,36%	0,08%	0,01%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,53%	2,91%	1,42%	2,43%	3,24%	5,83%	0,03%	0,01%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.gov.br/epv/validarDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	2,92%	1,36%	2,35%	3,28%	6,19%	0,03%	0,00%
IPCA (Benchmark)	1,25%	8,24%	3,32%	5,73%	10,67%	15,01%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,66%	-1,82%	-1,75%	-2,29%	0,30%	4,82%	0,96%	0,03%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,72%	-2,35%	-1,37%	-0,82%	0,85%	2,10%	1,48%	0,03%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.cef.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



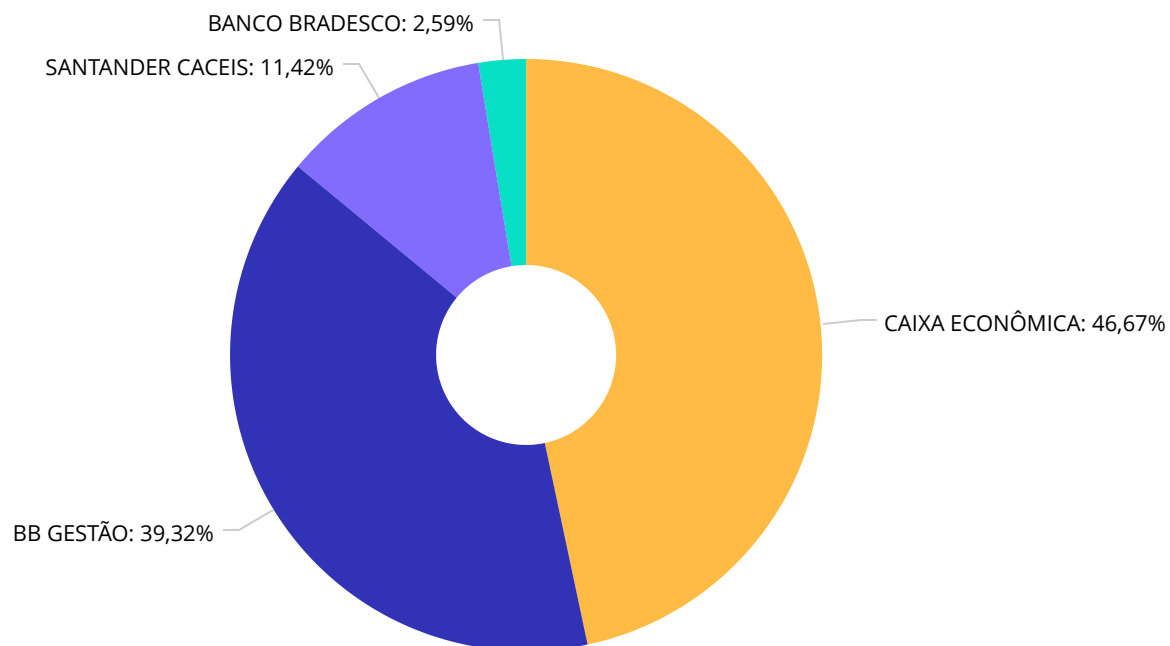
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	6,91%	22,61%	4,78%	10,15%	40,84%	51,61%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	7,19%	24,44%	5,39%	11,16%	41,24%	-	5,72%	0,13%
Ibovespa (Benchmark)	-6,74%	-13,04%	-15,02%	-12,95%	10,16%	-3,47%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-5,02%	-8,12%	-10,68%	-8,86%	18,52%	15,82%	10,48%	0,25%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	-2,90%	-6,66%	-7,91%	-7,10%	13,68%	12,17%	9,14%	0,19%
CDI (Benchmark)	0,48%	3,00%	1,35%	2,29%	3,32%	6,65%	-	-
BNB FI MULTIMERCADO LP	0,02%	0,01%	0,15%	0,65%	1,48%	3,88%	0,81%	0,01%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.itec.pe.gov.br/ep/vvalidadoc/seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



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

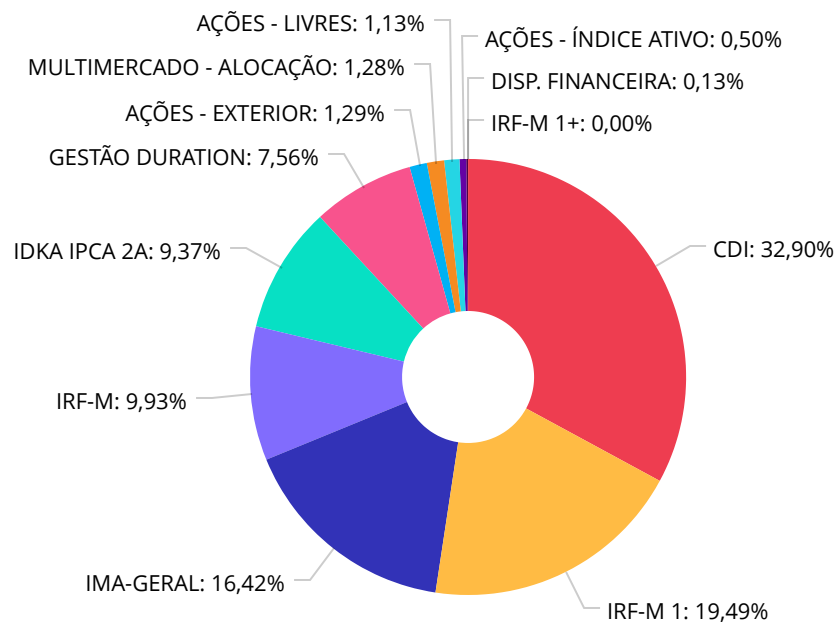


CAIXA ECONÔMICA	38.076.277,77
BB GESTÃO	32.085.480,99
SANTANDER CACEIS	9.314.820,51
BANCO BRADESCO	2.114.200,67

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-af7-3b85229d2c91



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



CDI	26.883.054,4
IRF-M 1	15.919.851,9
IMA-GERAL	13.413.081,8
IRF-M	8.116.171,6
IDKA IPCA 2A	7.658.461,4
GESTÃO DURATION	6.175.081,4
AÇÕES - EXTERIOR	1.051.011,0
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.045.661,3
AÇÕES - LIVRES	923.461,2
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	404.801,9
DISP. FINANCEIRA	109.321,9
IRF-M 1+	141,4

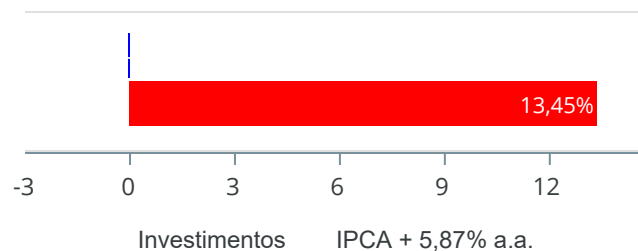
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
 Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/validarDoc.asp?CodigoDocumento=7100490-b31-406-a1c7-3085229d2c91>



