



# Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2019

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

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

**LEMA**  
ECONOMIA & FINANÇAS



**Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2019)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	101.879,27	8,39%	702	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	101.191,86	8,33%	1.466	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	268.078,83	<b>22,08%</b>	738	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	57.983,14	4,78%	1.263	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	119.874,12	9,87%	363	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	92.338,02	7,60%	758	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	18,05	0,00%	15.529	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	285.320,64	<b>23,50%</b>	362	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	102.152,68	8,41%	823	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	85.357,93	7,03%	1.315	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>1.214.194,54</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>9.312,73</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>1.223.507,27</b>				

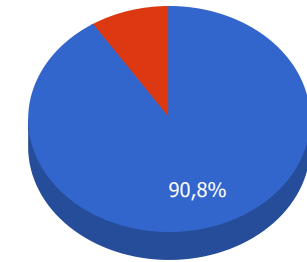
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: [https://etec.tce.pe.gov.br/epi/validarDoc?seam\\_codigo\\_documento:90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6a](https://etec.tce.pe.gov.br/epi/validarDoc?seam_codigo_documento:90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6a)



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	741.345,24	61,06%	50,00%	60,00%	100,00%	472.849,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	728.516,72
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	102.170,73	8,41%	0,00%	20,00%	40,00%	383.507,09
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>843.515,97</b>	<b>69,47%</b>	<b>50,00%</b>	<b>90,00%</b>	<b>200,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**



● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

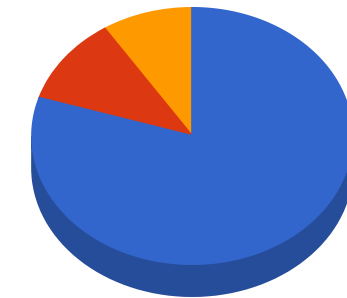
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90697012-41eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	85.357,93	7,03%	0,00%	5,00%	20,00%	157.480,98
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	121.419,45
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>85.357,93</b>	<b>7,03%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>30,00%</b>	

**Distribuição por Artigos**



- 7º I b
- 7º IV a
- 8º II a

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	1.156.211,40	95,22	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	57.983,14	4,78	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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	1,26%	1,26%	2,71%	6,23%	10,29%	24,91%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,27%	1,27%	2,57%	5,93%	9,64%	23,04%	0,01%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,58%	0,58%	1,69%	3,70%	6,96%	18,04%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	0,58%	1,64%	3,60%	6,75%	17,55%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,65%	3,62%	6,80%	17,67%	0,00%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	1,54%	1,54%	3,07%	6,93%	10,09%	24,15%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,53%	1,53%	3,07%	6,88%	9,91%	23,73%	0,01%	0,03%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	4,37%	4,37%	7,05%	14,01%	14,11%	30,65%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,39%	4,39%	7,05%	13,97%	13,95%	30,18%	0,02%	0,05%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	1,39%	1,39%	3,96%	8,08%	10,83%	26,44%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,35%	1,35%	3,87%	7,97%	10,69%	25,91%	0,01%	0,04%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,54%	0,54%	1,54%	3,15%	6,38%	16,36%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,53%	0,53%	1,50%	3,07%	6,19%	16,16%	0,00%	0,00%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etec.ice.pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa0ba



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,10%	0,10%	0,29%	0,59%	1,22%	5,40%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2019 - RENDA VARIÁVEL

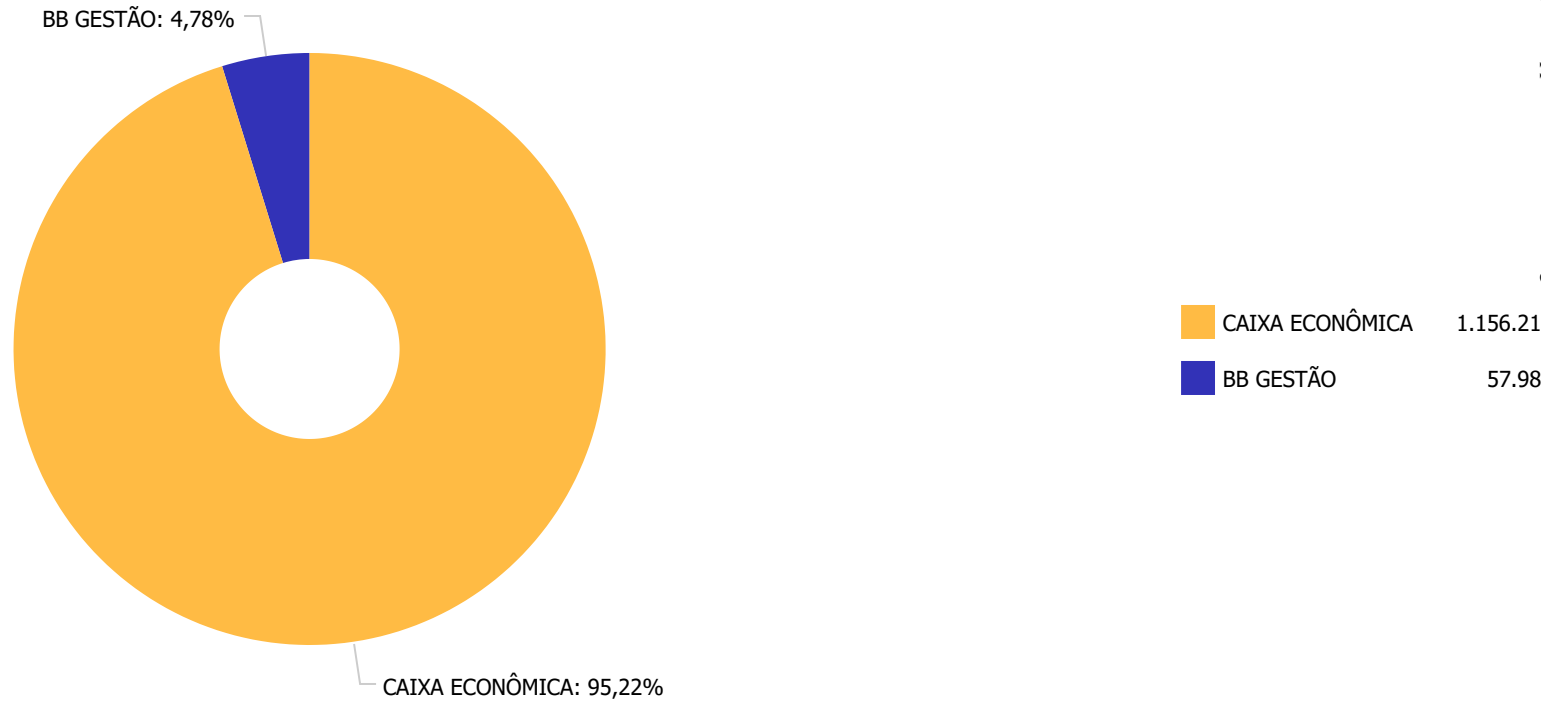
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	13,35%	13,35%	21,44%	32,60%	18,01%	46,53%	0,06%	0,17%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etecf.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba6ba





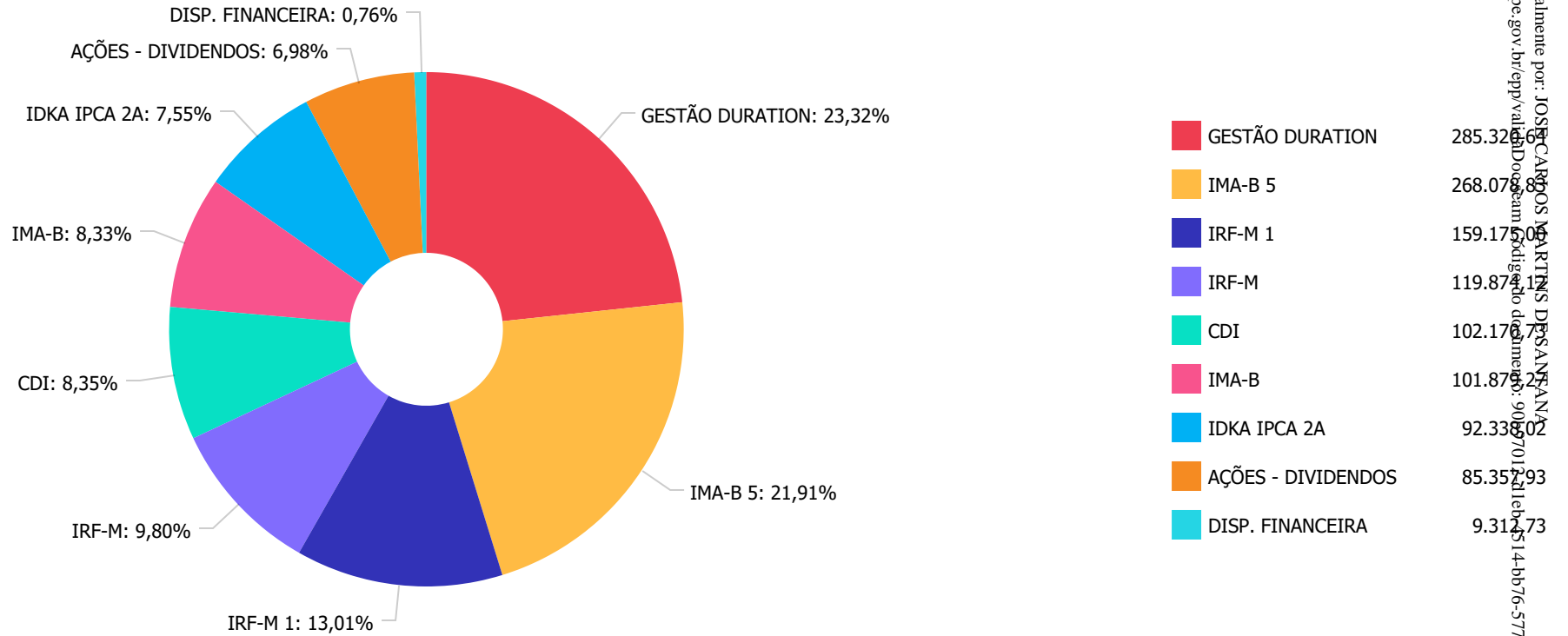
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2019)



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



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



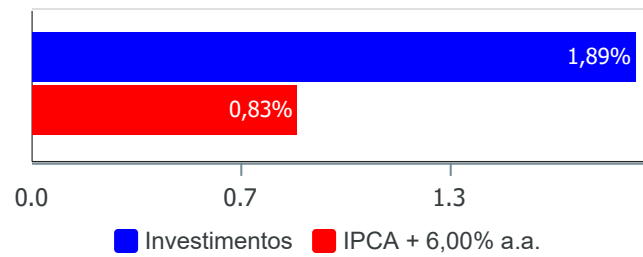
Documento Assinado Digitalmente por: JOSÉ CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesso em: https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validarDocumentoSam50d1e57012511e4b76-57777ebad0a



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	759.894,37	898.600,00	466.835,22	1.214.194,54	22.535,39	22.535,39	1,89%	1,89%	0,83%	0,83%	227,40%	1,

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba6ba

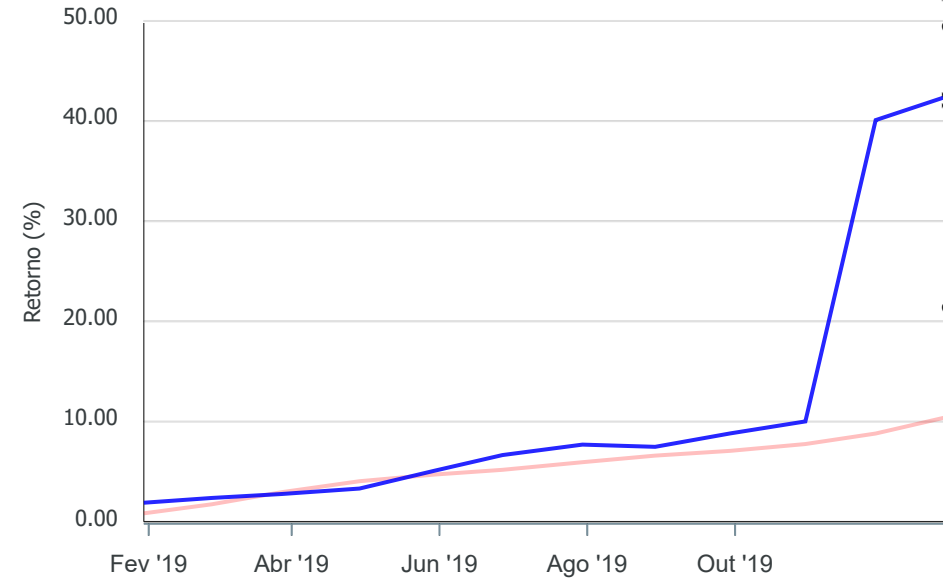


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebada0a



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	85.836,93	200.000,00	6.678,00	285.320,64	6.161,71	2,16%	2,88%	1,38%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	100.000,00	0,00	101.879,27	1.879,27	1,88%	4,39%	1,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	75.099,79	200.000,00	10.106,10	268.078,83	3.085,14	1,12%	1,53%	0,74%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	118.600,00	0,00	119.874,12	1.274,12	1,07%	1,35%	1,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	189.775,81	100.000,00	200.000,00	92.338,02	2.562,21	0,88%	1,27%	0,59%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	57.651,47	0,00	0,00	57.983,14	331,67	0,58%	0,58%	0,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	211.373,81	100.000,00	211.500,00	101.191,86	1.318,05	0,42%	0,57%	0,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	140.138,52	0,00	38.551,12	102.152,68	565,28	0,40%	0,53%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	18,04	0,00	0,00	18,05	0,01	0,06%	0,10%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>759.894,37</b>	<b>818.600,00</b>	<b>466.835,22</b>	<b>1.128.836,61</b>	<b>17.177,46</b>	<b>1,55%</b>		<b>0,86%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinatura em: https://sistemas.ges.br/gsp/vizualizacaoDocumentoCodigoDocumnto: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	80.000,00	0,00	85.357,93	5.357,93	6,70%	13,35%	6,13%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>0,00</b>	<b>80.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>85.357,93</b>	<b>5.357,93</b>	<b>6,70%</b>		<b>6,13%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Assinse em: https://etcc.tee.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



# Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2019

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

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



**Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2019)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	43.773,67	3,84%	799	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	254.172,41	<b>22,32%</b>	751	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	52.074,73	4,57%	1.463	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	231.983,24	<b>20,37%</b>	762	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	58.039,21	5,10%	1.249	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	120.204,23	10,56%	369	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	18,07	0,00%	15.691	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	286.750,99	<b>25,18%</b>	387	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.867,05	0,78%	826	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	82.696,44	7,26%	1.474	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>1.138.580,04</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>25.754,78</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>1.164.334,82</b>				

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: [https://etec.tce.pe.gov.br/epi/validarDoc?seam\\_codigo\\_documento:90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba](https://etec.tce.pe.gov.br/epi/validarDoc?seam_codigo_documento:90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba)

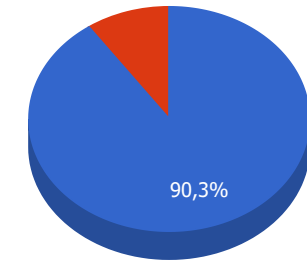




**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Fevereiro / 2019)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	760.247,49	66,77%	50,00%	60,00%	100,00%	378.332,55
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	683.148,02
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	8.885,12	0,78%	0,00%	20,00%	40,00%	446.546,90
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>769.132,61</b>	<b>67,55%</b>	<b>50,00%</b>	<b>90,00%</b>	<b>200,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**



● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

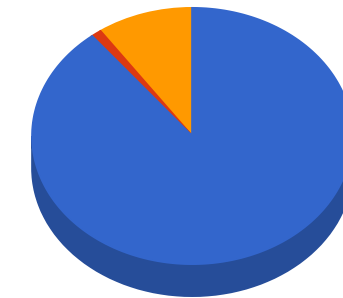
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	82.696,44	7,26%	0,00%	5,00%	20,00%	145.019,57
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	113.858,00
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>82.696,44</b>	<b>7,26%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>30,00%</b>	

**Distribuição por Artigos**



- 7º I b
- 7º IV a
- 8º II a

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	1.080.540,83	94,90	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	58.039,21	5,10	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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,53%	1,80%	3,07%	6,69%	10,19%	23,90%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,56%	1,83%	3,01%	6,51%	9,63%	22,15%	0,01%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,47%	1,05%	1,61%	3,73%	6,88%	17,40%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	1,02%	1,56%	3,65%	6,65%	16,91%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,45%	1,02%	1,57%	3,66%	6,71%	17,04%	0,00%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,55%	2,09%	3,49%	7,79%	10,10%	23,00%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	2,06%	3,47%	7,74%	9,90%	22,57%	0,01%	0,03%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	0,55%	4,94%	6,67%	15,14%	14,11%	26,50%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	4,93%	6,64%	15,10%	13,92%	26,03%	0,02%	0,06%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,29%	1,68%	3,24%	9,41%	9,94%	24,31%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,28%	1,63%	3,13%	9,45%	9,71%	23,73%	0,01%	0,04%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,49%	1,04%	1,54%	3,07%	6,41%	15,93%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,48%	1,01%	1,50%	2,99%	6,23%	15,70%	0,00%	0,00%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebba0ba



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,09%	0,20%	0,29%	0,58%	1,21%	4,96%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba6ba



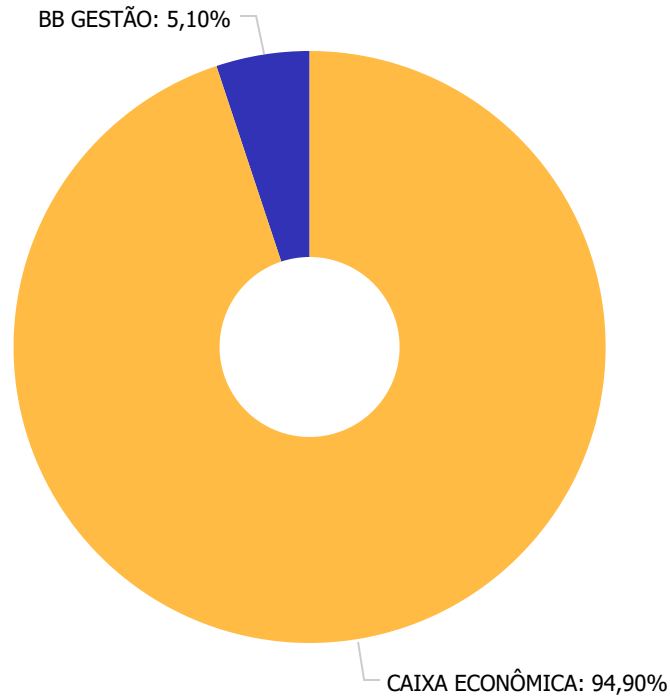
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2019 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,12%	9,82%	11,59%	31,48%	13,69%	36,42%	0,06%	0,17%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-41eb-4514-bb76-57777eba6ba



