

RISCO DE MERCADO

FUNDO	BENCHMARK	RENT. (%)		¹ VAR (%) (252 D.U)		² VOL (%)		³ TREYNOR		⁴ DRAWDOWN		⁵ SHARPE		RES. 4963
		MÊS	12M	MÊS	12M	MÊS	12M	MÊS	12M	MÊS	12M	MÊS	12M	
CARTEIRA	=meta	0,71%	13,45%	1,26%	4,38%	0,45%	2,16%	-0,13	0,10	1,54%	1,63%	-1,08	0,53	-
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO...	IRF-M 1	0,81	12,23	0,00%	0,00%	0,08%	0,26%	-5,31	-16,68	0,00	0,00	-0,52	-0,42	7, I "b"
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	IMA-B	0,06	10,58	0,02%	0,07%	1,17%	4,04%	-7,47	-4,48	0,00	2,14	-1,26	-0,15	7, I "b"
BANESTES INVESTIMENTO PUBLICO...	CDI	0,08	2,94	0,00%	0,00%	0,01%	0,05%	-1.847,79	-16.763,81	0,00	0,00	-54,28	-63,87	7, I "b"
BB IRF-M TP FI RF PREVID	IRF-M	0,50	13,43	0,01%	0,04%	0,64%	2,21%	-7,46	20,95	0,00	0,00	-0,77	0,70	7, I "b"
BB TP IPCA III FI RF...	IPCA	0,91	9,78	0,00%	0,02%	0,26%	0,91%	16,73	-318,93	0,00	0,01	0,66	-2,88	7, I "b"
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	IMA Geral ex-C	0,58	11,99	0,01%	0,02%	0,39%	1,36%	-7,36	-8,62	0,00	0,00	-0,79	-0,25	7, I "b"
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF...	IRF-M	0,50	13,78	0,01%	0,04%	0,64%	2,22%	-7,58	23,30	0,00	0,00	-0,78	0,78	7, I "b"
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI...	IMA-B 5	0,92	9,78	0,01%	0,05%	0,84%	2,92%	16,01	-6.578,71	0,00	2,07	0,71	-1,95	7, I "b"
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI...	IMA-B 5	0,92	9,79	0,00%	0,02%	0,27%	0,92%	16,35	-312,80	0,00	0,01	0,72	-2,83	7, I "b"
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS...	IMA-B	0,00	10,98	0,02%	0,08%	1,42%	4,91%	-8,79	-32,93	0,00	2,42	-1,27	-0,86	7, I "b"
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	CDI	0,68	11,69	0,00%	0,01%	0,21%	0,71%	-7,20	-31,85	0,00	0,00	-1,18	-1,03	7, III "a"
BANESTES LIQUIDEZ FI...	CDI	0,90	12,60	0,00%	0,00%	0,04%	0,13%	-30,75	-1.370,58	0,00	0,00	3,12	2,10	7, III "a"
BB PERFIL FIC RF REF DI...	CDI	0,85	12,40	0,00%	0,00%	0,02%	0,06%	328,36	114,36	0,00	0,00	2,55	0,94	7, III "a"
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FUNDO DE...	IPCA	1,42	5,14	-	-	-	-	7,29		0,00	1,14	1,77		7, III "a"
BANESTES DIVIDENDOS FIC DE FIA	IDIV	-0,32	22,13	0,07%	0,24%	4,27%	14,80%	-1,28	12,14	0,32	4,66	-0,39	0,73	8, I