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V
Janeiro	68.596.497,97	0,00	0,00	68.502.207,86	-94.290,11	-94.290,11	-0,14%	-0,14%	0,70%	0,70%	-19,50%	0,00%
Fevereiro	68.502.207,86	2.000.000,00	450.000,00	69.845.078,89	-207.128,97	-301.419,08	-0,30%	-0,43%	1,27%	1,99%	-21,79%	0,00%
Março	69.845.078,89	1.700.471,70	530.000,00	70.952.174,78	-63.375,81	-364.794,89	-0,09%	-0,52%	1,46%	3,47%	-15,03%	0,00%
Abril	70.952.174,78	1.218.000,00	0,00	72.443.028,79	272.854,01	-91.940,88	0,38%	-0,15%	0,77%	4,26%	-3,41%	0,00%
Maio	72.443.028,79	1.683.000,00	538.000,00	73.801.662,86	213.634,07	121.693,19	0,29%	0,14%	1,31%	5,63%	2,57%	0,00%
Junho	73.801.662,86	1.685.000,00	538.300,00	75.092.787,92	144.425,06	266.118,25	0,19%	0,34%	1,01%	6,70%	5,04%	0,00%
Julho	75.092.787,92	1.359.371,65	555.000,00	75.911.070,79	13.911,22	280.029,47	0,02%	0,36%	1,46%	8,26%	4,31%	0,00%
Agosto	75.911.070,79	10.368.962,14	7.599.496,61	78.748.271,04	67.734,72	347.764,19	0,09%	0,44%	1,37%	9,74%	4,54%	0,00%
Setembro	78.748.271,04	2.244.737,81	605.917,23	80.526.886,09	139.794,47	487.558,66	0,17%	0,62%	1,64%	11,55%	5,34%	0,00%
Outubro	80.526.886,09	2.234.604,56	626.208,21	81.590.797,82	-544.484,62	-56.925,96	-0,66%	-0,05%	1,71%	13,45%	-0,37%	1,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



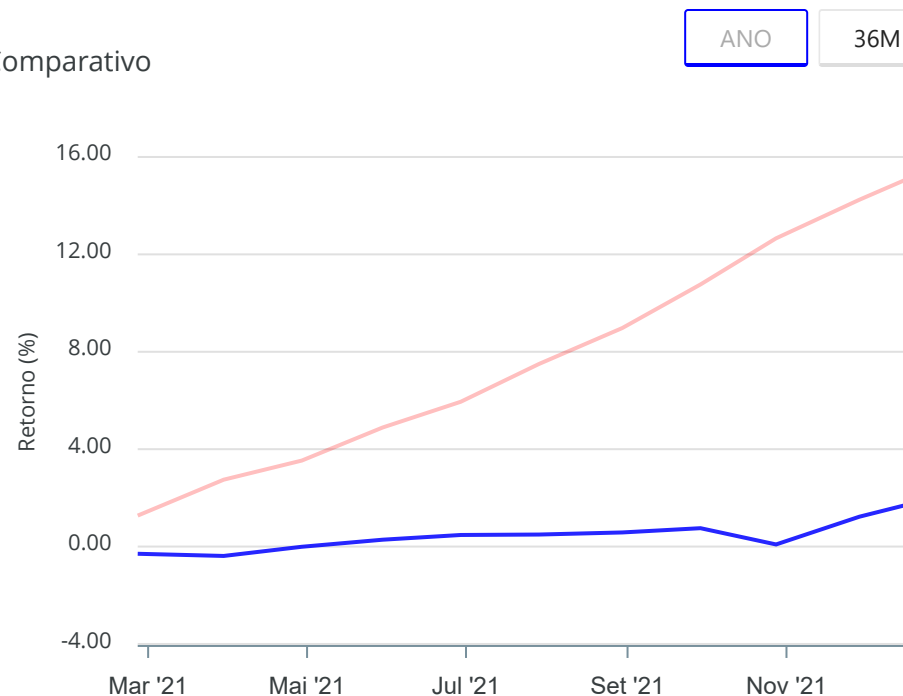


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b0f-a1c7-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.822.912,82	0,00	0,00	7.864.354,14	41.441,32	0,53%	0,53%	0,03%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.731.105,01	0,00	0,00	7.771.334,20	40.229,19	0,52%	0,52%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.191.091,50	0,00	0,00	11.247.364,09	56.272,59	0,50%	0,50%	0,08%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENC...	6.348.865,88	0,00	0,00	6.315.931,62	-32.934,26	-0,52%	-0,52%	0,74%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.581.994,14	89.644,44	15.849,26	9.603.920,28	-51.869,04	-0,54%	-0,54%	0,73%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.703.315,38	0,00	610.208,88	4.060.877,73	-32.228,77	-0,69%	-0,66%	0,96%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.294.567,87	0,00	0,00	2.265.822,47	-28.745,40	-1,25%	-1,25%	1,89%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.463.259,54	0,00	22,00	5.392.638,95	-70.598,59	-1,29%	-1,29%	1,97%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	2.144.960,12	0,00	2.114.202,67	-30.757,45	-1,43%	-0,72%	1,48%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.634.834,60	0,00	0,00	13.413.086,88	-221.747,72	-1,63%	-1,63%	1,99%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.339.495,83	0,00	0,00	8.116.170,69	-223.325,14	-2,68%	-2,68%	3,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	278,21	0,00	128,07	142,47	-7,67	-2,76%	-3,49%	3,96%
Total Renda Fixa	77.111.720,78	2.234.604,56	626.208,21	78.165.846,19	-554.270,94	-0,70%		1,10%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://seccap.gov.br/app/validador/validarCodigo do documento: 621d049b-b2a1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	980.506,77	0,00	0,00	1.051.014,03	70.507,26	7,19%	7,19%	5,72%
BNB FI MULTIMERCADO LP	1.045.482,46	0,00	0,00	1.045.664,38	181,92	0,02%	0,02%	0,81%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	416.880,08	0,00	0,00	404.809,99	-12.070,09	-2,90%	-2,90%	9,14%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	972.296,00	0,00	0,00	923.463,23	-48.832,77	-5,02%	-5,02%	10,48%
Total Renda Variável	3.415.165,31	0,00	0,00	3.424.951,63	9.786,32	0,29%		5,91%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: 29/10/2021
Assinse em: https://eic.cei.br/validarDoc/seam Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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 das outras providências.

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tee.pb.gov.br/app/qualificaDoc/seam> Código do Documento: 67140696-b2b1-4016-b0fc7-3b852299cc91

Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <http://etcpe-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afc7-3b85229d2c91



