

RISCO DE MERCADO

FUNDO	BENCHMARK	RENT. (%)		¹ VAR (%) (252 D.U)		² VOL (%)		³ TREYNOR		⁴ DRAWDOWN (%)		⁵ SHARPE		RES. 4.963
		MÊS	12M	MÊS	12M	MÊS	12M	MÊS	12M	MÊS	12M	MÊS	12M	
CARTEIRA	=meta	0,89%	13,97%	1,32%	4,57%	0,25%	2,28%	-1,03	-0,04	0,13%	0,24%	-4,78	-0,14	-
BANESTES INVESTIMENTO PUBLICO...	CDI	0,53%	4,78%	0,00%	0,00%	0,01%	0,05%	1.455,65	19.378,07	0,00%	0,00%	-37,39	-76,33	7, I "b"
BB IRF-M TP FI RF PREVID	IRF-M	0,61%	15,70%	0,01%	0,05%	0,86%	2,98%	-4,91	31,25	0,00%	0,00%	-0,75	1,08	7, I "b"
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO...	IRF-M 1	1,14%	14,51%	0,00%	0,01%	0,09%	0,31%	-9,51	22,38	0,00%	0,00%	-1,42	0,45	7, I "b"
BNB RPPS IMA-B FI RF	IMA-B	0,30%	13,36%	0,02%	0,07%	1,17%	4,06%	-3,31	-9,52	0,00%	0,65%	-0,52	-0,31	7, I "b"
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REF DI	CDI	1,19%	13,94%	0,00%	0,00%	0,01%	0,05%	-1.490,22	3.697,69	0,00%	0,00%	-6,87	-6,91	7, I "b"
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	IRF-M 1	1,14%	14,51%	0,00%	0,01%	0,09%	0,32%	-9,77	24,31	0,00%	0,00%	-1,50	0,47	7, I "b"
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RF SIMPLES	CDI	1,21%	1,60%	0,00%	0,00%	0,02%	0,06%	-162,11	610,26	0,00%	0,00%	-0,92	-1,52	7, I "b"
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA...	CDI	1,16%	14,09%	0,00%	0,01%	0,10%	0,36%	-2.140,27	1.536,15	0,00%	0,00%	-4,73	-0,49	7, III "a"
BANESTES INSTITUCIONAL FI...	IMA-B	0,26%	13,13%	0,02%	0,07%	1,20%	4,16%	-3,40	-11,07	0,00%	0,82%	-0,53	-0,37	7, III "a"
BANESTES LIQUIDEZ FI...	CDI	1,21%	13,57%	0,00%	0,00%	0,02%	0,06%	565,24	-203,14	0,00%	0,00%	0,38	2,37	7, III "a"
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	CDI	0,98%	13,79%	0,00%	0,01%	0,18%	0,63%	-4,85	-28,01	0,00%	0,00%	-0,70	-0,91	7, III "a"
BNB PLUS FIC RF LP	CDI	1,19%	14,01%	0,00%	0,00%	0,02%	0,06%	89,30	3.936,04	0,00%	0,00%	-1,52	-4,92	7, III "a"
BB PERFIL FIC RF REF DI...	CDI	1,22%	14,48%	0,00%	0,00%	0,02%	0,05%	20,08	948,58	0,00%	0,00%	0,83	2,62	7, III "a"
BRADESCO PREMIUM FI RF REF DI	CDI	1,22%	14,05%	0,00%	0,00%	0,01%	0,05%	4,57	-424,68	0,00%	0,00%	-0,24	2,92	7, III "a"
MAG CASH FI RF LP	CDI	1,23%	13,67%	0,00%	0,00%	0,03%	0,11%	6,25	-613,96	0,00%	0,00%	0,30	-0,56	7, III "a"
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	CDI	1,23%	14,46%	0,00%	0,00%	0,02%	0,05%	46,09	-828,37	0,00%	0,00%	0,38	2,53	7, III "a"
CLARITAS FI RF CRÉDITO PRIVADO LP	CDI	1,22%	3,39%	0,00%	0,01%	0,11%	0,37%	-1.570,77	-1.643,22	0,00%	0,00%	-0,06	1,85	7, V "b"
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC...	SMLL	-4,28%	31,09%	0,09%	0,30%	5,31%	18,39%	-3,54	15,44	4,28%	8,17%	-0,62	0,88	8, I
QLZ MOS FIA	IBOVESPA	-0,15%	24,04%	0,09%	0,31%	5,40%	18,70%	-1,12	11,34	0,15%	5,86%	-0,23	0,65	8, I
PLURAL DIVIDENDOS FIA	IBOVESPA	1,11%	40,90%	0,07%	0,23%	4,01%	13,89%	0,19	30,16	0,00%	3,80%	-0,02	1,94	8, I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	IDIV	1,45%	27,88%	0,06%	0,22%	3,87%	13,41%	1,09	16,05	0,00%	2,99%	0,04	1,03	8, I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL...	IBOVESPA	1,93%	1,93%	0,09%	0,32%	5,56%	19,27%	-0,09	10,55	0,00%	5,58%	-0,13	0,62	8, I
GENIAL MS US...	MSCI World	4,50%	4,18%	0,14%	0,49%	8,63%	29,90%	-7,42	-111,69	0,00%	22,83%	0,50	-0,36	9, II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES...	MSCI World	5,98%	1,50%	0,09%	0,32%	5,57%	19,30%	-14,11	44,67	0,00%	11,47%	1,20	-0,63	9, II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES...	MSCI World	4,73%	-1,37%	0,11%	0,36%	6,39%	22,14%	-5,27	71,64	0,00%	12,61%	0,70	-0,70	9, II
RIO BRAVO PROTEÇÃO...	IBOVESPA	1,43%	27,35%	0,06%	0,21%	3,63%	12,59%	0,82	16,72	0,00%	3,27%	0,04	1,03	10, I
ICATU VANG IGARATE LONG BIASED FIM...	IBOVESPA	0,17%	15,06%	0,04%	0,15%	2,62%	9,06%	-1,21	1,50	0,00%	1,40%	-0,26	0,09	10, I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES...	IBOVESPA	2,08%	14,68%	0,03%	0,09%	1,54%	5,32%	-8,98	11,13	0,00%	2,20%	1,03	0,09	10, I
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FUNDO...	IPCA	-1,78%	0,08%	-	-	-	-			0,00%	0,00%			10, II

