



Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2021



Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELO BORBA ALVES
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/ep/validarDocumento> Código do documento: d335ecd3-d0c2-489d-ba94-949e8d499b86

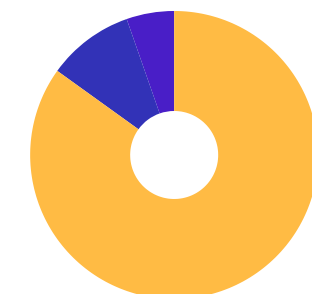
Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.863.811,19	13,26%	553	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.572.780,08	11,19%	1.035	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	802.045,82	5,71%	788	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.022,59	0,01%	636	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.103.628,02	14,97%	1.127	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.948.112,06	13,86%	945	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	578.999,25	4,12%	1.060	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.277.633,31	9,09%	590	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.785.971,19	12,71%	854	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	306.153,97	2,18%	2.203	0,03%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	342.891,00	2,44%	10.347	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	11.607,21	0,08%	19.787	0,00%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	705.690,78	5,02%	12.762	0,05%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	751.791,48	5,35%	25.475	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		13.252,07	0,09%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			14.052.137,95				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			13.252,07	Artigo 6º			
PL Total			14.065.390,02				



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 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%	14.052.137,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	8.870.399,01	63,12%	40,00%	65,00%	100,00%	5.181.738,94
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	14.052.137,95
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	702.606,90
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	8.431.282,77
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	8.431.282,77
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	3.063.604,50	21,80%	0,00%	10,00%	40,00%	2.557.250,68
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	5.620.855,18
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	2.810.427,59
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	2.107.820,69
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	2.107.820,69
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	702.606,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	702.606,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	702.606,90
Total Renda Fixa	100,00%	11.934.003,51	84,93%	40,00%	75,00%	570,00%	



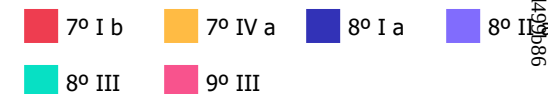
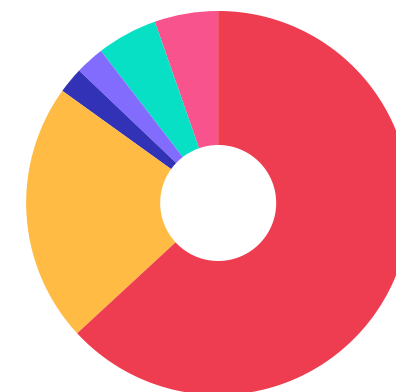
RENTA FIXA 11.934.003,51
RENTA VARIÁVEL 1.366.342,96
EXTERIOR 751.791,48



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REDA 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%	306.153,97	2,18%	0,00%	2,00%	30,00%	3.909.487,42
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	4.215.641,39
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	342.891,00	2,44%	0,00%	12,00%	20,00%	2.467.536,59
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	2.810.427,59
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	717.297,99	5,10%	0,00%	5,00%	10,00%	687.915,81
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	702.606,90
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	702.606,90
Total Renda Variável	30,00%	1.366.342,96	9,72%	0,00%	20,00%	120,00%	

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%	1.405.213,80
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.405.213,80
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	751.791,48	5,35%	0,00%	5,00%	10,00%	653.422,32
Total Exterior	10,00%	751.791,48	5,35%	0,00%	5,00%	30,00%	



Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELO BORBA ALVES
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/ep/validaDoc.seam> Código do documento: d335ecd3-d0c2-489d-ba94-949e8d49986



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Dezembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.464.837,65	74,47	0,00
CAIXA DTVM	3.587.300,30	25,53	-

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELO BORBA ALVES
Acesse em: <https://pcc.tec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: d335ecd3-d0c2-489d-ba94-949e8d499086



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%	-	-
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%
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%
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%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,79%	4,57%	2,03%	3,24%	4,57%	12,97%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,76%	4,27%	1,94%	3,06%	4,27%	12,38%	1,04%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	0,22%	-1,26%	1,06%	-0,55%	-1,26%	5,06%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	-1,52%	0,97%	-0,70%	-1,52%	4,53%	2,16%	0,05%
CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,80%	4,62%	1,93%	3,26%	4,62%	7,13%	0,03%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,73%	10,06%	2,96%	6,07%	10,06%	15,03%	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELO BORBA ALVES
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epyp/validarDoc.seam> Código do documento: d335ecd3-d0c2-489d-ba94-949e8d499086



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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,83%	-0,11%	1,07%	-0,82%	-0,11%	6,55%	0,23%	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%

Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELO BORBA ALVES
Acesse em: <https://etce.ice-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: d335ecd3-d0c2-489d-ba94-949e8d499b86



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%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4,25%	-17,13%	-11,61%	-25,64%	-17,13%	-19,81%	12,17%	0,20%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	3,44%	-11,53%	-6,39%	-19,00%	-11,53%	-9,52%	9,23%	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%
MSCI ACWI (Benchmark)	3,17%	25,42%	9,15%	16,96%	25,42%	84,89%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,56%	32,83%	13,07%	14,36%	32,83%	47,69%	7,98%	0,11%

Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELO BORBA ALVES
Acesse em: <https://etce.ice-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: d335ecd3-d0c2-489d-ba94-949e8d499086



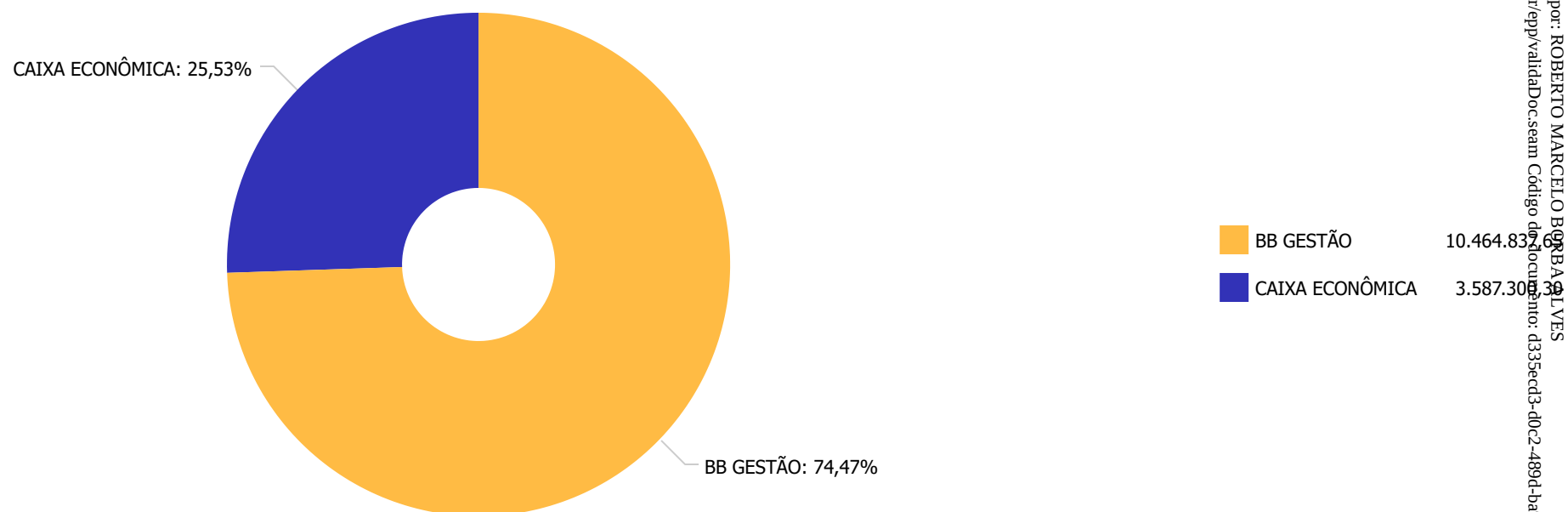
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	1,71%	33,65%	12,29%	21,44%	33,65%	105,84%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,90%	32,16%	12,22%	22,40%	32,16%	94,37%	8,37%	0,13%

Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELO BORBA ALVES
Acesse em: <https://etce.ice-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: d335ecd3-d0c2-489d-ba94-949e8d499086



