

# Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2020

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.fcp.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

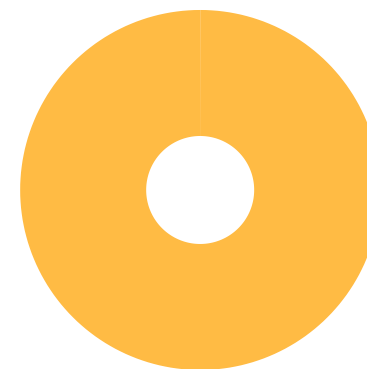
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.395.355,88	62,65%	1.213	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.493.101,46	21,28%	651	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	4.452,79	0,06%	166.177	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.122.660,04	16,00%	737	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>7.015.570,17</b>				

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epj/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 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%	7.015.570,17
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.395.355,88	62,65%	40,00%	75,00%	100,00%	2.620.214,29
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	7.015.570,17
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	350.778,51
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	4.209.342,10
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	4.209.342,10
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	2.620.214,29	37,35%	0,00%	0,12%	40,00%	186.013,78
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	2.806.228,07
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.403.114,03
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.052.335,53
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.052.335,53
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	350.778,51
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	350.778,51
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	350.778,51
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>7.015.570,17</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>80,12%</b>	<b>570,00%</b>	



RENDA FIXA 7.015.570,17



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 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%	2,00%	30,00%	2.104.671,05
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	2.104.671,05
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	1.403.114,03
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	1.403.114,03
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	701.557,02
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	350.778,51
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	350.778,51
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>8,00%</b>	<b>120,00%</b>	

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%	701.557,02
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	701.557,02
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	701.557,02
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b 7º IV a

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.015.570,17	100,00	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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



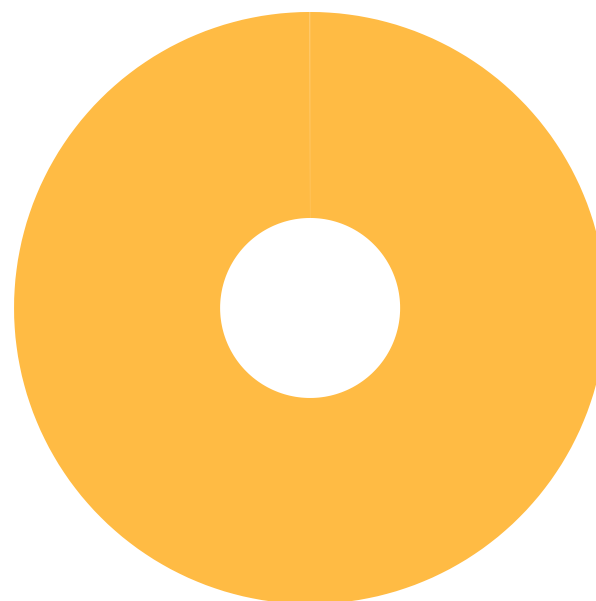
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	0,42%	1,13%	2,89%	6,33%	13,50%	0,09%	0,00%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	0,29%	0,87%	2,05%	4,65%	10,14%	0,00%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,35%	0,35%	1,05%	2,45%	5,55%	12,19%	0,01%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,11%	0,11%	0,38%	0,88%	1,97%	4,25%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etcc.cef.gov.br/epp/validaDoc.aspx> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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



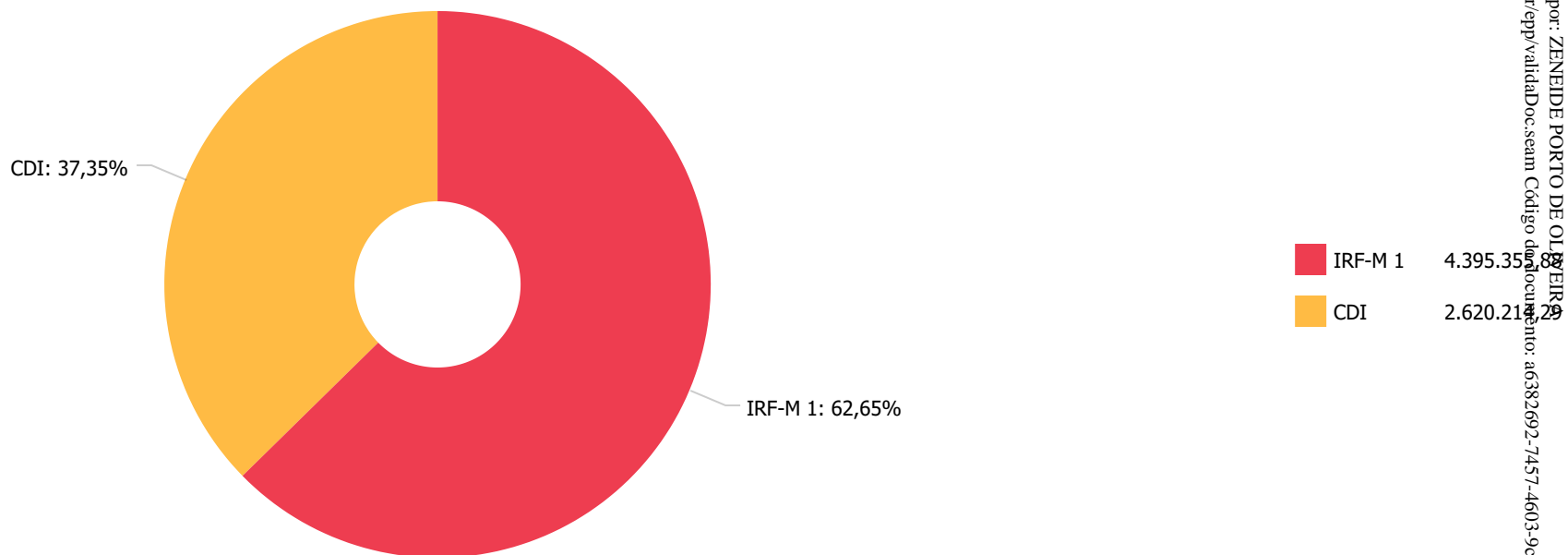
BB GESTÃO: 100,00%

BB GESTÃO 7.015.570,14

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26025

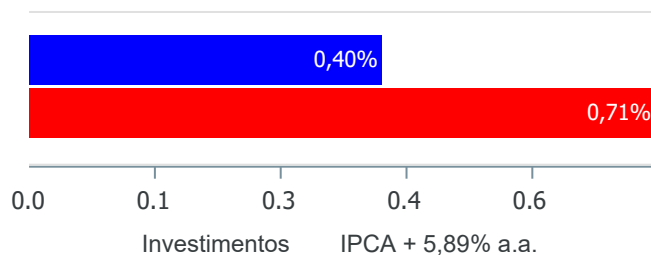




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V
Janeiro	5.933.822,27	1.740.944,09	687.122,64	7.015.570,17	27.926,45	27.926,45	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,14%	0,

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://gcof.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25

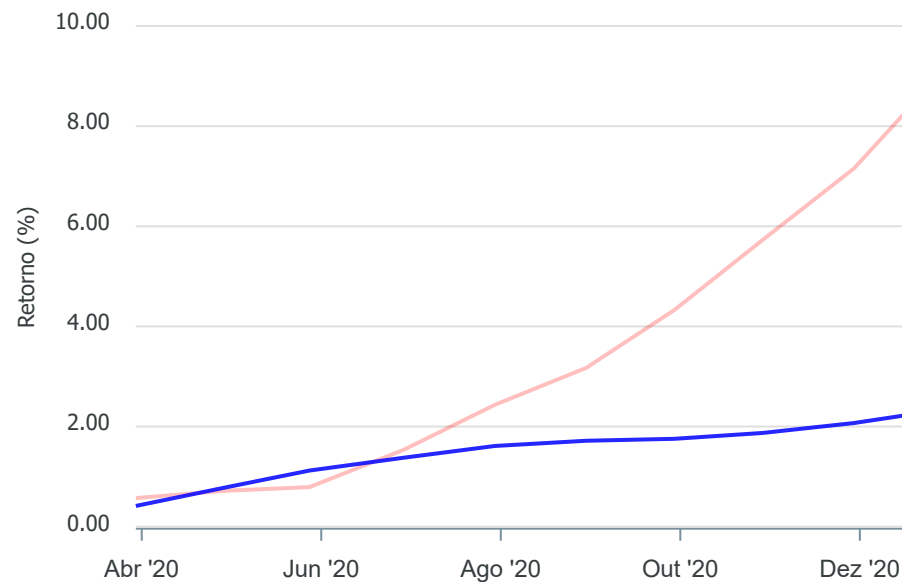


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos    Meta Atuarial     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: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - M
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.377.001,14	0,00	0,00	4.395.355,88	18.354,74	0,42%	0,42%	0,09
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.487.896,36	0,00	0,00	1.493.101,46	5.205,10	0,35%	0,35%	0,01
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	65.131,39	1.740.288,89	687.122,64	1.122.660,04	4.362,40	0,24%	0,29%	0,00
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	3.793,38	655,20	0,00	4.452,79	4,21	0,09%	0,11%	0,00
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>5.933.822,27</b>	<b>1.740.944,09</b>	<b>687.122,64</b>	<b>7.015.570,17</b>	<b>27.926,45</b>	<b>0,40%</b>		<b>0,06</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinatura em: https://sccs.tce-pe.gov.br/snp/view/validaDoc.seam Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25

# Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2020

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.cei-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2020)

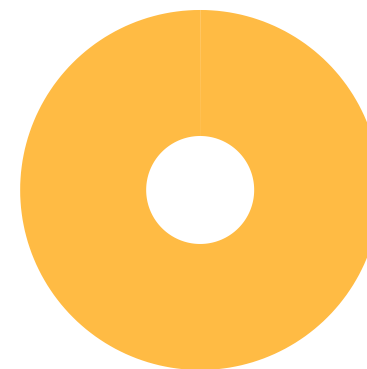
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.410.868,88	61,50%	1.214	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.258.798,66	17,55%	740	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.497.179,33	20,88%	644	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	5.080,28	0,07%	166.442	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>7.171.927,15</b>				

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: [https://etec.tce.pe.gov.br/epj/vaiadaDoc:seam/Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25](https://etec.tce.pe.gov.br/epj/vaiadaDoc:seam/Código%20do%20documento:46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25)



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Fevereiro / 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%	7.171.927,15
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.410.868,88	61,50%	40,00%	75,00%	100,00%	2.761.058,27
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	7.171.927,15
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	358.596,36
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	4.303.156,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	4.303.156,29
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	2.761.058,27	38,50%	0,00%	0,12%	40,00%	107.712,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	2.868.770,86
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.434.385,43
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.075.789,07
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.075.789,07
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	358.596,36
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	358.596,36
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	358.596,36
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>7.171.927,15</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>80,12%</b>	<b>570,00%</b>	



RENDA FIXA 7.171.927,15



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 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%	2,00%	30,00%	2.151.578,15
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	2.151.578,15
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	1.434.385,43
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	1.434.385,43
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	717.192,72
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	358.596,36
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	358.596,36
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>8,00%</b>	<b>120,00%</b>	

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%	717.192,72
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	717.192,72
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	717.192,72
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b 7º IV a

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.171.927,15	100,00	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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25





**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,38%	0,82%	1,25%	2,87%	6,52%	13,85%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	0,77%	1,17%	2,73%	6,24%	13,31%	0,07%	0,00%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,29%	0,67%	1,05%	2,39%	5,57%	12,34%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,22%	0,50%	0,79%	1,85%	4,45%	9,95%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,27%	0,62%	0,98%	2,23%	5,33%	11,98%	0,02%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,08%	0,19%	0,32%	0,81%	1,88%	4,14%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etecf.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



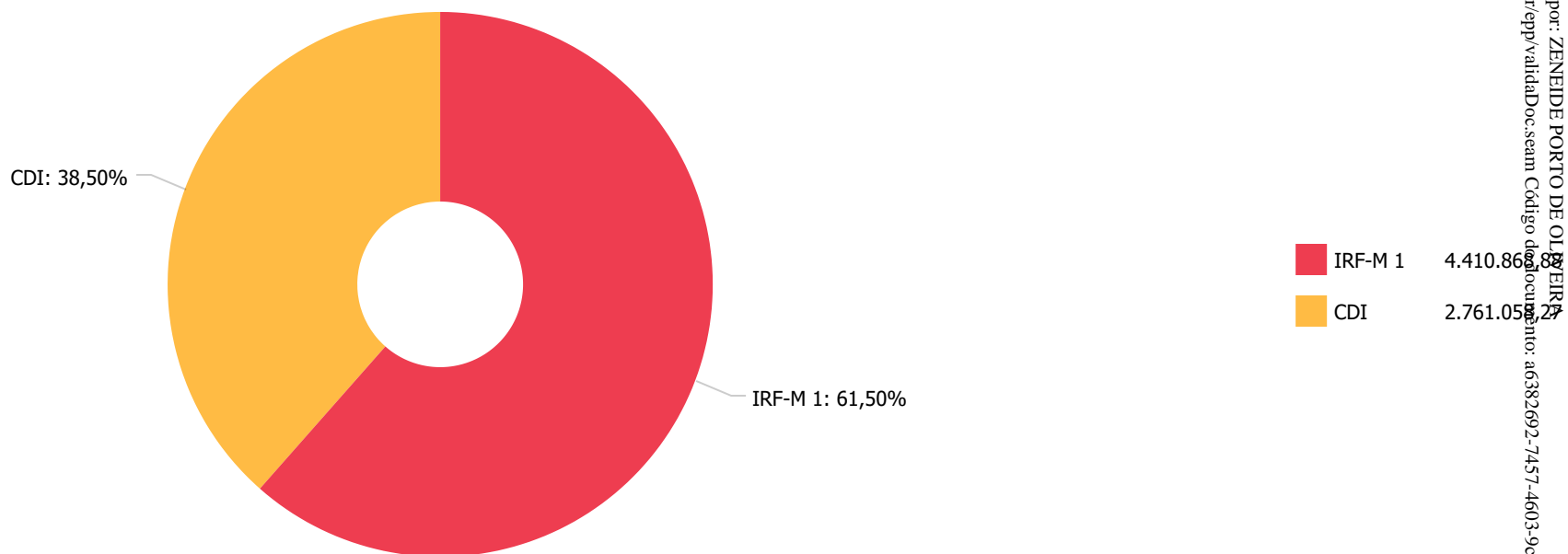
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Fevereiro / 2020)



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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



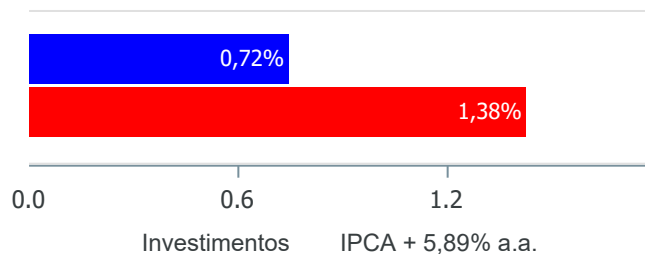
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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.R.
Janeiro	5.933.822,27	1.740.944,09	687.122,64	7.015.570,17	27.926,45	27.926,45	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,14%	0,00%
Fevereiro	7.015.570,17	806.081,33	672.774,85	7.171.927,15	23.050,50	50.976,95	0,32%	0,72%	0,66%	1,38%	52,52%	0,00%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://gicx.leg.br/pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00f818e26b25