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

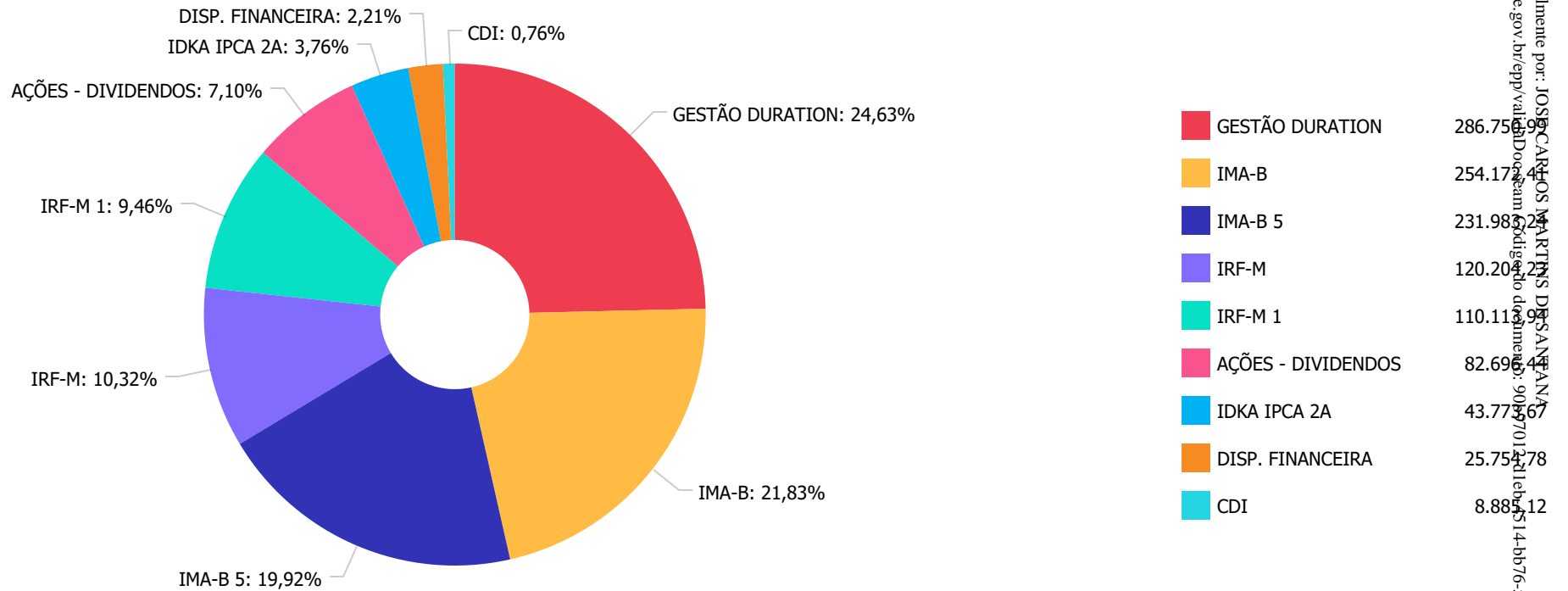


CAIXA ECONÔMICA	1.080.549,89
BB GESTÃO	58.032,21

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 90697012-41eb-4514-bb76-57777eba0ba



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



Documento Assinado Digitalmente por: JOSÉ CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Assinado em: 28/02/2019  
 Acesso em: https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validarDocumento.aspx?codigo\_documento=9089701211e514bb7657777ebad6a

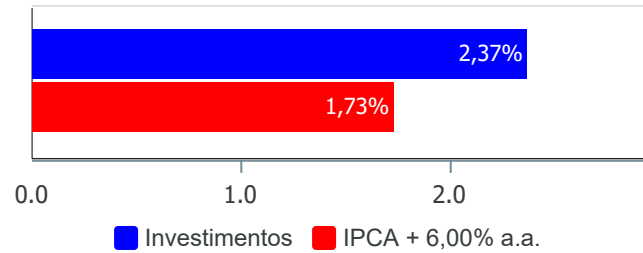




**Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V.R.
Janeiro	759.894,37	898.600,00	466.835,22	1.214.194,54	22.535,39	22.535,39	1,89%	1,89%	0,83%	0,83%	227,40%	1,89%
Fevereiro	1.214.194,54	450.000,00	531.298,05	1.138.580,04	5.683,55	28.218,94	0,47%	2,37%	0,90%	1,73%	136,52%	1,89%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://pccs.leg.br/pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

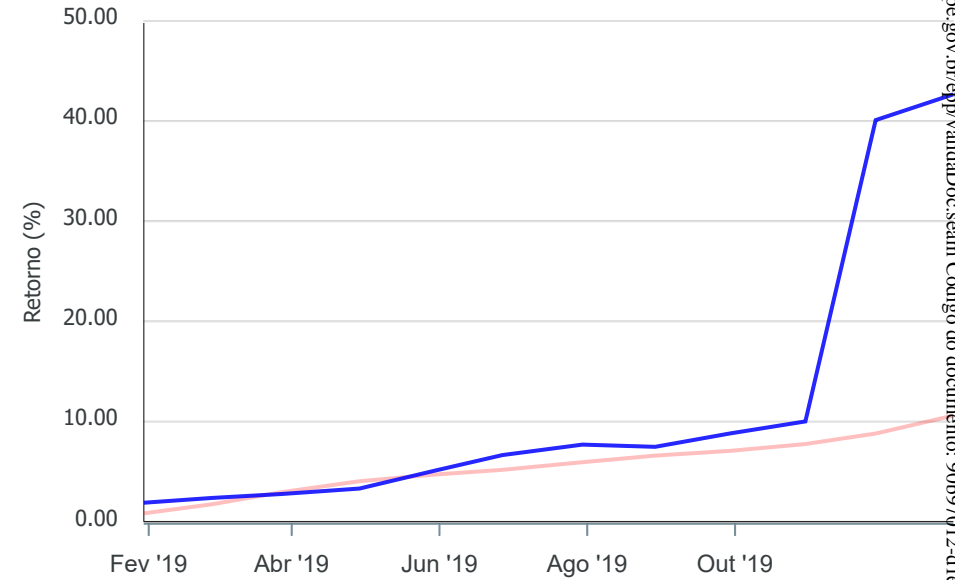


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebada0a



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	101.879,27	150.000,00	0,00	254.172,41	2.293,14	0,91%	0,52%	2,41%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	92.338,02	150.000,00	200.000,00	43.773,67	1.435,65	0,59%	0,56%	0,63%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	268.078,83	0,00	37.500,00	231.983,24	1.404,41	0,52%	0,52%	0,79%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	285.320,64	0,00	0,00	286.750,99	1.430,35	0,50%	0,50%	2,41%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	57.983,14	0,00	198,05	58.039,21	254,12	0,44%	0,44%	0,08%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	101.191,86	150.000,00	200.000,00	52.074,73	882,87	0,35%	0,45%	0,08%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	102.152,68	0,00	93.600,00	8.867,05	314,37	0,31%	0,48%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	119.874,12	0,00	0,00	120.204,23	330,11	0,28%	0,28%	0,98%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	18,05	0,00	0,00	18,07	0,02	0,11%	0,09%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.128.836,61</b>	<b>450.000,00</b>	<b>531.298,05</b>	<b>1.055.883,60</b>	<b>8.345,04</b>	<b>0,53%</b>		<b>1,55%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinse em: https://sccs.cespe.gov.br/ggp/vizualDoce/signCodigo do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	85.357,93	0,00	0,00	82.696,44	-2.661,49	-3,12%	-3,12%	6,19%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>85.357,93</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>82.696,44</b>	<b>-2.661,49</b>	<b>-3,12%</b>		<b>6,19%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinse em: https://etcc.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6a



# Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º trimestre de 2019

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://sps7.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

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



**Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2019)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	255.596,01	24,12%	777	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	52.305,88	4,94%	1.454	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	233.756,64	22,06%	782	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	58.293,66	5,50%	1.248	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	120.864,75	11,40%	368	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	44.063,36	4,16%	830	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	18,09	0,00%	15.747	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	205.174,91	19,36%	416	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.908,40	0,84%	832	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	80.817,06	7,63%	1.532	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>1.059.798,76</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>4.483,15</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>1.064.281,91</b>				

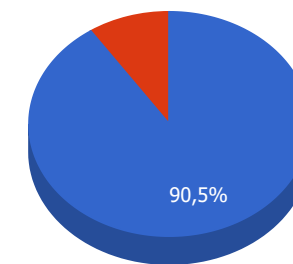
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: [https://etec.tce.pe.gov.br/epi/validarDoc?seam\\_codigo\\_documento:90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6a](https://etec.tce.pe.gov.br/epi/validarDoc?seam_codigo_documento:90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6a)



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	764.880,30	72,17%	50,00%	60,00%	100,00%	294.918,46
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	635.879,26
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	8.926,49	0,84%	0,00%	20,00%	40,00%	414.993,01
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>773.806,79</b>	<b>73,01%</b>	<b>50,00%</b>	<b>90,00%</b>	<b>200,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**



● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

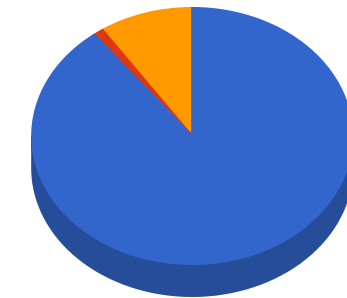
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	80.817,06	7,63%	0,00%	5,00%	20,00%	131.142,69
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	105.979,88
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>80.817,06</b>	<b>7,63%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>30,00%</b>	

**Distribuição por Artigos**



- 7º I b
- 7º IV a
- 8º II a

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba





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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	1.001.505,10	94,50	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	58.293,66	5,50	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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,67%	2,48%	2,48%	5,97%	9,19%	22,74%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,66%	2,50%	2,50%	5,99%	8,71%	21,23%	0,01%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,47%	1,53%	1,53%	3,59%	6,68%	16,65%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	1,46%	1,46%	3,49%	6,45%	16,15%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,44%	1,47%	1,47%	3,51%	6,50%	16,26%	0,00%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,78%	2,90%	2,90%	7,68%	9,19%	22,26%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,76%	2,85%	2,85%	7,64%	9,00%	21,82%	0,01%	0,03%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	0,58%	5,54%	5,54%	15,99%	13,71%	25,92%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,56%	5,52%	5,52%	15,95%	13,52%	25,44%	0,04%	0,06%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,59%	2,28%	2,28%	8,65%	9,14%	23,19%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,55%	2,19%	2,19%	8,77%	8,90%	22,66%	0,02%	0,04%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,47%	1,51%	1,51%	3,07%	6,34%	15,26%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,47%	1,49%	1,49%	3,01%	6,18%	15,01%	0,00%	0,00%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etec.ice.pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa0ba



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,09%	0,29%	0,29%	0,58%	1,18%	4,44%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



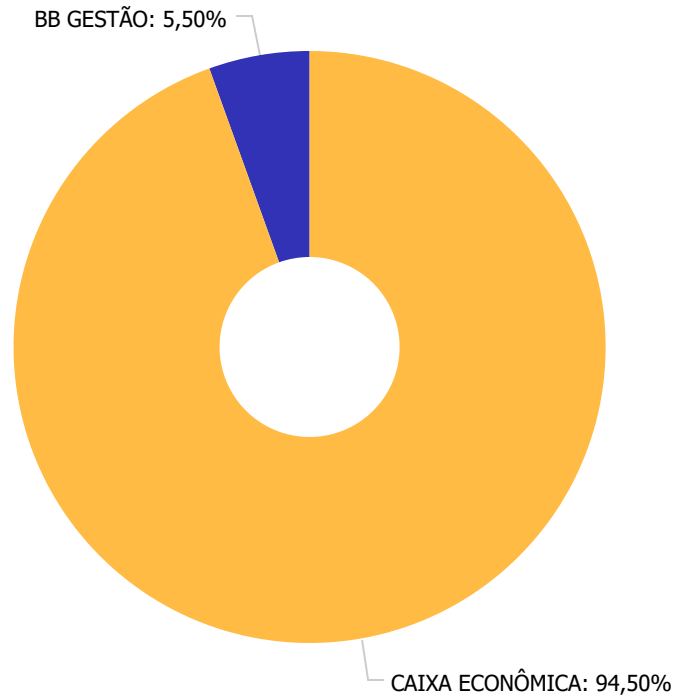
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,27%	7,32%	7,32%	29,10%	13,16%	34,62%	0,09%	0,17%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-41eb-4514-bb76-57777eba6ba



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

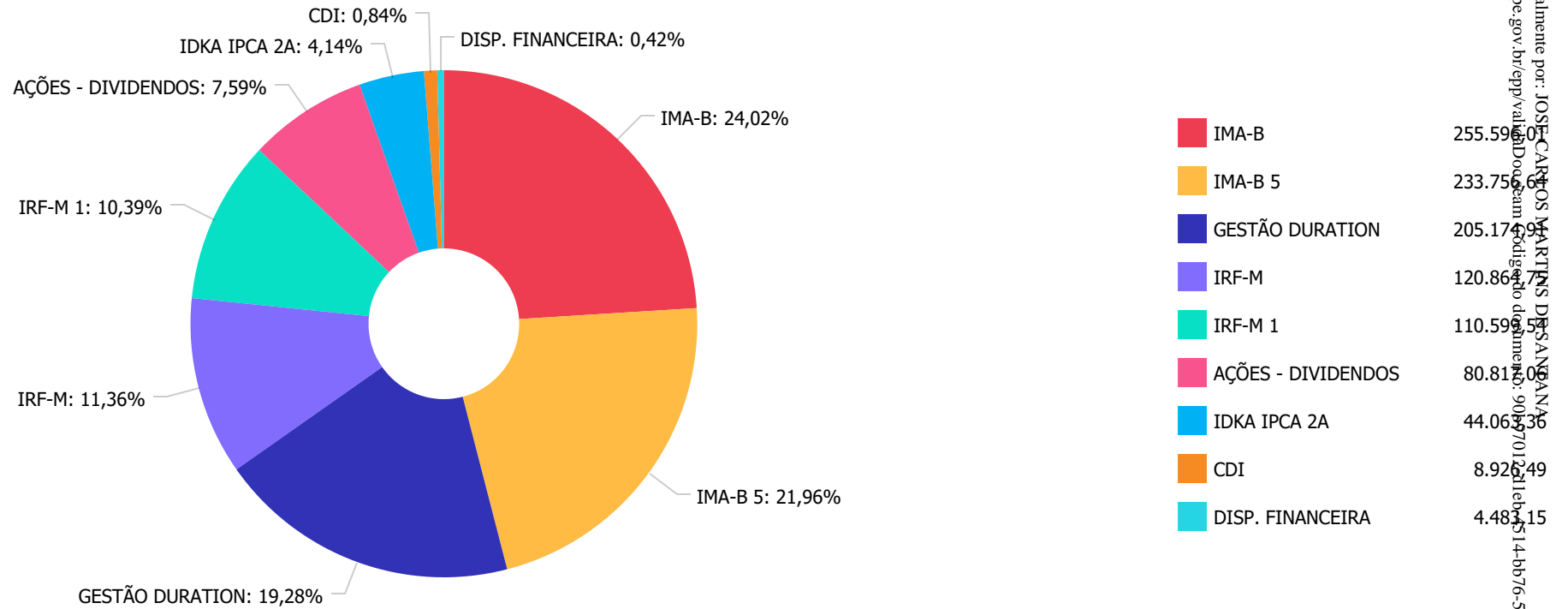


CAIXA ECONÔMICA	1.001.501,15
BB GESTÃO	58.299,66

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 90697012-11eb-4514-bb76-57777eba0ba



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



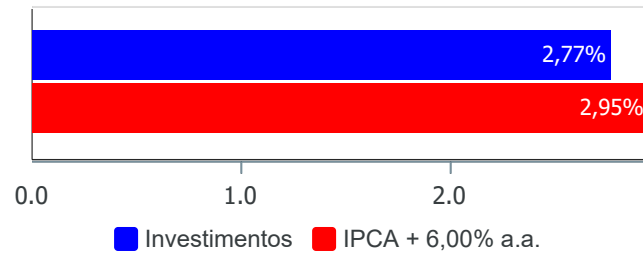
Documento Assinado Digitalmente por: JOSÉ CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesso em: https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validarDocumentoSam4Podis47do documento: 9089701211eb7514bb76-57777ebad6a



**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	VR
Janeiro	759.894,37	898.600,00	466.835,22	1.214.194,54	22.535,39	22.535,39	1,89%	1,89%	0,83%	0,83%	227,40%	1,89%
Fevereiro	1.214.194,54	450.000,00	531.298,05	1.138.580,04	5.683,55	28.218,94	0,47%	2,37%	0,90%	1,73%	136,52%	1,89%
Março	1.138.580,04	0,00	83.200,00	1.059.798,76	4.418,72	32.637,66	0,39%	2,77%	1,19%	2,95%	93,77%	2,77%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://pccs169.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

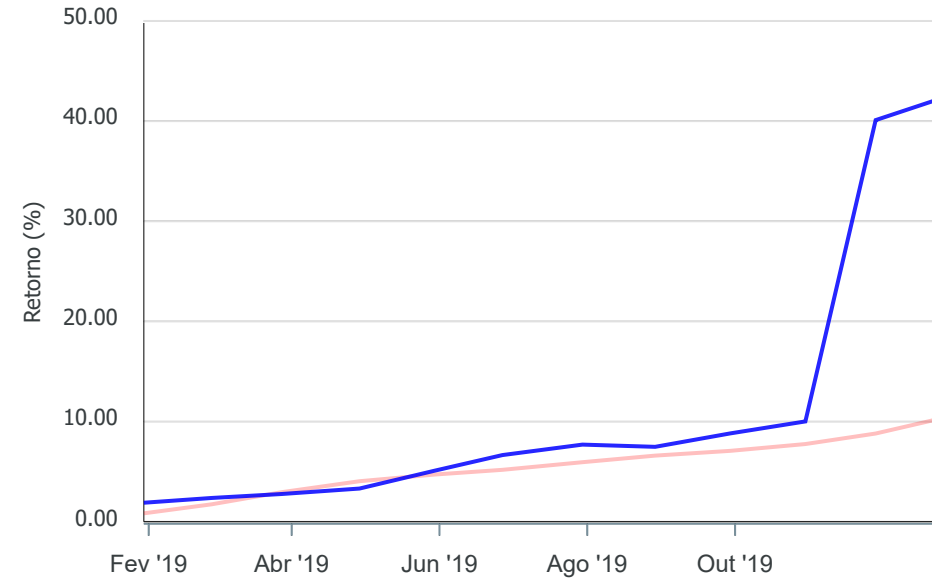


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebada0a





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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	231.983,24	0,00	0,00	233.756,64	1.773,40	0,76%	0,76%	1,21%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	43.773,67	0,00	0,00	44.063,36	289,69	0,66%	0,66%	0,93%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	286.750,99	0,00	83.200,00	205.174,91	1.623,92	0,57%	0,54%	4,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	254.172,41	0,00	0,00	255.596,01	1.423,60	0,56%	0,56%	4,05%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	120.204,23	0,00	0,00	120.864,75	660,52	0,55%	0,55%	1,67%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.867,05	0,00	0,00	8.908,40	41,35	0,47%	0,47%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	52.074,73	0,00	0,00	52.305,88	231,15	0,44%	0,44%	0,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	58.039,21	0,00	0,00	58.293,66	254,45	0,44%	0,44%	0,11%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	18,07	0,00	0,00	18,09	0,02	0,11%	0,09%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.055.883,60</b>	<b>0,00</b>	<b>83.200,00</b>	<b>978.981,70</b>	<b>6.298,10</b>	<b>0,60%</b>		<b>2,45%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinatura em: https://sistemas.fundapar.com.br/gestao-fundapar/validarDocumento.aspx?CodigoDocumento=90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	82.696,44	0,00	0,00	80.817,06	-1.879,38	-2,27%	-2,27%	8,85%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>82.696,44</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>80.817,06</b>	<b>-1.879,38</b>	<b>-2,27%</b>		<b>8,85%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Assinse em: https://etcc.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2019