¹VaR (252 d.u): O Value at Risk é uma medida estatística que indica a perda máxima potencial de determinado ativo ou determinada carteira em determinado período. Para o seu cálculo, utiliza-se o retorno esperado, o desvio padrão dos retornos diários e determinado nível de confiança probabilística supondo uma distribuição normal. Seu resultado pode ser interpretado como, quanto mais alto for, mais arriscado é o ativo ou a carteira. Dado o desempenho da Carteira nos últimos 12 meses, estima-se com 95% de confiança que, se houver uma perda de um dia para o outro, o prejuízo máximo será de 0,29%.

²Volatilidade: Volatilidade é uma variável que representa a intensidade e a frequência que acontecem as movimentações do valor de um determinado ativo, dentro de um período. De uma forma mais simples, podemos dizer que volatilidade é a forma de medir a variação do ativo. Assim sendo, uma Volatilidade alta representa maior risco, visto que os preços do ativo tendem a se afastar mais de seu valor médio. Estima-se que os retornos diários da Carteira, em média, se afastam em 2,28% do retorno diário médio dos últimos 12 meses.

³Treynor: Similar ao Sharpe, porém, utiliza o risco do mercado (Beta) no cálculo em vez da volatilidade da Carteira. A leitura é a mesma feita no sharpe, quanto maior seu valor, melhor performa o ativo ou a carteira.

Valores negativos indicam que a carteira teve rentabilidade menor do que a alcançada pelo mercado. Em 12 meses, cada 100 pontos de risco a que a Carteira se expôs foram convertidos em uma rentabilidade -0,04 menor que a do mercado.

