



Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2018

Documento assinado digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesso em: 11/12/2018
https://etc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 588438fe-5333-4109-9c45-1b10162e6004

**CLECIA
RIBEIRO
DIAS
BEZERRA:80
950728420**

Assinado de
forma digital por
CLECIA RIBEIRO
DIAS
BEZERRA:8095072
8420
Dados: 2019.03.27
11:54:30 -03'00'



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.



Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
 Acesse em: <https://etcds.alice.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 588438fe-5333-4109-9c45-1b10162c6004

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			132,12	11,24%			Artigo 20
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	895,01	76,11%	1.266	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea
BNB AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	148,74	12,65%	38.490	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea
		TOTAL -	1.175,87				

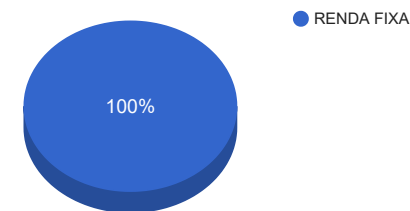


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (dezembro / 2018)

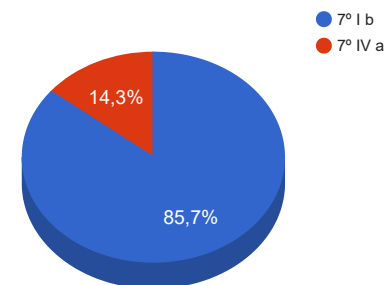
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	895,01	76,11%	50,00%	65,00%	100,00%	280,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	705,52
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	148,74	12,65%	0,00%	10,00%	40,00%	321,61
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	58,79
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	235,17
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	235,17
Total Carteira		1.043,75					

RENDA FIXA	1.175,87	112,66%
------------	----------	---------

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
 Acesse em: <https://etec.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 588438fe-5333-4109-9c45-1b10162c6004



Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 588438fe-5333-4109-9c45-1b10162c6004

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: dezembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	895,01	76,11%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	148,74	12,65%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	1.043,75	88,76%	0,00	0,00



Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 588438fe-5333-4109-9c45-1b10162c6004

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (dezembro / 2018)

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)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	895,01	76,11%	0,00%
Banco do Nordeste do Brasil	148,74	12,65%	0,00%



Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
 Assinado em: https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validarDoc:seam Código do documento: 588438fe-5333-4109-9c45-1b10162c6004

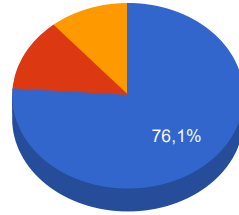
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,56%	6,97%	2,03%	3,78%	6,97%	18,87%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	6,76%	2,00%	3,71%	6,76%	18,35%	0,10%	0,045%	0,55%
CDI	0,49%	6,42%	1,54%	3,15%	6,42%	16,98%	-	-	-
BNB AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,29%	3,80%	0,91%	1,86%	3,80%	11,33%	2,50%	0,018%	-
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-



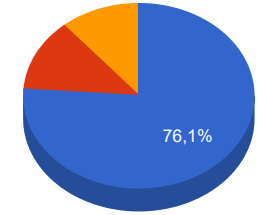
Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (dezembro / 2018)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	895,01	76,11%
Santander Securities Services	148,74	12,65%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	132,12	11,24%



- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- Santander Securities Services
- DISPONIBILIDADE FINANCEIRA

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	895,01	76,11%
CDI	148,74	12,65%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	132,12	11,24%