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES PREVID	IBOVESPA	-1,18	21,78	0,07%	0,24%	4,29%	14,87%	-1,92	9,92	1,18	6,70	-0,64	0,64	8, I
BB FATORIAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	-1,58	5,02	0,07%	0,25%	4,40%	15,25%	-2,42	7,17	1,58	7,45	-0,79	0,47	8, I
CAIXA BRASIL AÇÕES...	IBOVESPA	1,36	36,45	0,07%	0,26%	4,55%	15,76%	0,61	26,65	0,00	9,05	0,17	1,55	8, I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS...	IDIV	-1,01	26,45	0,06%	0,21%	3,72%	12,88%	-2,54	17,89	1,01	5,85	-0,79	1,13	8, I
OCCAM FIC AÇÕES	IBOVESPA	-1,50	18,73	0,07%	0,24%	4,28%	14,83%	-2,31	7,07	1,50	7,27	-0,76	0,45	8, I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC...	SMLL	2,89	23,62	0,08%	0,27%	4,81%	16,65%	3,02	12,34	0,00	13,08	0,83	0,66	8, I
PLURAL DIVIDENDOS FIA	IBOVESPA	0,01	0,01	0,06%	0,22%	3,81%	13,18%	-3,63	13,79	2,23	4,19	-1,16	0,86	8, I
BB SCHRODER INVESTIMENTO...	MSCI World	4,27	24,88	0,06%	0,22%	3,94%	13,67%	-29,85	-57,86	0,00	4,34	0,88	0,87	9, II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT...	MSCI World	4,75	9,69	0,07%	0,23%	4,01%	13,90%	-17,79	16,30	0,00	10,72	1,19	-0,19	9, II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES...	MSCI World	3,31	18,82	0,07%	0,23%	4,11%	14,23%	-14,28	-33,71	0,00	6,80	0,66	0,43	9, II
GENIAL MS GLOBAL...	MSCI World	0,54	12,53	0,06%	0,22%	3,80%	13,16%	-30,99	-0,72	0,00	6,02	-0,09	0,01	9, II
GENIAL MS US...	MSCI World	2,58	33,27	0,13%	0,45%	7,93%	27,45%	47,31	135,72	0,00	16,89	0,22	0,80	9, II
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	GLOBAL BDRX	3,48	32,44	0,07%	0,23%	4,03%	13,97%	8,91	-767,44	0,00	4,92	0,78	1,51	9, III
CAIXA BOLSA AMERICANA...	S&P 500	3,39	36,04	0,05%	0,19%	3,34%	11,58%	5,20	79,03	0,00	7,01	0,98	2,29	10, I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA...	CDI	0,52	12,84	0,02%	0,06%	1,01%	3,48%	-2,23	1,53	0,00	0,41	-0,52	0,09	10, I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II...	S&P 500	-0,60	7,70	0,05%	0,18%	3,12%	10,81%	7,35	-48,44	0,60	2,18	-0,49	-0,40	10, I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS...	IPCA	-20,76	40,03	-	-	-	-			0,00	2,58			11