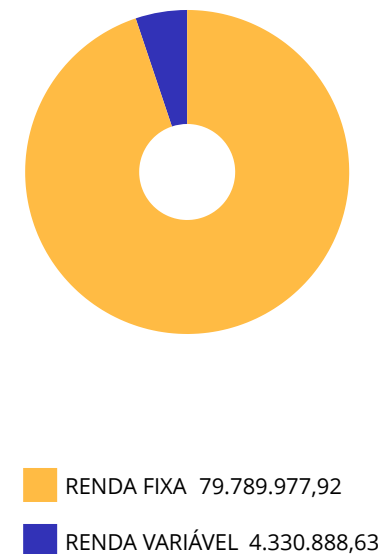
Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	13.645.666,23	16,22%	560	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.320.863,40	2,76%	1.026	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	6.364.743,27	7,57%	1.122	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.262.383,08	9,82%	542	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	14.415.545,19	17,14%	952	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	12.050.152,00	14,32%	1.061	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	308.050,77	0,37%	1.240	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	145,59	0,00%	265	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.960.105,98	10,65%	392	2,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.144.960,12	2,55%	194	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	11.317.362,29	13,45%	841	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3 du	Não há	1.045.330,31	1,24%	47.856	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	909.698,81	1,08%	27.327	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	399.770,39	0,48%	865	0,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.976.089,12	2,35%	13.679	0,13%	Artigo 8º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		88.427,64	0,11%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			84.120.866,55				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			88.427,64				Artigo 6º
PL Total			84.209.294,19				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	84.120.866,55
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	57.367.549,53	68,20%	50,00%	62,00%	100,00%	26.753.317,02
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	25.236.259,97
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.206.043,33
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	16.824.173,31
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	50.472.519,93
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	22.422.428,39	26,66%	0,00%	33,00%	40,00%	11.225.918,23
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	33.648.346,62
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	16.824.173,31
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	12.618.129,98
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	12.618.129,98
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.206.043,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.206.043,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.206.043,33
Total Renda Fixa	100,00%	79.789.977,92	94,85%	50,00%	95,00%	460,00%	



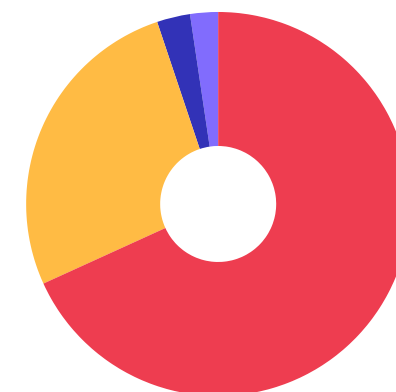
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	25.236.259,97
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	25.236.259,97
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	2.354.799,51	2,80%	0,00%	4,00%	6,00%	2.692.452,48
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	16.824.173,31
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.976.089,12	2,35%	0,00%	1,00%	2,00%	-293.671,79
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.206.043,33
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.206.043,33
Total Renda Variável	30,00%	4.330.888,63	5,15%	0,00%	5,00%	98,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	8.412.086,66
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	1.682.417,33
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	8.412.086,66
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	22,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



Enquadramento por Gestores - base (Novembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	40.067.344,96	47,63	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	32.548.685,10	38,69	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	9.359.876,37	11,13	0,11
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.144.960,12	2,55	0,00

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Documento Assinado Digitalmente por: CARLOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: https://www.fundoprev.com.br/portal/validar-ocorrencia-ocorrendo-no-documento: 621d043b-12b1-40ff-a67-3b55239d2691



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	1,82%	-0,32%	0,46%	0,34%	1,79%	5,46%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,73%	-1,30%	0,07%	-0,51%	1,05%	4,72%	1,45%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	2,51%	4,11%	2,12%	1,88%	5,91%	14,44%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,43%	3,91%	2,19%	2,36%	5,50%	13,43%	1,11%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,42%	3,91%	2,18%	2,03%	5,63%	13,50%	1,10%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	2,19%	-7,11%	-2,04%	-3,73%	-4,28%	1,46%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,19%	-7,41%	-2,15%	-3,96%	-4,60%	0,90%	2,48%	0,06%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,79%	2,03%	0,65%	1,42%	2,35%	6,40%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	1,78%	0,62%	1,30%	2,10%	5,73%	0,32%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,78%	1,84%	0,62%	1,32%	2,13%	5,96%	0,32%	0,01%
IRF-M (Benchmark)	1,79%	-3,81%	-1,21%	-2,06%	-1,93%	3,27%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80%	-4,08%	-1,30%	-2,26%	-2,20%	2,67%	1,82%	0,04%
CDI (Benchmark)	0,59%	3,60%	1,51%	2,62%	3,77%	6,87%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,62%	3,81%	1,66%	2,94%	4,19%	6,69%	0,06%	0,01%
BNB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,59%	3,35%	1,60%	2,80%	3,80%	6,21%	0,01%	0,01%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b0f-afcf-3b85229d2c91



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,95%	9,26%	3,40%	5,86%	10,74%	15,51%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,91%	-0,93%	0,60%	-1,64%	0,38%	6,30%	0,40%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,46%	-0,93%	0,57%	0,20%	1,53%	4,57%	1,14%	0,03%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.itec.pe.gov.br/ep/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



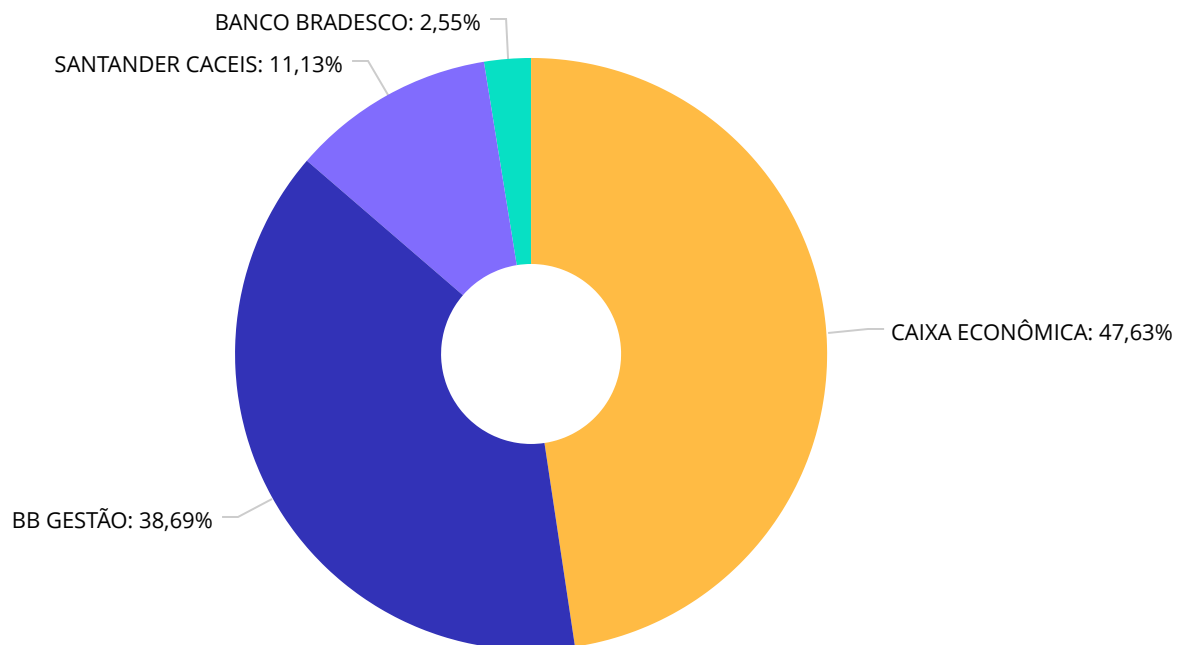
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	-0,83%	21,59%	0,98%	8,63%	26,10%	45,40%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-0,54%	23,77%	1,51%	10,22%	27,35%	-	7,09%	0,11%
Ibovespa (Benchmark)	-1,53%	-14,37%	-14,20%	-19,25%	-6,41%	-5,84%	-	-
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	-1,25%	-7,82%	-7,01%	-11,76%	-1,22%	9,56%	7,60%	0,14%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-1,49%	-9,49%	-10,16%	-15,14%	-0,06%	13,16%	9,51%	0,19%
CDI (Benchmark)	0,59%	3,60%	1,51%	2,62%	3,77%	6,87%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,12%	-2,07%	-2,91%	-3,89%	0,44%	2,63%	3,14%	0,05%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.itec.gov.br/ep/vai/validarDoc/seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