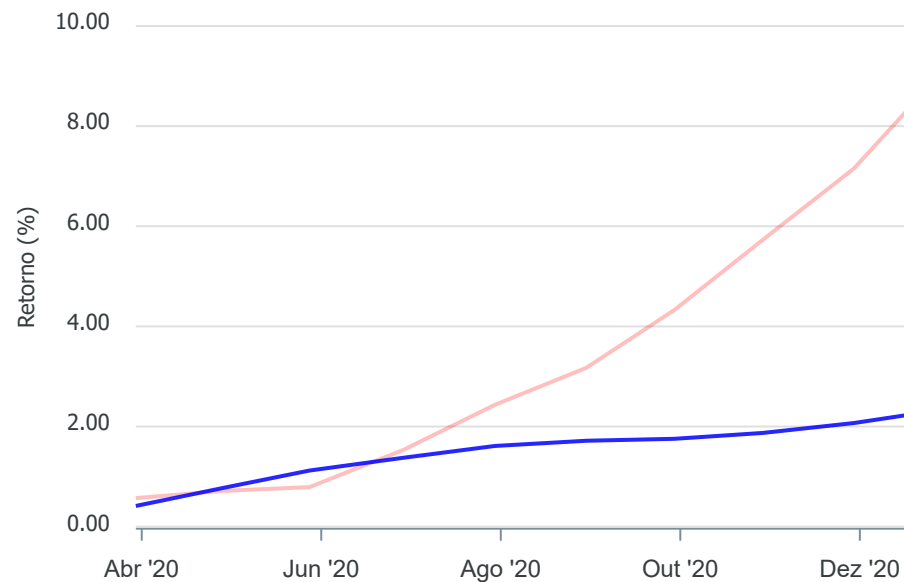


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos    Meta Atuarial     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: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etec.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00f818e26b25



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.395.355,88	0,00	0,00	4.410.868,88	15.513,00	0,35%	0,35%	0,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.493.101,46	0,00	0,00	1.497.179,33	4.077,87	0,27%	0,27%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.122.660,04	805.425,95	672.743,50	1.258.798,66	3.456,17	0,18%	0,22%	0,01%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	4.452,79	655,38	31,35	5.080,28	3,46	0,07%	0,08%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>7.015.570,17</b>	<b>806.081,33</b>	<b>672.774,85</b>	<b>7.171.927,15</b>	<b>23.050,50</b>	<b>0,32%</b>		<b>0,05%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://sccs.tcepe.gov.br/gdp/vista/validaDoc.seam Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



# Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º trimestre de 2020

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.fcp.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2020)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.437.228,61	65,65%	1.227	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	822.167,61	12,16%	744	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.496.684,30	22,14%	637	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	2.915,22	0,04%	166.888	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>6.758.995,74</b>				

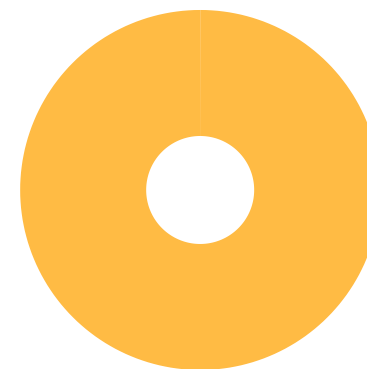
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: [https://etec.tce.pe.gov.br/epj/vaiadaDoc:seam/Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25](https://etec.tce.pe.gov.br/epj/vaiadaDoc:seam/Código%20do%20documento%3A46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25)





**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Março / 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%	6.758.995,74
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.437.228,61	65,65%	40,00%	75,00%	100,00%	2.321.767,13
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	6.758.995,74
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	337.949,79
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	4.055.397,44
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	4.055.397,44
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	2.321.767,13	34,35%	0,00%	0,12%	40,00%	381.831,17
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	2.703.598,30
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.351.799,15
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.013.849,36
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.013.849,36
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	337.949,79
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	337.949,79
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	337.949,79
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>6.758.995,74</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>80,12%</b>	<b>570,00%</b>	



RENDA FIXA 6.758.995,74



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Março / 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%	2,00%	30,00%	2.027.698,72
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	2.027.698,72
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	1.351.799,15
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	1.351.799,15
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	675.899,57
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	337.949,79
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	337.949,79
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>8,00%</b>	<b>120,00%</b>	

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%	675.899,57
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	675.899,57
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	675.899,57
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b 7º IV a

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.758.995,74	100,00	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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://atce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



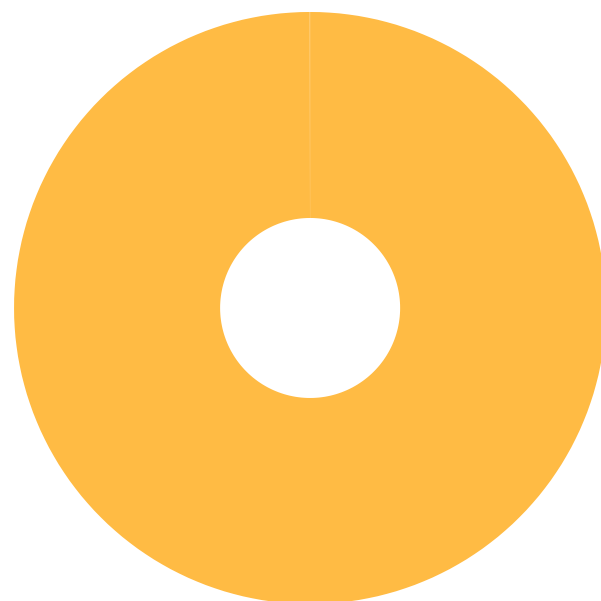
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,60%	1,43%	1,43%	2,83%	6,66%	13,79%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	1,38%	1,38%	2,70%	6,41%	13,27%	0,62%	0,00%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,34%	1,01%	1,01%	2,26%	5,44%	12,12%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,25%	0,75%	0,75%	1,73%	4,31%	9,74%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	-0,03%	0,59%	0,59%	1,74%	4,81%	11,34%	0,18%	0,01%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,08%	0,27%	0,27%	0,74%	1,79%	4,02%	0,01%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etecf.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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



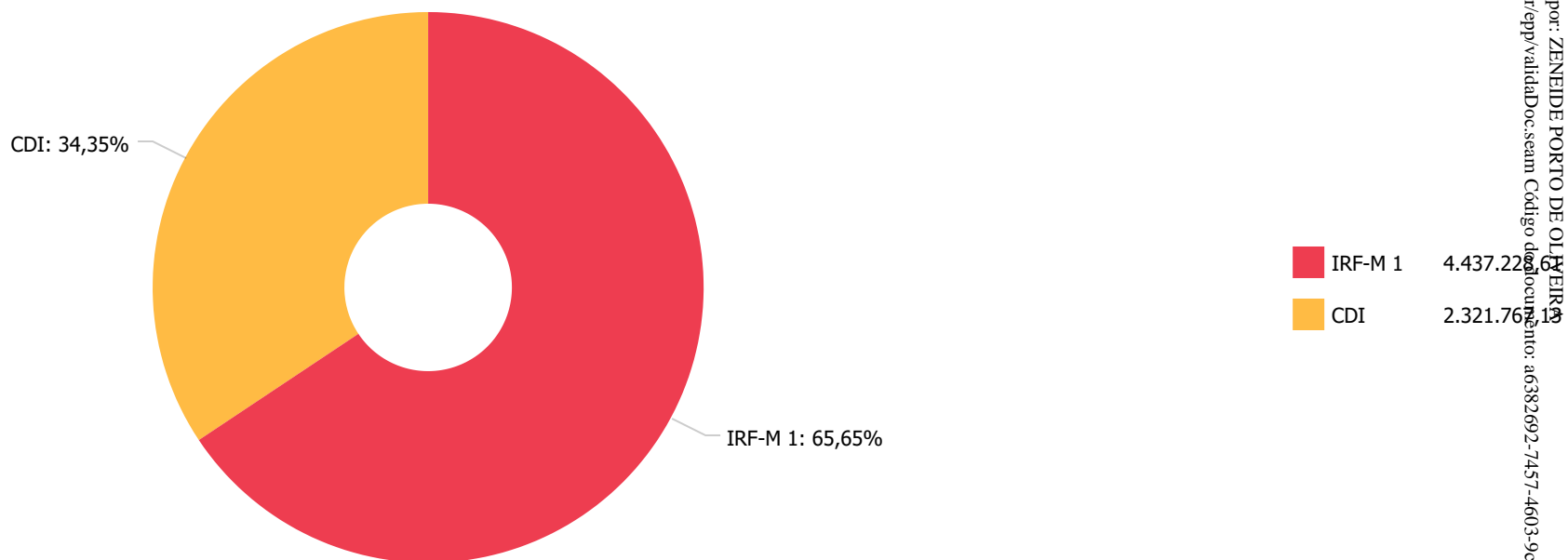
BB GESTÃO: 100,00%

BB GESTÃO 6.758.990,74

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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



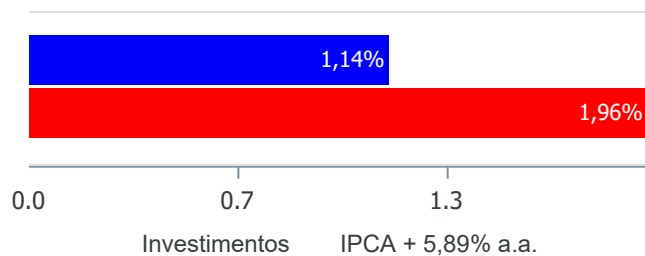
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**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.R.
Janeiro	5.933.822,27	1.740.944,09	687.122,64	7.015.570,17	27.926,45	27.926,45	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,14%	0,00%
Fevereiro	7.015.570,17	806.081,33	672.774,85	7.171.927,15	23.050,50	50.976,95	0,32%	0,72%	0,66%	1,38%	52,52%	0,00%
Março	7.171.927,15	409.559,61	852.145,22	6.758.995,74	29.654,20	80.631,15	0,41%	1,14%	0,57%	1,96%	58,26%	0,00%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://gcof.sp.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25

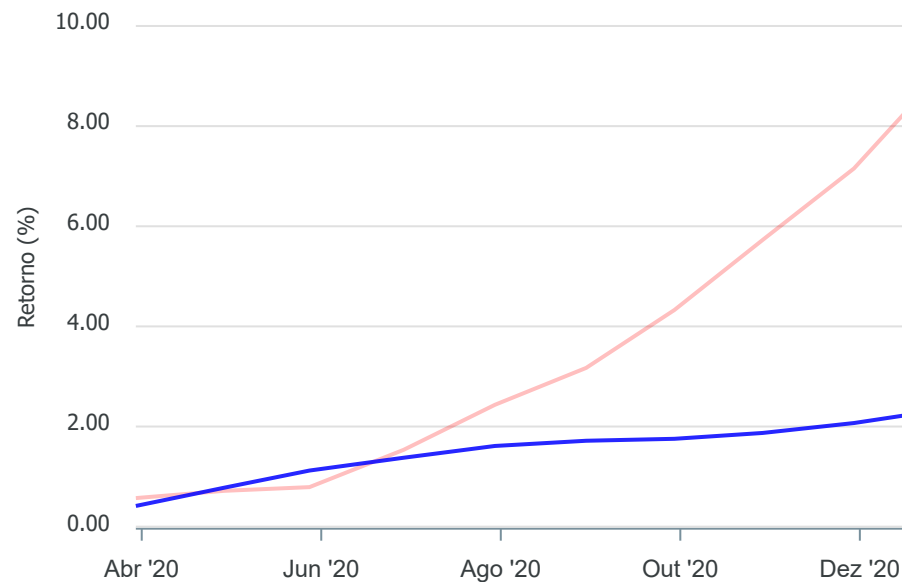


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos    Meta Atuarial     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: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00f818e26b25





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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.410.868,88	0,00	0,00	4.437.228,61	26.359,73	0,60%	0,60%	0,62%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.258.798,66	405.678,81	846.093,98	822.167,61	3.784,12	0,23%	0,25%	0,01%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	5.080,28	3.880,80	6.051,24	2.915,22	5,38	0,06%	0,08%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.497.179,33	0,00	0,00	1.496.684,30	-495,03	-0,03%	-0,03%	0,18%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>7.171.927,15</b>	<b>409.559,61</b>	<b>852.145,22</b>	<b>6.758.995,74</b>	<b>29.654,20</b>	<b>0,39%</b>		<b>0,45%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinatura em: https://sccs.tcepe.gov.br/gpd/vizualizarDoc:seam Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Int...
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.377.001,14	0,00	0,00	4.437.228,61	60.227,47	1,38%	1,38%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	65.131,39	2.951.393,65	2.205.960,12	822.167,61	11.602,69	0,38%	0,75%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.487.896,36	0,00	0,00	1.496.684,30	8.787,94	0,59%	0,59%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	3.793,38	5.191,38	6.082,59	2.915,22	13,05	0,15%	0,27%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>80.631,15</b>	<b>1,21%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://sistemas.seg.br/gpp/validaDoc.seam Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25

# Relatório Analítico dos Investimentos

## em abril de 2020

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.fcp.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2020)

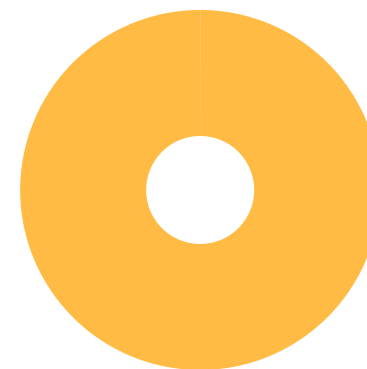
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.455.523,71	68,61%	1.251	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	535.367,43	8,24%	746	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.500.548,85	23,11%	631	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	2.549,13	0,04%	167.717	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>6.493.989,12</b>				

Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epj/vaiadaDoc:seamCodigo.do.documento:46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25>



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Abril / 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%	6.493.989,12
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.455.523,71	68,61%	40,00%	75,00%	100,00%	2.038.465,41
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	6.493.989,12
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	324.699,46
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	3.896.393,47
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	3.896.393,47
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	2.038.465,41	31,39%	0,00%	0,12%	40,00%	559.130,24
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	2.597.595,65
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.298.797,82
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	974.098,37
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	974.098,37
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	324.699,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	324.699,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	324.699,46
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>6.493.989,12</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>80,12%</b>	<b>570,00%</b>	



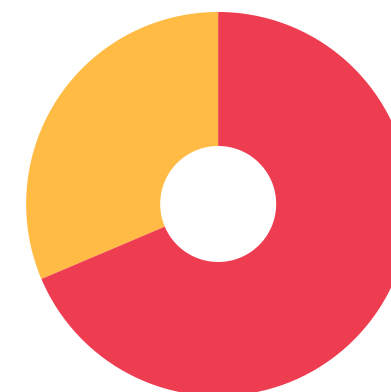
RENDA FIXA 6.493.989,12



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Abril / 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%	2,00%	30,00%	1.948.196,74
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	1.948.196,74
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	1.298.797,82
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	1.298.797,82
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	649.398,91
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	324.699,46
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	324.699,46
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>8,00%</b>	<b>120,00%</b>	

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%	649.398,91
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	649.398,91
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	649.398,91
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b      7º IV a

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.493.989,12	100,00	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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,45%	1,88%	1,44%	2,65%	6,60%	13,72%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	1,79%	1,37%	2,51%	6,31%	13,19%	0,49%	0,00%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,28%	1,30%	0,92%	2,07%	5,19%	11,87%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	0,95%	0,67%	1,54%	4,07%	9,49%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,26%	0,85%	0,50%	1,55%	4,55%	11,05%	0,12%	0,01%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,05%	0,31%	0,20%	0,58%	1,65%	3,88%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etecf.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25