⁴DrawDown: Auxilia a determinar o risco de um investimento, indicando quão estável é determinado ativo, ao medir seu declínio desde o valor máximo alcançado pelo ativo, até o valor mínimo atingido em determinado período de tempo. Para determinar o percentual de queda, o Draw-Down é medido desde que a desvalorização começa até se atingir um novo ponto de máximo, garantindo, dessa forma, que a mínima da série representa a maior queda ocorrida no período. Quanto mais negativo o número, maior a perda ocorrida e, conseqüentemente, maior o risco do ativo. Já um Draw-Down igual a zero, indica que não houve desvalorização do ativo ao longo do período avaliado.

⁵Sharpe: Trata-se de um indicador de performance utilizado no mercado financeiro para avaliar a relação risco-retorno de um ativo através da diferença entre o retorno do ativo e o ativo livre de risco, com o CDI sendo comumente utilizado como proxy deste, dividido pela volatilidade. Portanto, quanto maior o índice de Sharpe do ativo, melhor a sua performance. Em 12 meses, o indicador apontou que para cada 100 pontos de risco a que a Carteira se expôs, houve uma rentabilidade -0,14 menor que aquela realizada pelo CDI.

RISCO DE DESENQUADRAMENTOS E CONFORMIDADE

Esta seção detalha a exposição individual de cada ativo em relação aos limites de concentração por Emissor, Gestor, Administrador e Classe, conforme estabelecido nos artigos da Resolução CMN 4.963/2021.

Todos os ativos encontram-se enquadrados nos limites de concentração previstos na regulação e aderentes às diretrizes da Política de Investimentos.