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	85.836,93	200.000,00	89.878,00	205.174,91	9.215,98	3,22%	3,96%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	75.099,79	200.000,00	47.606,10	233.756,64	6.262,95	2,28%	2,85%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	250.000,00	0,00	255.596,01	5.596,01	2,24%	5,52%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	189.775,81	250.000,00	400.000,00	44.063,36	4.287,55	0,97%	2,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	211.373,81	250.000,00	411.500,00	52.305,88	2.432,07	0,53%	1,47%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	118.600,00	0,00	120.864,75	2.264,75	1,91%	2,19%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	140.138,52	0,00	132.151,12	8.908,40	921,00	0,66%	1,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	57.651,47	0,00	198,05	58.293,66	840,24	1,46%	1,46%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	18,04	0,00	0,00	18,09	0,05	0,28%	0,29%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>31.820,60</b>	<b>3,36%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinatura em: https://scc.cnpj.gov.br/gpp/validarDocumentoCodigo do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2019

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inst
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	80.000,00	0,00	80.817,06	817,06	1,02%	7,32%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>817,06</b>	<b>1,02%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinse em: https://etec.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



# Relatório Analítico dos Investimentos

## em abril de 2019

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

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

**LEMA**  
ECONOMIA & FINANÇAS



**Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2019)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	48.715,11	5,82%	376	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	56.749,30	6,77%	805	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	140.964,78	16,83%	852	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	46.119,91	5,51%	1.449	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	199.167,31	<b>23,78%</b>	811	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	58.584,15	6,99%	1.248	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4,32	0,00%	839	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	106.303,00	12,69%	454	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	50.351,62	6,01%	324	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	48.985,47	5,85%	81	0,02%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	81.715,63	9,76%	1.576	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>837.660,60</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>3.865,27</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>841.525,87</b>				

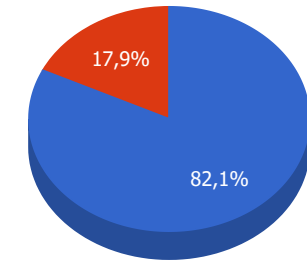
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epi/validarDoc?seamCodigoDocumento:90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba>



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	550.300,56	65,69%	50,00%	60,00%	100,00%	287.360,04
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	502.596,36
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	50.355,94	6,01%	0,00%	20,00%	40,00%	284.708,30
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>600.656,50</b>	<b>71,71%</b>	<b>50,00%</b>	<b>90,00%</b>	<b>200,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**



● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

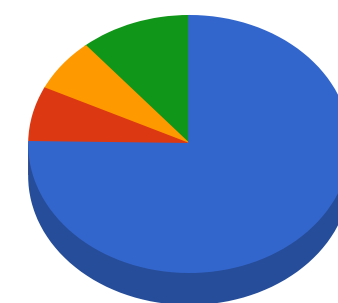
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90697012-41eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	48.985,47	5,85%	0,00%	0,00%	0,00%	-48.985,47
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	81.715,63	9,76%	0,00%	5,00%	20,00%	85.816,49
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	83.766,06
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>130.701,10</b>	<b>15,60%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>30,00%</b>	

**Distribuição por Artigos**



- 7º I b
- 7º IV a
- 8º I a
- 8º II a

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba





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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	779.076,45	93,01	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	58.584,15	6,99	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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6a



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	1,03%	3,54%	2,25%	5,02%	9,41%	22,74%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07%	3,60%	2,30%	4,94%	9,02%	21,57%	0,01%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,50%	2,03%	1,45%	3,16%	6,68%	16,65%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	1,97%	1,38%	3,05%	6,47%	15,74%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	1,98%	1,40%	3,07%	6,52%	15,85%	0,00%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	1,11%	4,03%	2,46%	5,60%	9,94%	22,26%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08%	3,95%	2,38%	5,53%	9,73%	22,29%	0,01%	0,03%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	1,51%	7,13%	2,65%	9,89%	15,59%	25,92%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,49%	7,09%	2,59%	9,82%	15,40%	27,74%	0,02%	0,06%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,61%	2,90%	1,49%	5,51%	9,30%	23,19%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,56%	2,76%	1,39%	5,32%	9,12%	22,77%	0,01%	0,04%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,52%	2,04%	1,49%	3,05%	6,34%	15,26%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,51%	2,00%	1,46%	2,99%	6,18%	14,69%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,45%	1,76%	1,28%	2,63%	5,46%	13,09%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etcc.cef.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



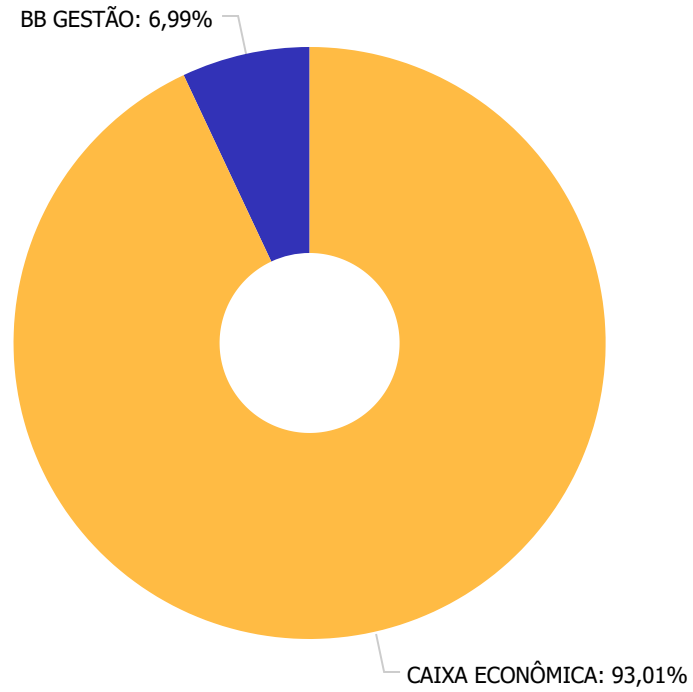
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2019 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	0,98%	9,63%	-1,07%	10,21%	11,89%	46,83%	-	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	0,94%	9,40%	-1,10%	10,00%	11,36%	45,59%	0,08%	0,22%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,11%	8,51%	-4,27%	16,26%	17,60%	35,04%	0,06%	0,17%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etcce.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba6ba



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



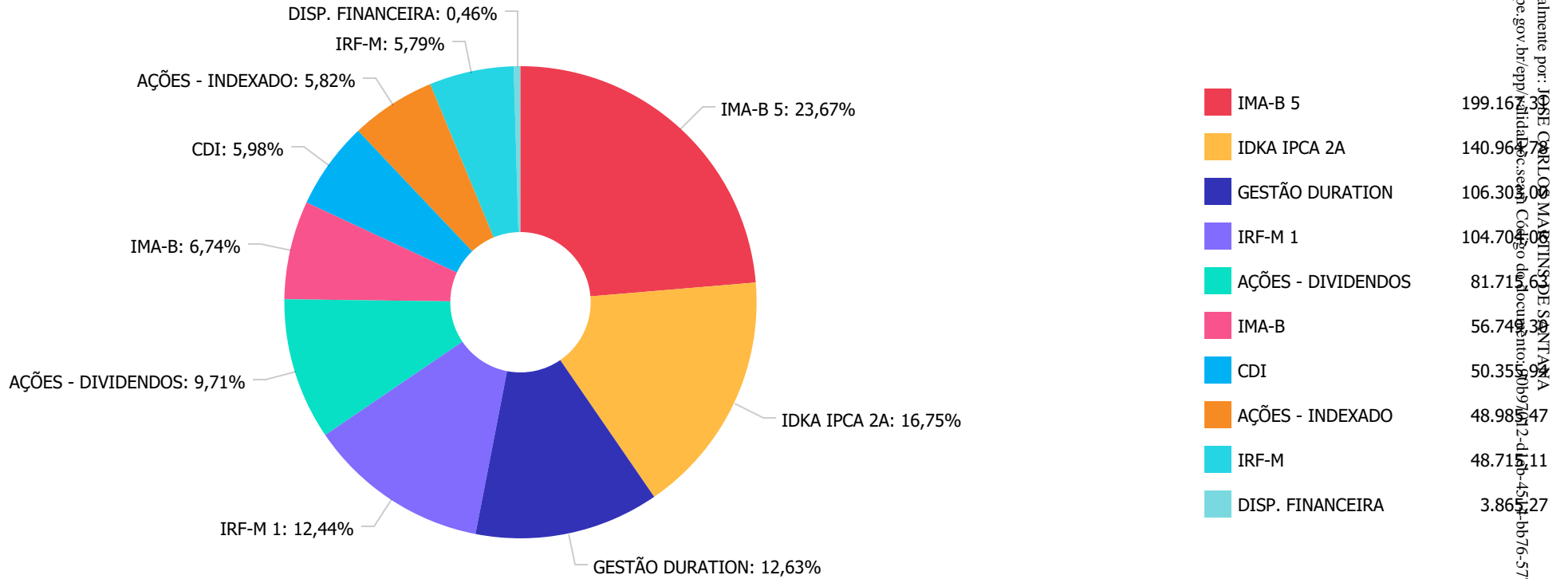
CAIXA ECONÔMICA	779.074,40
BB GESTÃO	58.581,15

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



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

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesso em: https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validador.aspx?secao=Cofre do documento: 15069762-41b-451-bb76-57777ebaa0ba

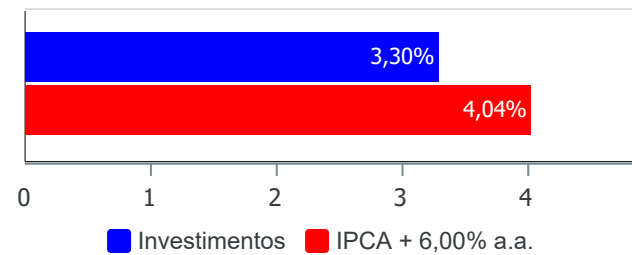




**Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V
Janeiro	759.894,37	898.600,00	466.835,22	1.214.194,54	22.535,39	22.535,39	1,89%	1,89%	0,83%	0,83%	227,40%	1,89%
Fevereiro	1.214.194,54	450.000,00	531.298,05	1.138.580,04	5.683,55	28.218,94	0,47%	2,37%	0,90%	1,73%	136,52%	1,89%
Março	1.138.580,04	0,00	83.200,00	1.059.798,76	4.418,72	32.637,66	0,39%	2,77%	1,19%	2,95%	93,77%	2,18%
Abril	1.059.798,76	1.226.962,99	1.460.963,04	837.660,60	11.861,89	44.499,55	0,52%	3,30%	1,06%	4,04%	81,65%	1,89%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: https://doc.leg.br/validador/validadorDoc.seam?codigo\_documento:90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6a

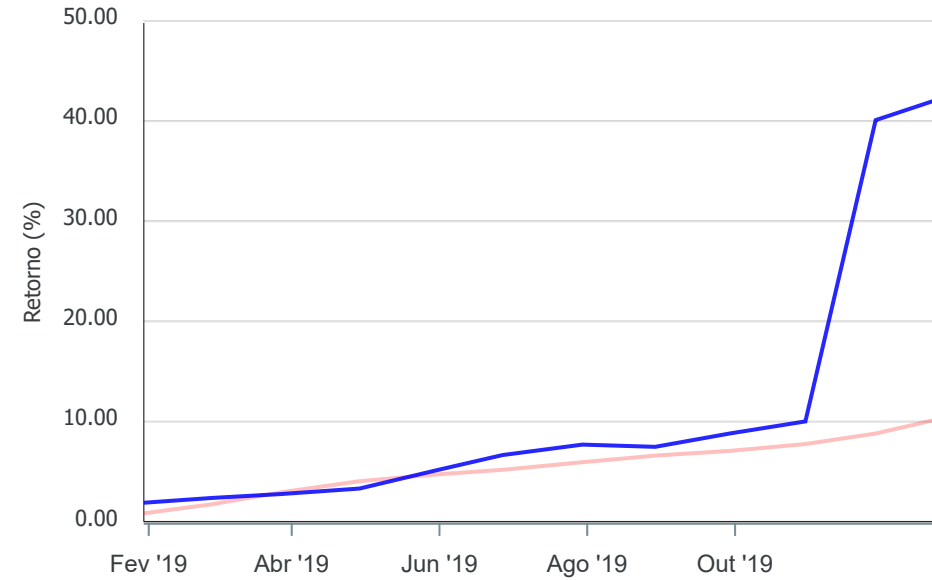


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777e8a606a



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	233.756,64	62.932,15	100.000,00	199.167,31	2.478,52	0,84%	1,08%	0,64%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	44.063,36	195.000,00	100.000,00	140.964,78	1.901,42	0,80%	1,07%	0,56%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	255.596,01	0,00	200.733,97	56.749,30	1.887,26	0,74%	1,49%	1,62%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	205.174,91	0,00	100.000,00	106.303,00	1.128,09	0,55%	1,11%	1,41%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	58.293,66	0,00	0,00	58.584,15	290,49	0,50%	0,50%	0,09%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	120.864,75	83.000,00	156.000,00	48.715,11	850,36	0,42%	0,56%	0,84%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	52.305,88	193.169,11	200.000,00	46.119,91	644,92	0,26%	0,50%	0,08%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.908,40	0,00	8.925,54	4,32	21,46	0,24%	0,51%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00	67.918,10	17.702,95	50.351,62	136,47	0,20%	0,45%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	18,09	577.500,00	577.600,58	0,00	82,49	0,01%	0,10%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>978.981,70</b>	<b>1.179.519,36</b>	<b>1.460.963,04</b>	<b>706.959,50</b>	<b>9.421,48</b>	<b>0,44%</b>		<b>0,70%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinatura em: https://sistemas.cnpj.gov.br/v/validar/DadosAssinaturaCodigo do Documento: 90697012-11eb-4514-bb76-57777ebada0a





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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	47.443,63	0,00	48.985,47	1.541,84	3,25%	0,94%	8,11%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	80.817,06	0,00	0,00	81.715,63	898,57	1,11%	1,11%	5,52%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>80.817,06</b>	<b>47.443,63</b>	<b>0,00</b>	<b>130.701,10</b>	<b>2.440,41</b>	<b>1,90%</b>		<b>6,49%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinatura em: https://etcc.etc.br/pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6a



# Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2019

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

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



**Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2019)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	46.639,80	6,15%	1.439	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	101.140,67	13,33%	864	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	47.306,94	6,23%	385	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	58.962,49	7,77%	1.253	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	194.270,01	<b>25,60%</b>	854	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	41.938,35	5,53%	897	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	136.209,96	17,95%	513	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	371,59	0,05%	329	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	49.336,35	6,50%	86	0,01%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	82.701,25	10,90%	1.627	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>758.877,41</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>8.059,60</b>				Artigo 6º
			<b>PL Total</b>	<b>766.937,01</b>			

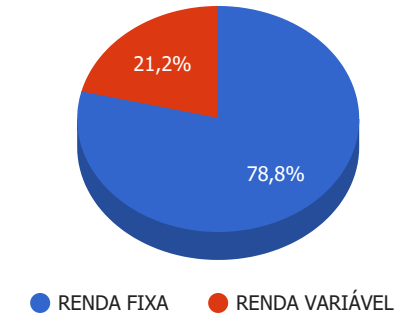
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epi/validarDoc?seamCodigoDoDocumento:90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba>



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	490.258,26	64,60%	50,00%	60,00%	100,00%	268.619,15
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	455.326,45
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	371,59	0,05%	0,00%	20,00%	40,00%	303.179,37
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>490.629,85</b>	<b>64,65%</b>	<b>50,00%</b>	<b>90,00%</b>	<b>200,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**



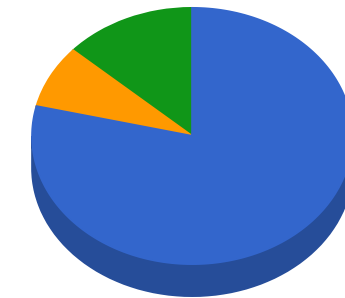
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90697012-41eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	49.336,35	6,50%	0,00%	0,00%	0,00%	-49.336,35
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	82.701,25	10,90%	0,00%	5,00%	20,00%	69.074,23
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	75.887,74
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>132.037,60</b>	<b>17,40%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>30,00%</b>	

**Distribuição por Artigos**



- 7º I b
- 8º I a
- 8º II a
- Outro

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	699.914,92	92,23	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	58.962,49	7,77	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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	1,37%	4,95%	3,10%	6,27%	12,05%	24,00%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,06%	4,70%	2,82%	5,91%	11,05%	22,36%	0,01%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,68%	2,72%	1,66%	3,30%	7,19%	15,95%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	2,62%	1,59%	3,17%	6,96%	15,46%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,65%	2,64%	1,61%	3,20%	7,01%	15,56%	0,00%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	1,39%	5,47%	3,31%	6,91%	13,22%	24,34%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,37%	5,38%	3,25%	6,83%	13,03%	23,86%	0,01%	0,03%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	3,66%	11,06%	5,83%	12,89%	23,73%	34,52%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,63%	10,98%	5,77%	12,79%	23,51%	33,98%	0,02%	0,06%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	1,77%	4,72%	2,99%	6,33%	13,33%	25,08%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,73%	4,54%	2,86%	6,08%	13,17%	24,52%	0,01%	0,03%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,54%	2,59%	1,54%	3,10%	6,37%	14,52%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,47%	2,24%	1,33%	2,67%	5,49%	12,66%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etcc.tce.pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2019 - RENDA VARIÁVEL**

