



Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2019

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesse em: <https://cece.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 42668167-f21d-494c-bd0c-a1f4964696cec



Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2019)

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	17.269,16	100,00%	1.198	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			17.269,16				

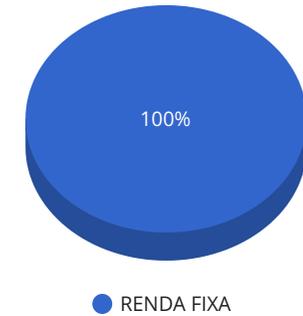
Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 42668167-f21d-494c-bd0c-a1f1964696ec



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2019)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	17.269,16	100,00%	40,00%	60,00%	100,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	10.361,50
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	20,00%	40,00%	6.907,66
Total Renda Fixa	100,00%	17.269,16	100,00%	40,00%	90,00%	200,00%	

Distribuição por Segmento



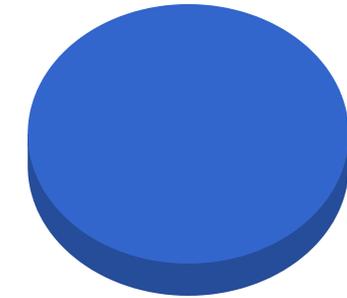
Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 42668167-f21d-494c-bd0c-a1f1964696ec



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2019)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	3.453,83
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	1.726,92
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	30,00%	

Distribuição por Artigos



● 70.1%

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 42668167-f21d-494c-bd0c-a1f1964696ec



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Dezembro / 2019)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.269,16	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 - 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 42668167-f21d-494c-bd0c-a1f1964696cec



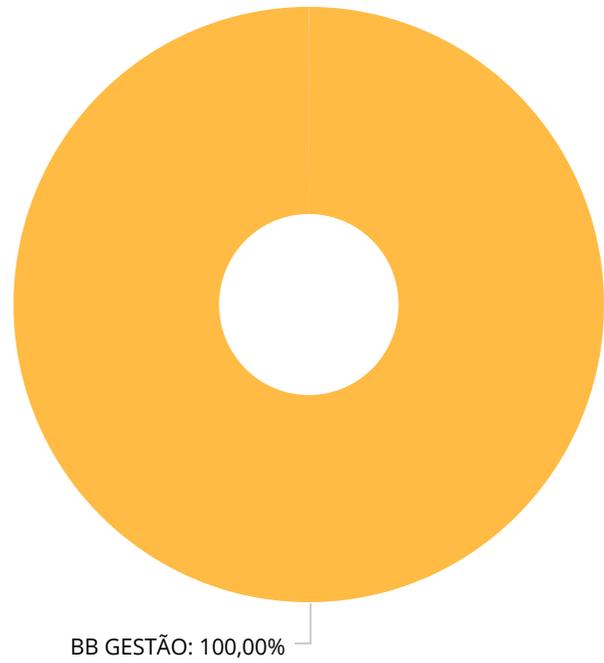
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M 1 (Benchmark)	0,42%	6,76%	1,38%	3,33%	6,76%	14,21%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	6,49%	0,71%	2,46%	5,88%	13,03%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
 Acesse em: <https://etcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 42668167-f21d-494c-bd0c-a1f1964696ec



Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2019)