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 0,28%.

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 2,16% do retorno diário médio dos últimos 12 meses.

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.

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 0,10 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 0,53 menor que aquela realizada pelo CDI.

RISCO DE DESENQUADRAMENTOS RES. CMN 4.963 E CONFORMIDADE

FUNDO	SALDO	ART. 18	ART. 19	GESTOR	ART. 20	ADMIN.	ART. 21
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO...	R\$ 25.402.834,72	4,87%	14,47%	BANESTES	0,37176%	BANESTES DTVM	0,37176% 7, I "b"
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	R\$ 24.530.778,72	4,70%	10,53%	BANESTES	0,359%	BANESTES DTVM	0,359% 7, I "b"
BANESTES INVESTIMENTO PUBLICO...	R\$ 4.659.573,45	0,89%	0,31%	BANESTES	0,06819%	BANESTES DTVM	0,06819% 7, I "b"
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 63.777.784,04	12,22%	1,51%	BB ASSET	0,00381%	BB ASSET	0,00381% 7, I "b"
BB TP IPCA III FI RF..	R\$ 2.320.374,51	0,44%	1,21%	BB ASSET	0,00014%	BB ASSET	0,00014% 7, I "b"
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	R\$ 30.541.512,84	5,85%	0,56%	CAIXA ASSET	0,00567%	CAIXA DTVM	0,00459% 7, I "b"
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF..	R\$ 24.044.865,32	4,61%	0,98%	CAIXA ASSET	0,00446%	CAIXA DTVM	0,00361% 7, I "b"
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI...	R\$ 9.331.357,10	1,79%	1,87%	CAIXA ASSET	0,00173%	CAIXA DTVM	0,0014% 7, I "b"
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI...	R\$ 10.535.199,13	2,02%	0,27%	CAIXA ASSET	0,00196%	CAIXA DTVM	0,00158% 7, I "b"
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS...	R\$ 9.490.302,50	1,82%	0,95%	CAIXA ASSET	0,00176%	CAIXA DTVM	0,00143% 7, I "b"
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	R\$ 20.492.795,99	3,93%	14,03%	BANESTES	0,2999%	BANESTES DTVM	0,2999% 7, III "a"
BANESTES LIQUIDEZ FI...	R\$ 8.261.544,42	1,58%	0,26%	BANESTES	0,1209%	BANESTES DTVM	0,1209% 7, III "a"
BB PERFIL FIC RF REF DI...	R\$ 6.316.075,15	1,21%	0,04%	BB ASSET	0,00038%	BB ASSET	0,00038% 7, III "a"
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FUNDO DE...	R\$ 5.257.040,21	1,01%	2,23%	RIO BRAVO INVESTIMENTOS	0,36216%	BEM DTVM (BRADESCO)	0,00101% 7, III "a"
BANESTES DIVIDENDOS FIC DE FIA	R\$ 1.946.150,51	0,37%	14,54%	BANESTES	0,02848%	BANESTES DTVM	0,02848% 8, I
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES PREVID	R\$ 17.952.844,62	3,44%	5,47%	BB ASSET	0,00107%	BB ASSET	0,00107% 8, I
BB FATORIAL FIC AÇÕES	R\$ 3.644.785,24	0,70%	0,27%	BB ASSET	0,00022%	BB ASSET	0,00022% 8, I
CAIXA BRASIL AÇÕES...	R\$ 17.523.240,63	3,36%	2,45%	CAIXA ASSET	0,00325%	CAIXA DTVM	0,00263% 8, I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS...	R\$ 1.980.049,65	0,38%	0,19%	CAIXA ASSET	0,00037%	CAIXA DTVM	0,0003% 8, I
OCCAM FIC AÇÕES	R\$ 3.166.813,07	0,61%	0,36%	OCCAM BRASIL	0,06648%	BEM DTVM (BRADESCO)	0,00061% 8, I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC...	R\$ 1.222.072,43	0,23%	0,15%	AZ QUEST INVESTIMENTOS	0,01462%	BEM DTVM (BRADESCO)	0,00024% 8, I
PLURAL DIVIDENDOS FIA	R\$ 4.034.595,96	0,77%	1,37%	PLURAL INVESTIMENTOS	0,04221%	BEM DTVM (BRADESCO)	0,00078% 8, I
BB SCHRODER INVESTIMENTO...	R\$ 1.202.509,69	0,23%	0,25%	BB ASSET	0,00007%	BB ASSET	0,00007% 9, II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT...	R\$ 5.595.028,62	1,07%	1,48%	BB ASSET	0,00033%	BB ASSET	0,00033% 9, II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES...	R\$ 1.735.495,59	0,33%	0,51%	SCHRODER INVESTMENT	0,02533%	BEM DTVM (BRADESCO)	0,00033% 9, II
GENIAL MS GLOBAL...	R\$ 1.826.069,68	0,35%	3,06%	PLURAL INVESTIMENTOS	0,01911%	BANCO BNP PARIBAS	0,00264% 9, II
GENIAL MS US...	R\$ 1.751.652,67	0,34%	1,30%	PLURAL INVESTIMENTOS	0,01833%	BANCO BNP PARIBAS	0,00253% 9, II
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	R\$ 19.559.661,78	3,75%	0,86%	CAIXA ASSET	0,00363%	CAIXA DTVM	0,00294% 9, III
CAIXA BOLSA AMERICANA...	R\$ 7.189.501,71	1,38%	0,39%	CAIXA ASSET	0,00133%	CAIXA DTVM	0,00108% 10, I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA...	R\$ 11.287.205,57	2,16%	5,03%	CAIXA ASSET	0,0021%	CAIXA DTVM	0,0017% 10, I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II...	R\$ 5.717.976,62	1,10%	11,14%	RIO BRAVO INVESTIMENTOS	0,39392%	BEM DTVM (BRADESCO)	0,0011% 10, I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS...	R\$ 2.006.000,00	0,38%	1,37%	RIO BRAVO INVESTIMENTOS	0,13819%	CAIXA DTVM	0,0003% 11
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 167.405.917,85	32,09%	-	-	-	-	- 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

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.