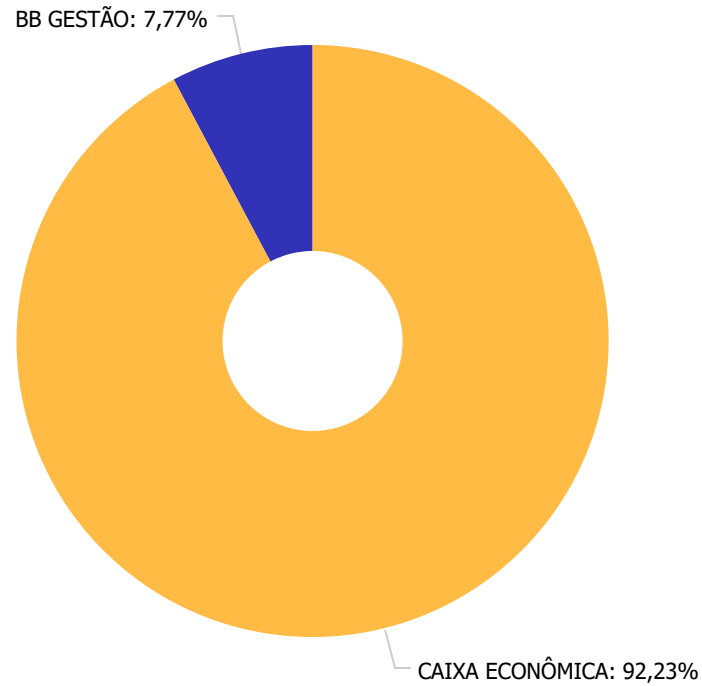
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	0,70%	10,40%	1,51%	8,41%	26,42%	54,73%	-	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	0,72%	10,19%	1,46%	8,26%	25,82%	52,88%	0,09%	0,22%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,21%	9,82%	0,01%	11,59%	28,27%	41,61%	0,08%	0,16%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etec.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6a





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

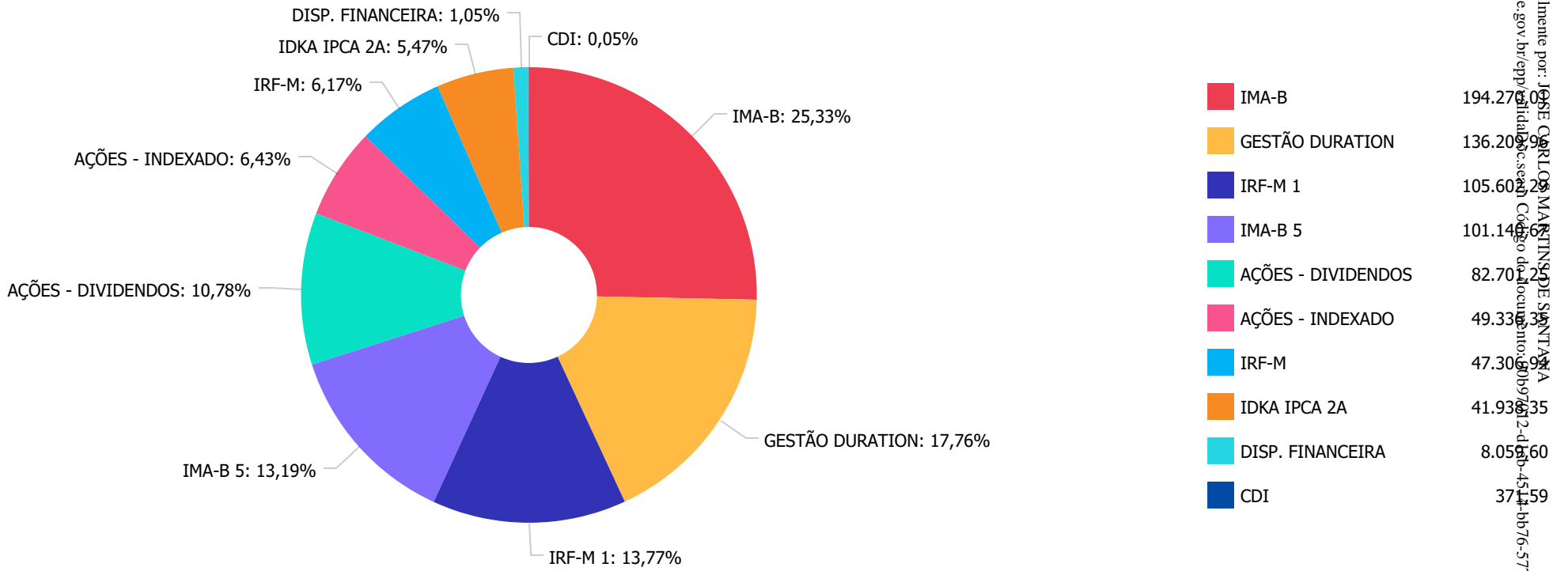


CAIXA ECONÔMICA	699.915.920,00
BB GESTÃO	58.964.080,00

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



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



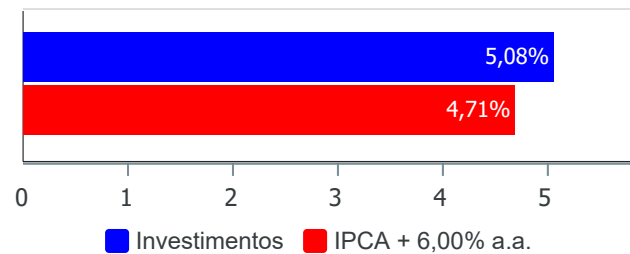
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesso em: https://etc.ce.gov.br/epp/validarDoc.aspx?secaoCodigo do documento: 5009782-d-80-45-14-bb76-57777ebad0a



**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	Variac
Janeiro	759.894,37	898.600,00	466.835,22	1.214.194,54	22.535,39	22.535,39	1,89%	1,89%	0,83%	0,83%	227,40%	1,06%
Fevereiro	1.214.194,54	450.000,00	531.298,05	1.138.580,04	5.683,55	28.218,94	0,47%	2,37%	0,90%	1,73%	136,52%	1,06%
Março	1.138.580,04	0,00	83.200,00	1.059.798,76	4.418,72	32.637,66	0,39%	2,77%	1,19%	2,95%	93,77%	2,00%
Abril	1.059.798,76	1.226.962,99	1.460.963,04	837.660,60	11.861,89	44.499,55	0,52%	3,30%	1,06%	4,04%	81,65%	1,06%
Maio	837.660,60	526.504,33	619.742,83	758.877,41	14.455,31	58.954,86	1,73%	5,08%	0,64%	4,71%	107,96%	2,00%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: https://app.viudadoc.com/Doc/90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba6ba

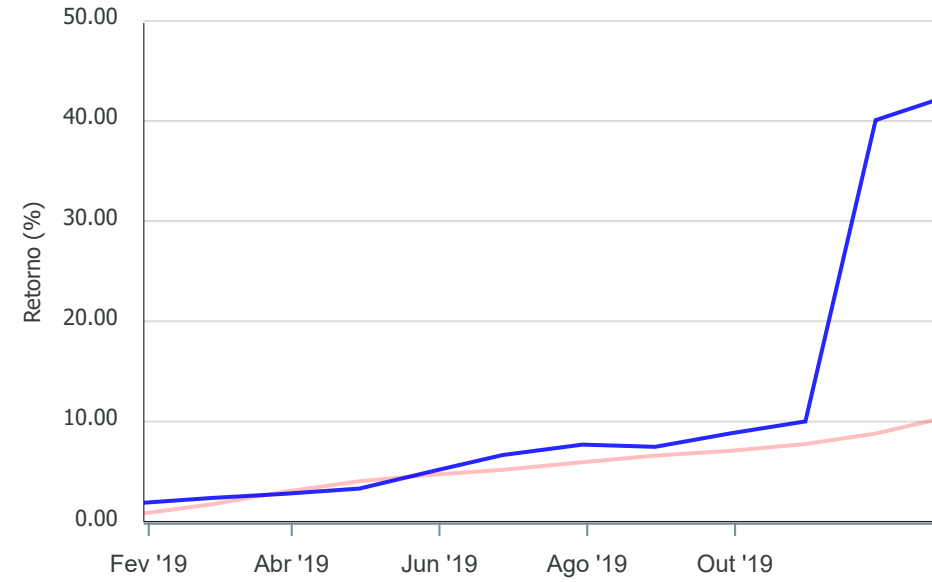


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebada0a



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	56.749,30	200.000,00	67.510,00	194.270,01	5.030,71	1,96%	3,63%	2,13%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	48.715,11	0,00	2.221,80	47.306,94	813,63	1,67%	1,73%	1,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	106.303,00	126.504,33	100.000,00	136.209,96	3.402,63	1,46%	2,72%	1,51%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	199.167,31	0,00	100.000,00	101.140,67	1.973,36	0,99%	1,37%	0,86%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	140.964,78	0,00	100.000,00	41.938,35	973,57	0,69%	1,06%	0,63%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	58.584,15	0,00	0,00	58.962,49	378,34	0,65%	0,65%	0,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4,32	0,00	4,33	0,00	0,01	0,23%	0,54%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	46.119,91	200.000,00	200.000,00	46.639,80	519,89	0,21%	0,65%	0,10%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	50.351,62	0,00	50.006,70	371,59	26,67	0,05%	0,47%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>706.959,50</b>	<b>526.504,33</b>	<b>619.742,83</b>	<b>626.839,81</b>	<b>13.118,81</b>	<b>1,06%</b>		<b>1,26%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinatura em: https://sistemas.ges.br/gsp/validaDocumentoCodigoDocumnto: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	81.715,63	0,00	0,00	82.701,25	985,62	1,21%	1,21%	8,24%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	48.985,47	0,00	0,00	49.336,35	350,88	0,72%	0,72%	9,46%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>130.701,10</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>132.037,60</b>	<b>1.336,50</b>	<b>1,02%</b>		<b>8,69%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinatura em: https://cfc.ces.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba6ba



# Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2019

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

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



**Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2019)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	58.202,03	8,95%	889	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	59.300,06	9,12%	1.250	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	304.751,84	<b>46,88%</b>	909	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	71.201,51	10,95%	560	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	0,01	0,00%	328	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	21.108,20	3,25%	91	0,01%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	50.000,00	7,69%	534	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	85.553,77	13,16%	1.645	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>650.117,42</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>24.772,23</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>674.889,65</b>				

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epi/validaDoc?seamCodigoDoDocumento:90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6a>

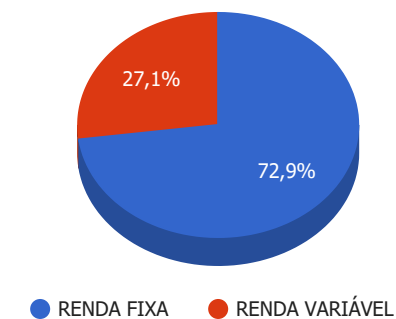




**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Junho / 2019)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	422.253,93	64,95%	50,00%	60,00%	100,00%	227.863,49
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	390.070,45
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,01	0,00%	0,00%	20,00%	40,00%	260.046,96
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>422.253,94</b>	<b>64,95%</b>	<b>50,00%</b>	<b>90,00%</b>	<b>200,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**



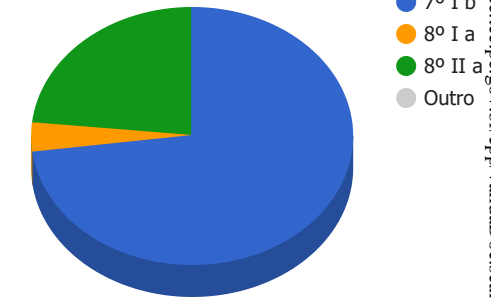
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba06a



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	21.108,20	3,25%	0,00%	0,00%	0,00%	-21.108,20
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	135.553,77	20,85%	0,00%	5,00%	20,00%	-5.530,29
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	65.011,74
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>156.661,97</b>	<b>24,10%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>30,00%</b>	

**Distribuição por Artigos**



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	590.817,36	90,88	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	59.300,06	9,12	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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,58%	3,32%	1,77%	3,32%	7,23%	15,60%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	3,21%	1,73%	3,21%	7,04%	15,12%	0,00%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	1,72%	7,28%	4,27%	7,28%	14,65%	25,81%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,70%	7,17%	4,20%	7,17%	14,47%	25,32%	0,01%	0,03%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	3,73%	15,21%	9,15%	15,21%	28,76%	39,31%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,69%	15,08%	9,06%	15,08%	28,54%	38,72%	0,02%	0,08%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,41%	2,65%	1,33%	2,65%	5,44%	12,28%	0,00%	0,00%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etcc.ice.gov.br/epp/validarDoc?seamCodigoDoDocumento:90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebada6a>



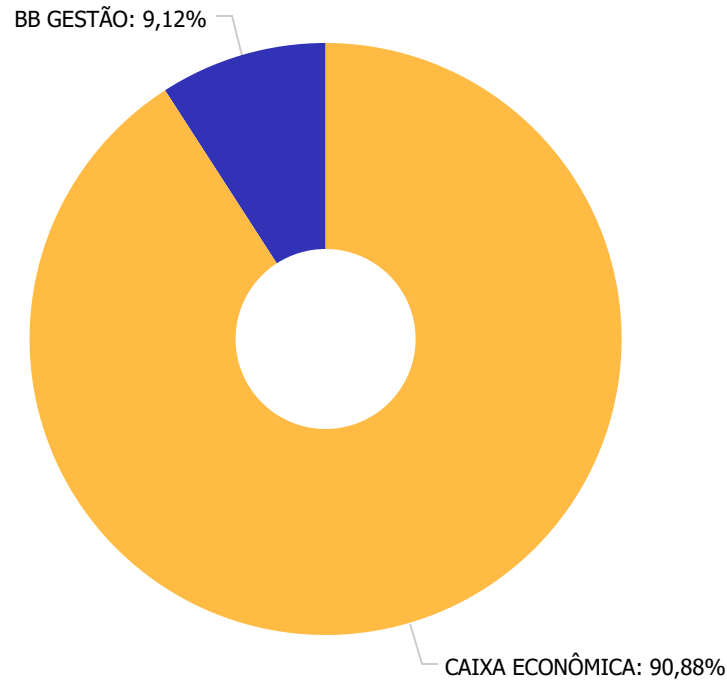
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2019 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	4,06%	14,88%	5,82%	14,88%	38,76%	60,52%	-	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	3,99%	14,58%	5,72%	14,58%	38,05%	58,69%	0,08%	0,16%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,45%	13,61%	5,86%	13,61%	41,58%	47,38%	0,05%	0,19%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etecfcp.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



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

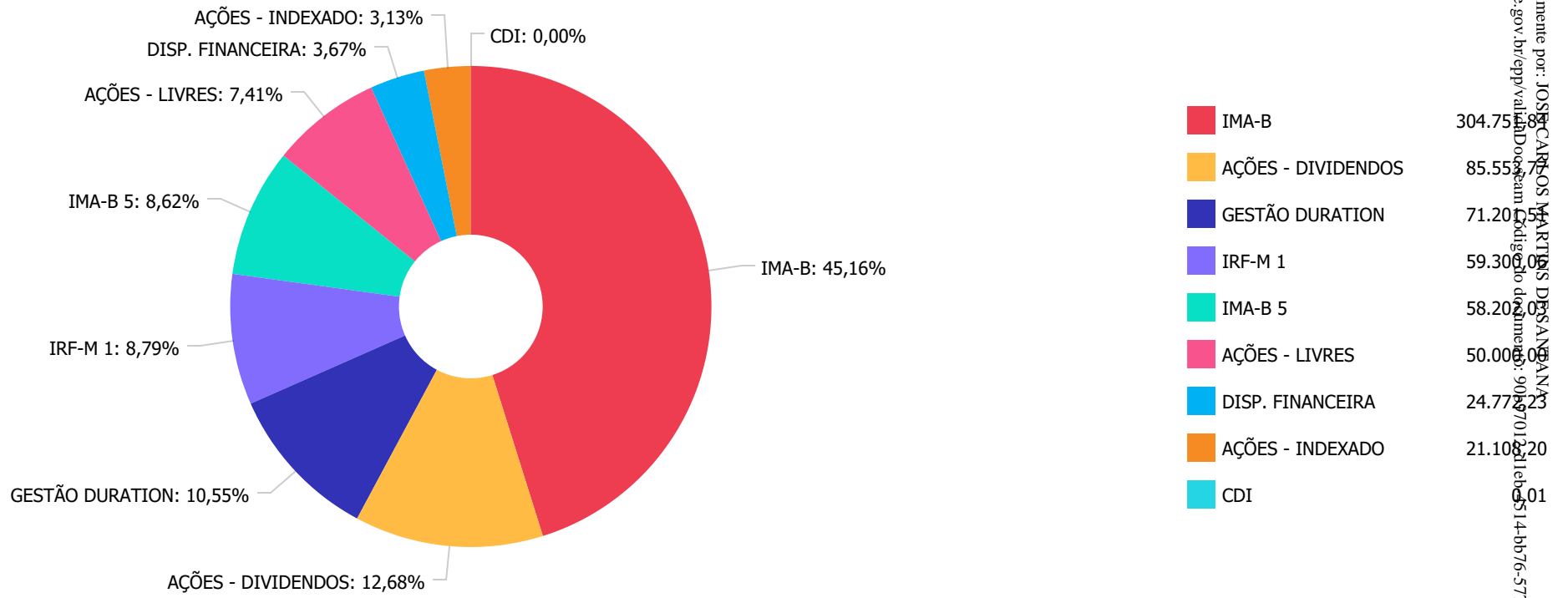


CAIXA ECONÔMICA	590.813,30
BB GESTÃO	59.300,00

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



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



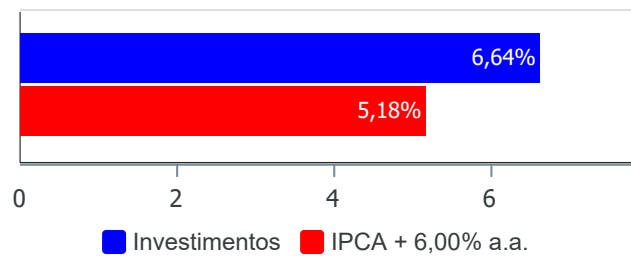
Documento Assinado Digitalmente por: JOSÉ CARLOS MARTINS DE SÁ BARRA  
 Acesso em: https://etc.ce.gov.br/epp/validarDocumento.aspx?CodigoDocumento=908701211eb05144bb76-57777ebad0a