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

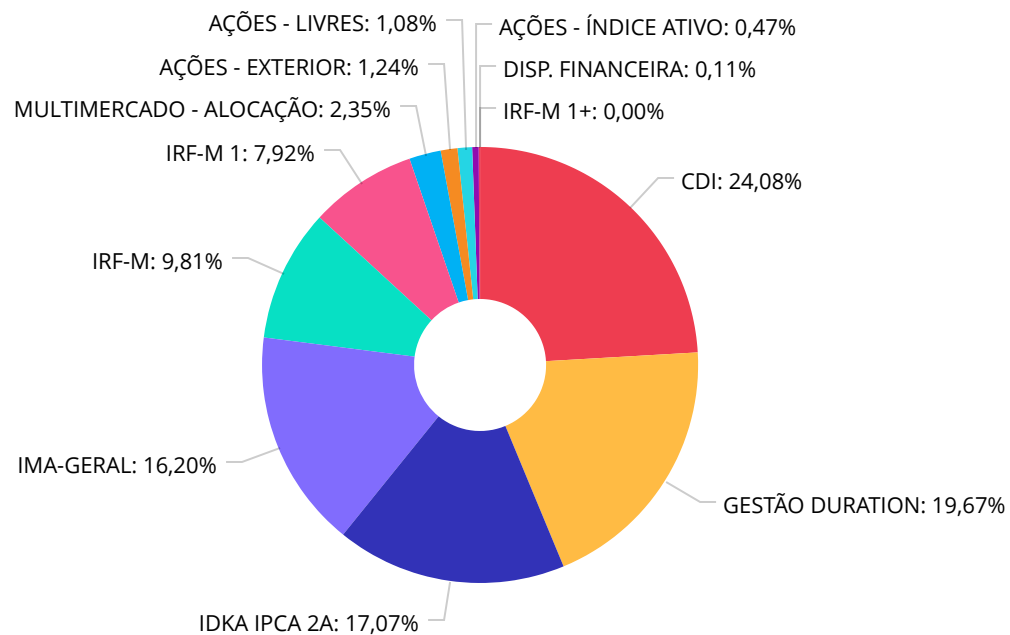


CAIXA ECONÔMICA	40.067.344,99
BB GESTÃO	32.548.681,11
SANTANDER CACEIS	9.359.870,37
BANCO BRADESCO	2.144.965,12

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 671d049b-b2b1-4b1f-af7-3b85229d2c91



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



CDI	20.277.461,2
GESTÃO DURATION	16.560.501,3
IDKA IPCA 2A	14.371.011,4
IMA-GERAL	13.645.661,2
IRF-M	8.262.381,0
IRF-M 1	6.672.791,0
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.976.081,2
AÇÕES - EXTERIOR	1.045.331,3
AÇÕES - LIVRES	909.691,8
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	399.771,3
DISP. FINANCEIRA	88.421,6
IRF-M 1+	14.559,5

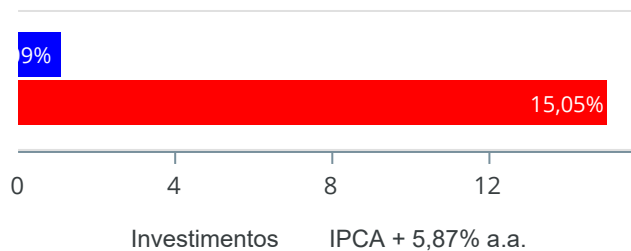
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: https://etce.ice.pe.gov.br/etce/validar_documento.php?documento=671008b-b14b-4b5-a1c75b85229d2c91



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	Variância
Janeiro	68.596.497,97	0,00	0,00	68.502.207,86	-94.290,11	-94.290,11	-0,14%	-0,14%	0,70%	0,70%	-19,50%	0,00%
Fevereiro	68.502.207,86	2.000.000,00	450.000,00	69.845.078,89	-207.128,97	-301.419,08	-0,30%	-0,43%	1,27%	1,99%	-21,79%	0,00%
Março	69.845.078,89	1.700.471,70	530.000,00	70.952.174,78	-63.375,81	-364.794,89	-0,09%	-0,52%	1,46%	3,47%	-15,03%	0,00%
Abril	70.952.174,78	1.218.000,00	0,00	72.443.028,79	272.854,01	-91.940,88	0,38%	-0,15%	0,77%	4,26%	-3,41%	0,00%
Mai	72.443.028,79	1.683.000,00	538.000,00	73.801.662,86	213.634,07	121.693,19	0,29%	0,14%	1,31%	5,63%	2,57%	0,00%
Junho	73.801.662,86	1.685.000,00	538.300,00	75.092.787,92	144.425,06	266.118,25	0,19%	0,34%	1,01%	6,70%	5,04%	0,00%
Julho	75.092.787,92	1.359.371,65	555.000,00	75.911.070,79	13.911,22	280.029,47	0,02%	0,36%	1,46%	8,26%	4,31%	0,00%
Agosto	75.911.070,79	10.368.962,14	7.599.496,61	78.748.271,04	67.734,72	347.764,19	0,09%	0,44%	1,37%	9,74%	4,54%	0,00%
Setembro	78.748.271,04	2.244.737,81	605.917,23	80.526.886,09	139.794,47	487.558,66	0,17%	0,62%	1,64%	11,55%	5,34%	0,00%
Outubro	80.526.886,09	2.234.604,56	626.208,21	81.590.797,82	-544.484,62	-56.925,96	-0,66%	-0,05%	1,71%	13,45%	-0,37%	1,00%
Novembro	81.590.797,82	30.528.842,00	28.945.437,59	84.120.866,55	946.664,32	889.738,36	1,14%	1,09%	1,41%	15,05%	7,23%	1,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