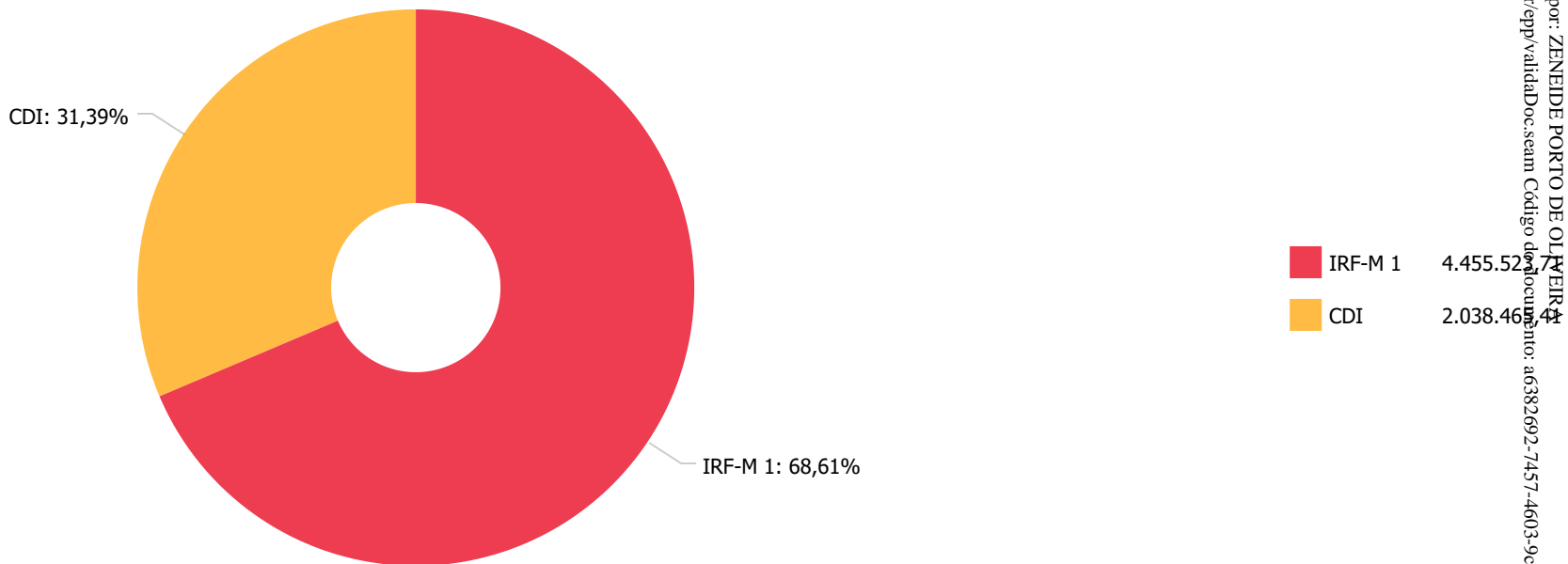
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Abril / 2020)



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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



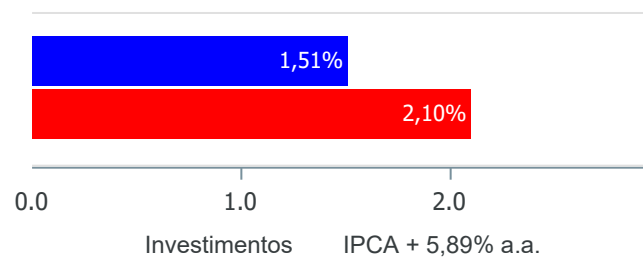
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**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	Variac
Janeiro	5.933.822,27	1.740.944,09	687.122,64	7.015.570,17	27.926,45	27.926,45	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,14%	0,00%
Fevereiro	7.015.570,17	806.081,33	672.774,85	7.171.927,15	23.050,50	50.976,95	0,32%	0,72%	0,66%	1,38%	52,52%	0,00%
Março	7.171.927,15	409.559,61	852.145,22	6.758.995,74	29.654,20	80.631,15	0,41%	1,14%	0,57%	1,96%	58,26%	0,00%
Abril	6.758.995,74	490.255,26	779.782,09	6.493.989,12	24.520,21	105.151,36	0,36%	1,51%	0,14%	2,10%	71,65%	0,00%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://gco.leg.br/pe/pe-95/bpp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25

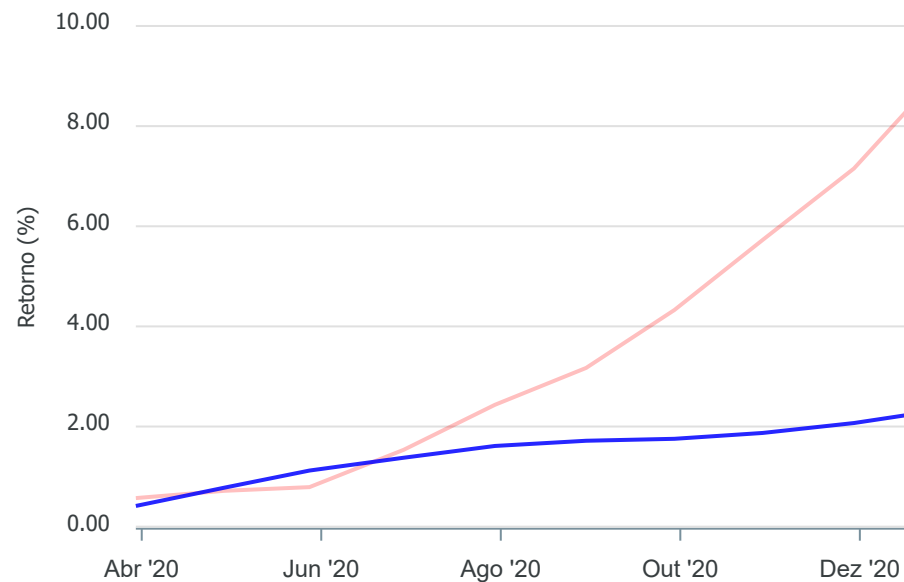


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos    Meta Atuarial     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: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00f818e26b25



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.437.228,61	0,00	0,00	4.455.523,71	18.295,10	0,41%	0,41%	0,49%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.496.684,30	0,00	0,00	1.500.548,85	3.864,55	0,26%	0,26%	0,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	822.167,61	474.914,86	764.073,80	535.367,43	2.358,76	0,18%	0,20%	0,01%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	2.915,22	15.340,40	15.708,29	2.549,13	1,80	0,01%	0,04%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>6.758.995,74</b>	<b>490.255,26</b>	<b>779.782,09</b>	<b>6.493.989,12</b>	<b>24.520,21</b>	<b>0,34%</b>		<b>0,36%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinatura em: https://sccs.tcepe.gov.br/gpd/vtda/Doc:seam Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25

# Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2020

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.fcp.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2020)

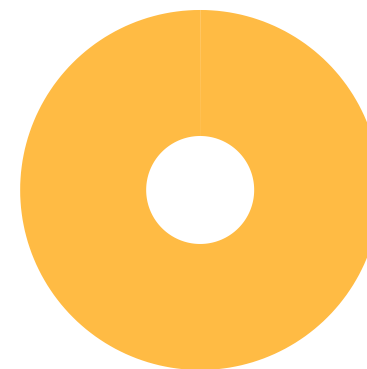
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.472.843,25	71,32%	1.269	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	292.653,49	4,67%	744	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.504.386,71	23,99%	626	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	1.801,01	0,03%	167.918	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>6.271.684,46</b>				

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: [https://etec.tce.pe.gov.br/epj/vaiadaDoc:seam/Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25](https://etec.tce.pe.gov.br/epj/vaiadaDoc:seam/Código%20do%20documento:46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25)



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Maio / 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%	6.271.684,46
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.472.843,25	71,32%	40,00%	75,00%	100,00%	1.798.841,21
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	6.271.684,46
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	313.584,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	3.763.010,68
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	3.763.010,68
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.798.841,21	28,68%	0,00%	0,12%	40,00%	709.832,57
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	2.508.673,78
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.254.336,89
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	940.752,67
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	940.752,67
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	313.584,22
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	313.584,22
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	313.584,22
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>6.271.684,46</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>80,12%</b>	<b>570,00%</b>	



RENDA FIXA 6.271.684,46





**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Maio / 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%	2,00%	30,00%	1.881.505,34
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	1.881.505,34
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	1.254.336,89
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	1.254.336,89
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	627.168,45
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	313.584,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	313.584,22
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>8,00%</b>	<b>120,00%</b>	

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%	627.168,45
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	627.168,45
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	627.168,45
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b 7º IV a

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.271.684,46	100,00	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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://atce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



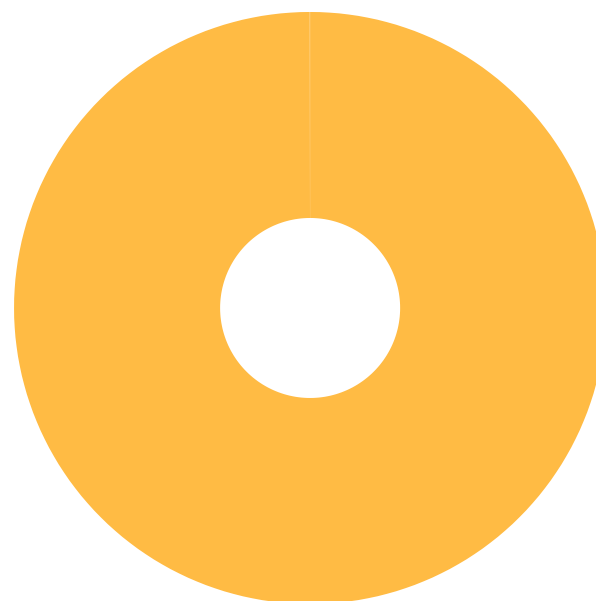
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,42%	2,31%	1,47%	2,74%	6,33%	13,97%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	2,19%	1,41%	2,60%	6,04%	13,42%	0,20%	0,00%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,24%	1,54%	0,86%	1,92%	4,87%	11,55%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,16%	1,11%	0,61%	1,40%	3,77%	9,20%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,26%	1,11%	0,48%	1,47%	4,27%	10,77%	0,05%	0,01%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,05%	0,36%	0,17%	0,49%	1,51%	3,74%	0,01%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etec.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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



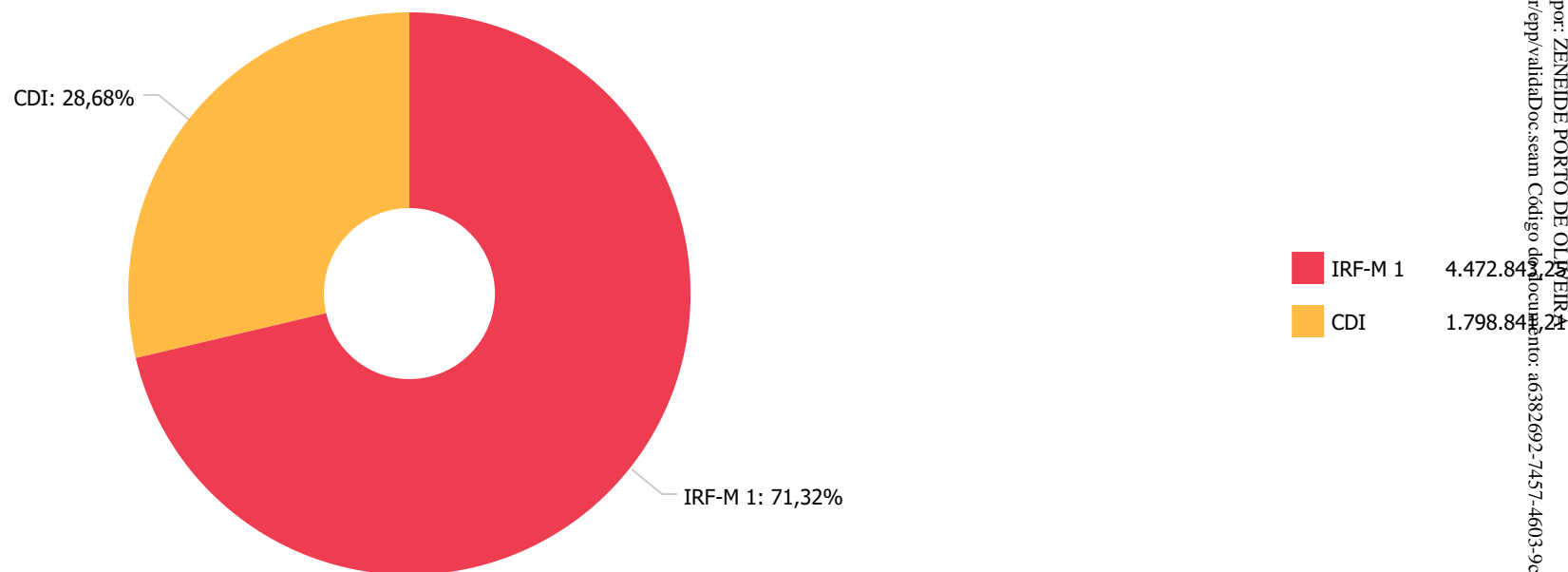
BB GESTÃO: 100,00%

BB GESTÃO 6.271.683,48

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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



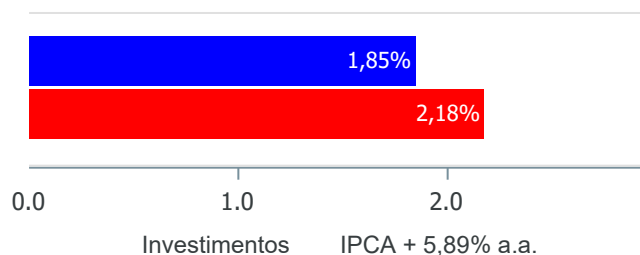
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**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	Variância
Janeiro	5.933.822,27	1.740.944,09	687.122,64	7.015.570,17	27.926,45	27.926,45	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,14%	0,00%
Fevereiro	7.015.570,17	806.081,33	672.774,85	7.171.927,15	23.050,50	50.976,95	0,32%	0,72%	0,66%	1,38%	52,52%	0,00%
Março	7.171.927,15	409.559,61	852.145,22	6.758.995,74	29.654,20	80.631,15	0,41%	1,14%	0,57%	1,96%	58,26%	0,00%
Abril	6.758.995,74	490.255,26	779.782,09	6.493.989,12	24.520,21	105.151,36	0,36%	1,51%	0,14%	2,10%	71,65%	0,00%
Maio	6.493.989,12	312.300,43	556.689,47	6.271.684,46	22.084,38	127.235,74	0,34%	1,85%	0,07%	2,18%	85,03%	0,00%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://gco.leg.br/pe/pe-sv/bpp/vtdoc:seam/Codigo-do-documento:46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25>