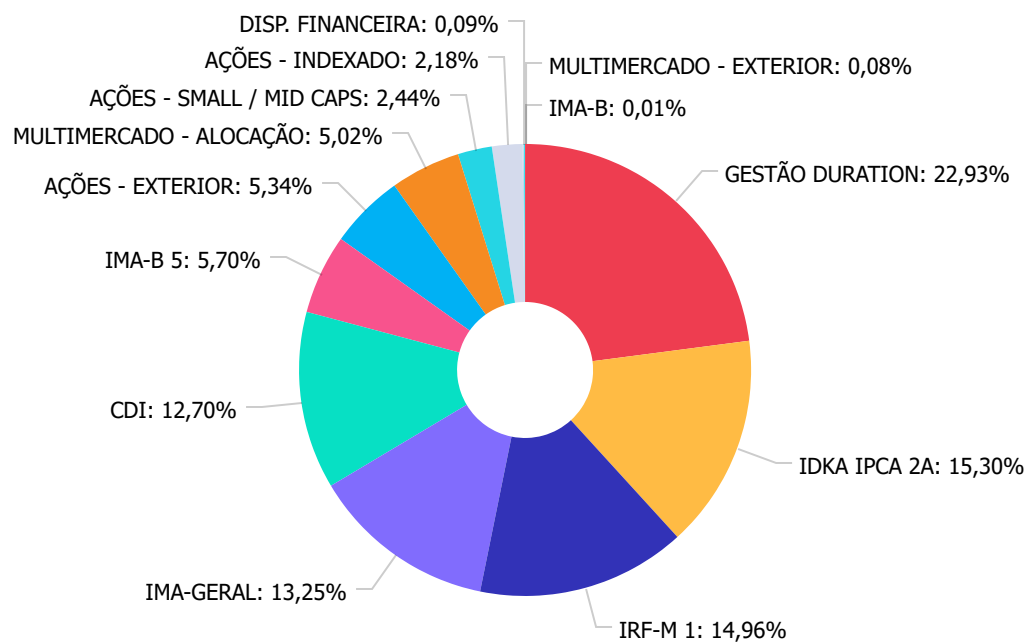
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2021)



Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELO BORGES ALVES
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: d335ecd3-d0c2-489d-ba94-949e8d499086



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



GESTÃO DURATION	3.225.744,33
IDKA IPCA 2A	2.151.770,00
IRF-M 1	2.103.620,00
IMA-GERAL	1.863.811,10
CDI	1.785.970,10
IMA-B 5	802.041,88
AÇÕES - EXTERIOR	751.790,40
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	705.690,70
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	342.890,00
AÇÕES - INDEXADO	306.150,97
DISP. FINANCEIRA	13.250,07
MULTIMERCADO - EXTERIOR	11.600,21
IMA-B	1.020,59

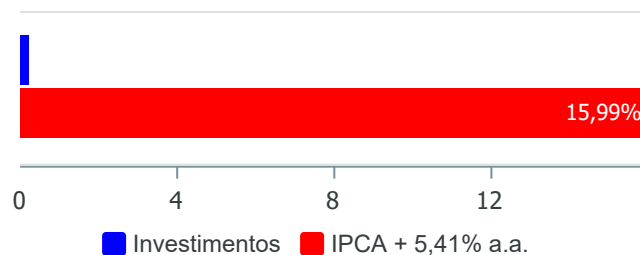
Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELLO BORGES ALVES
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epi/validarDocumento.aspx?CodigoDocumento=133e6cd3-10c2-489d-b794-9698d499086>



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	7.321.567,81	89.429,33	361.958,48	7.019.608,39	-29.430,27	-29.430,27	-0,40%	-0,40%	0,67%	0,67%	-59,99%	1,07%
Fevereiro	7.019.608,39	449.200,52	325.705,89	7.078.365,02	-64.738,00	-94.168,27	-0,91%	-1,30%	1,24%	1,92%	-68,00%	1,05%
Março	7.078.365,02	1.127.076,49	564.677,52	7.655.405,66	14.641,67	-79.526,60	0,19%	-1,12%	1,42%	3,36%	-33,18%	2,00%
Abril	7.655.405,66	704.666,35	369.735,52	8.052.696,48	62.359,99	-17.166,61	0,78%	-0,34%	0,73%	4,12%	-8,35%	1,00%
Maiο	8.052.696,48	839.348,56	373.246,25	8.592.488,99	73.690,20	56.523,59	0,87%	0,52%	1,27%	5,44%	9,52%	1,00%
Junho	8.592.488,99	726.458,93	376.851,78	8.948.172,46	6.076,32	62.599,91	0,07%	0,59%	0,97%	6,47%	9,07%	1,00%
Julho	8.948.172,46	570.191,18	368.492,55	9.103.597,92	-46.273,17	16.326,74	-0,51%	0,08%	1,43%	7,99%	0,98%	2,00%
Agosto	9.103.597,92	682.261,14	382.468,60	9.346.175,40	-57.215,06	-40.888,32	-0,61%	-0,53%	1,34%	9,43%	-5,63%	2,00%
Setembro	9.346.175,40	2.279.714,03	392.597,54	11.207.120,30	-26.171,59	-67.059,91	-0,23%	-0,76%	1,61%	11,18%	-6,82%	1,00%
Outubro	11.207.120,30	545.010,15	377.794,45	11.231.391,10	-142.944,90	-210.004,81	-1,26%	-2,01%	1,67%	13,05%	-15,41%	2,00%
Novembro	11.231.391,10	1.586.187,49	386.360,21	12.576.115,18	144.896,80	-65.108,01	1,17%	-0,87%	1,37%	14,60%	-5,94%	2,00%
Dezembro	12.576.115,18	2.312.942,62	990.039,92	14.052.137,95	153.120,07	88.012,06	1,10%	0,22%	1,22%	15,99%	1,40%	1,00%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELO BORBALVES
Acesse em: <https://pse.psp.br/pep/vf/validarDoc.seam?CodigoDoDocumento=43358cd3-d0c2-489d-ba94-949e8d499b86>