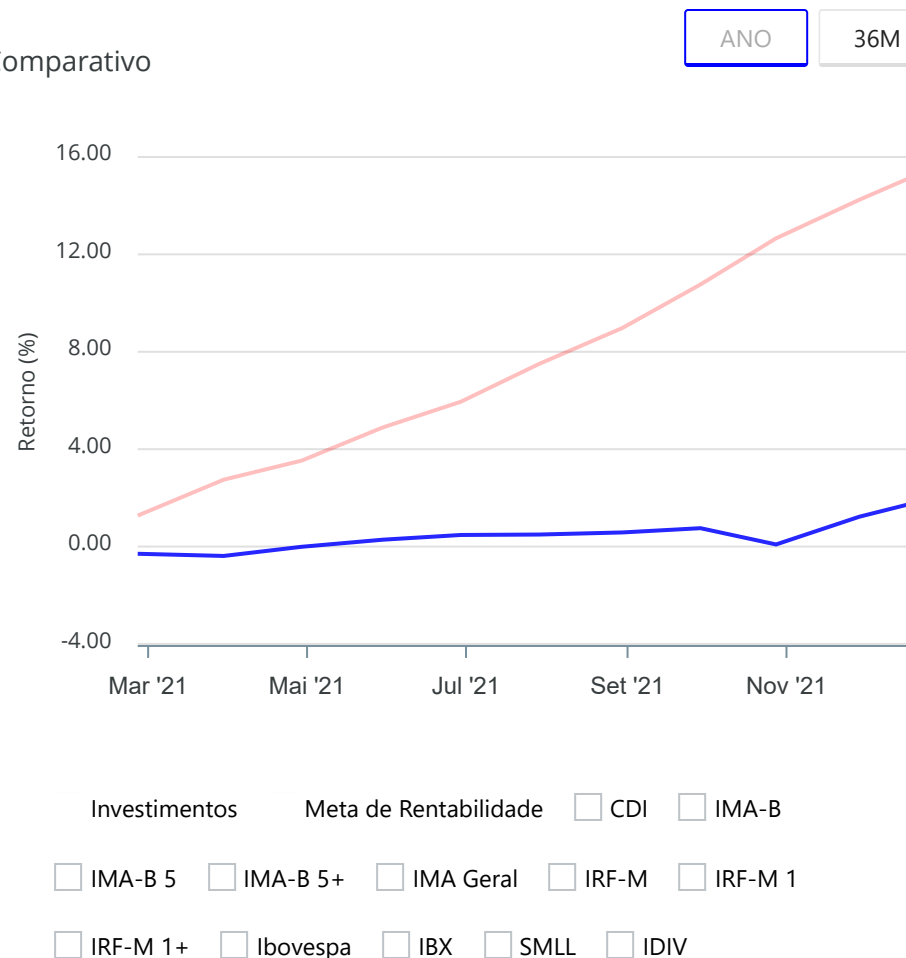


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b0f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.265.822,47	0,00	0,00	2.320.863,40	55.040,93	2,43%	2,43%	1,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	142,47	0,00	0,00	145,59	3,12	2,19%	2,19%	2,48%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.116.170,69	0,00	0,00	8.262.383,08	146.212,39	1,80%	1,80%	1,82%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.413.086,88	0,00	0,00	13.645.666,23	232.579,35	1,73%	1,73%	1,45%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.392.638,95	6.465.791,86	0,00	12.050.152,00	191.721,19	1,62%	2,42%	1,10%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.114.202,67	0,00	0,00	2.144.960,12	30.757,45	1,45%	1,45%	1,14%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	6.315.931,62	0,00	0,00	6.364.743,27	48.811,65	0,77%	0,77%	0,32%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.247.364,09	0,00	0,00	11.317.362,29	69.998,20	0,62%	0,62%	0,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.060.877,73	10.903.403,57	624.446,84	14.415.545,19	75.710,73	0,51%	0,91%	0,40%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.864.354,14	0,00	7.903.478,37	0,00	39.124,23	0,50%	0,59%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.771.334,20	0,00	7.803.388,15	0,00	32.053,95	0,41%	0,59%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.603.920,28	2.225.705,40	11.564.606,38	308.050,77	43.031,47	0,36%	0,78%	0,32%
BNB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,00	8.952.996,22	0,00	8.960.105,98	7.109,76	0,08%	0,59%	0,01%
Total Renda Fixa	78.165.846,19	28.547.897,05	27.895.919,74	79.789.977,92	972.154,42	1,23%		0,77%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: 30/11/2021 14:00:00
URL: https://www.lemasf.com.br/portal/validarAssinatura.aspx?codigo=67100401b25f405a1c7-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BNB FI MULTIMERCADO LP	1.045.664,38	0,00	1.049.517,85	0,00	3.853,47	0,37%	0,41%	0,67%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	1.980.944,95	0,00	1.976.089,12	-4.855,83	-0,25%	0,12%	3,14%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.051.014,03	0,00	0,00	1.045.330,31	-5.683,72	-0,54%	-0,54%	7,09%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	404.809,99	0,00	0,00	399.770,39	-5.039,60	-1,24%	-1,24%	7,60%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	923.463,23	0,00	0,00	909.698,81	-13.764,42	-1,49%	-1,49%	9,51%
Total Renda Variável	3.424.951,63	1.980.944,95	1.049.517,85	4.330.888,63	-25.490,10	-0,59%		5,84%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://brasil.gov.br/pt/validar/Documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tee.pb.gov.br/app/qualificaDoc/seam> Código do Documento: 67140696-b2b1-4016-b0fc7-3b852299cc91

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2021

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <http://etcpe-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afc7-3b85229d2c91



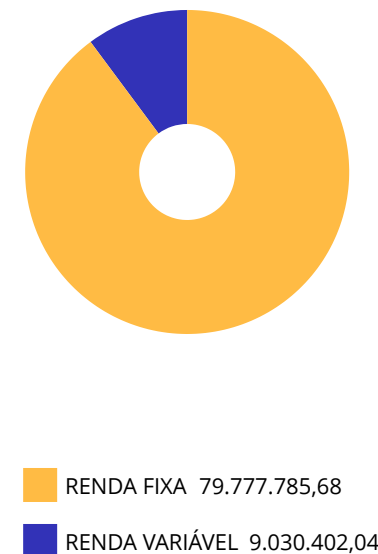
Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	13.770.401,32	15,51%	553	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.337.253,38	2,63%	1.035	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.034.358,83	2,29%	1.127	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.383.523,73	4,94%	540	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	13.894.374,17	15,65%	945	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	12.136.878,31	13,67%	1.060	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	438.527,20	0,49%	1.241	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	148,89	0,00%	258	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	5.739.244,62	6,46%	590	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BNB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.027.029,78	10,16%	400	2,47%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.160.982,20	2,43%	193	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	13.855.063,25	15,60%	865	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	4.099.711,06	4,62%	27.197	0,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	406.114,19	0,46%	848	0,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	2.523.333,01	2,84%	151.964	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.001.243,78	2,25%	12.762	0,14%	Artigo 8º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		554.481,39	0,62%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			88.808.187,72				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			554.481,39	Artigo 6º			
PL Total			89.362.669,11				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	88.808.187,72
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	48.995.465,83	55,17%	50,00%	62,00%	100,00%	39.812.721,89
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	26.642.456,32
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.440.409,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	17.761.637,54
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	53.284.912,63
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	30.782.319,85	34,66%	0,00%	33,00%	40,00%	4.740.955,24
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	35.523.275,09
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	17.761.637,54
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	13.321.228,16
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	13.321.228,16
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.440.409,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.440.409,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.440.409,39
Total Renda Fixa	100,00%	79.777.785,68	89,83%	50,00%	95,00%	460,00%	



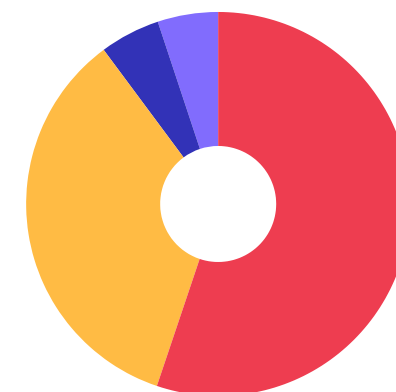
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afc7-3b85229d2c91