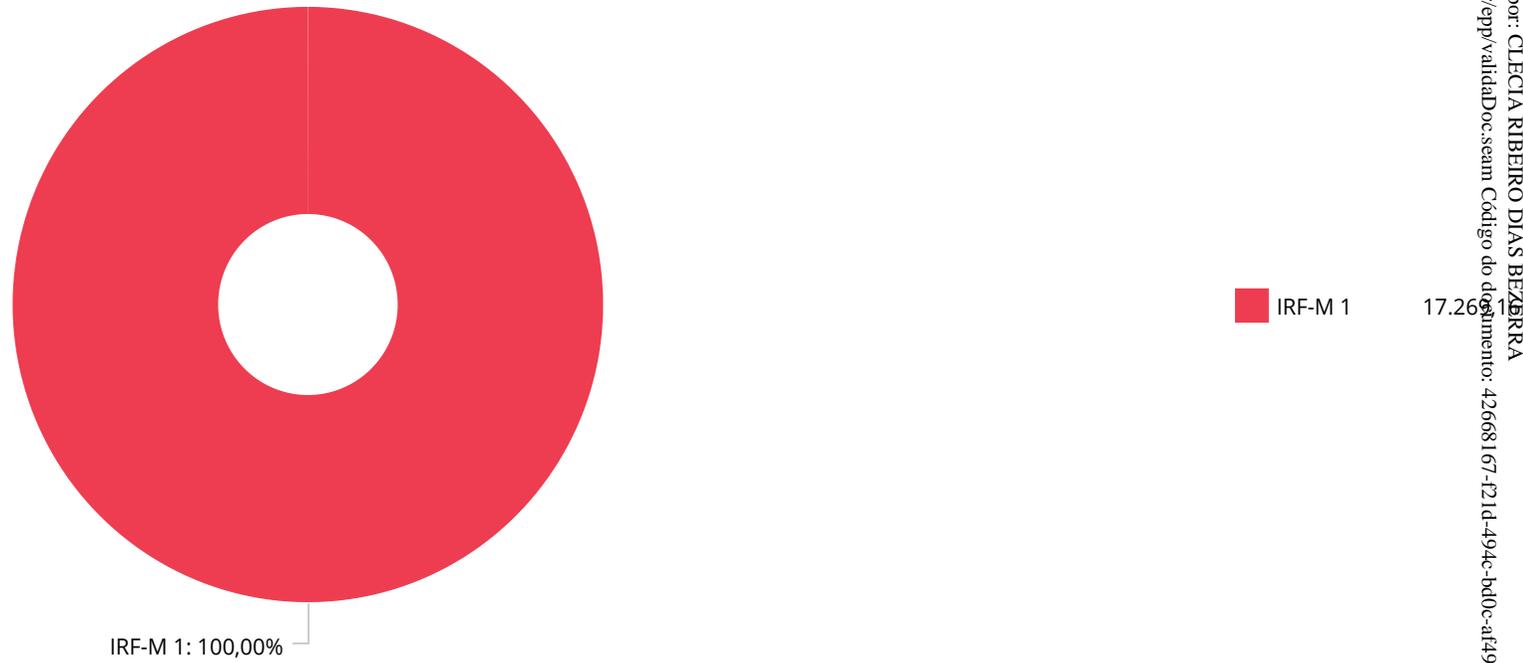


BB GESTÃO 17.268,11

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 42668167-f21d-494c-bd0c-a1f1964696ec



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2019)



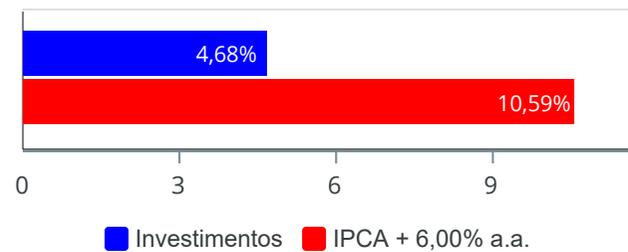
Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesse em: <https://etc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 42668167-f21d-494c-bd0c-a1f1964696ec