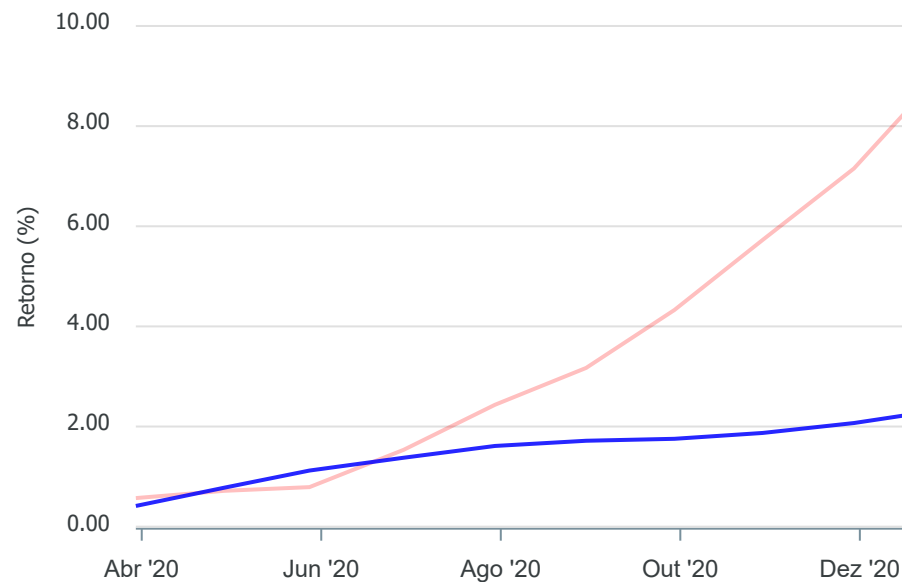


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos    Meta Atuarial     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: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00f818e26b25



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.455.523,71	0,00	0,00	4.472.843,25	17.319,54	0,39%	0,39%	0,20%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.500.548,85	0,00	0,00	1.504.386,71	3.837,86	0,26%	0,26%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	535.367,43	306.159,52	549.799,61	292.653,49	926,15	0,11%	0,16%	0,01%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	2.549,13	6.140,91	6.889,86	1.801,01	0,83	0,01%	0,05%	0,01%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>6.493.989,12</b>	<b>312.300,43</b>	<b>556.689,47</b>	<b>6.271.684,46</b>	<b>22.084,38</b>	<b>0,32%</b>		<b>0,16%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Assinse em: https://sccs.tcepe.gov.br/gdp/vizualizarDoc.aspx?Codigo\_documento:46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



# Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2020

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.fcp.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

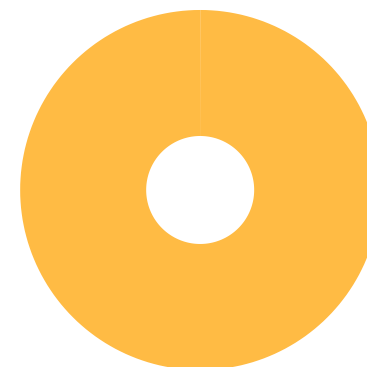
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.484.325,38	73,93%	1.262	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.508.298,50	24,87%	608	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	1.771,97	0,03%	168.015	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	71.420,65	1,18%	742	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>6.065.816,50</b>				

Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epj/validaDoc.seam> Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Junho / 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%	6.065.816,50
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.484.325,38	73,93%	40,00%	75,00%	100,00%	1.581.491,12
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	6.065.816,50
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	303.290,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	3.639.489,90
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	3.639.489,90
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.581.491,12	26,07%	0,00%	0,12%	40,00%	844.835,48
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	2.426.326,60
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.213.163,30
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	909.872,48
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	909.872,48
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	303.290,83
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	303.290,83
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	303.290,83
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>6.065.816,50</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>80,12%</b>	<b>570,00%</b>	



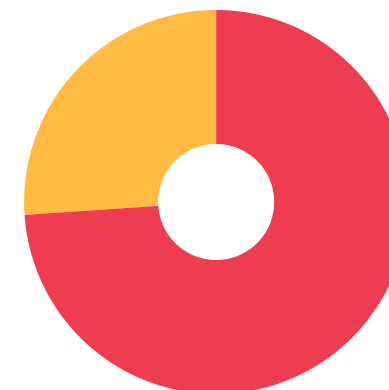
RENDA FIXA 6.065.816,50



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 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%	2,00%	30,00%	1.819.744,95
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	1.819.744,95
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	1.213.163,30
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	1.213.163,30
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	606.581,65
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	303.290,83
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	303.290,83
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>8,00%</b>	<b>120,00%</b>	

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%	606.581,65
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	606.581,65
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	606.581,65
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b 7º IV a

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.065.816,50	100,00	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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://atce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



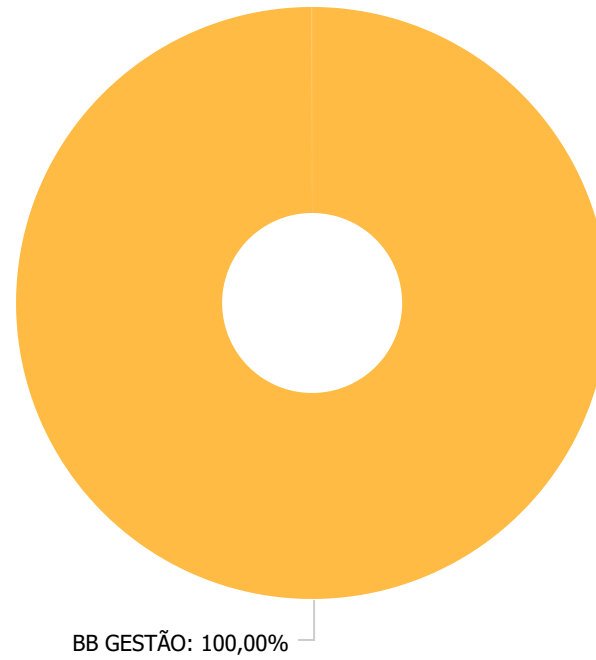
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,28%	2,60%	1,15%	2,60%	5,98%	13,67%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	2,45%	1,06%	2,45%	5,71%	13,15%	0,05%	0,00%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,13%	1,24%	0,49%	1,24%	3,50%	8,88%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,26%	1,37%	0,78%	1,37%	4,06%	10,51%	0,03%	0,01%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,04%	0,41%	0,14%	0,41%	1,38%	3,60%	0,01%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etec.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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

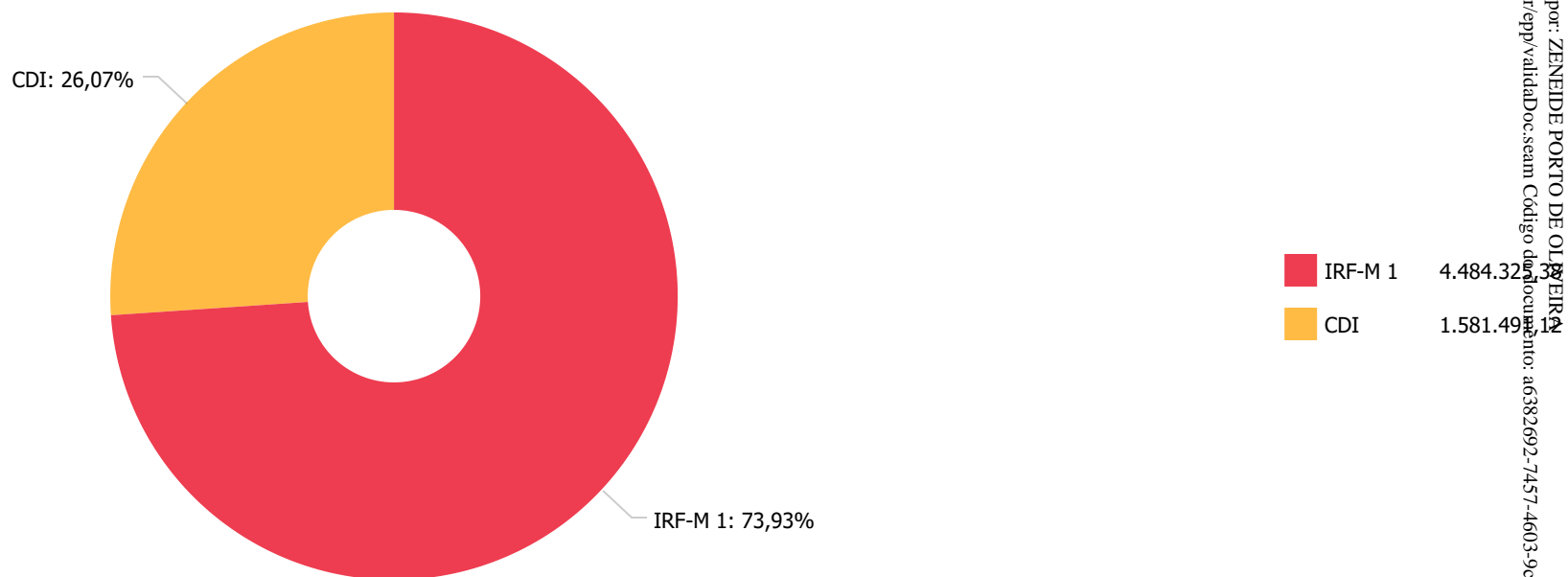


BB GESTÃO 6.065.810,00

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25

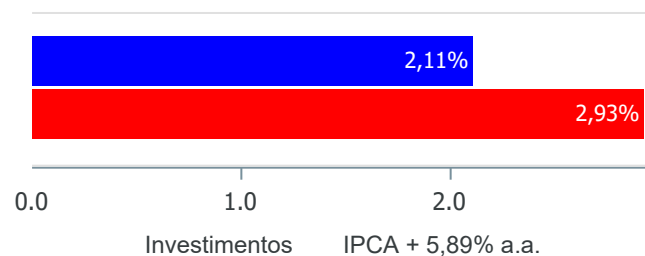




**Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	Variância
Janeiro	5.933.822,27	1.740.944,09	687.122,64	7.015.570,17	27.926,45	27.926,45	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,14%	0,00%
Fevereiro	7.015.570,17	806.081,33	672.774,85	7.171.927,15	23.050,50	50.976,95	0,32%	0,72%	0,66%	1,38%	52,52%	0,00%
Março	7.171.927,15	409.559,61	852.145,22	6.758.995,74	29.654,20	80.631,15	0,41%	1,14%	0,57%	1,96%	58,26%	0,00%
Abril	6.758.995,74	490.255,26	779.782,09	6.493.989,12	24.520,21	105.151,36	0,36%	1,51%	0,14%	2,10%	71,65%	0,00%
Mai	6.493.989,12	312.300,43	556.689,47	6.271.684,46	22.084,38	127.235,74	0,34%	1,85%	0,07%	2,18%	85,03%	0,00%
Junho	6.271.684,46	625.962,20	847.735,91	6.065.816,50	15.905,75	143.141,49	0,25%	2,11%	0,74%	2,93%	71,94%	0,00%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por ZENIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://gco.leg.br/pe/pe-tyb/pe/vpp/vpp-vidal-9c-scam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25

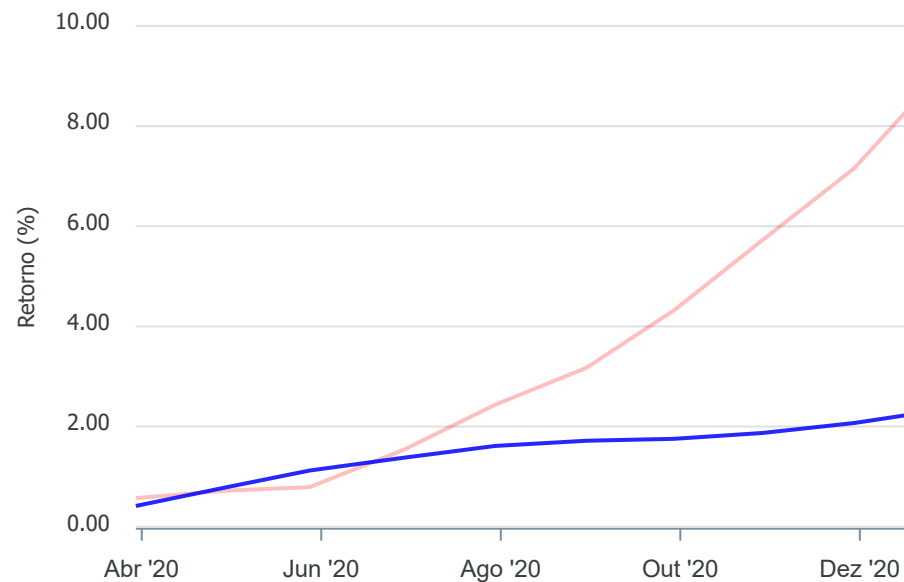


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos    Meta Atuarial     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: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etec.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.504.386,71	0,00	0,00	1.508.298,50	3.911,79	0,26%	0,26%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.472.843,25	0,00	0,00	4.484.325,38	11.482,13	0,26%	0,26%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	292.653,49	623.681,60	845.425,91	71.420,65	511,47	0,06%	0,13%	0,01%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	1.801,01	2.280,60	2.310,00	1.771,97	0,36	0,01%	0,04%	0,01%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>6.271.684,46</b>	<b>625.962,20</b>	<b>847.735,91</b>	<b>6.065.816,50</b>	<b>15.905,75</b>	<b>0,23%</b>		<b>0,05%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinatura em: https://sccs.tcepe.gov.br/snp/vtda/Doc:seam/Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Int...
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.437.228,61	0,00	0,00	4.484.325,38	47.096,77	1,06%	1,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.496.684,30	0,00	0,00	1.508.298,50	11.614,20	0,78%	0,78%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	822.167,61	1.404.755,98	2.159.299,32	71.420,65	3.796,38	0,17%	0,49%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	2.915,22	23.761,91	24.908,15	1.771,97	2,99	0,01%	0,14%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>62.510,34</b>	<b>0,76%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://sistemas.ssp.gov.br/spp/validador/validadorDoc.seam Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Int...
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.377.001,14	0,00	0,00	4.484.325,38	107.324,24	2,45%	2,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.487.896,36	0,00	0,00	1.508.298,50	20.402,14	1,37%	1,37%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	65.131,39	4.356.149,63	4.365.259,44	71.420,65	15.399,07	0,35%	1,24%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	3.793,38	28.953,29	30.990,74	1.771,97	16,04	0,05%	0,41%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>143.141,49</b>	<b>1,39%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://sccs.tcepe.gov.br/gpp/validaDoc.seam Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25

# Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2020

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.fcp.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2020)

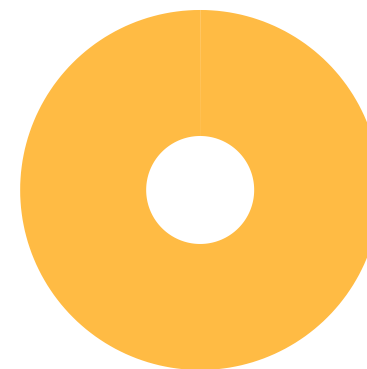
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.494.770,31	81,27%	1.251	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	119.144,12	2,15%	751	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	911.742,87	16,48%	600	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	5.108,72	0,09%	168.195	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>5.530.766,02</b>				

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epj/vai/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Julho / 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%	5.530.766,02
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.494.770,31	81,27%	40,00%	75,00%	100,00%	1.035.995,71
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	5.530.766,02
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	276.538,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	3.318.459,61
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	3.318.459,61
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.035.995,71	18,73%	0,00%	0,12%	40,00%	1.176.310,70
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	2.212.306,41
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	1.106.153,20
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	829.614,90
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	829.614,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	276.538,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	276.538,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	276.538,30
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>5.530.766,02</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>80,12%</b>	<b>570,00%</b>	



RENDA FIXA 5.530.766,02

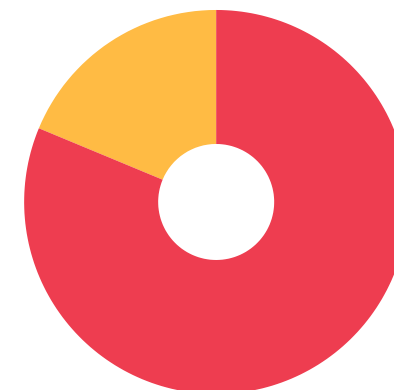




**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2020)**

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%	2,00%	30,00%	1.659.229,81
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	1.659.229,81
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	1.106.153,20
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	1.106.153,20
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	553.076,60
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	276.538,30
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	276.538,30
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>8,00%</b>	<b>120,00%</b>	