**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	759.894,37	898.600,00	466.835,22	1.214.194,54	22.535,39	22.535,39	1,89%	1,89%	0,83%	0,83%	227,40%	1,89%
Fevereiro	1.214.194,54	450.000,00	531.298,05	1.138.580,04	5.683,55	28.218,94	0,47%	2,37%	0,90%	1,73%	136,52%	1,89%
Março	1.138.580,04	0,00	83.200,00	1.059.798,76	4.418,72	32.637,66	0,39%	2,77%	1,19%	2,95%	93,77%	2,89%
Abril	1.059.798,76	1.226.962,99	1.460.963,04	837.660,60	11.861,89	44.499,55	0,52%	3,30%	1,06%	4,04%	81,65%	1,89%
Mai	837.660,60	526.504,33	619.742,83	758.877,41	14.455,31	58.954,86	1,73%	5,08%	0,64%	4,71%	107,96%	2,89%
Junho	758.877,41	662.503,40	792.368,82	650.117,42	21.105,43	80.060,29	1,48%	6,64%	0,45%	5,18%	128,27%	2,89%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://brs.cpf.gov.br/brs/validarDocumento.aspx?CodigoDocumento:90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba>



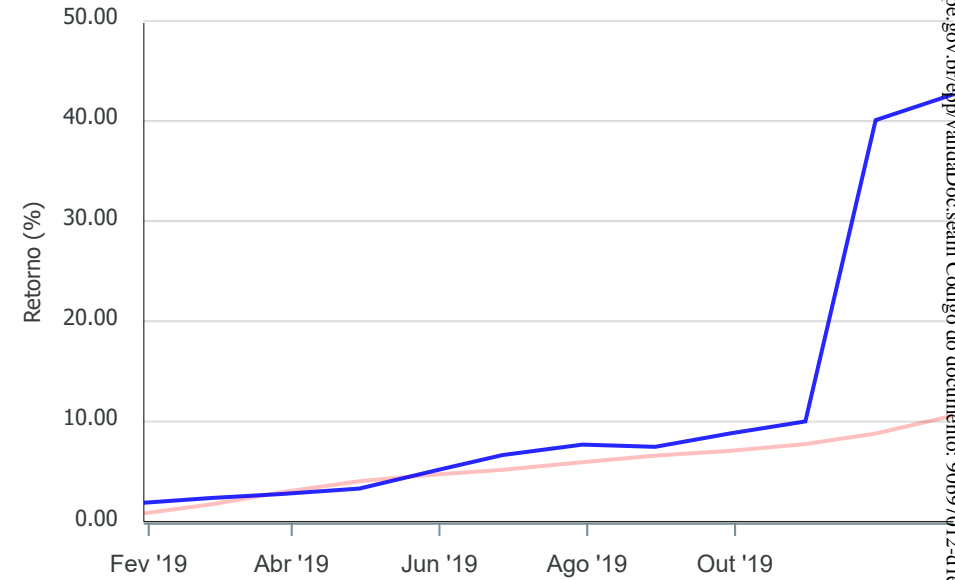


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777e8a606a



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

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	194.270,01	300.000,00	200.000,00	304.751,84	10.481,83	2,12%	3,69%	2,31%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	136.209,96	112.503,40	180.998,00	71.201,51	3.486,15	1,40%	2,73%	1,65%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	47.306,94	0,00	47.922,29	0,00	615,35	1,30%	2,15%	1,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	41.938,35	0,00	42.193,17	0,00	254,82	0,61%	1,22%	0,95%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	58.962,49	0,00	0,00	59.300,06	337,57	0,57%	0,57%	0,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	46.639,80	0,00	46.848,49	0,00	208,69	0,45%	0,57%	0,15%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	101.140,67	200.000,00	244.035,00	58.202,03	1.096,36	0,36%	1,70%	1,34%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	371,59	0,00	371,87	0,01	0,29	0,08%	0,41%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>626.839,81</b>	<b>612.503,40</b>	<b>762.368,82</b>	<b>493.455,45</b>	<b>16.481,06</b>	<b>1,33%</b>		<b>1,85%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinatura em: https://sistemas.lemas.com.br/gestao/assinatura/validarDocumentoCodigo do Documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	49.336,35	0,00	30.000,00	21.108,20	1.771,85	3,59%	3,99%	7,54%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	82.701,25	0,00	0,00	85.553,77	2.852,52	3,45%	3,45%	5,42%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,00	50.000,00	0,00	50.000,00	0,00	0,00%	0,00%	-
<b>Total Renda Variável</b>	<b>132.037,60</b>	<b>50.000,00</b>	<b>30.000,00</b>	<b>156.661,97</b>	<b>4.624,37</b>	<b>3,04%</b>		<b>5,84%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Assinatura em: https://cdec.tce.pe.gov.br/gpd/validaDoc.seam Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2019

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	255.596,01	500.000,00	468.243,97	304.751,84	17.399,80	2,30%	9,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	205.174,91	239.007,73	380.998,00	71.201,51	8.016,87	1,80%	6,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	233.756,64	262.932,15	444.035,00	58.202,03	5.548,24	1,12%	4,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	44.063,36	195.000,00	242.193,17	0,00	3.129,81	1,31%	3,39%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	120.864,75	83.000,00	206.144,09	0,00	2.279,34	1,12%	4,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	52.305,88	393.169,11	446.848,49	0,00	1.373,50	0,31%	1,74%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	58.293,66	0,00	0,00	59.300,06	1.006,40	1,73%	1,73%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00	67.918,10	68.081,52	0,01	163,43	0,24%	1,33%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	18,09	577.500,00	577.600,58	0,00	82,49	0,01%	0,29%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.908,40	0,00	8.929,87	0,00	21,47	0,24%	1,50%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>39.021,35</b>	<b>1,18%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinatura em: https://atendimento.pe.gov.br/gpp/validaDocumentoCodigo do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2019

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Ins
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	80.817,06	0,00	0,00	85.553,77	4.736,71	5,86%	5,86%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	47.443,63	30.000,00	21.108,20	3.664,57	7,72%	5,72%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,00	50.000,00	0,00	50.000,00	0,00	0,00%	-
<b>Total Renda Variável</b>					<b>8.401,28</b>	<b>5,67%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinse em: https://etcc.cef.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2019

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	750.000,00	468.243,97	304.751,84	22.995,81	3,07%	15,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	85.836,93	439.007,73	470.876,00	71.201,51	17.232,85	3,28%	10,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	75.099,79	462.932,15	491.641,10	58.202,03	11.811,19	2,20%	7,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	189.775,81	445.000,00	642.193,17	0,00	7.417,36	1,17%	5,98%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	201.600,00	206.144,09	0,00	4.544,09	2,25%	6,78%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	211.373,81	643.169,11	858.348,49	0,00	3.805,57	0,45%	3,23%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	57.651,47	0,00	198,05	59.300,06	1.846,64	3,20%	3,21%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	140.138,52	0,00	141.080,99	0,00	942,47	0,67%	3,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00	67.918,10	68.081,52	0,01	163,43	0,24%	2,65%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	18,04	577.500,00	577.600,58	0,00	82,54	0,01%	0,58%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>70.841,95</b>	<b>1,63%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinatura em: https://sccs.cnpj.gov.br/gpp/vvalidaDocumentoCodigo: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2019

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Ins
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	80.000,00	0,00	85.553,77	5.553,77	6,94%	13,61%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	47.443,63	30.000,00	21.108,20	3.664,57	7,72%	14,58%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,00	50.000,00	0,00	50.000,00	0,00	0,00%	-
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>9.218,34</b>	<b>6,25%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Assinse em: https://docproc.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



# Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2019

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

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



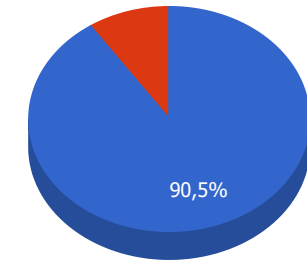




**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Julho / 2019)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	501.935,54	90,51%	50,00%	60,00%	100,00%	52.617,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	332.731,88
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,01	0,00%	0,00%	20,00%	40,00%	221.821,24
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>501.935,55</b>	<b>90,51%</b>	<b>50,00%</b>	<b>90,00%</b>	<b>200,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**



● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

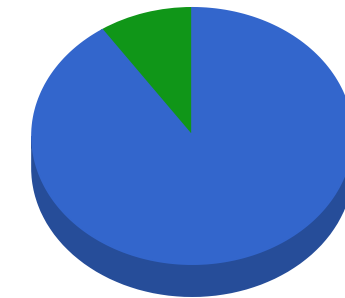
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	52.617,58	9,49%	0,00%	5,00%	20,00%	58.293,05
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	55.455,31
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>52.617,58</b>	<b>9,49%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>30,00%</b>	

**Distribuição por Artigos**



- 7º I b
- 8º II a
- Outro

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	494.838,45	89,23	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	59.714,68	10,77	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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,72%	4,06%	1,99%	3,46%	7,29%	15,22%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	3,93%	1,93%	3,34%	7,06%	14,72%	0,00%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,97%	8,33%	4,13%	6,69%	14,08%	23,52%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	8,18%	4,07%	6,55%	13,88%	23,03%	0,01%	0,03%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	1,29%	16,69%	8,92%	11,81%	27,47%	35,68%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,27%	16,55%	8,83%	11,64%	27,24%	35,12%	0,01%	0,08%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,49%	3,15%	1,37%	2,67%	5,46%	12,01%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,19%	2,42%	0,33%	2,10%	3,22%	7,85%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,11%	12,15%	6,69%	9,01%	16,92%	25,04%	0,01%	0,03%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etcc.cef.gov.br/epp/validarDoc.aspx> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebada6a



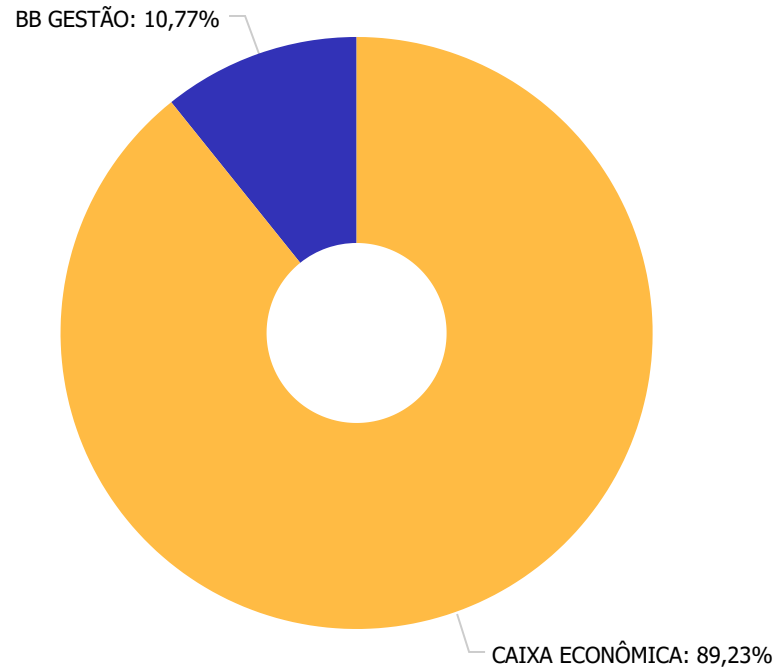
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	0,84%	15,84%	5,67%	4,54%	28,52%	54,45%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5,24%	-	-	-	-	-	0,06%	-

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etcc.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba6ba



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

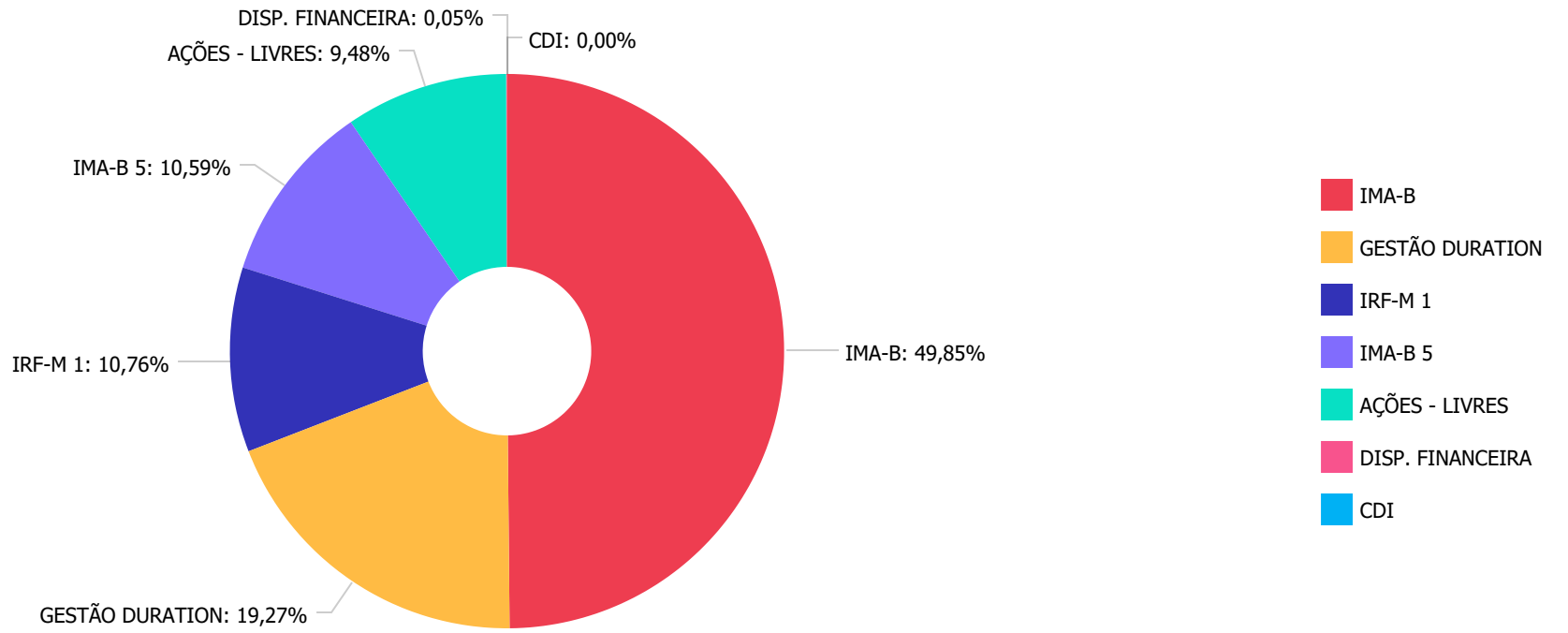


CAIXA ECONÔMICA	494.831.400,00
BB GESTÃO	59.714.600,00

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 90697012-41eb-4514-bb76-57777eba0ba



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



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesso em: https://etc.ce.gov.br/epp/validaDocumento.htm  
 Assinatura: 9097012511eb-4514-bb76-57777ebad6a

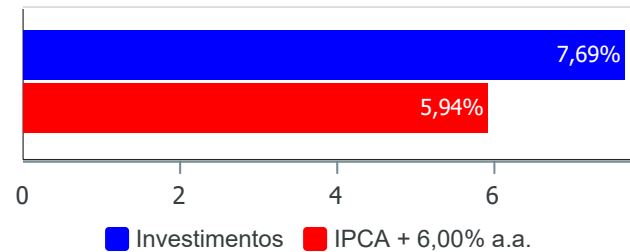




**Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V
Janeiro	759.894,37	898.600,00	466.835,22	1.214.194,54	22.535,39	22.535,39	1,89%	1,89%	0,83%	0,83%	227,40%	1,89%
Fevereiro	1.214.194,54	450.000,00	531.298,05	1.138.580,04	5.683,55	28.218,94	0,47%	2,37%	0,90%	1,73%	136,52%	1,89%
Março	1.138.580,04	0,00	83.200,00	1.059.798,76	4.418,72	32.637,66	0,39%	2,77%	1,19%	2,95%	93,77%	2,89%
Abril	1.059.798,76	1.226.962,99	1.460.963,04	837.660,60	11.861,89	44.499,55	0,52%	3,30%	1,06%	4,04%	81,65%	1,89%
Mai	837.660,60	526.504,33	619.742,83	758.877,41	14.455,31	58.954,86	1,73%	5,08%	0,64%	4,71%	107,96%	2,89%
Junho	758.877,41	662.503,40	792.368,82	650.117,42	21.105,43	80.060,29	1,48%	6,64%	0,45%	5,18%	128,27%	2,89%
Julho	650.117,42	577.996,00	685.591,37	554.553,13	12.031,08	92.091,37	0,98%	7,69%	0,72%	5,94%	129,40%	1,89%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: [https://pcc.lem.pe.gov.br/epi/validar\\_documento.asp?Codigo\\_documento:90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba](https://pcc.lem.pe.gov.br/epi/validar_documento.asp?Codigo_documento:90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba)

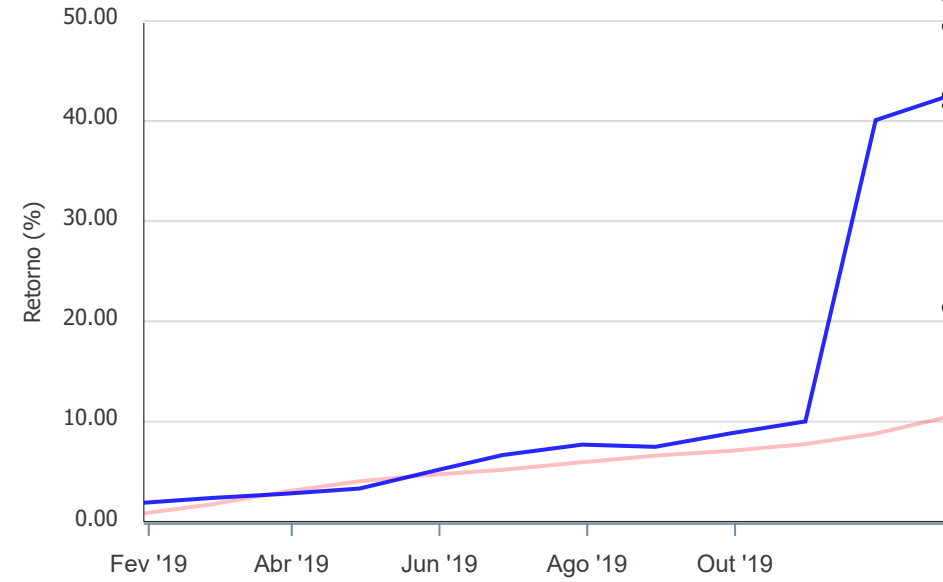


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6a



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	71.201,51	50.000,00	15.678,42	106.889,99	1.366,90	1,13%	1,11%	1,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	58.202,03	0,00	0,00	58.753,32	551,29	0,95%	0,95%	0,75%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	304.751,84	527.996,00	563.201,51	276.577,55	7.031,22	0,84%	1,27%	1,34%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	59.300,06	0,00	0,00	59.714,68	414,62	0,70%	0,70%	0,12%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,49%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>493.455,45</b>	<b>577.996,00</b>	<b>578.879,93</b>	<b>501.935,55</b>	<b>9.364,03</b>	<b>0,87%</b>		<b>1,06%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinse em: https://sistemas.gestbr.com/vendas/validarDocumento.aspx?codigo=90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	50.000,00	0,00	0,00	52.617,58	2.617,58	5,24%	5,24%	5,79%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	85.553,77	0,00	85.603,24	0,00	49,47	0,06%	3,51%	4,72%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	21.108,20	0,00	21.108,20	0,00	0,00	0,00%	0,78%	6,22%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>156.661,97</b>	<b>0,00</b>	<b>106.711,44</b>	<b>52.617,58</b>	<b>2.667,05</b>	<b>1,70%</b>		<b>5,79%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinatura em: https://sistemas.receita.fazenda.gov.br/qep/validador; Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6a



# Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2019

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

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



**Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2019)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	58.773,83	10,49%	915	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	60.023,37	10,71%	1.214	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	90.587,07	16,17%	962	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	298.689,37	<b>53,31%</b>	630	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	0,01	0,00%	333	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a'
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	52.228,85	9,32%	2.340	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' a'
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>560.302,50</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>7.669,22</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>567.971,72</b>				

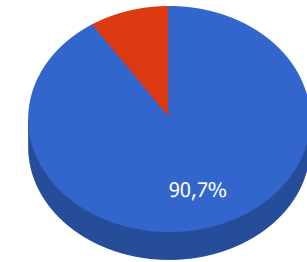
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epi/validaDoc?seamCodigo=documento:90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba>



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	508.073,64	90,68%	50,00%	60,00%	100,00%	52.228,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	336.181,50
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,01	0,00%	0,00%	20,00%	40,00%	224.120,99
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>508.073,65</b>	<b>90,68%</b>	<b>50,00%</b>	<b>90,00%</b>	<b>200,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**



● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

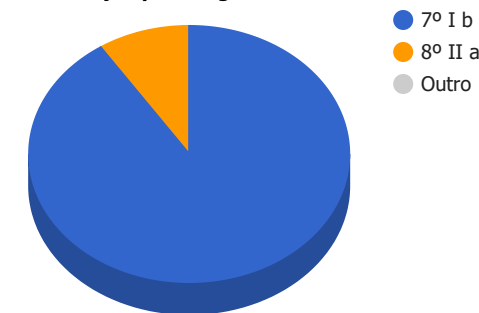
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	52.228,85	9,32%	0,00%	5,00%	20,00%	59.831,65
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	56.030,25
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>52.228,85</b>	<b>9,32%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>30,00%</b>	

**Distribuição por Artigos**



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba





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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	500.279,13	89,29	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	60.023,37	10,71	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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,55%	4,63%	1,86%	3,55%	7,40%	14,81%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	4,47%	1,80%	3,42%	7,19%	14,31%	0,00%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,05%	8,38%	2,76%	6,16%	14,43%	22,05%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,03%	8,22%	2,70%	6,03%	14,23%	21,57%	0,01%	0,03%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,40%	16,22%	4,65%	10,75%	27,53%	33,35%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,42%	16,06%	4,57%	10,60%	27,30%	32,79%	0,02%	0,08%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,43%	3,60%	1,33%	2,68%	5,40%	11,68%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,11%	2,54%	0,31%	1,77%	3,43%	7,77%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,13%	12,00%	3,74%	8,33%	16,60%	23,55%	0,02%	0,04%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etcc.cef.gov.br/epp/validarDoc> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebada6a



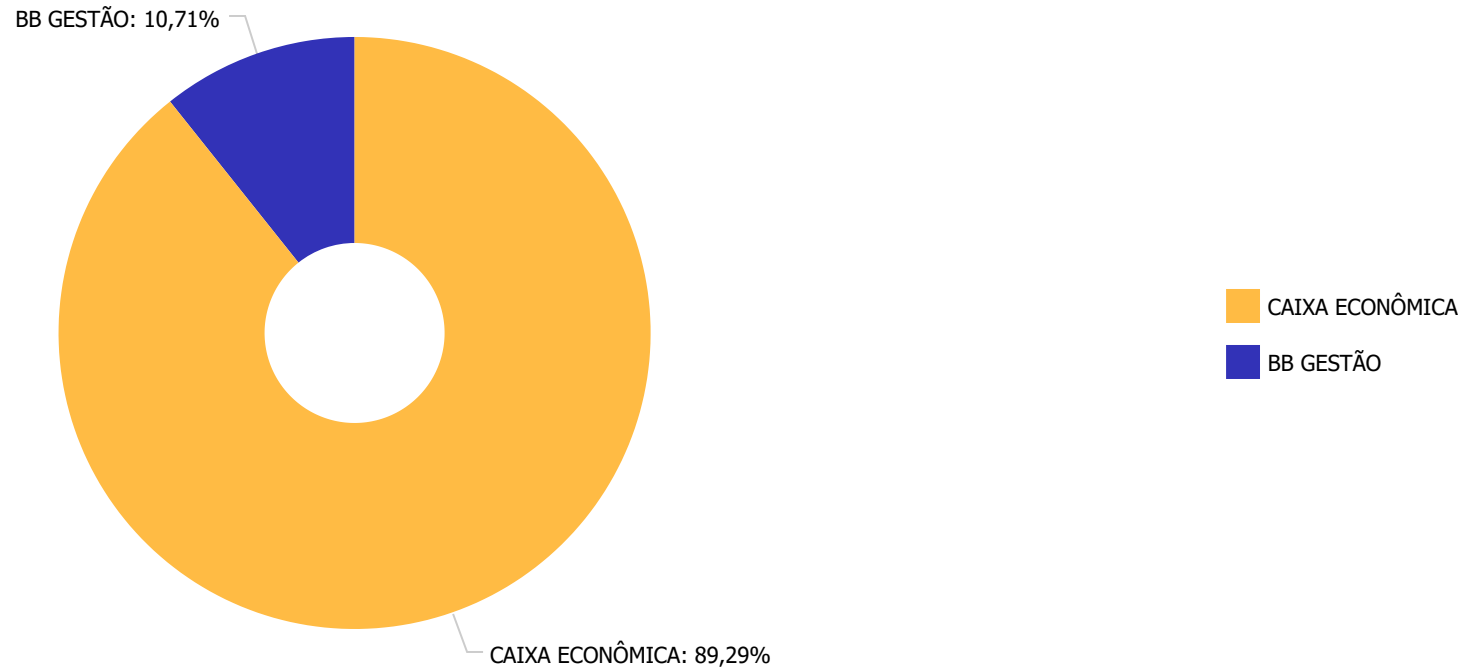
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-0,67%	15,07%	4,23%	5,81%	31,90%	42,77%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,74%	-	-	-	-	-	0,11%	-

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etec.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba6ba



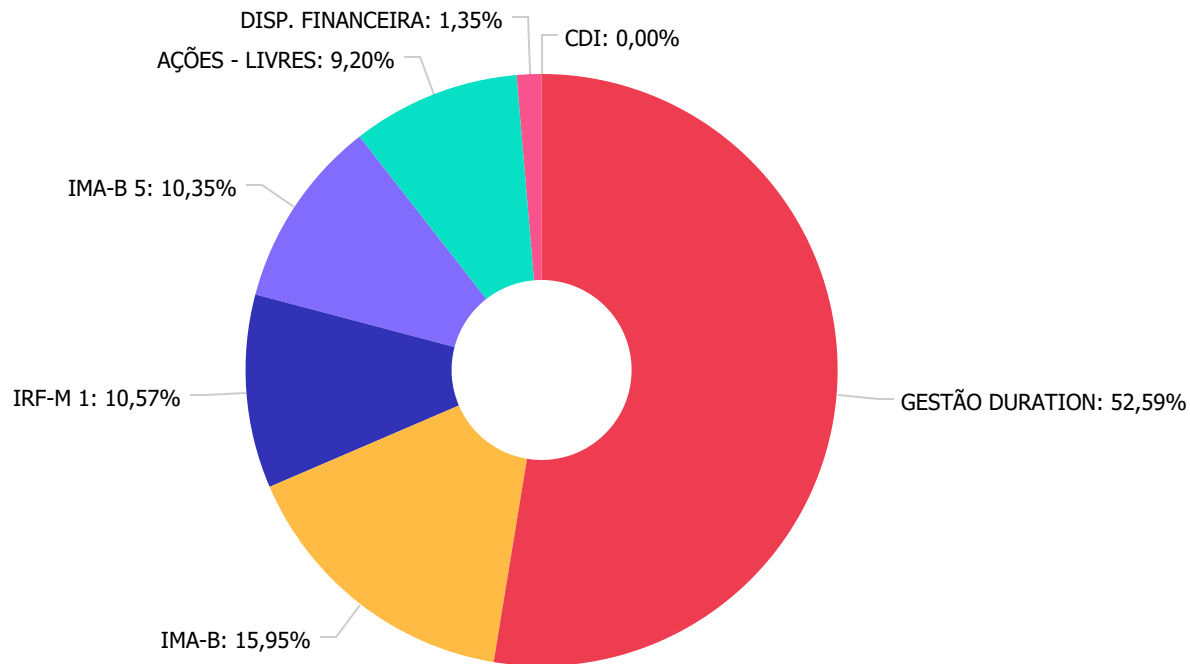
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Agosto / 2019)



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



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



<span style="color: red;">■</span> GESTÃO DURATION	298.683,33
<span style="color: orange;">■</span> IMA-B	90.587,00
<span style="color: blue;">■</span> IRF-M 1	60.021,33
<span style="color: purple;">■</span> IMA-B 5	58.776,89
<span style="color: cyan;">■</span> AÇÕES - LIVRES	52.228,50
<span style="color: pink;">■</span> DISP. FINANCEIRA	7.665,22
<span style="color: lightblue;">■</span> CDI	0,01

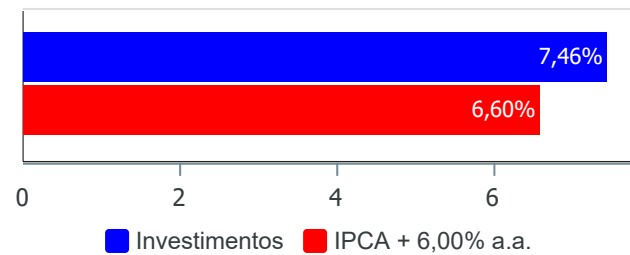
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DESSANANA  
 Assinatura em: 30/08/2019 11:01:21  
 Acesso em: <https://etc.ce.gov.br/epp/validaDocumento.asp>



**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	Variância
Janeiro	759.894,37	898.600,00	466.835,22	1.214.194,54	22.535,39	22.535,39	1,89%	1,89%	0,83%	0,83%	227,40%	1,06%
Fevereiro	1.214.194,54	450.000,00	531.298,05	1.138.580,04	5.683,55	28.218,94	0,47%	2,37%	0,90%	1,73%	136,52%	1,06%
Março	1.138.580,04	0,00	83.200,00	1.059.798,76	4.418,72	32.637,66	0,39%	2,77%	1,19%	2,95%	93,77%	2,06%
Abril	1.059.798,76	1.226.962,99	1.460.963,04	837.660,60	11.861,89	44.499,55	0,52%	3,30%	1,06%	4,04%	81,65%	1,06%
Mai	837.660,60	526.504,33	619.742,83	758.877,41	14.455,31	58.954,86	1,73%	5,08%	0,64%	4,71%	107,96%	2,06%
Junho	758.877,41	662.503,40	792.368,82	650.117,42	21.105,43	80.060,29	1,48%	6,64%	0,45%	5,18%	128,27%	2,06%
Julho	650.117,42	577.996,00	685.591,37	554.553,13	12.031,08	92.091,37	0,98%	7,69%	0,72%	5,94%	129,40%	1,06%
Agosto	554.553,13	641.691,27	633.466,44	560.302,50	-2.475,46	89.615,91	-0,21%	7,46%	0,62%	6,60%	113,13%	2,06%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://pcc.les.pe.gov.br/epi/v?idalDhc:sesqjC44go> do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

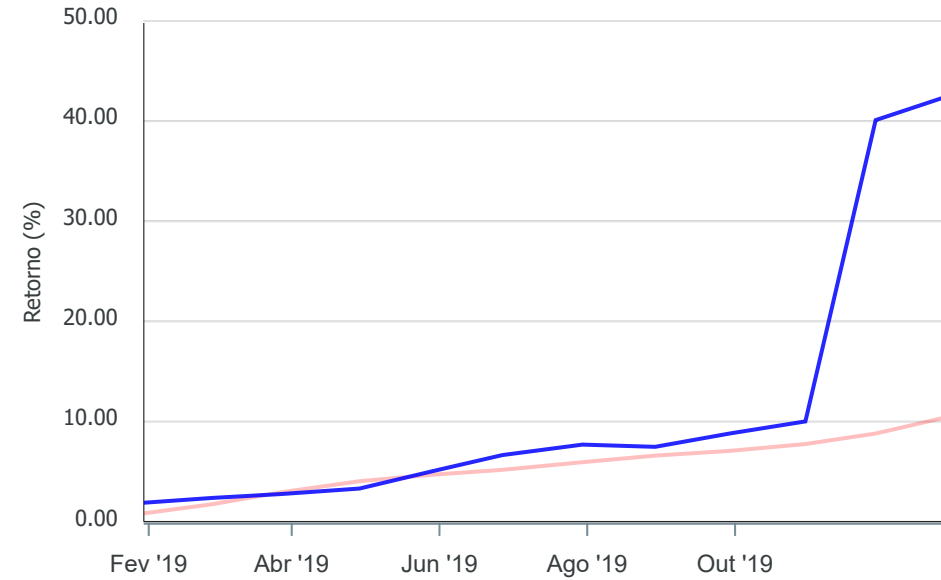


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777e8a606a



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/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...	59.714,68	0,00	0,00	60.023,37	308,69	0,52%	0,52%	0,18%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	58.753,32	0,00	0,00	58.773,83	20,51	0,03%	0,03%	1,04%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,43%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	276.577,55	431.481,27	616.509,51	90.587,07	-962,24	-0,14%	-0,42%	2,48%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	106.889,99	210.210,00	16.956,93	298.689,37	-1.453,69	-0,46%	-0,13%	1,74%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>501.935,55</b>	<b>641.691,27</b>	<b>633.466,44</b>	<b>508.073,65</b>	<b>-2.086,73</b>	<b>-0,41%</b>		<b>1,61%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinatura em: https://sistemas.gestor.br/gpd/validarDocumento.aspx?CodigoDoDocumento:90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba





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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	52.617,58	0,00	0,00	52.228,85	-388,73	-0,74%	-0,74%	10,76%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>52.617,58</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>52.228,85</b>	<b>-388,73</b>	<b>-0,74%</b>		<b>10,76%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Assinse em: 30/08/2019 14:58:00  
<https://sede.caspe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



# Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º trimestre de 2019

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://tce.ce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

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

**LEMA**  
ECONOMIA & FINANÇAS



**Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2019)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	60.808,03	11,75%	913	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	60.395,11	11,67%	1.212	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	50.797,67	9,81%	963	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	111.590,96	21,56%	643	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	180.262,24	34,82%	1.389	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	0,01	0,00%	333	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	53.786,98	10,39%	2.318	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>517.641,00</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>6,08</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>517.647,08</b>				

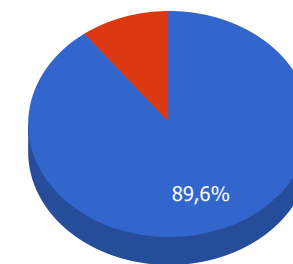
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: [https://etec.tce.pe.gov.br/epi/validaDoc?scan=Código do documento: 90697012-41eb-4514-bb76-57777ebaa6ba](https://etec.tce.pe.gov.br/epi/validaDoc?scan=Código%20do%20documento%3A90697012-41eb-4514-bb76-57777ebaa6ba)



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	463.854,01	89,61%	50,00%	60,00%	100,00%	53.786,99
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	310.584,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,01	0,00%	0,00%	20,00%	40,00%	207.056,39
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>463.854,02</b>	<b>89,61%</b>	<b>50,00%</b>	<b>90,00%</b>	<b>200,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**



● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

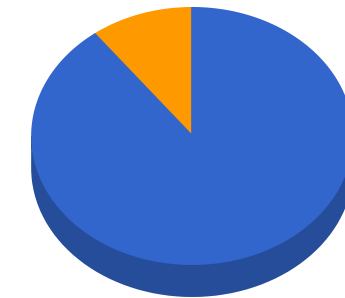
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90697012-41eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	53.786,98	10,39%	0,00%	5,00%	20,00%	49.741,22
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	51.764,10
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>53.786,98</b>	<b>10,39%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>30,00%</b>	

**Distribuição por Artigos**



- 7º I b
- 8º II a
- Outro

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba6ba



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	457.245,89	88,33	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	60.395,11	11,67	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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,64%	5,31%	1,92%	3,72%	7,44%	14,70%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,62%	5,12%	1,85%	3,60%	7,22%	14,20%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,63%	5,15%	1,86%	3,63%	7,28%	14,32%	0,00%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	1,74%	10,27%	2,78%	7,17%	15,40%	22,93%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,72%	10,08%	2,72%	7,04%	15,21%	22,44%	0,01%	0,03%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	2,86%	19,55%	3,77%	13,27%	31,37%	34,72%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,85%	19,37%	3,72%	13,12%	31,16%	34,16%	0,02%	0,07%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,39%	4,01%	1,32%	2,67%	5,39%	11,49%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	-0,04%	2,49%	0,26%	0,97%	2,89%	7,55%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2,12%	14,38%	3,11%	10,02%	18,30%	25,15%	0,01%	0,04%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etcc.ice.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebada6a