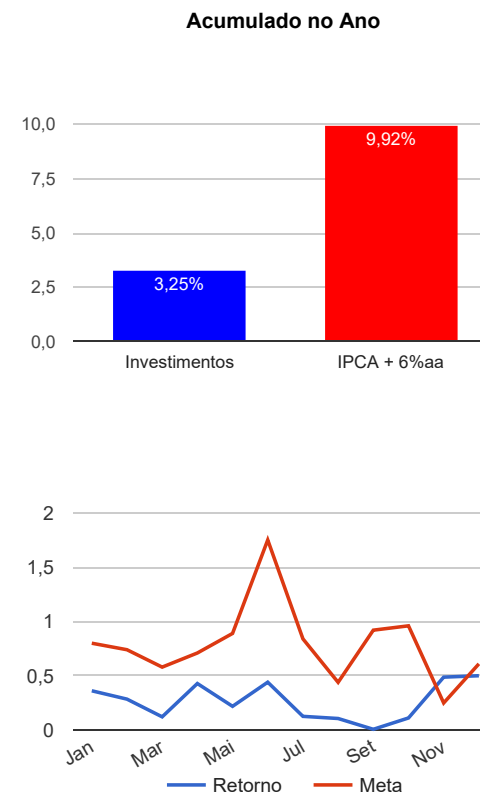
- IRF-M 1
- CDI
- DISPONIBILIDADE FINANCEIRA

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
 Acesse em: <https://pds.pec.br/epi/validarDoc.seam> Código do documento: 588438fe-5333-4109-9c45-1b10162c6004



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	237,45	0,00	0,00	238,31	0,86	0,36%	0,80%	45,19%	0,00%
Fevereiro	238,31	0,00	0,00	238,99	0,68	0,29%	0,74%	38,64%	0,00%
Março	238,99	450.000,00	450.000,00	790,30	551,31	0,12%	0,58%	21,21%	0,09%
Abril	790,30	0,00	0,00	793,69	3,39	0,43%	0,71%	60,60%	0,05%
Mai	793,69	0,00	0,00	795,43	1,74	0,22%	0,89%	24,67%	0,20%
Junho	795,43	0,00	0,00	798,94	3,51	0,44%	1,75%	25,17%	0,48%
Julho	798,94	20.000,00	96,00	20.729,22	26,28	0,13%	0,84%	15,08%	0,20%
Agosto	20.729,22	250.000,00	270.000,00	1.019,27	290,05	0,11%	0,44%	24,20%	0,21%
Setembro	1.019,27	184.783,27	123,50	185.693,37	14,33	0,01%	0,92%	0,84%	0,00%
Outubro	185.693,37	468.653,81	654.046,77	1.033,51	733,10	0,11%	0,96%	11,64%	0,23%
Novembro	1.033,51	0,00	0,00	1.038,55	5,04	0,49%	0,25%	193,09%	0,06%
Dezembro	1.038,55	0,00	0,00	1.043,75	5,20	0,50%	0,61%	81,52%	0,04%
Acumulado no ano					1.635,49	3,25%	9,92%	32,74%	



Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 588438fe-5333-4109-9c45-1b10162c6004



Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesso em: https://p1ce.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 588438fe-5333-4109-9c45-1b10162c6004

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição (%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	890,24	0,00	0,00	895,01	4,77	0,54%	0,04%	0,5
BNB AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	148,31	0,00	0,00	148,74	0,43	0,29%	0,02%	0,2
Total Renda Fixa					5,20	0,50%	0,04%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	184.668,54	468.653,81	654.046,77	0,00	724,42	0,11%	1,27%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	877,43	0,00	0,00	895,01	17,58	2,00%	2,00%
BNB AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	147,40	0,00	0,00	148,74	1,34	0,91%	0,91%
Total Renda Fixa					743,34	1,39%	

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
 Acesso em: https://etec.jce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 588438fe-5333-4109-9c45-1b10162c6004



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	720.000,00	720.000,00	895,01	895,01	4,17%	6,76%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	653.437,08	654.170,27	0,00	733,19	0,12%	5,29%
BNB AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	237,45	0,00	96,00	148,74	7,29	3,69%	3,80%
Total Renda Fixa					1.635,49	246,38%	

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
 Acesso em: https://etce.pec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 588438fe-5333-4109-9c45-1b10162c6004