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%	553.076,60
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	553.076,60
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	553.076,60
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b 7º IV a

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.530.766,02	100,00	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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://atce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,24%	2,84%	0,94%	2,39%	5,51%	13,20%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,23%	2,69%	0,88%	2,26%	5,22%	12,65%	0,15%	0,00%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,19%	1,95%	0,64%	1,57%	4,21%	10,83%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,10%	1,35%	0,39%	1,06%	3,13%	8,50%	0,00%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,24%	1,61%	0,75%	1,26%	3,74%	10,19%	0,03%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,03%	0,44%	0,13%	0,33%	1,21%	3,43%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etec.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



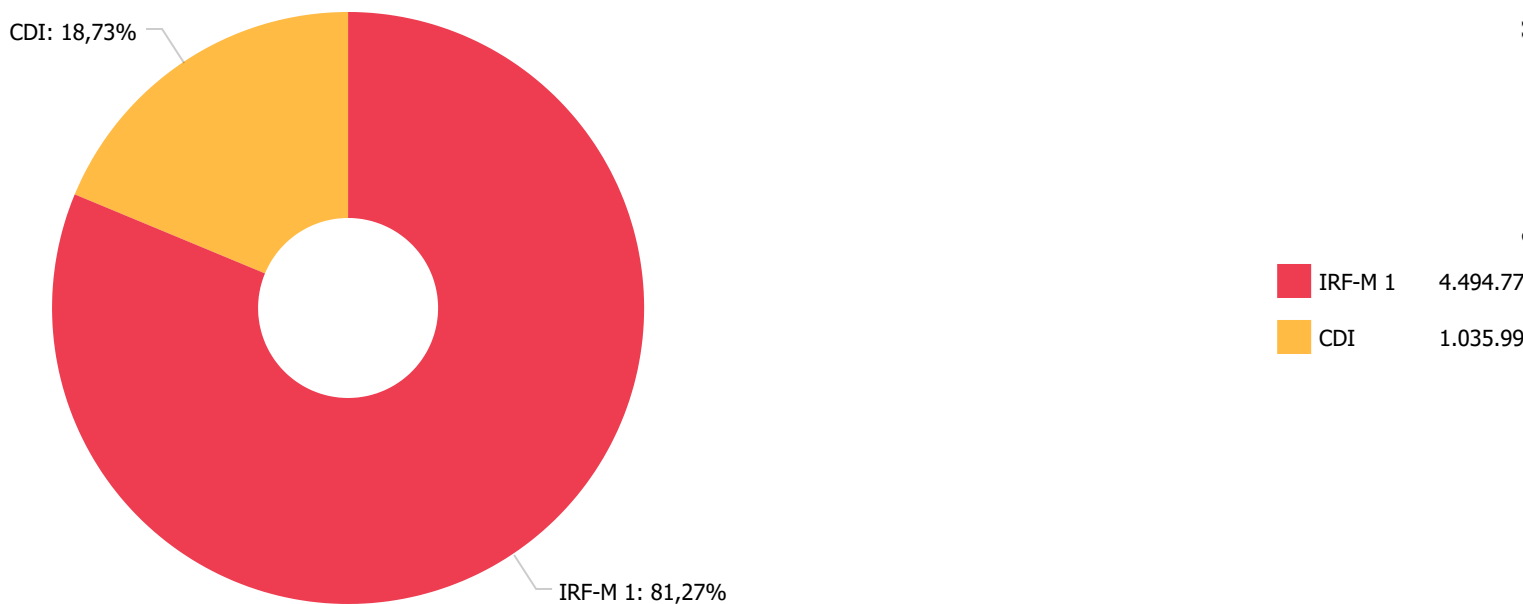
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Julho / 2020)



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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



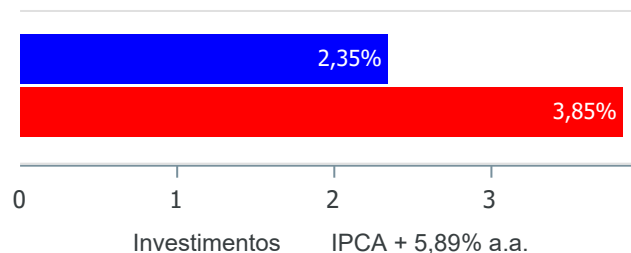
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



**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	5.933.822,27	1.740.944,09	687.122,64	7.015.570,17	27.926,45	27.926,45	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,14%	0,00%
Fevereiro	7.015.570,17	806.081,33	672.774,85	7.171.927,15	23.050,50	50.976,95	0,32%	0,72%	0,66%	1,38%	52,52%	0,00%
Março	7.171.927,15	409.559,61	852.145,22	6.758.995,74	29.654,20	80.631,15	0,41%	1,14%	0,57%	1,96%	58,26%	0,00%
Abril	6.758.995,74	490.255,26	779.782,09	6.493.989,12	24.520,21	105.151,36	0,36%	1,51%	0,14%	2,10%	71,65%	0,00%
Mai	6.493.989,12	312.300,43	556.689,47	6.271.684,46	22.084,38	127.235,74	0,34%	1,85%	0,07%	2,18%	85,03%	0,00%
Junho	6.271.684,46	625.962,20	847.735,91	6.065.816,50	15.905,75	143.141,49	0,25%	2,11%	0,74%	2,93%	71,94%	0,00%
Julho	6.065.816,50	759.305,79	1.308.429,97	5.530.766,02	14.073,70	157.215,19	0,23%	2,35%	0,89%	3,85%	61,04%	0,00%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: [https://cscs.gov.br/ppa/vigilância/validar\\_documento](https://cscs.gov.br/ppa/vigilância/validar_documento)  
Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



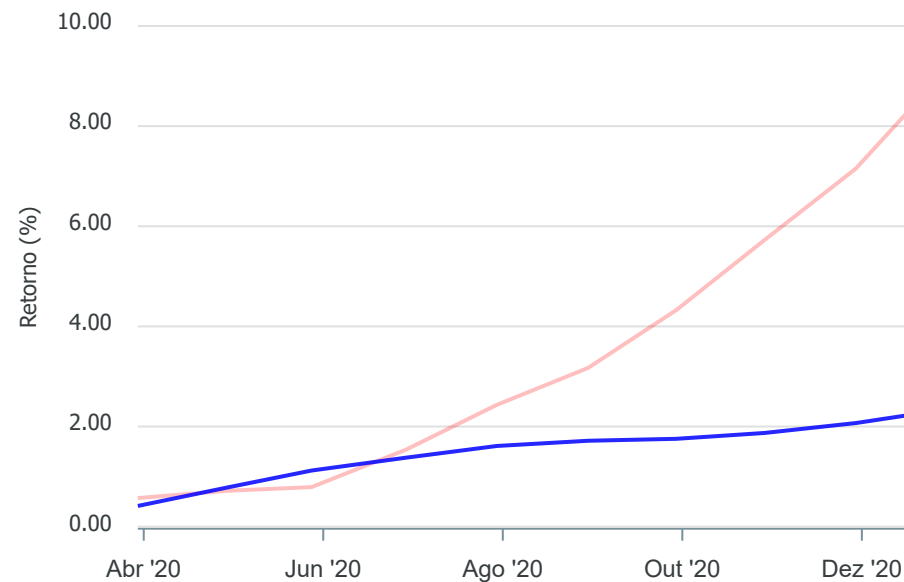
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos    Meta Atuarial     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: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.484.325,38	0,00	0,00	4.494.770,31	10.444,93	0,23%	0,23%	0,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.508.298,50	0,00	600.000,00	911.742,87	3.444,37	0,23%	0,24%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	71.420,65	753.550,59	706.010,17	119.144,12	183,05	0,02%	0,10%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	1.771,97	5.755,20	2.419,80	5.108,72	1,35	0,02%	0,03%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>6.065.816,50</b>	<b>759.305,79</b>	<b>1.308.429,97</b>	<b>5.530.766,02</b>	<b>14.073,70</b>	<b>0,21%</b>		<b>0,13%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinatura em: https://sccs.tce.pe.gov.br/gdp/vista/validaDoc.seam Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



# Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2020

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcdp-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)**

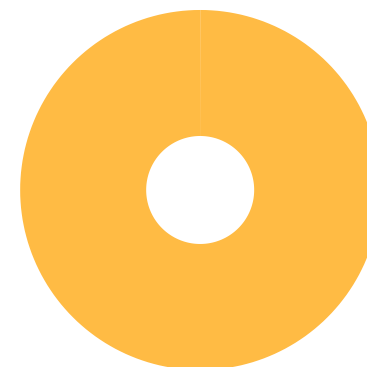
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.498.738,02	92,98%	1.244	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	121.751,56	2,52%	755	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	213.333,27	4,41%	590	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	4.794,34	0,10%	168.251	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>4.838.617,19</b>				

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epj/vai/validaDoc.seam> Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Agosto / 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%	4.838.617,19
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.498.738,02	92,98%	40,00%	75,00%	100,00%	339.879,17
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	4.838.617,19
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	241.930,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	2.903.170,31
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	2.903.170,31
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	339.879,17	7,02%	0,00%	0,12%	40,00%	1.595.567,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	1.935.446,88
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	967.723,44
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	725.792,58
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	725.792,58
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	241.930,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	241.930,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	241.930,86
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>4.838.617,19</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>80,12%</b>	<b>570,00%</b>	



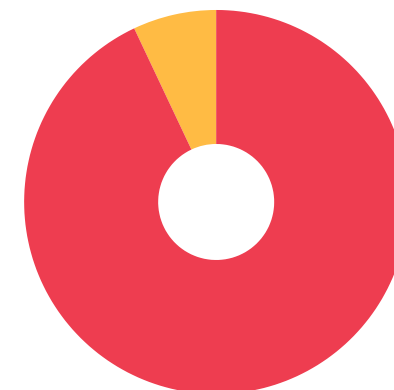
RENDA FIXA 4.838.617,19



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 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%	2,00%	30,00%	1.451.585,16
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	1.451.585,16
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	967.723,44
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	967.723,44
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	483.861,72
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	241.930,86
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	241.930,86
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>8,00%</b>	<b>120,00%</b>	

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%	483.861,72
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	483.861,72
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	483.861,72
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b 7º IV a

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.838.617,19	100,00	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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://atce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,12%	2,96%	0,64%	2,12%	5,06%	12,83%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,09%	2,78%	0,58%	1,99%	4,77%	12,31%	0,15%	0,01%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,16%	2,12%	0,57%	1,43%	3,86%	10,38%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	1,42%	0,31%	0,92%	2,78%	8,08%	0,00%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,18%	1,80%	0,68%	1,16%	3,42%	9,79%	0,03%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,45%	0,09%	0,26%	1,07%	3,24%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etec.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



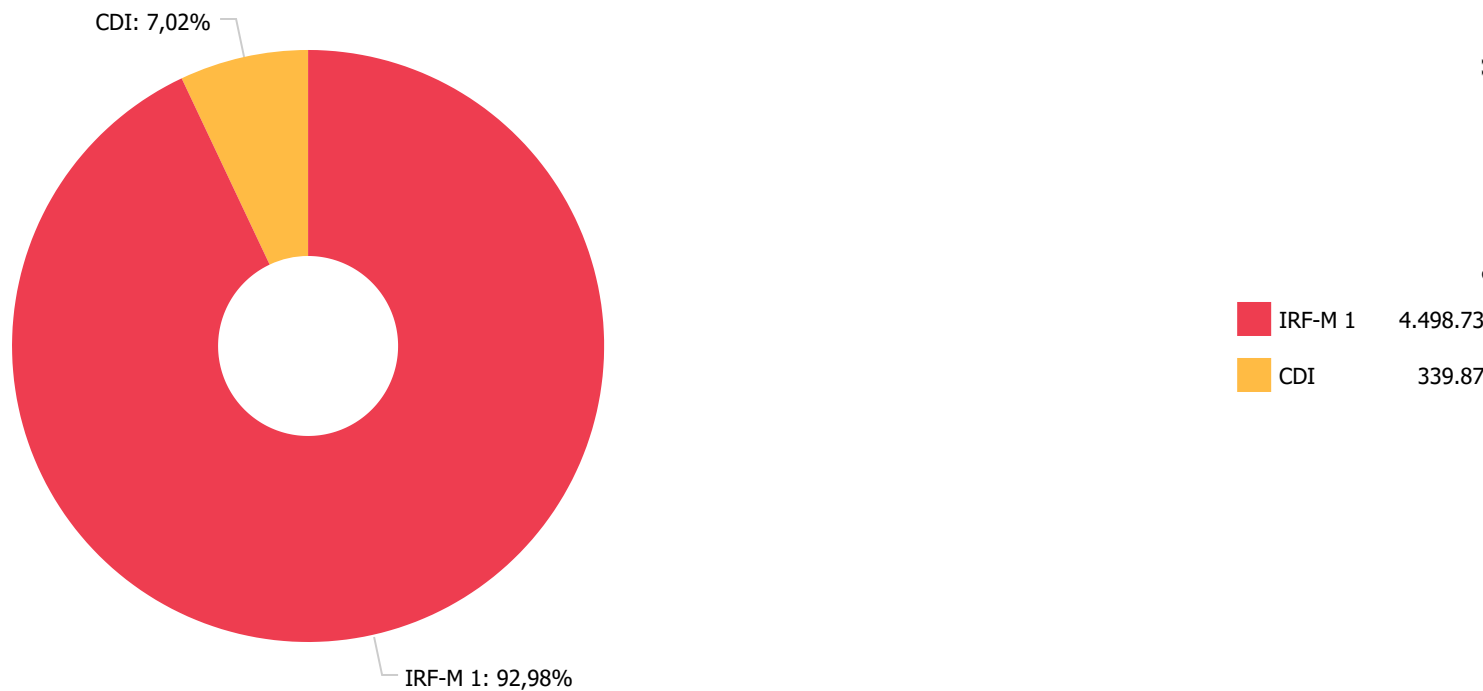
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Agosto / 2020)



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25

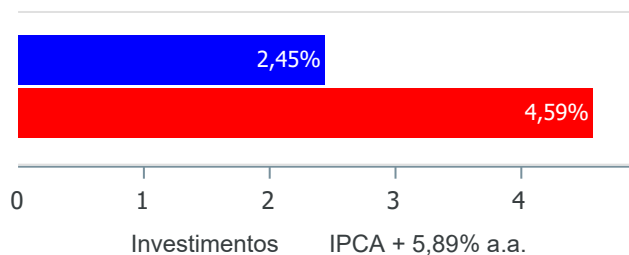




**Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V
Janeiro	5.933.822,27	1.740.944,09	687.122,64	7.015.570,17	27.926,45	27.926,45	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,14%	0,00%
Fevereiro	7.015.570,17	806.081,33	672.774,85	7.171.927,15	23.050,50	50.976,95	0,32%	0,72%	0,66%	1,38%	52,52%	0,00%
Março	7.171.927,15	409.559,61	852.145,22	6.758.995,74	29.654,20	80.631,15	0,41%	1,14%	0,57%	1,96%	58,26%	0,00%
Abril	6.758.995,74	490.255,26	779.782,09	6.493.989,12	24.520,21	105.151,36	0,36%	1,51%	0,14%	2,10%	71,65%	0,00%
Mai	6.493.989,12	312.300,43	556.689,47	6.271.684,46	22.084,38	127.235,74	0,34%	1,85%	0,07%	2,18%	85,03%	0,00%
Junho	6.271.684,46	625.962,20	847.735,91	6.065.816,50	15.905,75	143.141,49	0,25%	2,11%	0,74%	2,93%	71,94%	0,00%
Julho	6.065.816,50	759.305,79	1.308.429,97	5.530.766,02	14.073,70	157.215,19	0,23%	2,35%	0,89%	3,85%	61,04%	0,00%
Agosto	5.530.766,02	66.867,64	764.685,49	4.838.617,19	5.669,02	162.884,21	0,10%	2,45%	0,72%	4,59%	53,40%	0,00%