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

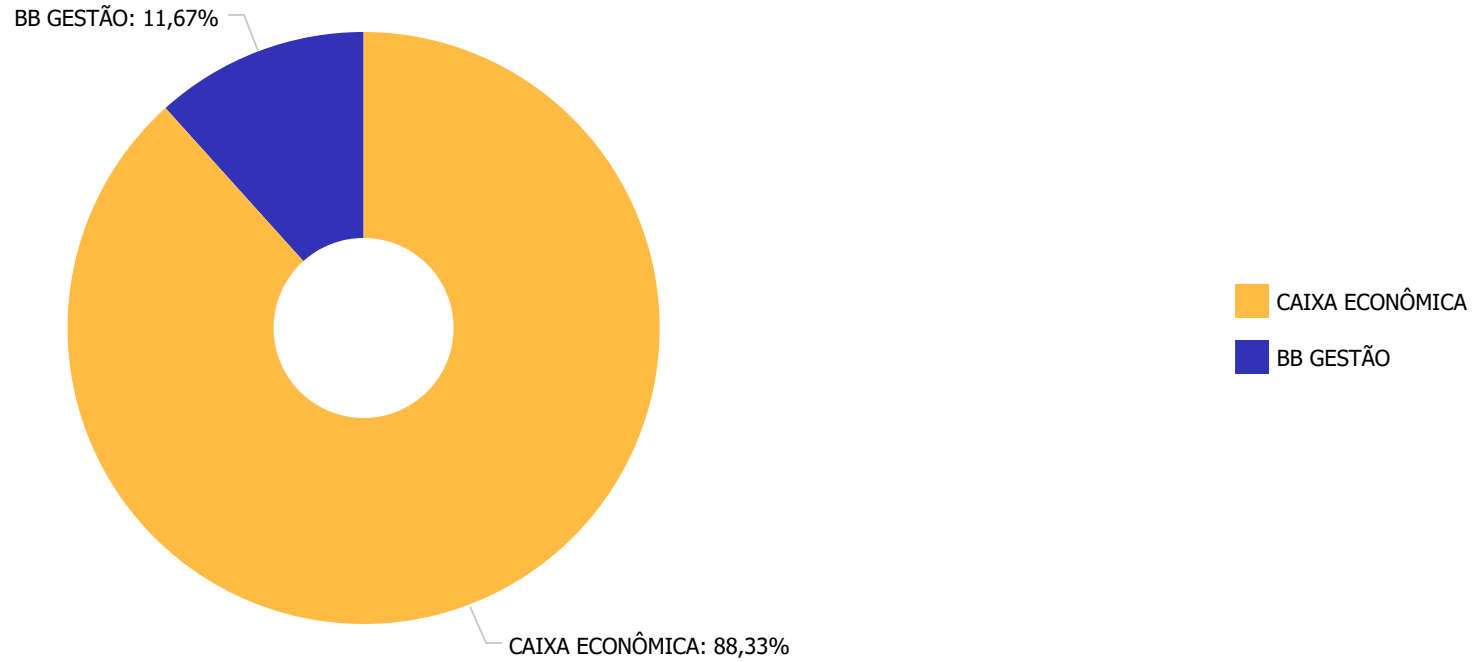
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	3,57%	19,18%	3,74%	9,78%	32,02%	40,99%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2,98%	-	7,57%	-	-	-	0,05%	-

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etcc.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba6ba





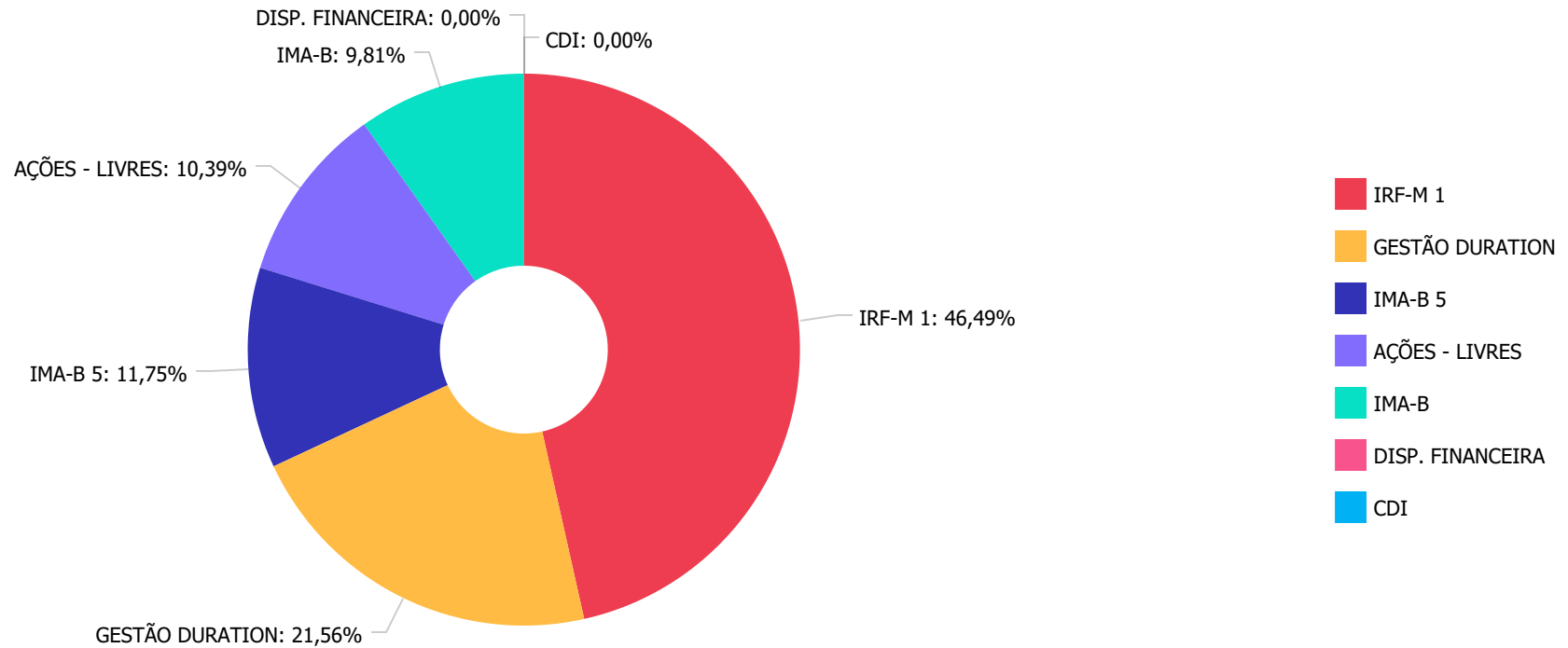
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Setembro / 2019)



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



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



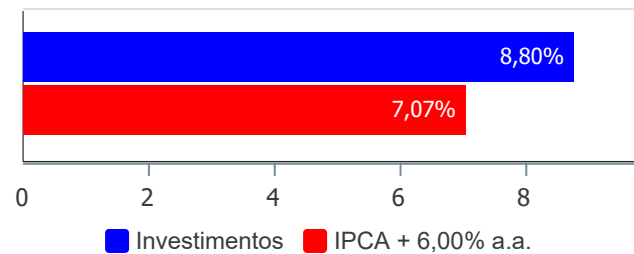
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesso em: https://etc.ce.gov.br/epp/validaDocumento.htm  
 Odiário do documento: 9097012511eb-4514-b676-57777ebad6a



**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	759.894,37	898.600,00	466.835,22	1.214.194,54	22.535,39	22.535,39	1,89%	1,89%	0,83%	0,83%	227,40%	1,00%
Fevereiro	1.214.194,54	450.000,00	531.298,05	1.138.580,04	5.683,55	28.218,94	0,47%	2,37%	0,90%	1,73%	136,52%	1,00%
Março	1.138.580,04	0,00	83.200,00	1.059.798,76	4.418,72	32.637,66	0,39%	2,77%	1,19%	2,95%	93,77%	2,00%
Abril	1.059.798,76	1.226.962,99	1.460.963,04	837.660,60	11.861,89	44.499,55	0,52%	3,30%	1,06%	4,04%	81,65%	1,00%
Maio	837.660,60	526.504,33	619.742,83	758.877,41	14.455,31	58.954,86	1,73%	5,08%	0,64%	4,71%	107,96%	2,00%
Junho	758.877,41	662.503,40	792.368,82	650.117,42	21.105,43	80.060,29	1,48%	6,64%	0,45%	5,18%	128,27%	2,00%
Julho	650.117,42	577.996,00	685.591,37	554.553,13	12.031,08	92.091,37	0,98%	7,69%	0,72%	5,94%	129,40%	1,00%
Agosto	554.553,13	641.691,27	633.466,44	560.302,50	-2.475,46	89.615,91	-0,21%	7,46%	0,62%	6,60%	113,13%	2,00%
Setembro	560.302,50	764.934,42	824.131,79	517.641,00	16.535,87	106.151,78	1,25%	8,80%	0,45%	7,07%	124,48%	1,00%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://pcc.lem.br/vf/validarDoc.aspx?idDoc=55455313>  
 Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

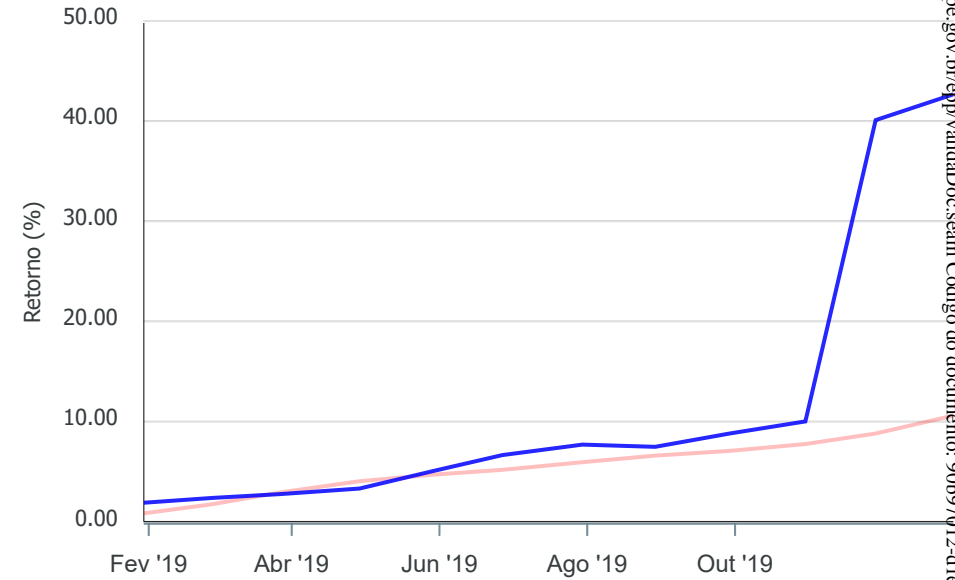


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebada0a



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	90.587,07	155.764,29	200.616,00	50.797,67	5.062,31	2,05%	2,85%	1,98%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	298.689,37	150.000,00	343.725,43	111.590,96	6.627,02	1,48%	2,12%	1,37%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	58.773,83	100.000,00	100.000,00	60.808,03	2.034,20	1,28%	1,72%	1,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	60.023,37	0,00	0,00	60.395,11	371,74	0,62%	0,62%	0,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	179.790,36	0,00	180.262,24	471,88	0,26%	0,63%	0,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	179.379,77	179.790,36	0,00	410,59	0,23%	1,85%	1,22%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,39%	0,01%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>508.073,65</b>	<b>764.934,42</b>	<b>824.131,79</b>	<b>463.854,02</b>	<b>14.977,74</b>	<b>1,18%</b>		<b>0,74%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinse em: https://sccs.csp.br/gsp/vizualizacao.do?codigo\_documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	52.228,85	0,00	0,00	53.786,98	1.558,13	2,98%	2,98%	5,20%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>52.228,85</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>53.786,98</b>	<b>1.558,13</b>	<b>2,98%</b>		<b>5,20%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinse em: https://cdec.ic.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2019

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	304.751,84	1.115.241,56	1.380.327,02	50.797,67	11.131,29	0,78%	3,72%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	71.201,51	410.210,00	376.360,78	111.590,96	6.540,23	1,36%	3,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	58.202,03	100.000,00	100.000,00	60.808,03	2.606,00	1,65%	2,72%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	59.300,06	0,00	0,00	60.395,11	1.095,05	1,85%	1,85%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	179.790,36	0,00	180.262,24	471,88	0,26%	1,86%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	179.379,77	179.790,36	0,00	410,59	0,23%	3,21%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	1,32%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>22.255,04</b>	<b>0,90%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinatura em: https://sistemas.pe.gov.br/gpp/valeadoc/assinatura/assinaturaCodigo.do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2019

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Ins
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	50.000,00	0,00	0,00	53.786,98	3.786,98	7,57%	7,57%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	85.553,77	0,00	85.603,24	0,00	49,47	0,06%	5,72%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	21.108,20	0,00	21.108,20	0,00	0,00	0,00%	3,60%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>3.836,45</b>	<b>2,45%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinse em: https://etcc.ice.gov.br/epps/validaDoc:seam Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba6ba





# Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2019

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

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



**Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2019)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	63.507,37	13,36%	943	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	60.756,72	12,78%	1.208	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	106.614,79	<b>22,42%</b>	966	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	69.598,58	14,64%	668	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	18.902,52	3,98%	1.372	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	100.767,97	<b>21,19%</b>	924	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	0,01	0,00%	326	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a'
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	55.305,17	11,63%	2.308	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' a'
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>475.453,13</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>6,08</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>475.459,21</b>				

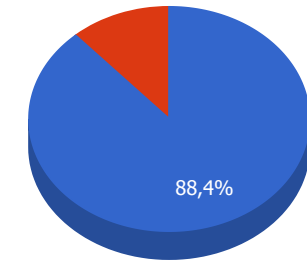
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epi/validaDoc?seamCodigoDoDocumento:90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba06a>



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	420.147,95	88,37%	50,00%	60,00%	100,00%	55.305,18
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	285.271,88
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,01	0,00%	0,00%	20,00%	40,00%	190.181,24
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>420.147,96</b>	<b>88,37%</b>	<b>50,00%</b>	<b>90,00%</b>	<b>200,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**



● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

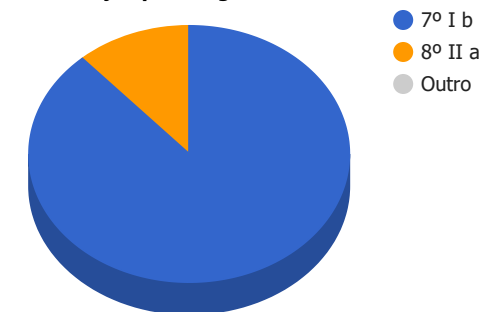
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	55.305,17	11,63%	0,00%	5,00%	20,00%	39.785,46
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	47.545,31
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>55.305,17</b>	<b>11,63%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>30,00%</b>	

**Distribuição por Artigos**



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	414.696,41	87,22	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	60.756,72	12,78	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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	1,23%	10,48%	2,93%	6,70%	12,06%	22,98%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,28%	9,97%	2,82%	6,15%	11,39%	21,52%	0,01%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,62%	5,96%	1,83%	3,85%	7,13%	14,70%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	5,75%	1,75%	3,71%	6,87%	14,19%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	5,79%	1,77%	3,74%	6,93%	14,31%	0,00%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	1,65%	12,09%	3,47%	7,74%	13,78%	24,36%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,64%	11,89%	3,42%	7,63%	13,58%	23,88%	0,01%	0,02%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	3,36%	23,57%	5,89%	15,34%	26,74%	39,79%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,33%	23,33%	5,82%	15,17%	26,47%	39,19%	0,02%	0,05%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,48%	5,16%	1,45%	3,06%	6,20%	13,16%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,40%	4,43%	1,23%	2,62%	5,32%	11,29%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,10%	2,60%	0,17%	0,50%	2,54%	7,21%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,71%	16,33%	3,73%	10,67%	18,32%	26,77%	0,01%	0,04%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etcc.cef.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2019 - RENDA VARIÁVEL

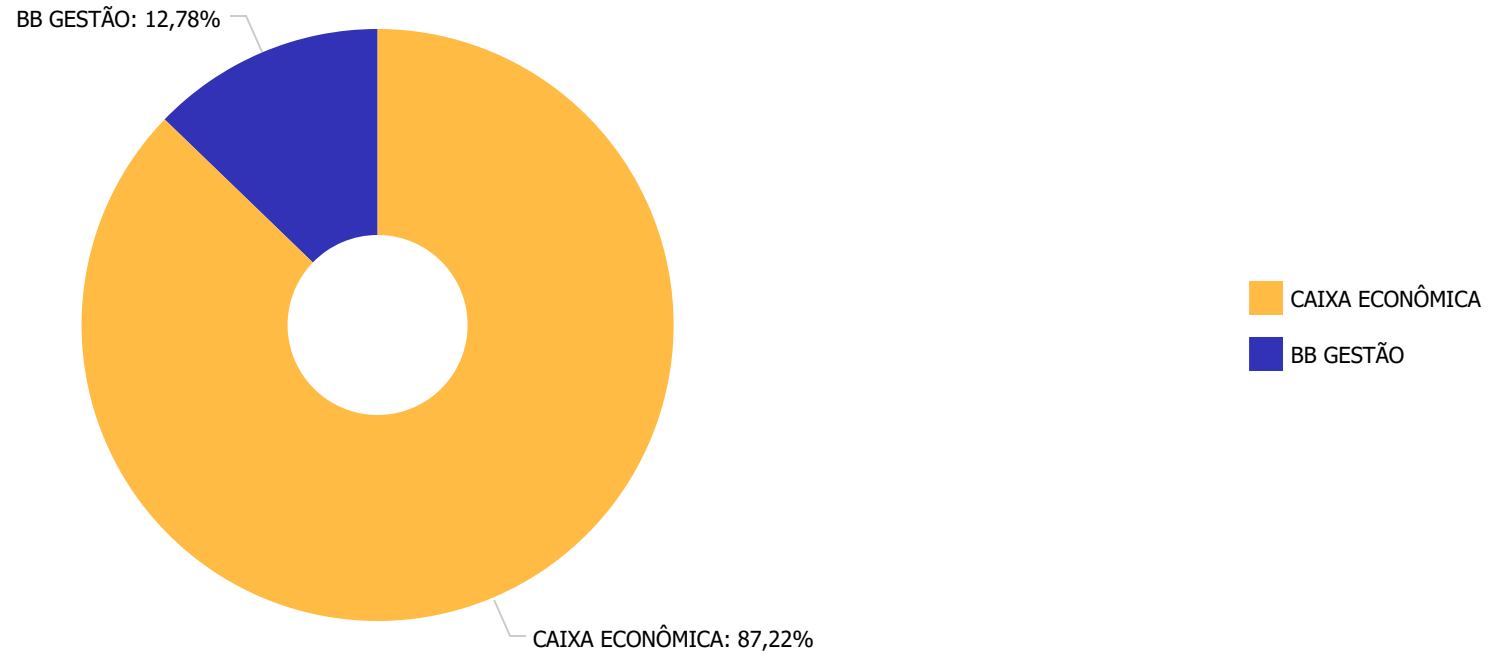
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	2,36%	22,00%	5,31%	11,28%	22,64%	44,29%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2,82%	-	5,11%	-	-	-	0,06%	-

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etcc.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba