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	26.642.456,32
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	26.642.456,32
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	4.505.825,25	5,07%	0,00%	4,00%	6,00%	822.666,01
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	17.761.637,54
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.524.576,79	5,09%	0,00%	1,00%	2,00%	-2.748.413,04
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.440.409,39
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.440.409,39
Total Renda Variável	30,00%	9.030.402,04	10,17%	0,00%	5,00%	98,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	8.880.818,77
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	1.776.163,75
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	8.880.818,77
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	22,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/ppv/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afcf-3b85229d2c91



Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	42.326.235,60	47,66	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.887.825,95	39,28	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	9.433.143,97	10,62	0,11
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.160.982,20	2,43	0,00

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Documento Assinado Digitalmente por: CARLOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: https://www.fundoprev.com.br/portal/validarassinatura/validarassinatura.do?documento=62100430-1201-40ff-8c7-3b55239d2691



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,94%	0,61%	1,38%	0,96%	0,61%	5,49%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	-0,40%	0,99%	0,29%	-0,40%	4,67%	1,00%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,83%	4,97%	1,84%	3,05%	4,97%	14,02%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,65%	1,86%	3,18%	4,65%	12,93%	1,05%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,72%	4,66%	1,82%	3,05%	4,66%	13,07%	1,10%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	2,29%	-4,99%	0,93%	-1,74%	-4,99%	3,04%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,27%	-5,31%	0,86%	-1,95%	-5,31%	2,47%	2,07%	0,06%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,88%	2,93%	1,13%	2,10%	2,93%	6,88%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,84%	2,64%	1,10%	1,97%	2,64%	6,20%	0,20%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,85%	2,70%	1,09%	1,99%	2,70%	6,43%	0,20%	0,01%
IRF-M (Benchmark)	1,89%	-1,99%	0,98%	-0,42%	-1,99%	4,57%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,88%	-2,28%	0,94%	-0,59%	-2,28%	3,97%	1,54%	0,04%
CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,75%	4,60%	1,89%	3,40%	4,60%	7,12%	0,04%	0,01%
BNB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,75%	4,12%	1,88%	3,23%	4,12%	6,59%	0,02%	0,01%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice-pe.gov.br/epyp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,73%	10,06%	2,96%	6,07%	10,06%	15,03%	-	-
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,78%	-0,16%	1,52%	0,65%	-0,16%	4,50%	0,70%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	0,54%	1,40%	0,93%	0,54%	-	0,79%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,83%	-0,11%	1,07%	-0,82%	-0,11%	6,55%	0,23%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ite.pe.gov.br/ep/vai/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



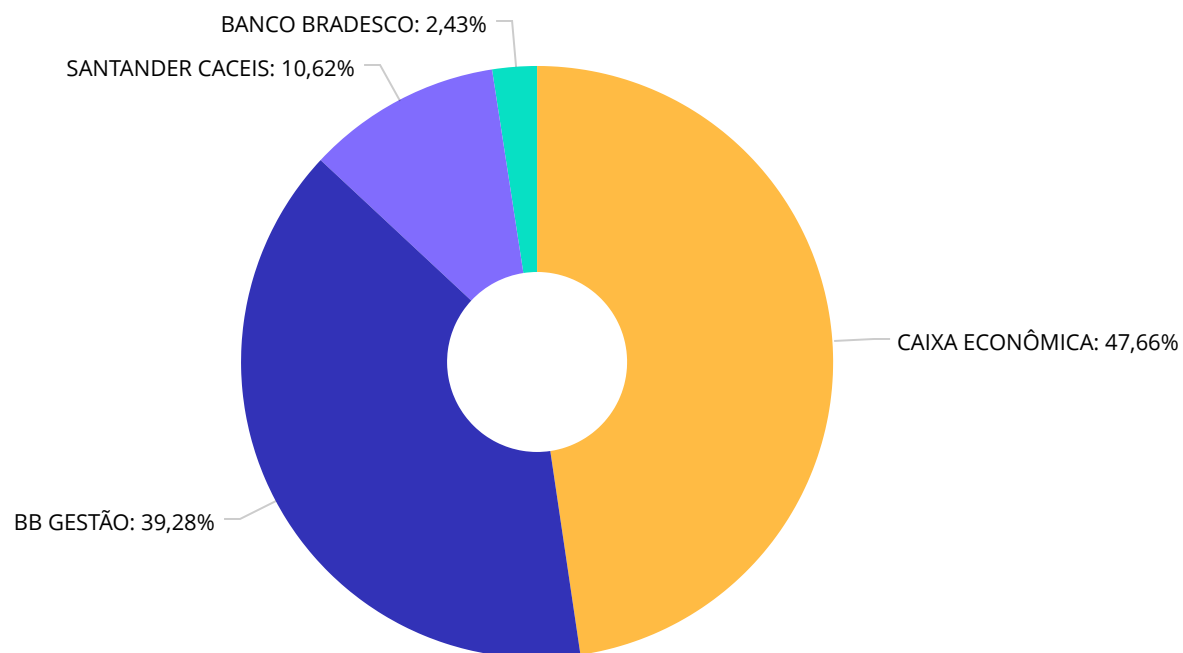
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	2,85%	-11,93%	-5,55%	-17,33%	-11,93%	-9,36%	-	-
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	1,59%	-6,36%	-2,58%	-9,90%	-6,36%	6,06%	7,25%	0,12%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3,56%	-6,27%	-3,10%	-11,41%	-6,27%	6,89%	9,21%	0,16%
CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,27%	-0,83%	-0,10%	-3,05%	-0,83%	1,68%	2,65%	0,04%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,73%	4,37%	1,82%	3,06%	4,37%	8,69%	0,12%	0,01%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.itec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4bf1-afc7-3b85229d2c91