FUNDO	SALDO	ART. 18	ART. 19	GESTOR	ART. 20	ADMIN.	ART. 21
BANESTES INVESTIMENTO PUBLICO...	R\$ 216.530,68	0,03%	0,02%	BANESTES DISTRIBUIDORA	0,00235%	BANESTES DISTRIBUIDORA	0,00235% 7, I "b"
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 54.906,61	0,01%	-	BB ASSET	0,00%	BB ASSET	0,00% 7, I "b"
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	R\$ 820.856,37	0,13%	-	CAIXA ASSET	0,00014%	CAIXA DTVM	0,00011% 7, I "b"
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO...	R\$ 1.573.718,75	0,25%	0,78%	BANESTES DISTRIBUIDORA	0,01708%	BANESTES DISTRIBUIDORA	0,01708% 7, I "b"
BNB RPPS IMA-B FI RF	R\$ 1.425.287,90	0,23%	1,47%	BANCO DO NORDESTE	0,00679%	S3 CACEIS (SANTANDER)	0,00136% 7, I "b"
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REF DI	R\$ 19.526,45	0,00%	0,00%	BANCO BRADESCO	0,00%	BANCO BRADESCO	0,00% 7, I "b"
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RF SIMPLES	R\$ 8.410.325,70	1,35%	0,07%	XP ASSET	0,01578%	XP SERVIÇOS	0,02134% 7, I "b"
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA...	R\$ 23.501.763,90	3,78%	6,49%	BANESTES DISTRIBUIDORA	0,25506%	BANESTES DISTRIBUIDORA	0,25506% 7, III "a"
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	R\$ 10.126.803,05	1,63%	-	CAIXA ASSET	0,0017%	CAIXA DTVM	0,00138% 7, III "a"
BANESTES INSTITUCIONAL FI...	R\$ 375.370,28	0,06%	0,30%	BANESTES DISTRIBUIDORA	0,00407%	BANESTES DISTRIBUIDORA	0,00407% 7, III "a"
BANESTES LIQUIDEZ FI...	R\$ 42.989.657,67	6,92%	1,07%	BANESTES DISTRIBUIDORA	0,46655%	BANESTES DISTRIBUIDORA	0,46655% 7, III "a"
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	R\$ 12.387.678,02	1,99%	7,73%	BANESTES DISTRIBUIDORA	0,13444%	BANESTES DISTRIBUIDORA	0,13444% 7, III "a"
BNB PLUS FIC RF LP	R\$ 2.229.623,24	0,36%	0,16%	BANCO DO NORDESTE	0,01062%	S3 CACEIS (SANTANDER)	0,00213% 7, III "a"
BB PERFIL FIC RF REF DI...	R\$ 35.735.271,70	5,75%	-	BB ASSET	0,00195%	BB ASSET	0,00194% 7, III "a"
BRADESCO PREMIUM FI RF REF DI	R\$ 12.780.659,31	2,06%	0,07%	BANCO BRADESCO	0,0014%	BANCO BRADESCO	0,00165% 7, III "a"
MAG CASH FI RF LP	R\$ 5.942.234,79	0,96%	0,35%	MONGERAL AEGON	0,03656%	BTG PACTUAL DTVM	0,00062% 7, III "a"
CLARITAS FI RF CRÉDITO PRIVADO LP	R\$ 2.067.747,80	0,33%	0,86%	PRINCIPAL ASSET	0,05513%	BTG PACTUAL DTVM	0,00021% 7, V "b"
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	R\$ 2.844.532,94	0,46%	0,90%	CAIXA ASSET	0,00048%	CAIXA DTVM	0,00039% 8, I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC...	R\$ 1.020.497,97	0,16%	0,12%	AZ QUEST INVESTIMENTOS	0,01823%	INTRAG DTVM	0,00017% 8, I
QLZ MOS FIA	R\$ 2.166.355,31	0,35%	1,33%	MOS GESTÃO	0,79448%	BEM DTVM (BRADESCO)	0,00037% 8, I
PLURAL DIVIDENDOS FIA	R\$ 9.551.104,71	1,54%	1,19%	PLURAL INVESTIMENTOS	0,10988%	BEM DTVM (BRADESCO)	0,00165% 8, I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL...	R\$ 3.567.555,96	0,57%	0,44%	GUEPARDO INVESTIMENTOS	0,06896%	BANCO DAYCOVAL	0,00467% 8, I
GENIAL MS US...	R\$ 2.228.441,17	0,36%	1,82%	PLURAL INVESTIMENTOS	0,02564%	BANCO BNP PARIBAS	0,00286% 9, II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES...	R\$ 6.183.086,00	1,00%	2,62%	SCHRODER INVESTMENT	0,11125%	INTRAG DTVM	0,00101% 9, II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES...	R\$ 1.138.159,06	0,18%	0,19%	XP ASSET	0,00214%	BANCO BNP PARIBAS	0,00146% 9, II
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES...	R\$ 2.946.779,53	0,47%	1,57%	CAIXA ASSET	0,00049%	CAIXA DTVM	0,0004% 10, I
RIO BRAVO PROTEÇÃO...	R\$ 6.159.635,83	0,99%	3,81%	RIO BRAVO INVESTIMENTOS	0,3659%	BTG PACTUAL DTVM	0,00064% 10, I
ICATU VANG IGARATE LONG BIASED FIM...	R\$ 9.300.834,53	1,50%	1,50%	ICATU VANGUARDA	0,01538%	BEM DTVM (BRADESCO)	0,00161% 10, I
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FUNDO...	R\$ 3.059.096,77	0,49%	-	PÁTRIA INVESTIMENTOS	0,00675%	XP INVESTIMENTOS	0,00257% 10, II
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 410.378.544,08	66,06%	-	-	-	-	- 7, I "a"

Art. 18. As aplicações em cotas de um mesmo fundo de investimento não podem, direta ou indiretamente, exceder a 20% das aplicações dos recursos do RPPS, exceto em casos de fundos compostos exclusivamente por títulos públicos.

Art. 19. O total das aplicações dos RPPS em um mesmo fundo de investimento deverá representar, no máximo, 15% do patrimônio líquido do fundo exceto em casos de fundos compostos exclusivamente por títulos públicos.

Em caso de FIDCs, FI Renda Fixa "Crédito Privado" e FI "Debêntures", o limite é de 5% do patrimônio líquido do fundo.

Art. 20. O total das aplicações dos recursos do RPPS em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico.

Art. 21. Os RPPS somente poderão aplicar recursos em cotas de fundos de investimento quando atendidas, cumulativamente, as seguintes condições:

I - o administrador ou o gestor do fundo de investimento seja instituição autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil obrigada a instituir comitê de auditoria e comitê de riscos;

II - o administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% dos recursos sob sua administração oriundos de RPPS;

III - o gestor e o administrador do fundo de investimento tenham sido objeto de prévio credenciamento e sejam considerados pelos responsáveis pela gestão de recursos como de boa qualidade de gestão e de ambiente de controle de investimento.