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
BB PERFIL FIC RF REF DI PR...	R\$ 6.316.075,15	CDI	0,85%	2,65%	5,55%	12,40%	102,54%	100,94%	100,40%	99,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO EST...	R\$ 30.541.512,84	IMA Geral ex-C	0,58%	1,80%	4,77%	11,99%	106,58%	108,16%	86,07%	92,21%
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI RF	R\$ 9.331.357,10	IMA-B 5	0,92%	2,77%	4,99%	9,78%	118,87%	134,81%	98,07%	100,69%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR ...	R\$ 19.559.661,78	GLOBAL BDRX	3,48%	14,98%	23,77%	32,44%	86,10%	94,34%	95,54%	90,90%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 63.777.784,04	IRF-M	0,50%	1,61%	6,00%	13,43%	93,09%	95,90%	97,98%	93,04%
BB TP IPCA III FI RF PREVID	R\$ 2.320.374,51	IPCA	0,91%	2,77%	4,98%	9,78%	568,93%	195,77%	198,23%	245,06%
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FL...	R\$ 10.535.199,13	IMA-B 5	0,92%	2,78%	5,00%	9,79%	119,09%	135,04%	98,21%	100,85%
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF	R\$ 24.044.865,32	IRF-M	0,50%	1,61%	6,01%	13,78%	92,46%	96,30%	98,11%	95,42%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR...	R\$ 1.980.049,65	IDIV	-1,01%	-2,33%	10,04%	26,45%	84,09%	61,17%	98,05%	93,68%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO D...	R\$ 2.006.000,00	IPCA	-20,76%	2,18%	2,57%	40,03%	-12.977,94%	154,21%	102,17%	1.003,38%
CAIXA BOLSA AMERICANA F...	R\$ 7.189.501,71	S&P 500	3,39%	11,13%	25,56%	36,04%	109,43%	109,55%	113,44%	118,35%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇ...	R\$ 17.952.844,62	IBOVESPA	-1,18%	-5,46%	6,70%	21,78%	165,92%	120,41%	67,67%	84,26%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA ...	R\$ 11.287.205,57	CDI	0,52%	1,08%	6,14%	12,84%	62,50%	41,11%	110,97%	102,98%
OCCAM FIC AÇÕES	R\$ 3.166.813,07	IBOVESPA	-1,50%	-4,14%	8,63%	18,73%	211,29%	91,44%	87,12%	72,45%
BB NORDEA GLOBAL CLIMA...	R\$ 5.595.028,62	MSCI World	4,75%	10,39%	16,65%	9,69%	159,07%	123,01%	81,43%	38,05%
BB FATORIAL FIC AÇÕES	R\$ 3.644.785,24	IBOVESPA	-1,58%	-7,45%	-11,02%	-	223,58%	164,49%	-111,26%	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE...	R\$ 17.523.240,63	IBOVESPA	1,36%	0,85%	15,71%	36,45%	-191,54%	-18,71%	158,68%	141,01%
GENIAL MS US GROWTH IN...	R\$ 1.751.652,67	MSCI World	2,58%	8,83%	25,67%	33,27%	86,39%	104,53%	125,51%	130,71%
AZ QUEST SMALL MID CAPS...	R\$ 1.222.072,43	SMLL	2,89%	1,36%	10,39%	23,62%	135,79%	-33,32%	150,16%	95,04%
BANESTES IMA-B TÍTULOS P...	R\$ 24.530.778,72	IMA-B	0,06%	-0,05%	3,93%	10,58%	75,66%	-28,99%	79,55%	87,69%
BANESTES LIQUIDEZ FI REN...	R\$ 8.261.544,42	CDI	0,90%	2,79%	5,81%	12,60%	108,28%	106,54%	105,09%	101,10%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC ...	R\$ 20.492.795,99	CDI	0,68%	2,08%	5,39%	11,69%	82,09%	79,42%	97,56%	93,82%
SCHRODER SUSTENTABILID...	R\$ 1.735.495,59	MSCI World	3,31%	9,30%	18,87%	18,82%	110,80%	110,08%	92,26%	73,92%
BANESTES INVESTIMENTO ...	R\$ 4.659.573,45	CDI	0,08%	0,21%	0,81%	2,94%	9,16%	8,11%	14,65%	23,62%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTUL...	R\$ 9.490.302,50	IMA-B	0,00%	0,24%	4,45%	10,98%	1,95%	139,03%	90,08%	91,06%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IP...	R\$ 5.257.040,21	IPCA	1,42%	3,13%	3,12%	-	890,00%	220,86%	124,01%	-
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS...	R\$ 25.402.834,72	IRF-M 1	0,81%	2,46%	5,37%	12,23%	95,90%	100,02%	99,05%	98,65%
BANESTES DIVIDENDOS FIC...	R\$ 1.946.150,51	IDIV	-0,32%	-2,32%	12,70%	22,13%	26,35%	60,92%	123,94%	78,37%
BB SCHRODER INVESTIMEN...	R\$ 1.202.509,69	MSCI World	4,27%	13,16%	19,92%	24,88%	143,05%	155,89%	97,39%	97,72%
GENIAL MS GLOBAL BRAND...	R\$ 1.826.069,68	MSCI World	0,54%	7,52%	12,44%	12,53%	18,06%	89,01%	60,84%	49,23%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOL...	R\$ 5.717.976,62	S&P 500	-0,60%	-2,18%	1,65%	7,70%	-19,29%	-21,42%	7,34%	25,27%
PLURAL DIVIDENDOS FIA	R\$ 4.034.595,96	IBOVESPA	0,01%	-	-	-	-2,09%	-	-	-