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

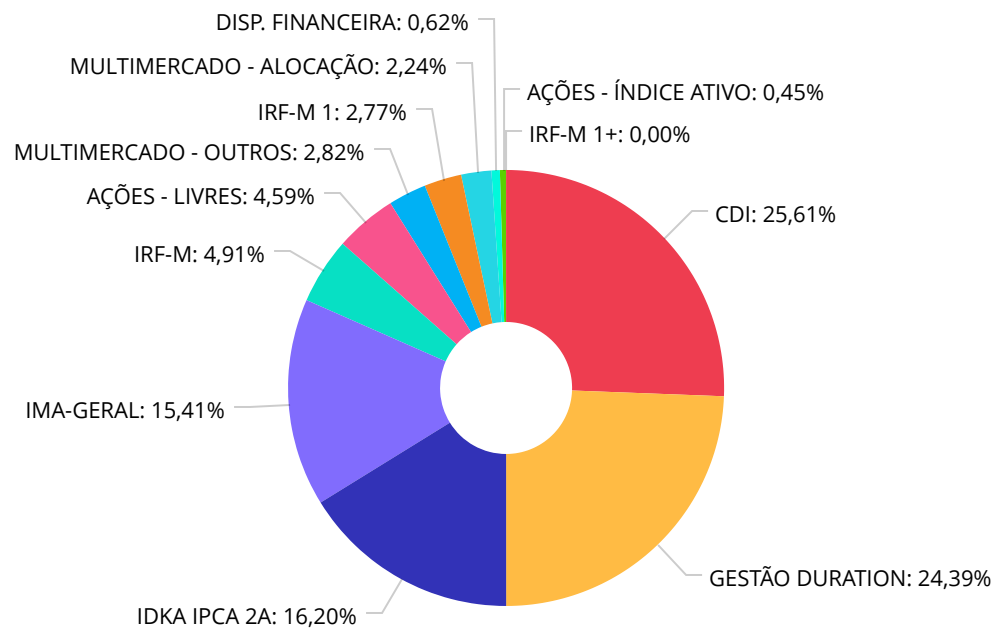


CAIXA ECONÔMICA	42.326.238,66
BB GESTÃO	34.887.821,99
SANTANDER CACEIS	9.433.141,97
BANCO BRADESCO	2.160.981,20

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-af7-3b85229d2c91



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



CDI	22.882.091,00
GESTÃO DURATION	21.794.600,99
IDKA IPCA 2A	14.474.131,65
IMA-GERAL	13.770.401,37
IRF-M	4.383.527,70
AÇÕES - LIVRES	4.099.711,05
MULTIMERCADO - OUTROS	2.523.331,01
IRF-M 1	2.472.881,03
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	2.001.241,78
DISP. FINANCEIRA	554.481,39
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	406.111,19
IRF-M 1+	14,89

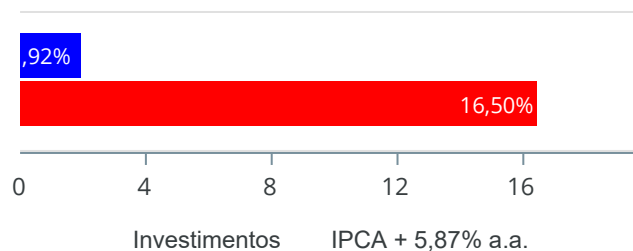
Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.ice.gov.br/etce/validarDocumento.aspx?CodigoDocumento=6710049b-b2b1-4b4f-8085-229d2c91>



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V
Janeiro	68.596.497,97	0,00	0,00	68.502.207,86	-94.290,11	-94.290,11	-0,14%	-0,14%	0,70%	0,70%	-19,50%	0,00%
Fevereiro	68.502.207,86	2.000.000,00	450.000,00	69.845.078,89	-207.128,97	-301.419,08	-0,30%	-0,43%	1,27%	1,99%	-21,79%	0,00%
Março	69.845.078,89	1.700.471,70	530.000,00	70.952.174,78	-63.375,81	-364.794,89	-0,09%	-0,52%	1,46%	3,47%	-15,03%	0,00%
Abril	70.952.174,78	1.218.000,00	0,00	72.443.028,79	272.854,01	-91.940,88	0,38%	-0,15%	0,77%	4,26%	-3,41%	0,00%
Mai	72.443.028,79	1.683.000,00	538.000,00	73.801.662,86	213.634,07	121.693,19	0,29%	0,14%	1,31%	5,63%	2,57%	0,00%
Junho	73.801.662,86	1.685.000,00	538.300,00	75.092.787,92	144.425,06	266.118,25	0,19%	0,34%	1,01%	6,70%	5,04%	0,00%
Julho	75.092.787,92	1.359.371,65	555.000,00	75.911.070,79	13.911,22	280.029,47	0,02%	0,36%	1,46%	8,26%	4,31%	0,00%
Agosto	75.911.070,79	10.368.962,14	7.599.496,61	78.748.271,04	67.734,72	347.764,19	0,09%	0,44%	1,37%	9,74%	4,54%	0,00%
Setembro	78.748.271,04	2.244.737,81	605.917,23	80.526.886,09	139.794,47	487.558,66	0,17%	0,62%	1,64%	11,55%	5,34%	0,00%
Outubro	80.526.886,09	2.234.604,56	626.208,21	81.590.797,82	-544.484,62	-56.925,96	-0,66%	-0,05%	1,71%	13,45%	-0,37%	1,00%
Novembro	81.590.797,82	30.528.842,00	28.945.437,59	84.120.866,55	946.664,32	889.738,36	1,14%	1,09%	1,41%	15,05%	7,23%	1,00%
Dezembro	84.120.866,55	16.068.562,42	12.106.278,64	88.808.187,72	725.037,39	1.614.775,75	0,82%	1,92%	1,26%	16,50%	11,64%	1,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



