



Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2020





Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
Total para cálculo dos limites da Resolução			0,00				



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	0,00	0,00%	40,00%	75,00%	100,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	40,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	0,00
Total Renda Fixa	100,00%	0,00	0,00%	40,00%	90,00%	570,00%	

 RENDA FIXA 0,00

Documento Assinado Digitalmente por: MAYARA SILVA DE ARAUJO
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: a1cc1091-b22e-472f-b270-93a0c7a31490



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	0,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	0,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	0,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	0,00
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	0,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	0,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	0,00
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	120,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	0,00
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	0,00
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	0,00
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	

Documento Assinado Digitalmente por: MAYARA SILVA DE ARAUJO
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: a1cc1091-b22e-472f-b270-93a0c7a31490



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Dezembro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
--------	-------	---------------	----------------

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 - 2020		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 ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	
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	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	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	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Documento Assinado Digitalmente por: MAYCAR ESTEVÃO DE ARAÚJO
 Acesse em: https://www.tcece.org.br/dep/validador/validador.asp



Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2020)

Documento Assinado Digitalmente por: MAYARA SILVA DE ARAUJO
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: a1cc1091-b22e-472f-b270-93a0c7a31490



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2020)



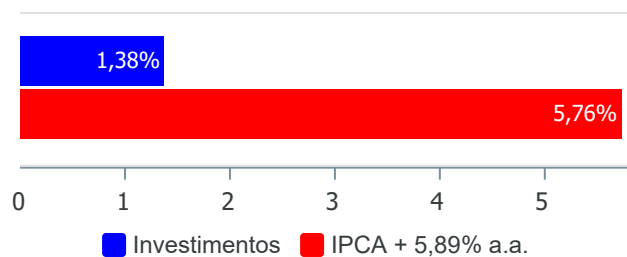
Documento Assinado Digitalmente por: MAYARA SILVA DE ARAUJO
Acesse em: <https://etc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: a1cc1091-b22e-472f-b270-93a0c7a31490



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V
Janeiro	762.086,54	382.418,69	322.490,14	826.947,33	4.932,24	4.932,24	0,60%	0,60%	0,71%	0,71%	84,28%	0,00%
Fevereiro	826.947,33	109.782,56	344.143,68	596.362,49	3.776,28	8.708,52	0,46%	1,06%	0,66%	1,38%	76,92%	1,00%
Março	596.362,49	369.670,15	417.510,87	543.473,49	-5.048,28	3.660,24	-0,85%	0,20%	0,57%	1,96%	10,42%	5,00%
Abril	543.473,49	481.681,47	657.047,35	375.384,74	7.277,13	10.937,37	0,71%	0,92%	0,14%	2,10%	43,52%	0,00%
Mai	375.384,74	58.182,62	262.193,16	172.517,75	1.143,55	12.080,92	0,30%	1,22%	0,07%	2,18%	56,13%	0,00%
Junho	172.517,75	510.649,27	420.343,11	263.380,63	556,72	12.637,64	0,08%	1,31%	0,74%	2,93%	44,49%	0,00%
Julho	263.380,63	123.419,92	338.307,77	48.697,22	204,44	12.842,08	0,05%	1,36%	0,89%	3,85%	35,34%	0,00%
Agosto	48.697,22	478.602,75	518.029,88	9.324,01	53,92	12.896,00	0,01%	1,37%	0,72%	4,59%	29,81%	0,00%
Setembro	9.324,01	286.751,58	296.095,91	0,00	20,32	12.916,32	0,01%	1,38%	1,12%	5,76%	23,87%	0,00%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por: MAYARA SILVA DE ARAUJO
Acesse em: <https://gco.ce.gov.br/gov.br/gov/validacao>
Código do documento: a1cc1091-b22e-472f-b270-93a0c7a31490