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V
Janeiro	8.109,87	0,00	0,00	8.122,82	12,95	12,95	0,16%	0,16%	0,83%	0,83%	19,20%	0,00%
Fevereiro	8.122,82	0,00	0,00	8.133,87	11,05	24,00	0,14%	0,30%	0,90%	1,73%	17,06%	0,00%
Março	8.133,87	0,00	112,00	8.032,40	10,53	34,53	0,13%	0,43%	1,19%	2,95%	14,44%	0,00%
Abril	8.032,40	500.000,00	507.127,01	1.449,34	543,95	578,48	0,11%	0,53%	1,06%	4,04%	13,20%	0,00%
Mai	1.449,34	20.000,00	0,00	21.535,77	86,43	664,91	0,40%	0,94%	0,64%	4,71%	19,94%	0,00%
Junho	21.535,77	0,00	0,00	21.659,07	123,30	788,21	0,57%	1,52%	0,45%	5,18%	29,29%	0,00%
Julho	21.659,07	0,00	0,00	21.810,51	151,44	939,65	0,70%	2,23%	0,72%	5,94%	37,48%	0,00%
Agosto	21.810,51	0,00	0,00	21.923,26	112,75	1.052,40	0,52%	2,75%	0,62%	6,60%	41,76%	0,00%
Setembro	21.923,26	0,00	5.000,00	17.046,12	122,86	1.175,26	0,56%	3,33%	0,45%	7,07%	47,09%	0,00%
Outubro	17.046,12	0,00	0,00	17.148,18	102,06	1.277,32	0,60%	3,95%	0,63%	7,75%	50,95%	0,00%
Novembro	17.148,18	0,00	0,00	17.200,81	52,63	1.329,95	0,31%	4,27%	0,98%	8,80%	48,48%	0,00%
Dezembro	17.200,81	0,00	0,00	17.269,16	68,35	1.398,30	0,40%	4,68%	1,64%	10,59%	44,22%	0,00%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesse em: https://gco.ic.gov.br/gov/vbr/vbr/validarDoc.aspx?CodigoDoc=4269167-f21d-494c-bd0c-af1964696cec



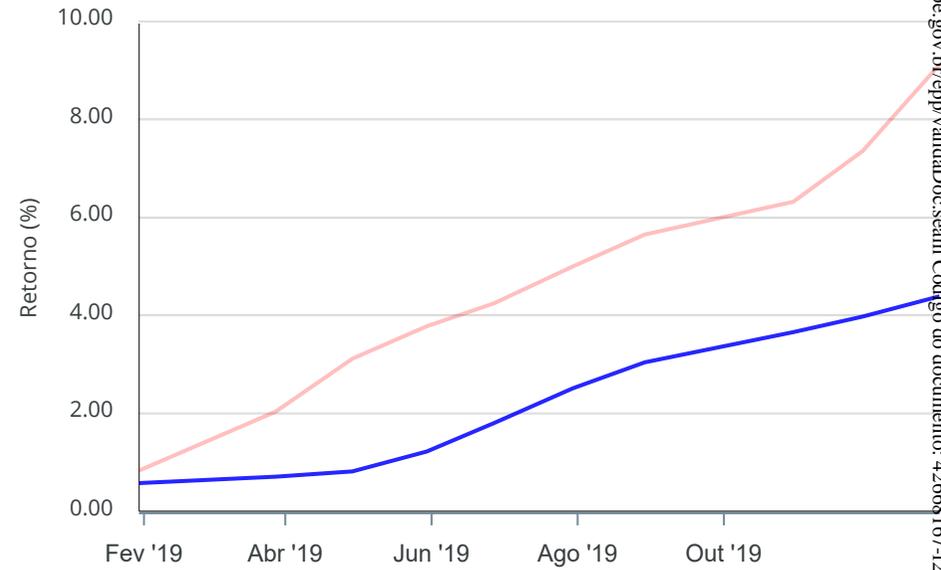
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesse em: <https://etec.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 42668167-f21d-494c-bd0c-af196469696ec



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2019

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...	17.200,81	0,00	0,00	17.269,16	68,35	0,40%	0,40%	0,07
Total Renda Fixa	17.200,81	0,00	0,00	17.269,16	68,35	0,40%		0,07

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Assinse em: https://sccs.tcepse.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 42668167-f21d-494c-bd0c-a1f1964696e6



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2019

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...	17.046,12	0,00	0,00	17.269,16	223,04	1,31%	1,31%
				Total Renda Fixa	223,04	1,31%	

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Assinse em: https://sccs.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 42668167-f21d-494c-bd0c-a1f1964696ec



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2019

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...	895,01	520.000,00	505.000,00	17.269,16	1.374,15	0,26%	6,49%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	7.066,12	0,00	7.089,08	0,00	22,96	0,32%	0,98%
BNB AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	148,74	0,00	149,93	0,00	1,19	0,80%	3,33%
				Total Renda Fixa	1.398,30	8,81%	

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Assinse em: https://sccs.tcepe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 42668167-f21d-494c-bd0c-a1f1964696ec