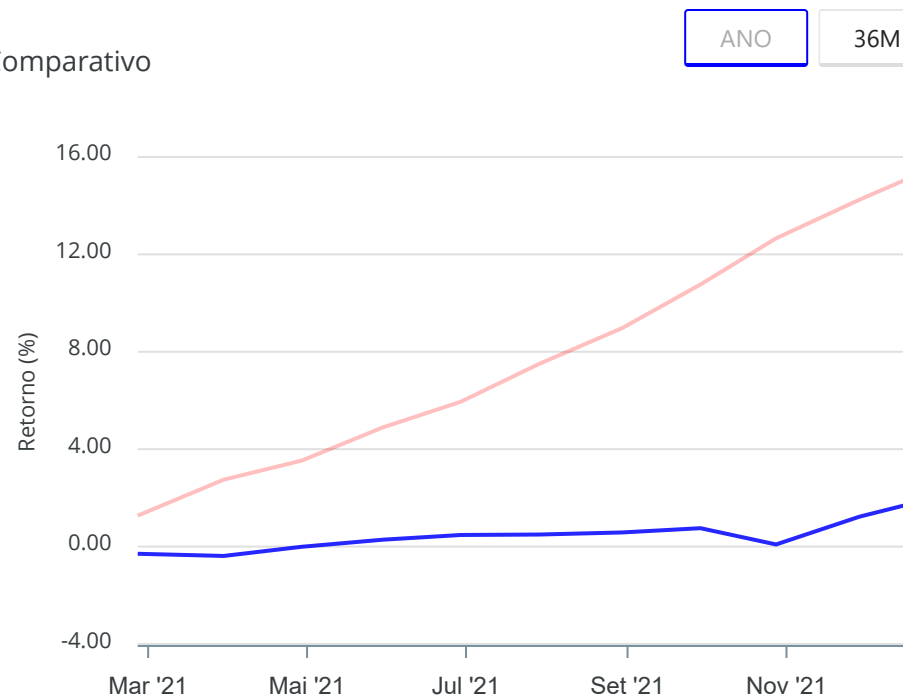


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 671d049b-b2b1-4b0f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	145,59	0,00	0,00	148,89	3,30	2,27%	2,27%	2,07%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.262.383,08	0,00	4.000.000,00	4.383.523,73	121.140,65	1,47%	1,88%	1,54%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.645.666,23	0,00	0,00	13.770.401,32	124.735,09	0,91%	0,91%	1,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	14.415.545,19	0,00	639.000,00	13.894.374,17	117.828,98	0,82%	0,83%	0,23%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.144.960,12	0,00	0,00	2.160.982,20	16.022,08	0,75%	0,78%	0,70%
BNB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	8.960.105,98	0,00	0,00	9.027.029,78	66.923,80	0,75%	0,75%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	12.050.152,00	0,00	0,00	12.136.878,31	86.726,31	0,72%	0,72%	1,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.320.863,40	0,00	0,00	2.337.253,38	16.389,98	0,71%	0,71%	1,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.317.362,29	2.443.108,93	0,00	13.855.063,25	94.592,03	0,69%	0,75%	0,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	308.050,77	144.212,05	16.732,76	438.527,20	2.997,14	0,66%	0,85%	0,20%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	6.364.743,27	2.030.685,11	6.378.412,88	2.034.358,83	17.343,33	0,21%	0,84%	0,20%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	5.728.188,65	0,00	5.739.244,62	11.055,97	0,19%	0,76%	0,79%
Total Renda Fixa	79.789.977,92	10.346.194,74	11.034.145,64	79.777.785,68	675.758,66	0,85%		0,59%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://brasil.gov.br/app/validador/validarCodigo do documento: 671d040b-254b-40ff-a1c7-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.045.330,31	0,00	1.072.133,00	0,00	26.802,69	2,56%	5,28%	7,90%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	399.770,39	0,00	0,00	406.114,19	6.343,80	1,59%	1,59%	7,25%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.976.089,12	0,00	0,00	2.001.243,78	25.154,66	1,27%	1,27%	2,65%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,00	2.508.528,95	0,00	2.523.333,01	14.804,06	0,59%	0,73%	0,12%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	909.698,81	3.213.838,73	0,00	4.099.711,06	-23.826,48	-0,58%	3,56%	9,21%
Total Renda Variável	4.330.888,63	5.722.367,68	1.072.133,00	9.030.402,04	49.278,73	0,55%		5,13%

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://brasil.gov.br/app/validador/assinseam Código do documento: 671d049b-b2b1-4b1f-afcf-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	102.310,32	0,00	0,00	554.481,39	452.171,07	441,96%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.191.091,50	2.443.108,93	0,00	13.855.063,25	220.862,82	1,62%	1,89%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.463.259,54	6.465.791,86	22,00	12.136.878,31	207.848,91	1,74%	1,82%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.703.315,38	10.903.403,57	1.873.655,72	13.894.374,17	161.310,94	1,03%	1,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.634.834,60	0,00	0,00	13.770.401,32	135.566,72	0,99%	0,99%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.822.912,82	0,00	7.903.478,37	0,00	80.565,55	1,03%	1,87%
BNB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,00	8.952.996,22	0,00	9.027.029,78	74.033,56	0,83%	1,88%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.731.105,01	0,00	7.803.388,15	0,00	72.283,14	0,93%	1,90%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.339.495,83	0,00	4.000.000,00	4.383.523,73	44.027,90	0,53%	0,93%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.294.567,87	0,00	0,00	2.337.253,38	42.685,51	1,86%	1,86%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	6.348.865,88	2.030.685,11	6.378.412,88	2.034.358,83	33.220,72	0,40%	1,10%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	2.144.960,12	0,00	2.160.982,20	16.022,08	0,75%	1,52%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	5.728.188,65	0,00	5.739.244,62	11.055,97	0,19%	1,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	278,21	0,00	128,07	148,89	-1,25	-0,45%	0,86%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.581.994,14	2.459.561,89	11.597.188,40	438.527,20	-5.840,43	-0,05%	1,09%
				Total Renda Fixa	1.545.813,21	1,96%	

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://etec.ce.gov.br/validador/validarCodigo do documento: 621d049b-b291-4b5a-fc73b85529d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Insist
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	980.506,77	0,00	1.072.133,00	0,00	91.626,23	9,34%	12,24%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	1.980.944,95	0,00	2.001.243,78	20.298,83	1,02%	-0,10%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,00	2.508.528,95	0,00	2.523.333,01	14.804,06	0,59%	1,82%
BNB FI MULTIMERCADO LP	1.045.482,46	0,00	1.049.517,85	0,00	4.035,39	0,39%	1,21%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	416.880,08	0,00	0,00	406.114,19	-10.765,89	-2,58%	-2,58%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	972.296,00	3.213.838,73	0,00	4.099.711,06	-86.423,67	-2,06%	-3,10%
Total Renda Variável					33.574,95	0,37%	

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://secreto.pe.gov.br/epu/validaDocumento.aspx?CodigoDoDocumento: 671d049b-b2b1-4bf1-afc7-3b85229d2c91



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.886.577,47	3.443.108,93	988.000,00	13.855.063,25	513.376,85	3,58%	4,60%
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	46.590,91	0,00	0,00	554.481,39	507.890,48	1.090,11%	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,00	11.864.818,61	22,00	12.136.878,31	272.081,70	2,29%	4,66%
BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	7.642.289,93	0,00	7.903.478,37	0,00	261.188,44	3,42%	4,28%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.827.407,03	800.000,00	8.888.388,15	0,00	260.981,12	3,03%	4,34%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	12.196.796,79	2.030.685,11	12.378.412,88	2.034.358,83	185.289,81	1,30%	2,64%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.595.814,45	2.865.627,62	12.168.805,63	438.527,20	145.890,76	1,17%	2,70%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	535.220,75	1.717.771,90	0,00	2.337.253,38	84.260,73	3,74%	4,65%
BNB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,00	8.952.996,22	0,00	9.027.029,78	74.033,56	0,83%	4,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,00	16.866.246,92	3.045.505,72	13.894.374,17	73.632,97	0,44%	-0,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.739.832,85	4.000.000,00	0,00	13.770.401,32	30.568,47	0,22%	-0,40%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	2.144.960,12	0,00	2.160.982,20	16.022,08	0,75%	-0,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	5.728.188,65	0,00	5.739.244,62	11.055,97	0,19%	0,53%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	127.183,71	127.032,78	148,89	-2,04	0,00%	-5,31%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	928.587,90	0,00	873.341,90	0,00	-55.246,00	-5,95%	-5,27%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.614.024,12	0,00	4.000.000,00	4.383.523,73	-230.500,39	-2,68%	-2,28%
Total Renda Fixa					2.150.524,51	2,75%	

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinatura em: https://sistema.pe.gov.br/validarAssinatura/validarAssinatura.do?codigoDoDocumento=621d046b-b261-4b5a-bc79-8b85299d2c91



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Insist
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	1.072.133,00	0,00	72.133,00	7,21%	30,30%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	1.980.944,95	0,00	2.001.243,78	20.298,83	1,02%	-0,82%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,00	2.508.528,95	0,00	2.523.333,01	14.804,06	0,59%	4,37%
BNB FI MULTIMERCADO LP	196.256,69	846.651,86	1.049.517,85	0,00	6.609,30	0,63%	1,21%
BNB SELEÇÃO FI AÇÕES	433.689,99	0,00	0,00	406.114,19	-27.575,80	-6,36%	-6,36%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	4.213.838,73	0,00	4.099.711,06	-114.127,67	-2,71%	-6,26%
Total Renda Variável					-27.858,28	-0,31%	

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Assinse em: https://secreto.pe.gov.br/epu/validaDocumento.aspx?codigo=671d049b-b2b1-4b1f-a1c7-3b85229d2c91



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 das outras providências.

Documento Assinado Digitalmente por: MARCOS ANTONIO DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pb.org.br/app/qualificaDoc/seam> Código do Documento: 67140696-b2b1-4016-b0fc7-3b852299cc91