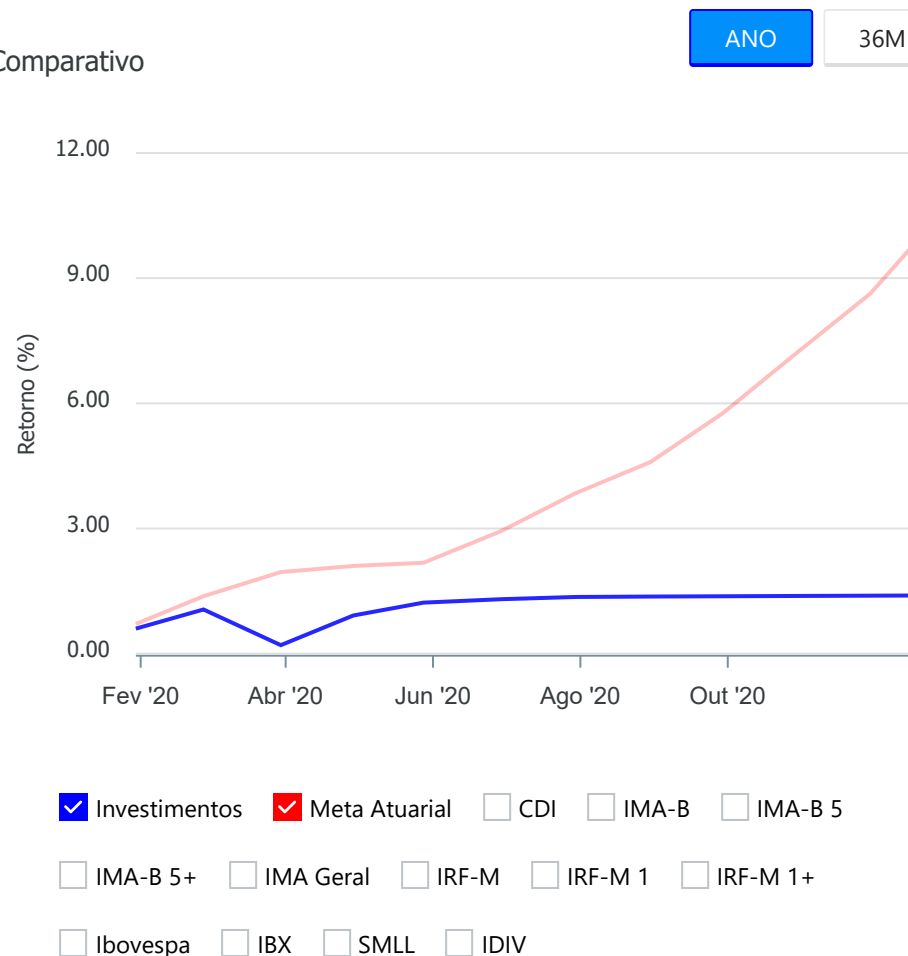


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Documento Assinado Digitalmente por: MAYARA SILVA DE ARAUJO
 Acesse em: <https://etec.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: a1cc1091-b22e-472f-b270-93a0c7a31490



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Fixa	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: MAYARA SILVA DE ARAUJO
Assinse em: https://etcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: a1cc1091-b22e-472f-b270-93a0c7a31490



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Insti
				Total Renda Fixa	0,00	0,00%	

Documento Assinado Digitalmente por: MAYARA SILVA DE ARAUJO
 Assine em: <https://etec.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: a1cc1091-b22e-472f-b270-93a0c7a31490



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	333.412,44	0,00	343.986,62	0,00	10.574,18	3,17%	6,66%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.395,77	2.390.846,63	2.411.143,98	0,00	2.901,58	0,12%	1,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	193.602,70	320.312,38	516.096,18	0,00	2.181,10	0,42%	3,47%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	217.675,63	90.000,00	304.935,09	0,00	-2.740,54	-0,89%	6,14%
Total Renda Fixa					12.916,32	0,36%	

Documento Assinado Digitalmente por: MAYARA SILVA DE ARAUJO
Assinse em: https://seccom.rsp.pe.gov.br/gpp/validaDoc.seam Código do documento: a1cc1091-b22e-472f-b270-93a0c7a31490