ADERÊNCIA AOS BENCHMARKS

FUNDO	SALDO	BENCHMARK	RENTABILIDADE (%)			RENT. VS BENCHMARKS (%)				
			MÊS	3M	6M	12M	MÊS	3M	6M	12M
CAIXA BRASIL FI RF REF DI LP	R\$ 10.126.803,05	CDI	1,23%	3,57%	7,43%	14,46%	100,43%	101,15%	100,87%	101,33%
BB PERFIL FIC RF REF DI PR...	R\$ 35.735.271,70	CDI	1,22%	3,60%	7,46%	14,48%	100,39%	101,90%	101,22%	101,44%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	R\$ 820.856,37	IRF-M 1	1,14%	3,51%	7,28%	14,51%	98,51%	100,06%	99,30%	98,98%
BNB PLUS FIC RF LP	R\$ 2.229.623,24	CDI	1,19%	3,52%	7,27%	14,01%	97,38%	99,76%	98,72%	98,19%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 54.906,61	IRF-M	0,61%	3,49%	6,60%	15,70%	200,74%	104,29%	99,10%	88,33%
BNB RPPS IMA-B FI RF	R\$ 1.425.287,90	IMA-B	0,30%	3,43%	4,17%	13,36%	98,33%	103,61%	107,11%	104,45%
BRADESCO PREMIUM FI RF ...	R\$ 12.780.659,31	CDI	1,22%	3,58%	7,04%	14,05%	99,90%	101,31%	95,60%	98,46%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	R\$ 2.844.532,94	IDIV	1,45%	8,45%	13,52%	27,88%	98,76%	91,77%	97,53%	92,22%
BRADESCO FEDERAL EXTRA...	R\$ 19.526,45	CDI	1,19%	3,50%	7,25%	13,94%	97,64%	99,11%	98,34%	97,67%
MS GLOBAL OPPORTUNITIE...	R\$ 1.138.159,06	MSCI World	4,73%	-0,79%	-2,87%	-1,37%	650,75%	-31,77%	-28,21%	-6,95%
GENIAL MS US GROWTH IN...	R\$ 2.228.441,17	MSCI World	4,50%	-5,21%	2,41%	4,18%	620,25%	-209,04%	23,67%	21,25%
AZ QUEST SMALL MID CAPS...	R\$ 1.020.497,97	SMLL	-4,28%	4,70%	9,36%	31,09%	119,03%	169,87%	282,08%	97,32%
GUEPARDO VALOR INSTITU...	R\$ 3.567.555,96	IBOVESPA	1,93%	-	-	-	149,55%	-	-	-
BANESTES INSTITUCIONAL ...	R\$ 375.370,28	IMA-B	0,26%	3,65%	4,19%	13,13%	83,42%	110,42%	107,44%	102,61%
BANESTES VIP DI FIC REND...	R\$ 23.501.763,90	CDI	1,16%	3,76%	7,39%	14,09%	94,90%	106,51%	100,30%	98,75%
BANESTES LIQUIDEZ FI REN...	R\$ 42.989.657,67	CDI	1,21%	3,57%	7,23%	13,57%	98,87%	100,98%	98,07%	95,06%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC ...	R\$ 12.387.678,02	CDI	0,98%	3,43%	6,65%	13,79%	79,93%	97,16%	90,31%	96,60%
SCHRODER SUSTENTABILID...	R\$ 6.183.086,00	MSCI World	5,98%	7,80%	9,58%	1,50%	822,78%	312,97%	94,25%	7,64%
BANESTES INVESTIMENTO ...	R\$ 216.530,68	CDI	0,53%	1,50%	2,65%	4,78%	43,84%	42,41%	35,97%	33,49%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO ...	R\$ 2.946.779,53	IBOVESPA	2,08%	4,40%	10,26%	14,68%	160,81%	41,06%	66,33%	43,02%
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS...	R\$ 1.573.718,75	IRF-M 1	1,14%	3,52%	7,29%	14,51%	98,53%	100,26%	99,53%	98,94%
PLURAL DIVIDENDOS FIA	R\$ 9.551.104,71	IBOVESPA	1,11%	9,81%	16,87%	40,90%	86,09%	91,42%	109,12%	119,85%
ICATU VANG IGARATE LONG...	R\$ 9.300.834,53	IBOVESPA	0,17%	4,04%	7,82%	15,06%	12,81%	37,65%	50,58%	44,14%
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ...	R\$ 3.059.096,77	IPCA	-1,78%	-2,80%	-2,76%	0,08%	-540,40%	-468,86%	-225,35%	1,87%
QLZ MOS FIA	R\$ 2.166.355,31	IBOVESPA	-0,15%	1,21%	3,52%	24,04%	-11,45%	11,29%	22,77%	70,43%
MAG CASH FI RF LP	R\$ 5.942.234,79	CDI	1,23%	3,48%	6,92%	13,67%	100,61%	98,46%	93,85%	95,79%
TREND PÓS-FIXADO FIC FI ...	R\$ 8.410.325,70	CDI	1,21%	-	-	-	99,42%	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI M...	R\$ 6.159.635,83	IBOVESPA	1,43%	9,33%	13,66%	27,35%	110,45%	87,01%	88,33%	80,12%
CLARITAS FI RF CRÉDITO PR...	R\$ 2.067.747,80	CDI	1,22%	3,36%	-	-	99,60%	95,04%	-	-