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\$ 167.405.917,85	32,09%	100,00%	30,00%	35,00%	60,00%	SIM
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN	R\$ 204.634.582,33	39,22%	100,00%	20,00%	35,00%	60,00%	SIM
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN	R\$ 0,00	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%	1,00%	SIM
Operações Compromissadas	R\$ 0,00	0,00%	5,00%	0,00%	0,00%	1,00%	SIM
FI Renda Fixa	R\$ 40.327.455,77	7,73%	75,00%	0,00%	6,00%	60,00%	SIM
FI de Índices Renda Fixa	R\$ 0,00	0,00%	75,00%	0,00%	0,00%	1,00%	SIM
Ativos Bancários	R\$ 0,00	0,00%	20,00%	0,00%	2,00%	20,00%	SIM
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior	R\$ 0,00	0,00%	15,00%	0,00%	0,00%	1,00%	SIM
FI Renda Fixa "Crédito Privado"	R\$ 0,00	0,00%	15,00%	0,00%	2,00%	5,00%	SIM
FI Debêntures	R\$ 0,00	0,00%	15,00%	0,00%	0,00%	1,00%	SIM
Renda Variável							
FI Ações	R\$ 51.470.552,11	9,87%	45,00%	0,00%	10,00%	30,00%	SIM
FI de Índices Ações	R\$ 0,00	0,00%	45,00%	0,00%	0,00%	1,00%	SIM
Exterior							
FI Renda Fixa - Dívida Externa	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	10,00%	SIM
FI Investimento no Exterior	R\$ 12.110.756,25	2,32%	10,00%	0,00%	2,00%	10,00%	SIM
FI Ações – BDR Nível I	R\$ 19.559.661,78	3,75%	10,00%	0,00%	3,00%	10,00%	SIM
Estruturados							
FI Multimercado - aberto	R\$ 24.194.683,90	4,64%	15,00%	0,00%	4,00%	10,00%	SIM
FI em Participações	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	10,00%	SIM
FI "Ações - Mercado de Acesso"	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	1,00%	SIM
Fundos Imobiliários							
FI Imobiliário	R\$ 2.006.000,00	0,38%	15,00%	0,00%	1,00%	5,00%	SIM
Emprést. Consignado							
Empréstimos Consignados	R\$ 0,00	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	1,00%	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.