**Investimentos x Meta Atuarial**



Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: [https://gco.leg.br/pe/br/pp/v/validar\\_documento](https://gco.leg.br/pe/br/pp/v/validar_documento)  
Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25

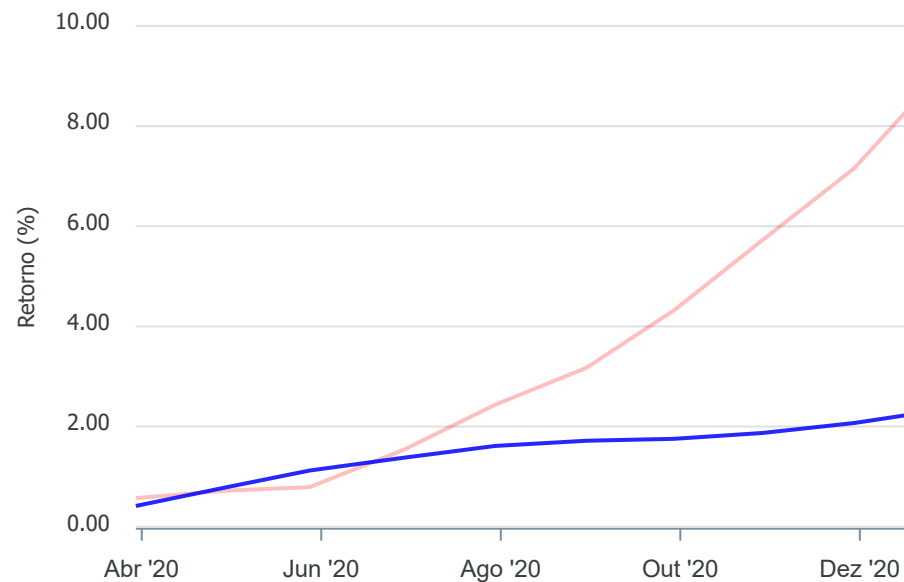


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos    Meta Atuarial     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: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	911.742,87	0,00	700.000,00	213.333,27	1.590,40	0,17%	0,18%	0,03
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.494.770,31	0,00	0,00	4.498.738,02	3.967,71	0,09%	0,09%	0,15
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	119.144,12	51.562,24	49.065,04	121.751,56	110,24	0,06%	0,08%	0,00
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	5.108,72	15.305,40	15.620,45	4.794,34	0,67	0,00%	0,01%	0,00
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>5.530.766,02</b>	<b>66.867,64</b>	<b>764.685,49</b>	<b>4.838.617,19</b>	<b>5.669,02</b>	<b>0,10%</b>		<b>0,14</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Assinatura em: https://sistemas.spe.gov.br/gpd/vtda/validaDoc.seam Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25

# Relatório Analítico dos Investimentos

## em setembro e 3º trimestre de 2020

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcdf.fcp.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)**

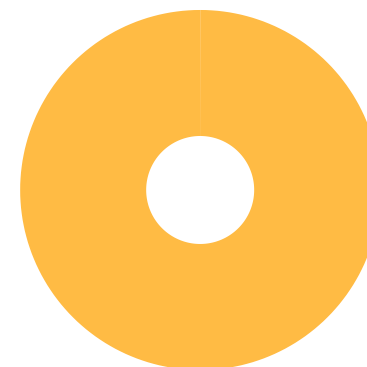
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.500.661,31	91,44%	1.239	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	202.994,90	4,12%	755	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	213.384,52	4,34%	586	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	4.710,08	0,10%	168.502	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>4.921.750,81</b>				

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epj/validarDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 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%	4.921.750,81
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.500.661,31	91,44%	40,00%	75,00%	100,00%	421.089,50
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	4.921.750,81
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	246.087,54
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	2.953.050,49
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	2.953.050,49
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	421.089,50	8,56%	0,00%	0,12%	40,00%	1.547.610,82
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	1.968.700,32
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	984.350,16
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	738.262,62
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	738.262,62
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	246.087,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	246.087,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	246.087,54
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>4.921.750,81</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>80,12%</b>	<b>570,00%</b>	



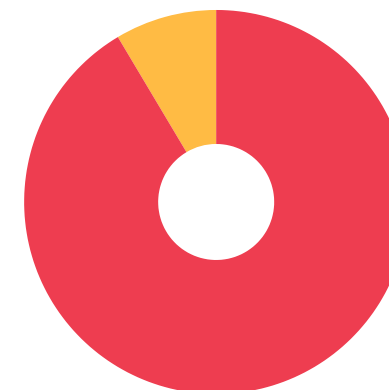
RENDA FIXA 4.921.750,81



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 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%	2,00%	30,00%	1.476.525,24
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	1.476.525,24
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	984.350,16
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	984.350,16
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	492.175,08
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	246.087,54
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	246.087,54
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>8,00%</b>	<b>120,00%</b>	

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%	492.175,08
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	492.175,08
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	492.175,08
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b      7º IV a

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.921.750,81	100,00	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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://atce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25





**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,15%	3,12%	0,51%	1,66%	4,54%	12,32%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04%	2,83%	0,36%	1,43%	4,17%	11,70%	0,15%	0,01%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	1,42%	0,18%	0,66%	2,40%	7,66%	0,03%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	1,82%	0,44%	1,22%	2,98%	9,27%	0,06%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,46%	0,05%	0,19%	0,94%	3,08%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etecf.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



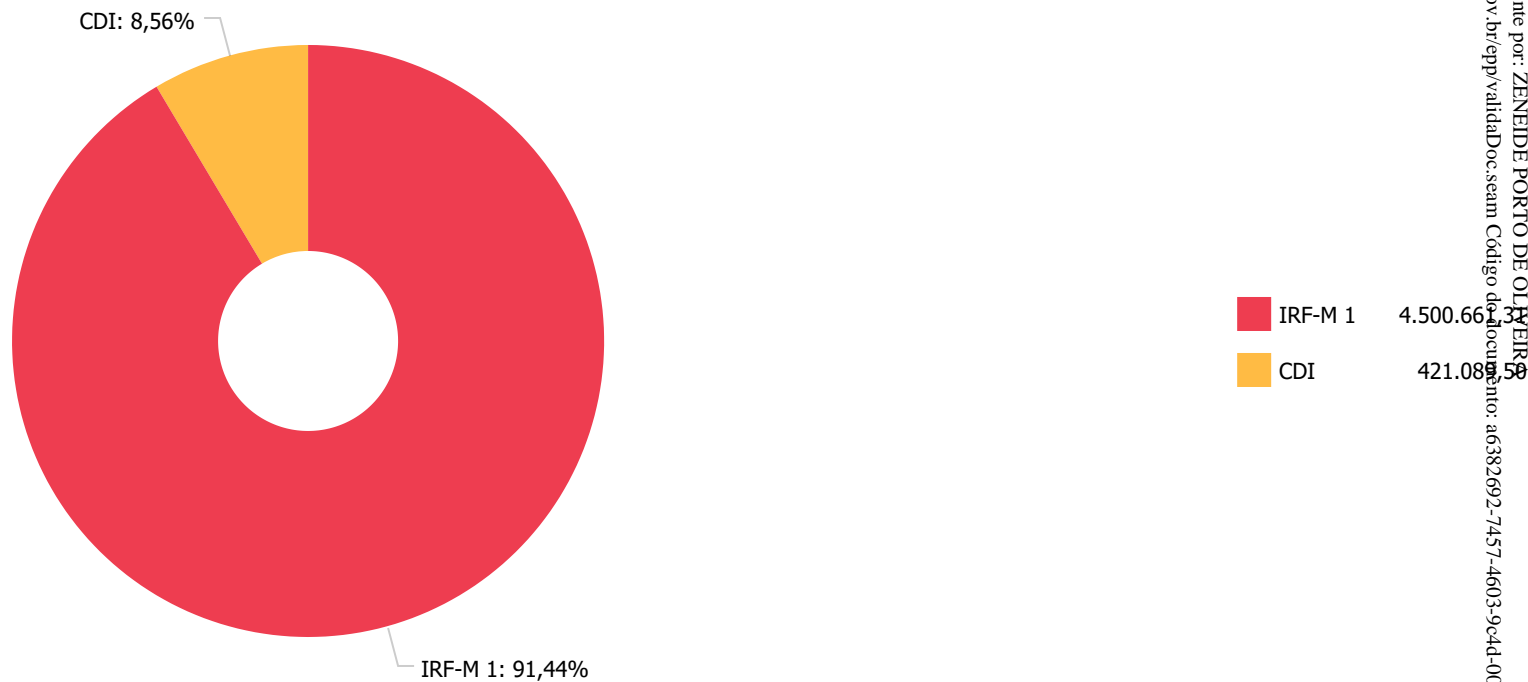
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Setembro / 2020)



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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



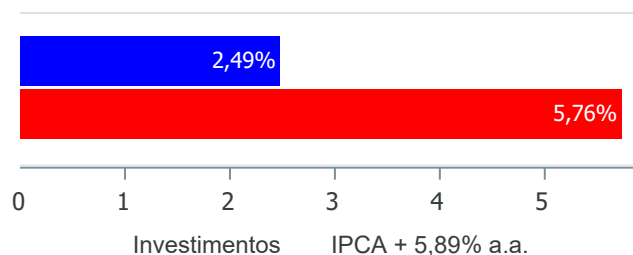
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**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	5.933.822,27	1.740.944,09	687.122,64	7.015.570,17	27.926,45	27.926,45	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,14%	0,00%
Fevereiro	7.015.570,17	806.081,33	672.774,85	7.171.927,15	23.050,50	50.976,95	0,32%	0,72%	0,66%	1,38%	52,52%	0,00%
Março	7.171.927,15	409.559,61	852.145,22	6.758.995,74	29.654,20	80.631,15	0,41%	1,14%	0,57%	1,96%	58,26%	0,00%
Abril	6.758.995,74	490.255,26	779.782,09	6.493.989,12	24.520,21	105.151,36	0,36%	1,51%	0,14%	2,10%	71,65%	0,00%
Mai	6.493.989,12	312.300,43	556.689,47	6.271.684,46	22.084,38	127.235,74	0,34%	1,85%	0,07%	2,18%	85,03%	0,00%
Junho	6.271.684,46	625.962,20	847.735,91	6.065.816,50	15.905,75	143.141,49	0,25%	2,11%	0,74%	2,93%	71,94%	0,00%
Julho	6.065.816,50	759.305,79	1.308.429,97	5.530.766,02	14.073,70	157.215,19	0,23%	2,35%	0,89%	3,85%	61,04%	0,00%
Agosto	5.530.766,02	66.867,64	764.685,49	4.838.617,19	5.669,02	162.884,21	0,10%	2,45%	0,72%	4,59%	53,40%	0,00%
Setembro	4.838.617,19	875.771,69	794.513,12	4.921.750,81	1.875,05	164.759,26	0,04%	2,49%	1,12%	5,76%	43,21%	0,00%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://gco.les.gov.br/pp/vtdalgc.secdmCodigoDocumento>: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25

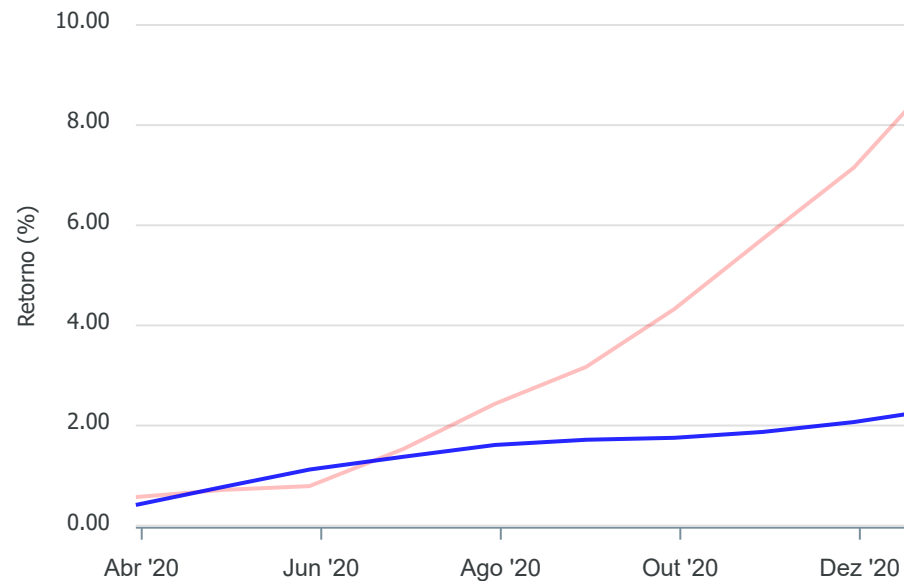


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos    Meta Atuarial     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: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00f818e26b25



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.498.738,02	0,00	0,00	4.500.661,31	1.923,29	0,04%	0,04%	0,15
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	213.333,27	0,00	0,00	213.384,52	51,25	0,02%	0,02%	0,06
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	4.794,34	5.015,40	5.100,00	4.710,08	0,34	0,00%	0,01%	0,00
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	121.751,56	870.756,29	789.413,12	202.994,90	-99,83	-0,01%	0,00%	0,03
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>4.838.617,19</b>	<b>875.771,69</b>	<b>794.513,12</b>	<b>4.921.750,81</b>	<b>1.875,05</b>	<b>0,04%</b>		<b>0,14</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinatura em: https://sistemas.tcepe.gov.br/sig/validarDoc.aspx?Codigo=documento:46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Int...
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.484.325,38	0,00	0,00	4.500.661,31	16.335,93	0,36%	0,36%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.508.298,50	0,00	1.300.000,00	213.384,52	5.086,02	0,34%	0,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	71.420,65	1.675.869,12	1.544.488,33	202.994,90	193,46	0,01%	0,18%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	1.771,97	26.076,00	23.140,25	4.710,08	2,36	0,01%	0,05%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>21.617,77</b>	<b>0,28%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://sistemas.ssp.gov.br/spp/validador/validarDoc.seam Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25

# Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2020

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.fcp.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25





Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)

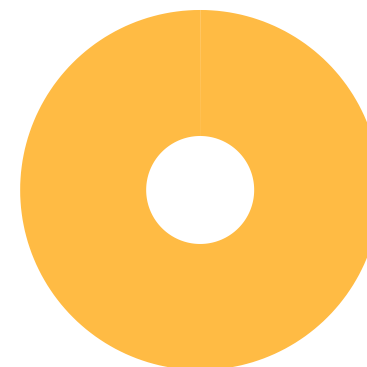
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.005.791,01	93,41%	1.234	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	60.926,13	1,42%	762	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	213.724,61	4,98%	582	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	8.039,14	0,19%	168.670	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>4.288.480,89</b>				