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



ADERÊNCIA À POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

TIPO DE ATIVO	CARTEIRA (R\$)	(%)	LIM. 4.963	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO			CONF?
				INFERIOR (%)	ALVO (%)	SUPERIOR (%)	
Renda Fixa							
Títulos Tesouro Nacional – SELIC	R\$ 410.378.544,08	66,06%	100,00%	0,00%	42,00%	100,00%	SIM
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN	R\$ 12.521.152,46	2,02%	100,00%	0,00%	15,00%	100,00%	SIM
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN	R\$ 0,00	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%	100,00%	SIM
Operações Compromissadas	R\$ 0,00	0,00%	5,00%	0,00%	0,00%	5,00%	SIM
FI Renda Fixa	R\$ 146.069.061,96	23,51%	70,00%	0,00%	23,00%	60,00%	SIM
FI de Índices Renda Fixa	R\$ 0,00	0,00%	70,00%	0,00%	0,00%	20,00%	SIM
Ativos Bancários	R\$ 0,00	0,00%	20,00%	0,00%	1,00%	5,00%	SIM
FI Direitos Creditórios (FIDC) – sênior	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	5,00%	SIM
FI Renda Fixa "Crédito Privado"	R\$ 2.067.747,80	0,33%	10,00%	0,00%	1,00%	5,00%	SIM
FI Debêntures	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	5,00%	SIM
Renda Variável							
FI Ações	R\$ 19.150.046,89	3,08%	40,00%	0,00%	9,00%	30,00%	SIM
FI de Índices Ações	R\$ 0,00	0,00%	40,00%	0,00%	0,00%	30,00%	SIM
Exterior							
FI Renda Fixa - Dívida Externa	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	0,00%	3,00%	10,00%	SIM
FI Investimento no Exterior	R\$ 9.549.686,23	1,54%	10,00%	0,00%	0,00%	10,00%	SIM
FI Ações – BDR Nível I	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	10,00%	SIM
Estruturados							
FI Multimercado - aberto	R\$ 18.407.249,89	2,96%	10,00%	0,00%	4,00%	10,00%	SIM
FI em Participações	R\$ 3.059.096,77	0,49%	5,00%	0,00%	1,00%	5,00%	SIM
FI "Ações - Mercado de Acesso"	R\$ 0,00	0,00%	5,00%	0,00%	0,00%	5,00%	SIM
Fundos Imobiliários							
FI Imobiliário	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	5,00%	SIM
Emprést. Consignado							
Empréstimos Consignados	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	0,00%	1,00%	10,00%	SIM
Imóveis							
Imóveis	R\$ 0,00	0,00%	-	-	-	-	SIM

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