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

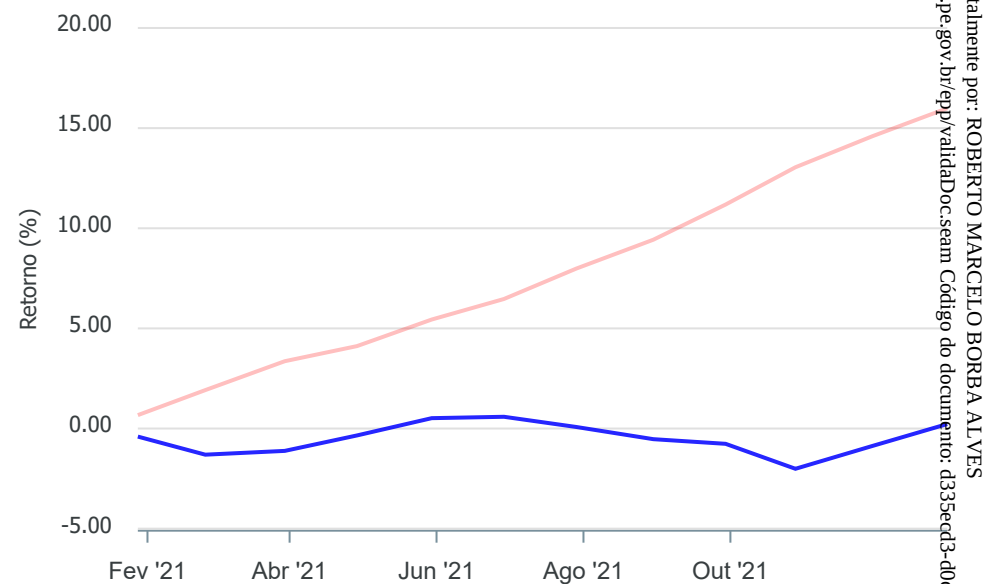
Evolução do Patrimônio



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: ROBERTO MARCELO BORBA ALVES
 Acesse em: <https://etc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: d335ecd3-d0c2-489d-ba94-949e8d499b86



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
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	100.285,56	0,00	100.285,56	1.022,59	1.022,59	1,02%	0,20%	2,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.846.928,41	0,00	0,00	1.863.811,19	16.882,78	0,91%	0,91%	1,00%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	795.978,74	0,00	0,00	802.045,82	6.067,08	0,76%	0,76%	1,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.267.982,27	0,00	0,00	1.277.633,31	9.651,04	0,76%	0,76%	0,79%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.565.452,19	54.383,07	536.099,05	2.103.628,02	19.891,81	0,76%	0,84%	0,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.543.516,13	390.000,00	0,00	1.948.112,06	14.595,93	0,75%	0,83%	0,23%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	574.861,90	0,00	0,00	578.999,25	4.137,35	0,72%	0,72%	1,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.561.750,96	0,00	0,00	1.572.780,08	11.029,12	0,71%	0,71%	1,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	153.076,16	1.624.678,37	0,00	1.785.971,19	8.216,66	0,46%	0,80%	0,03%
Total Renda Fixa	10.409.832,32	2.069.061,44	636.384,61	11.934.003,51	91.494,36	0,77%		0,58%

Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELO BORBA ALVES
Assinatura: 1335ecd3-d0c2-489d-ba94-949e8d499086



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	328.929,36	0,00	0,00	342.891,00	13.961,64	4,24%	4,24%	12,17%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	295.975,76	0,00	0,00	306.153,97	10.178,21	3,44%	3,44%	9,23%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	353.655,31	0,00	353.655,31	11.607,21	11.607,21	3,28%	5,56%	7,98%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	457.100,42	243.881,18	0,00	705.690,78	4.709,18	0,67%	1,27%	2,65%
Total Renda Variável	1.435.660,85	243.881,18	353.655,31	1.366.342,96	40.456,24	2,41%		6,56%

Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELO BORBA ALVES
Assinse em: https://brasil.gov.br/app/validaDoc/seam Código do documento: d335ecd3-d0c2-489d-ba94-949e8d499086



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	730.622,01	0,00	0,00	751.791,48	21.169,47	2,90%	2,90%	8,37%
Total Exterior	730.622,01	0,00	0,00	751.791,48	21.169,47	2,90%		8,37%

Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELO BORBA ALVES
Assinse em: https://brasil.gov.br/pp/validaDoc.seam Código do documento: d335ecd3-d0c2-489d-ba94-949e8d499086



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.544.056,23	0,00	0,00	1.572.780,08	28.723,85	1,86%	1,86%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.459.291,90	1.555.161,20	936.893,50	2.103.628,02	26.068,42	0,86%	1,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.845.462,36	0,00	0,00	1.863.811,19	18.348,83	0,99%	0,99%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.539.840,27	390.000,00	0,00	1.948.112,06	18.271,79	0,95%	1,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.260.028,95	0,00	0,00	1.277.633,31	17.604,36	1,40%	1,40%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	786.797,43	0,00	0,00	802.045,82	15.248,39	1,94%	1,94%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	568.648,27	0,00	0,00	578.999,25	10.350,98	1,82%	1,82%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	1.777.097,88	0,00	1.785.971,19	8.873,31	0,50%	1,93%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	462.853,73	0,00	463.645,77	1.022,59	1.814,63	0,39%	0,97%
				Total Renda Fixa	145.304,56	1,23%	

Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELO BORBA ALVES
Assinse em: https://sece-icpe.gov.br/validar/335ecd3-d0c2-489d-ba94-949e8d499086



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	330.163,94	0,00	353.655,31	11.607,21	35.098,58	10,63%	13,07%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	463.863,46	243.881,18	0,00	705.690,78	-2.053,86	-0,29%	-0,10%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	327.047,61	0,00	0,00	306.153,97	-20.893,64	-6,39%	-6,39%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	387.943,38	0,00	0,00	342.891,00	-45.052,38	-11,61%	-11,61%
Total Renda Variável					-32.901,30	-1,88%	

Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELO BORBA ALVES
Assinse em: https://secreta.pe.gov.br/app/validarDocumento?codigo_documento:d335ecd3-d0c2-489d-ba94-949e8d499086



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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	696.397,47	1.321.298,53	498.522,80	1.572.780,08	53.606,88	2,66%	4,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.376.981,23	3.605.181,57	2.926.513,39	2.103.628,02	47.978,61	0,96%	2,64%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	553.207,76	0,00	0,00	578.999,25	25.791,49	4,66%	4,66%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	778.282,14	0,00	802.045,82	23.763,68	3,05%	4,27%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	622.036,37	641.431,89	0,00	1.277.633,31	14.165,05	1,12%	0,53%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	1.777.097,88	0,00	1.785.971,19	8.873,31	0,50%	4,62%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.272.635,34	675.552,92	0,00	1.948.112,06	-76,20	0,00%	-0,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.335.531,17	532.348,92	0,00	1.863.811,19	-4.068,90	-0,22%	-0,40%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	387.575,05	441.362,79	814.892,02	1.022,59	-13.023,23	-1,57%	-1,51%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	662.585,32	33.000,00	676.345,19	0,00	-19.240,13	-2,77%	-2,28%
			Total Renda Fixa		137.770,56	1,17%	

Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELO BORBA ALVES
Assinse em: https://seccompe.gov.br/epi/validacao/validacao.do?codigo_documento:d335ecd3-d0c2-489d-ba94-949e8d499086



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	320.000,00	353.655,31	11.607,21	45.262,52	14,14%	32,83%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	711.491,30	0,00	705.690,78	-5.800,52	-0,82%	-0,82%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	200.419,41	150.000,00	0,00	306.153,97	-44.265,44	-12,63%	-11,53%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	214.198,69	225.000,00	0,00	342.891,00	-96.307,69	-21,93%	-17,13%
			Total Renda Variável		-101.111,13	-6,89%	

Documento Assinado Digitalmente por: ROBERTO MARCELO BORBA ALVES
Assinse em: https://brasil.gov.br/app/validador/validar_documento: d335ecd3-d0c2-489d-ba94-949e8d499086



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 3.922/2010, 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 3.922 de 25 de novembro de 2010 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: ROBERTO MARCELO BORDA ALVES
Acesse em: <https://etce.ice.gov.br/ppp/qualifica/Doc/seam/Código%20do%20documento%201355613-d0c2-4b90-b3a9-49498d49986>