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epj/va/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Outubro / 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%	4.288.480,89
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	4.005.791,01	93,41%	40,00%	75,00%	100,00%	282.689,88
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	4.288.480,89
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	214.424,04
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	2.573.088,53
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	2.573.088,53
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	282.689,88	6,59%	0,00%	0,12%	40,00%	1.432.702,48
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	1.715.392,36
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	857.696,18
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	643.272,13
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	643.272,13
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	214.424,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	214.424,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	214.424,04
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>4.288.480,89</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>80,12%</b>	<b>570,00%</b>	



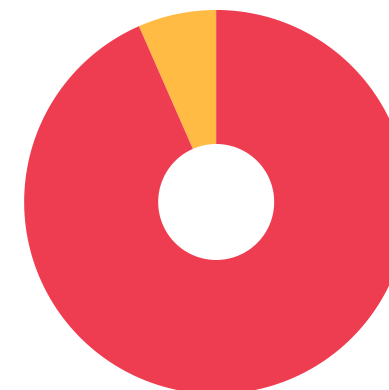
RENDA FIXA 4.288.480,89



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 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%	2,00%	30,00%	1.286.544,27
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	1.286.544,27
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	857.696,18
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	857.696,18
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	428.848,09
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	214.424,04
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	214.424,04
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>8,00%</b>	<b>120,00%</b>	

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%	428.848,09
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	428.848,09
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	428.848,09
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b 7º IV a

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.288.480,89	100,00	-

**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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



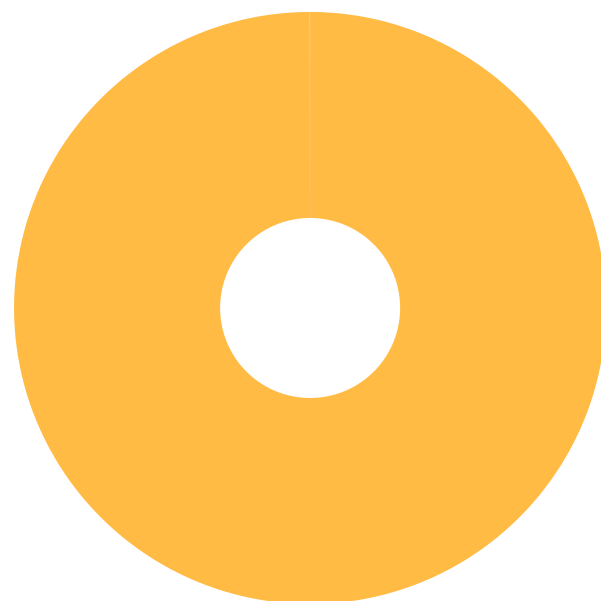
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,16%	3,29%	0,43%	1,38%	4,06%	11,49%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	2,94%	0,25%	1,13%	3,67%	10,79%	0,29%	0,01%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	1,48%	0,13%	0,52%	2,07%	7,24%	0,24%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,16%	1,98%	0,37%	1,12%	2,69%	8,87%	0,26%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,47%	0,03%	0,16%	0,74%	2,89%	0,01%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etecf.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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



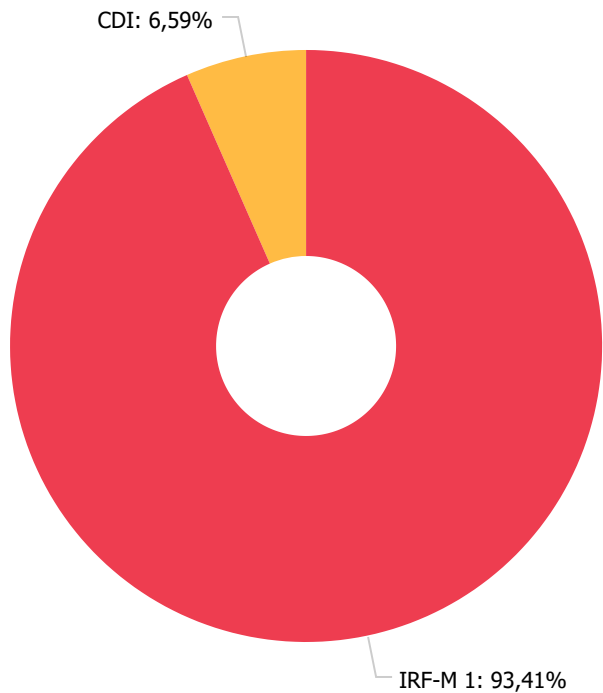
BB GESTÃO: 100,00%

BB GESTÃO 4.288.488,88

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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



IRF-M 1	4.005.790,00
CDI	282.688,88

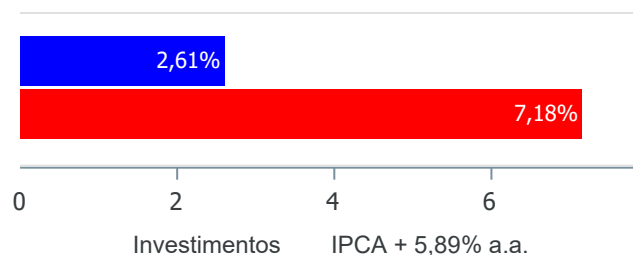
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**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	5.933.822,27	1.740.944,09	687.122,64	7.015.570,17	27.926,45	27.926,45	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,14%	0,05%
Fevereiro	7.015.570,17	806.081,33	672.774,85	7.171.927,15	23.050,50	50.976,95	0,32%	0,72%	0,66%	1,38%	52,52%	0,05%
Março	7.171.927,15	409.559,61	852.145,22	6.758.995,74	29.654,20	80.631,15	0,41%	1,14%	0,57%	1,96%	58,26%	0,05%
Abril	6.758.995,74	490.255,26	779.782,09	6.493.989,12	24.520,21	105.151,36	0,36%	1,51%	0,14%	2,10%	71,65%	0,05%
Mai	6.493.989,12	312.300,43	556.689,47	6.271.684,46	22.084,38	127.235,74	0,34%	1,85%	0,07%	2,18%	85,03%	0,05%
Junho	6.271.684,46	625.962,20	847.735,91	6.065.816,50	15.905,75	143.141,49	0,25%	2,11%	0,74%	2,93%	71,94%	0,05%
Julho	6.065.816,50	759.305,79	1.308.429,97	5.530.766,02	14.073,70	157.215,19	0,23%	2,35%	0,89%	3,85%	61,04%	0,05%
Agosto	5.530.766,02	66.867,64	764.685,49	4.838.617,19	5.669,02	162.884,21	0,10%	2,45%	0,72%	4,59%	53,40%	0,05%
Setembro	4.838.617,19	875.771,69	794.513,12	4.921.750,81	1.875,05	164.759,26	0,04%	2,49%	1,12%	5,76%	43,21%	0,05%
Outubro	4.921.750,81	130.750,37	769.687,27	4.288.480,89	5.666,98	170.426,24	0,12%	2,61%	1,34%	7,18%	36,32%	0,05%

**Investimentos x Meta Atuarial**



Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: https://gco.les.gov.br/portal/validarDoc.aspx?CodigoDoc=46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



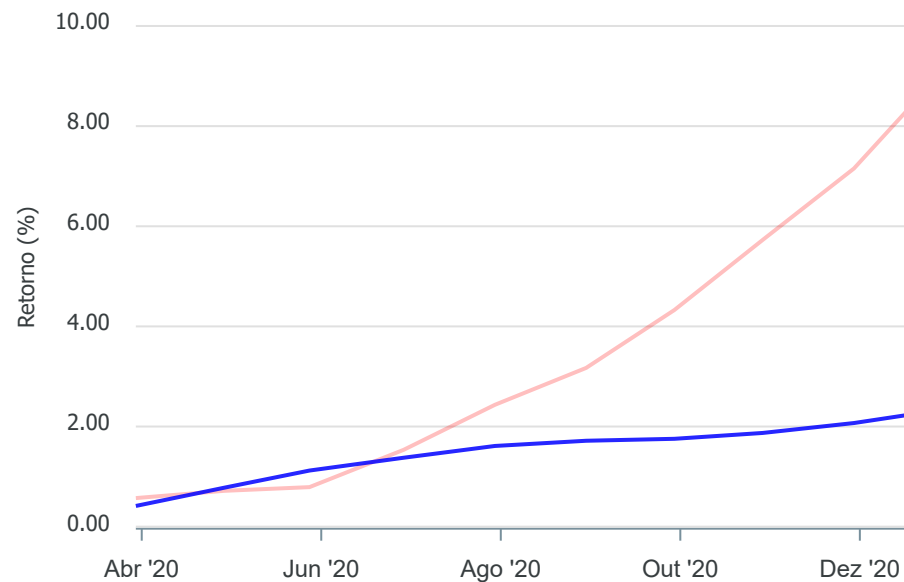


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos    Meta Atuarial     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: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00f818e26b25



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	213.384,52	0,00	0,00	213.724,61	340,09	0,16%	0,16%	0,26%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.500.661,31	0,00	500.000,00	4.005.791,01	5.129,70	0,11%	0,11%	0,29%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	202.994,90	125.742,02	268.007,27	60.926,13	196,48	0,06%	0,06%	0,24%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	4.710,08	5.008,35	1.680,00	8.039,14	0,71	0,01%	0,01%	0,01%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>4.921.750,81</b>	<b>130.750,37</b>	<b>769.687,27</b>	<b>4.288.480,89</b>	<b>5.666,98</b>	<b>0,11%</b>		<b>0,29%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://sccs.tcepe.gov.br/gdp/vtda/Doc:seam Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25

# Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro de 2020

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcg.fcp.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2020)

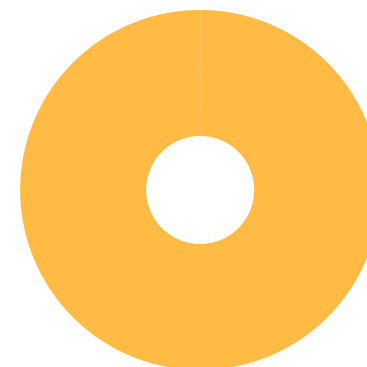
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	3.233.715,89	89,31%	1.229	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	163.475,92	4,51%	757	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	214.062,09	5,91%	584	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	9.492,49	0,26%	168.741	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>3.620.746,39</b>				

Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epj/vai/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Novembro / 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%	3.620.746,39
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	3.233.715,89	89,31%	40,00%	75,00%	100,00%	387.030,50
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	3.620.746,39
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	181.037,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	2.172.447,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	2.172.447,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	387.030,50	10,69%	0,00%	0,12%	40,00%	1.061.268,06
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	1.448.298,56
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	724.149,28
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	543.111,96
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	543.111,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	181.037,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	181.037,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	181.037,32
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>3.620.746,39</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>80,12%</b>	<b>570,00%</b>	



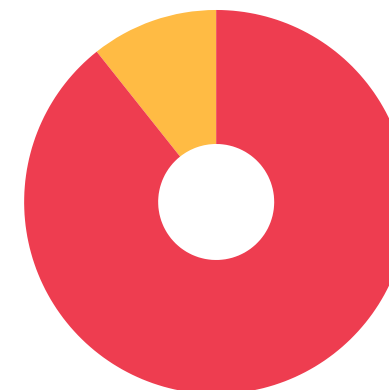
RENDA FIXA 3.620.746,39



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Novembro / 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%	2,00%	30,00%	1.086.223,92
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	1.086.223,92
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	724.149,28
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	724.149,28
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	362.074,64
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	181.037,32
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	181.037,32
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>8,00%</b>	<b>120,00%</b>	

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%	362.074,64
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	362.074,64
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	362.074,64
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b 7º IV a

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.620.746,39	100,00	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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://atce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,23%	3,52%	0,54%	1,19%	3,95%	11,13%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	3,15%	0,35%	0,94%	3,56%	10,43%	0,12%	0,01%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,15%	2,59%	0,46%	1,03%	2,97%	9,24%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	1,54%	0,11%	0,42%	1,83%	6,86%	0,02%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,16%	2,14%	0,34%	1,02%	2,50%	8,51%	0,03%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,48%	0,03%	0,12%	0,61%	2,72%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etccf.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25





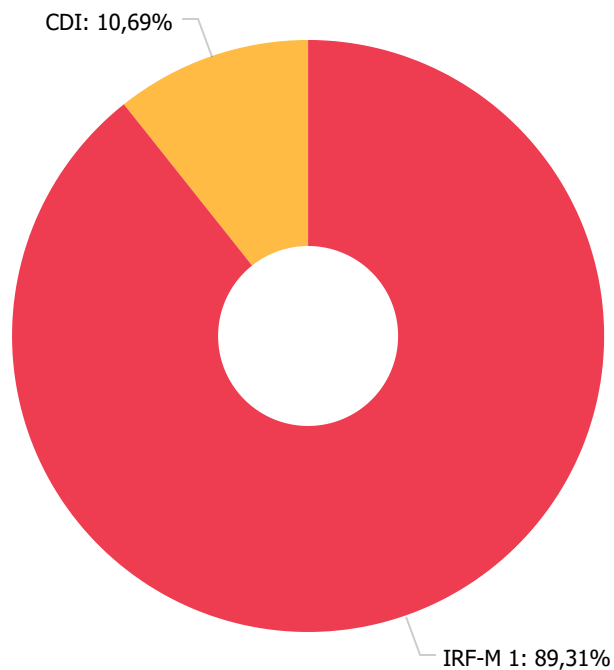
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Novembro / 2020)



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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



IRF-M 1	3.233.718,58
CDI	387.031,58

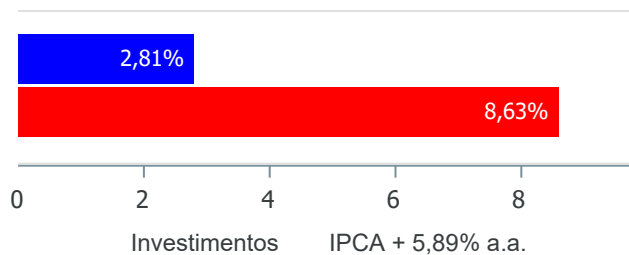
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**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	Variância
Janeiro	5.933.822,27	1.740.944,09	687.122,64	7.015.570,17	27.926,45	27.926,45	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,14%	0,00%
Fevereiro	7.015.570,17	806.081,33	672.774,85	7.171.927,15	23.050,50	50.976,95	0,32%	0,72%	0,66%	1,38%	52,52%	0,00%
Março	7.171.927,15	409.559,61	852.145,22	6.758.995,74	29.654,20	80.631,15	0,41%	1,14%	0,57%	1,96%	58,26%	0,00%
Abril	6.758.995,74	490.255,26	779.782,09	6.493.989,12	24.520,21	105.151,36	0,36%	1,51%	0,14%	2,10%	71,65%	0,00%
Mai	6.493.989,12	312.300,43	556.689,47	6.271.684,46	22.084,38	127.235,74	0,34%	1,85%	0,07%	2,18%	85,03%	0,00%
Junho	6.271.684,46	625.962,20	847.735,91	6.065.816,50	15.905,75	143.141,49	0,25%	2,11%	0,74%	2,93%	71,94%	0,00%
Julho	6.065.816,50	759.305,79	1.308.429,97	5.530.766,02	14.073,70	157.215,19	0,23%	2,35%	0,89%	3,85%	61,04%	0,00%
Agosto	5.530.766,02	66.867,64	764.685,49	4.838.617,19	5.669,02	162.884,21	0,10%	2,45%	0,72%	4,59%	53,40%	0,00%
Setembro	4.838.617,19	875.771,69	794.513,12	4.921.750,81	1.875,05	164.759,26	0,04%	2,49%	1,12%	5,76%	43,21%	0,00%
Outubro	4.921.750,81	130.750,37	769.687,27	4.288.480,89	5.666,98	170.426,24	0,12%	2,61%	1,34%	7,18%	36,32%	0,00%
Novembro	4.288.480,89	125.441,02	801.491,10	3.620.746,39	8.315,58	178.741,82	0,19%	2,81%	1,35%	8,63%	32,54%	0,00%

**Investimentos x Meta Atuarial**



Documento Assinado Digitalmente por ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: https://gco.ic.gov.br/pt/vtdadoc/secdmCodigoDocIdoqnto:46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25

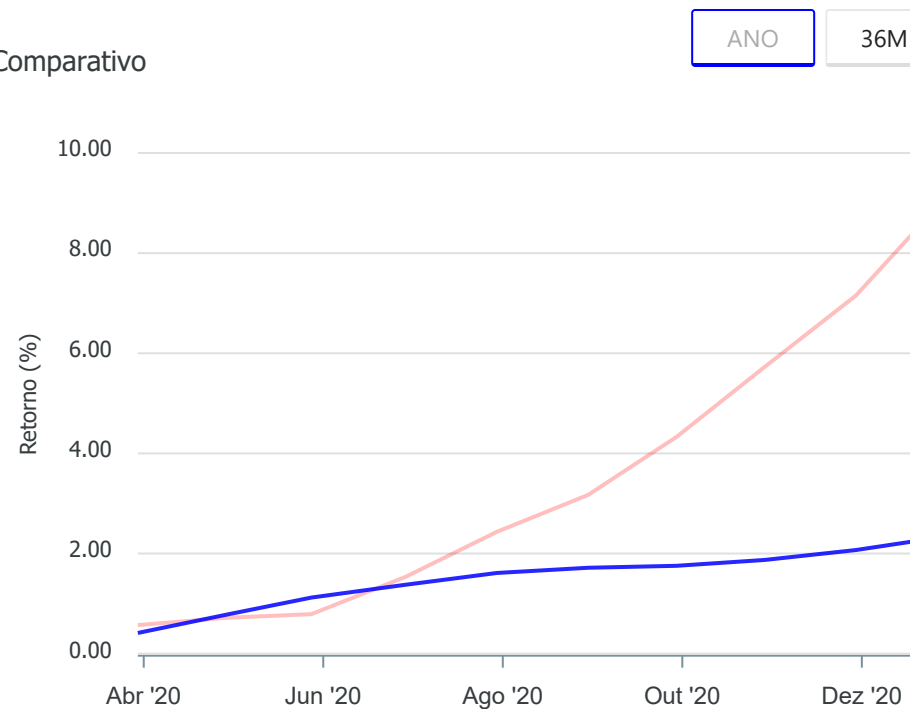


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos    Meta Atuarial     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: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00f818e26b25



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.005.791,01	0,00	780.000,00	3.233.715,89	7.924,88	0,20%	0,20%	0,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	213.724,61	0,00	0,00	214.062,09	337,48	0,16%	0,16%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	60.926,13	120.318,44	17.821,10	163.475,92	52,45	0,03%	0,06%	0,02%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	8.039,14	5.122,58	3.670,00	9.492,49	0,77	0,01%	0,01%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>4.288.480,89</b>	<b>125.441,02</b>	<b>801.491,10</b>	<b>3.620.746,39</b>	<b>8.315,58</b>	<b>0,19%</b>		<b>0,11%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinatura em: https://sccs.tcepe.gov.br/gpd/vistaDoc.seam Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25

# Relatório Analítico dos Investimentos

## em dezembro, 4º trimestre e ano de 2020

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <http://etcds.cce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)**

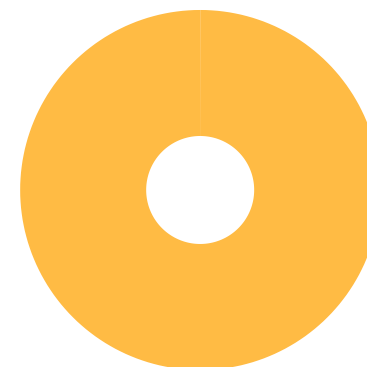
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.942.714,14	81,09%	1.225	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	214.600,67	8,96%	576	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	2.877,92	0,12%	167.511	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	235.565,31	9,83%	743	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>2.395.758,04</b>				

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epj/vai/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**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%	2.395.758,04
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.942.714,14	81,09%	40,00%	75,00%	100,00%	453.043,90
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	2.395.758,04
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	119.787,90
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.437.454,82
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	1.437.454,82
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	453.043,90	18,91%	0,00%	0,12%	40,00%	505.259,32
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	958.303,22
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	479.151,61
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	359.363,71
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	359.363,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	119.787,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	119.787,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	119.787,90
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>2.395.758,04</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>80,12%</b>	<b>570,00%</b>	



RENDA FIXA 2.395.758,04

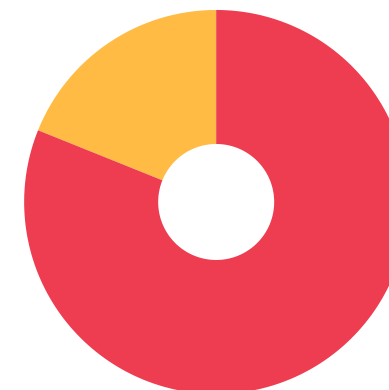




**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2020)**

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%	2,00%	30,00%	718.727,41
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	718.727,41
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	479.151,61
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	479.151,61
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	239.575,80
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	119.787,90
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	119.787,90
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>8,00%</b>	<b>120,00%</b>	

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%	239.575,80
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	239.575,80
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	239.575,80
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	



7º I b 7º IV a

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.395.758,04	100,00	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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://atce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,31%	3,84%	0,70%	1,21%	3,84%	10,86%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	3,47%	0,63%	0,99%	3,47%	10,19%	0,10%	0,01%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,10%	1,64%	0,22%	0,40%	1,64%	6,54%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,25%	2,40%	0,57%	1,01%	2,40%	8,28%	0,02%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,49%	0,03%	0,09%	0,49%	2,55%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
 Acesse em: <https://etccf.ce.gov.br/epp/validaDoc.aspx> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



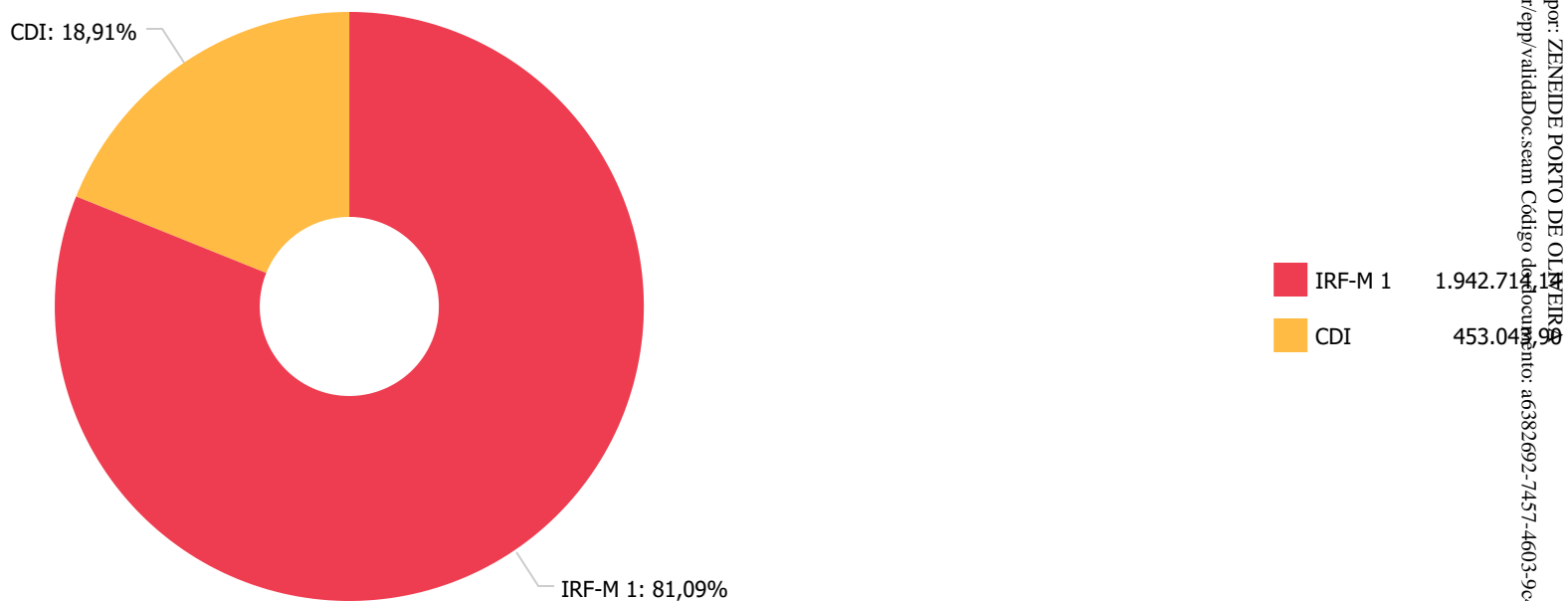
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2020)



Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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



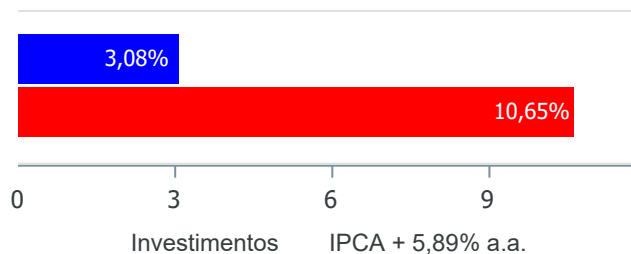
Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 46382692-7457-4603-9c4d-00818e26b25



**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	5.933.822,27	1.740.944,09	687.122,64	7.015.570,17	27.926,45	27.926,45	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,14%	0,00%
Fevereiro	7.015.570,17	806.081,33	672.774,85	7.171.927,15	23.050,50	50.976,95	0,32%	0,72%	0,66%	1,38%	52,52%	0,00%
Março	7.171.927,15	409.559,61	852.145,22	6.758.995,74	29.654,20	80.631,15	0,41%	1,14%	0,57%	1,96%	58,26%	0,00%
Abril	6.758.995,74	490.255,26	779.782,09	6.493.989,12	24.520,21	105.151,36	0,36%	1,51%	0,14%	2,10%	71,65%	0,00%
Mai	6.493.989,12	312.300,43	556.689,47	6.271.684,46	22.084,38	127.235,74	0,34%	1,85%	0,07%	2,18%	85,03%	0,00%
Junho	6.271.684,46	625.962,20	847.735,91	6.065.816,50	15.905,75	143.141,49	0,25%	2,11%	0,74%	2,93%	71,94%	0,00%
Julho	6.065.816,50	759.305,79	1.308.429,97	5.530.766,02	14.073,70	157.215,19	0,23%	2,35%	0,89%	3,85%	61,04%	0,00%
Agosto	5.530.766,02	66.867,64	764.685,49	4.838.617,19	5.669,02	162.884,21	0,10%	2,45%	0,72%	4,59%	53,40%	0,00%
Setembro	4.838.617,19	875.771,69	794.513,12	4.921.750,81	1.875,05	164.759,26	0,04%	2,49%	1,12%	5,76%	43,21%	0,00%
Outubro	4.921.750,81	130.750,37	769.687,27	4.288.480,89	5.666,98	170.426,24	0,12%	2,61%	1,34%	7,18%	36,32%	0,00%
Novembro	4.288.480,89	125.441,02	801.491,10	3.620.746,39	8.315,58	178.741,82	0,19%	2,81%	1,35%	8,63%	32,54%	0,00%
Dezembro	3.620.746,39	268.064,73	1.502.795,53	2.395.758,04	9.742,45	188.484,27	0,27%	3,08%	1,86%	10,65%	28,97%	0,00%

**Investimentos x Meta Atuarial**



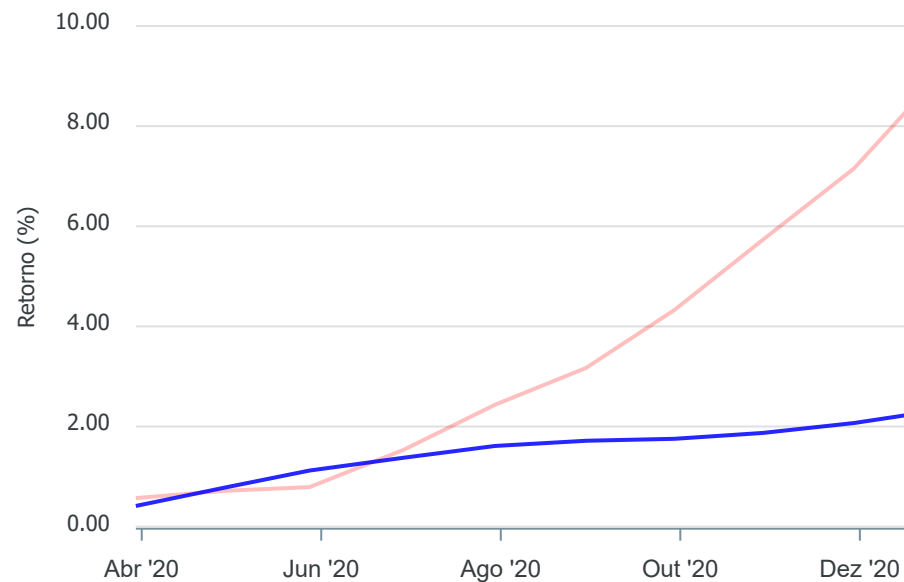


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos    Meta Atuarial     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: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 46382692-7457-4603-9e4d-00f818e26b25



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
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.233.715,89	0,00	1.300.000,00	1.942.714,14	8.998,25	0,28%	0,31%	0,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	214.062,09	0,00	0,00	214.600,67	538,58	0,25%	0,25%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	163.475,92	264.739,78	192.855,31	235.565,31	204,92	0,05%	0,10%	0,01%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	9.492,49	3.324,95	9.940,22	2.877,92	0,70	0,01%	0,01%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>3.620.746,39</b>	<b>268.064,73</b>	<b>1.502.795,53</b>	<b>2.395.758,04</b>	<b>9.742,45</b>	<b>0,25%</b>		<b>0,08%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinatura em: https://sccs.tce.pe.gov.br/snp/vista/validaDoc.seam Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25





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 (%)	(%) Inicial
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.500.661,31	0,00	2.580.000,00	1.942.714,14	22.052,83	0,49%	0,63%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	213.384,52	0,00	0,00	214.600,67	1.216,15	0,57%	0,57%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	202.994,90	510.800,24	478.683,68	235.565,31	453,85	0,06%	0,22%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	4.710,08	13.455,88	15.290,22	2.877,92	2,18	0,01%	0,03%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>23.725,01</b>	<b>0,44%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://seccom.rgs.gov.br/gpp/validarDoc:seam Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25



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 (%)	(%) Int...
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.377.001,14	0,00	2.580.000,00	1.942.714,14	145.713,00	3,33%	3,47%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.487.896,36	0,00	1.300.000,00	214.600,67	26.704,31	1,79%	2,40%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	65.131,39	6.542.818,99	6.388.431,45	235.565,31	16.046,38	0,24%	1,64%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	3.793,38	68.485,17	69.421,21	2.877,92	20,58	0,03%	0,49%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>188.484,27</b>	<b>1,50%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: ZENEIDE PORTO DE OLIVEIRA  
Assinse em: https://sistemas.ssp.br/spp/validador/validadorDoc.seam Código do documento: a6382692-7457-4603-9e4d-00818e26b25