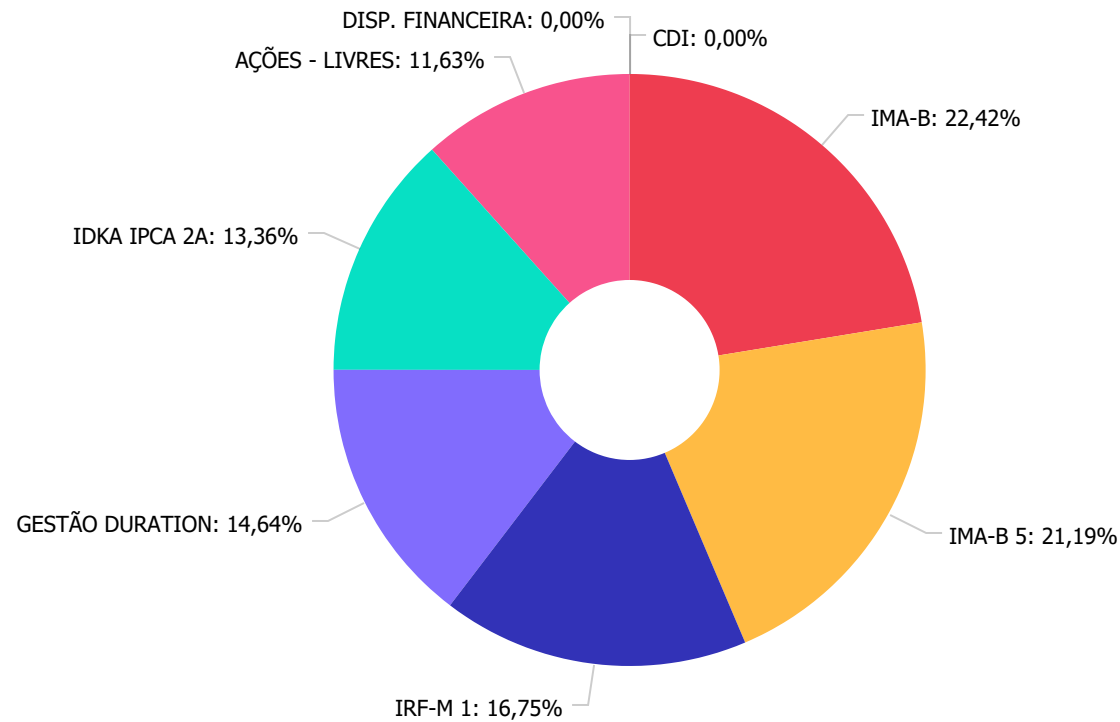
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Outubro / 2019)







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



IMA-B	106.617,77
IMA-B 5	100.769,99
IRF-M 1	79.659,22
GESTÃO DURATION	69.599,55
IDKA IPCA 2A	63.509,33
AÇÕES - LIVRES	55.309,11
DISP. FINANCEIRA	0,00
CDI	0,01

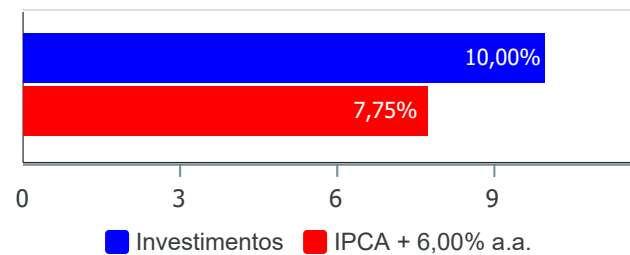
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesso em: https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validarDoc.aspx?CodigoDoc=10097012-d-15-4514-bb76-57777ebad6a



**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	759.894,37	898.600,00	466.835,22	1.214.194,54	22.535,39	22.535,39	1,89%	1,89%	0,83%	0,83%	227,40%	1,89%
Fevereiro	1.214.194,54	450.000,00	531.298,05	1.138.580,04	5.683,55	28.218,94	0,47%	2,37%	0,90%	1,73%	136,52%	1,89%
Março	1.138.580,04	0,00	83.200,00	1.059.798,76	4.418,72	32.637,66	0,39%	2,77%	1,19%	2,95%	93,77%	2,77%
Abril	1.059.798,76	1.226.962,99	1.460.963,04	837.660,60	11.861,89	44.499,55	0,52%	3,30%	1,06%	4,04%	81,65%	1,89%
Mai	837.660,60	526.504,33	619.742,83	758.877,41	14.455,31	58.954,86	1,73%	5,08%	0,64%	4,71%	107,96%	2,77%
Junho	758.877,41	662.503,40	792.368,82	650.117,42	21.105,43	80.060,29	1,48%	6,64%	0,45%	5,18%	128,27%	2,77%
Julho	650.117,42	577.996,00	685.591,37	554.553,13	12.031,08	92.091,37	0,98%	7,69%	0,72%	5,94%	129,40%	1,89%
Agosto	554.553,13	641.691,27	633.466,44	560.302,50	-2.475,46	89.615,91	-0,21%	7,46%	0,62%	6,60%	113,13%	2,77%
Setembro	560.302,50	764.934,42	824.131,79	517.641,00	16.535,87	106.151,78	1,25%	8,80%	0,45%	7,07%	124,48%	1,89%
Outubro	517.641,00	590.316,72	644.690,23	475.453,13	12.185,64	118.337,42	1,10%	10,00%	0,63%	7,75%	129,02%	1,89%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesso em: 10/11/2019 às 10:00:00  
 URL: https://www.lemab.com.br/portal/verdocumento.aspx?codigo\_documento=90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

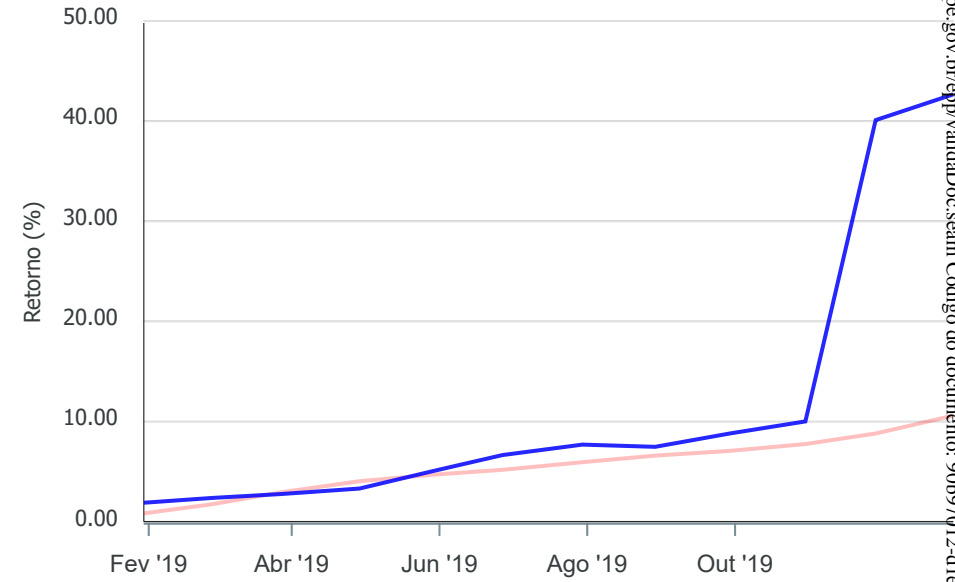


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebada0a



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	50.797,67	102.348,91	51.118,48	106.614,79	4.586,69	2,99%	3,33%	1,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	60.808,03	70.000,00	31.517,97	100.767,97	1.477,91	1,13%	1,64%	0,97%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	111.590,96	255.311,87	300.000,00	69.598,58	2.695,75	0,73%	1,71%	1,12%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	60.395,11	0,00	0,00	60.756,72	361,61	0,60%	0,60%	0,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,00	162.655,94	100.000,00	63.507,37	851,43	0,52%	1,28%	0,76%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	180.262,24	0,00	162.053,78	18.902,52	694,06	0,39%	0,61%	0,15%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,40%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>463.854,02</b>	<b>590.316,72</b>	<b>644.690,23</b>	<b>420.147,96</b>	<b>10.667,45</b>	<b>1,01%</b>		<b>1,05%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinse em: https://sccs.csp.br/gsp/vizualizacao.do?codigo\_documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	53.786,98	0,00	0,00	55.305,17	1.518,19	2,82%	2,82%	6,47%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>53.786,98</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>55.305,17</b>	<b>1.518,19</b>	<b>2,82%</b>		<b>6,47%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinse em: https://cdec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



# Relatório Analítico dos Investimentos em novembro de 2019

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

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



**Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2019)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	13.558,31	3,07%	956	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	60.943,18	13,81%	1.198	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	103.902,44	23,55%	965	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	169.193,93	38,34%	683	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.772,44	1,53%	1.360	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	30.531,75	6,92%	929	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	0,01	0,00%	322	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a'
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	56.377,28	12,78%	2.379	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' a'
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>441.279,34</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>256,08</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>441.535,42</b>				

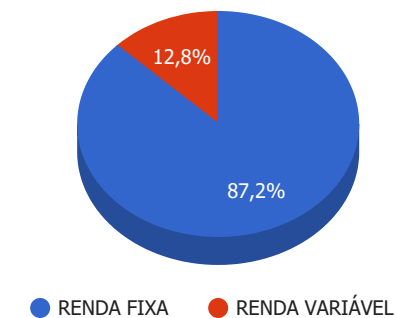
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epi/validaDoc?seamCodigoDoDocumento:90b97012-d1eb-4514-bb76-57777eba06a>



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	384.902,05	87,22%	50,00%	60,00%	100,00%	56.377,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	264.767,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,01	0,00%	0,00%	20,00%	40,00%	176.511,73
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>384.902,06</b>	<b>87,22%</b>	<b>50,00%</b>	<b>90,00%</b>	<b>200,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

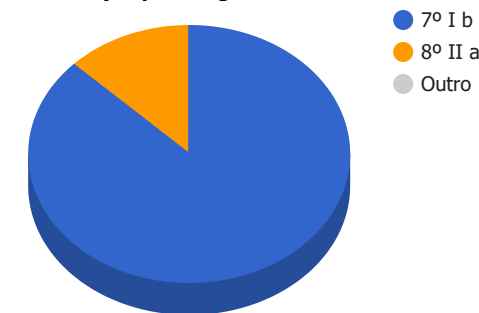




**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Novembro / 2019)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	56.377,28	12,78%	0,00%	5,00%	20,00%	31.878,59
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	44.127,93
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>56.377,28</b>	<b>12,78%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>30,00%</b>	

**Distribuição por Artigos**



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	380.336,16	86,19	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	60.943,18	13,81	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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,01%	10,49%	2,86%	5,28%	11,88%	22,68%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	9,98%	2,73%	5,04%	11,25%	21,26%	0,00%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,33%	6,31%	1,61%	3,49%	6,91%	14,37%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	6,07%	1,53%	3,36%	6,64%	13,87%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,31%	6,12%	1,56%	3,39%	6,70%	13,99%	0,00%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	-0,28%	11,77%	3,13%	5,97%	13,30%	23,89%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,34%	11,51%	3,04%	5,82%	13,05%	23,35%	0,01%	0,02%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-2,45%	20,53%	3,71%	8,53%	22,52%	37,40%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,54%	20,20%	3,57%	8,30%	22,16%	36,72%	0,02%	0,07%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,38%	5,56%	1,33%	2,90%	6,09%	12,95%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,31%	4,75%	1,12%	2,46%	5,20%	11,09%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,51%	3,12%	0,57%	0,88%	3,27%	7,45%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,51%	15,75%	3,34%	7,20%	17,28%	25,78%	0,01%	0,04%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etcc.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



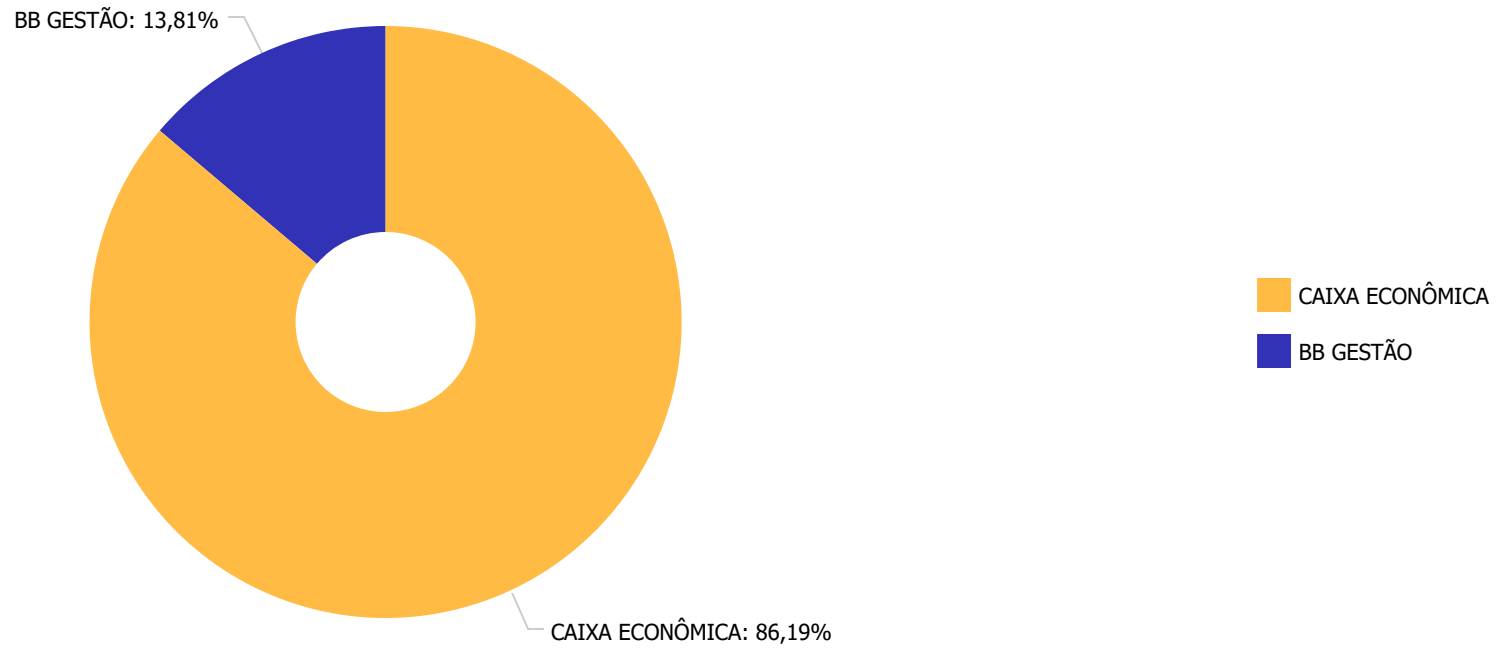
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	0,95%	23,15%	7,02%	11,55%	20,93%	50,38%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1,94%	-	7,94%	-	-	-	0,07%	-

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



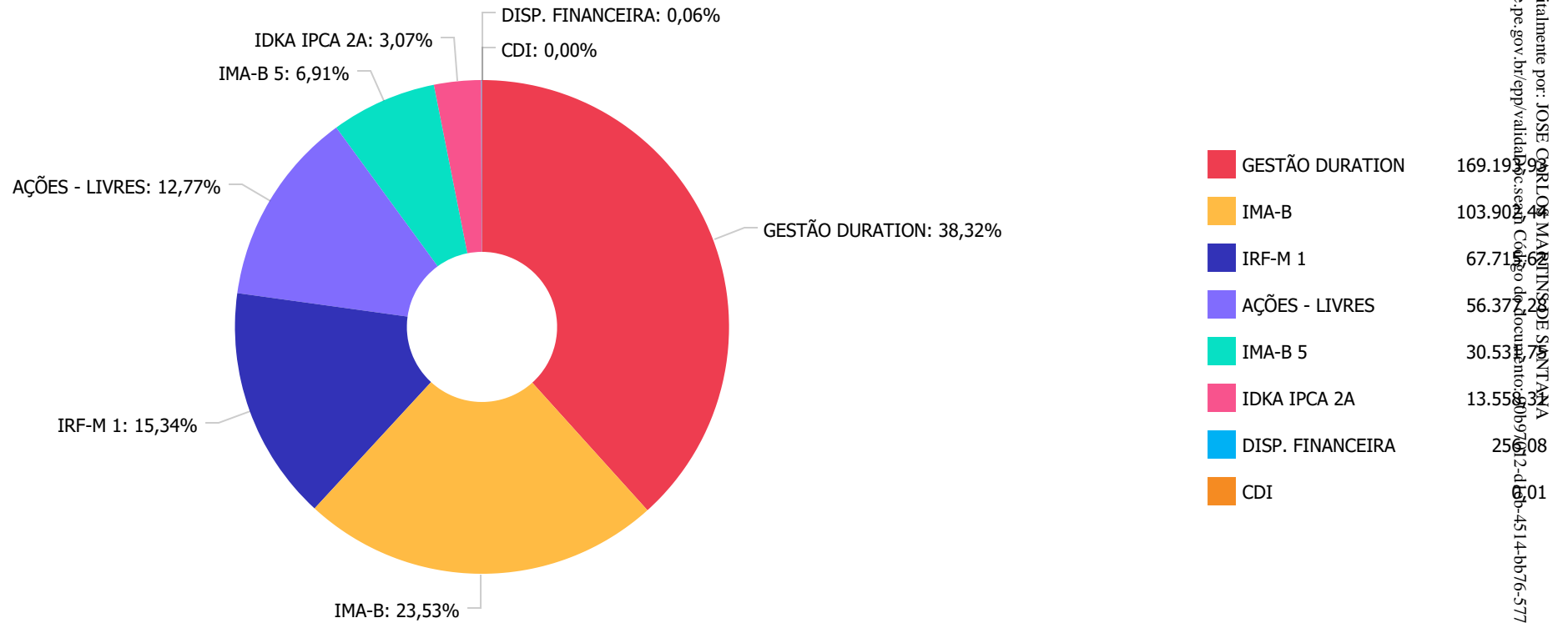
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Novembro / 2019)



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



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



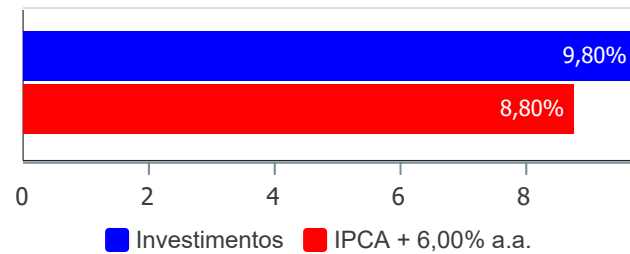
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesso em: https://etc.ce.gov.br/epp/validador/validador.jspx?docId=20191129100845144b7657777eba0ba



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	759.894,37	898.600,00	466.835,22	1.214.194,54	22.535,39	22.535,39	1,89%	1,89%	0,83%	0,83%	227,40%	1,89%
Fevereiro	1.214.194,54	450.000,00	531.298,05	1.138.580,04	5.683,55	28.218,94	0,47%	2,37%	0,90%	1,73%	136,52%	1,89%
Março	1.138.580,04	0,00	83.200,00	1.059.798,76	4.418,72	32.637,66	0,39%	2,77%	1,19%	2,95%	93,77%	2,77%
Abril	1.059.798,76	1.226.962,99	1.460.963,04	837.660,60	11.861,89	44.499,55	0,52%	3,30%	1,06%	4,04%	81,65%	1,89%
Mai	837.660,60	526.504,33	619.742,83	758.877,41	14.455,31	58.954,86	1,73%	5,08%	0,64%	4,71%	107,96%	2,77%
Junho	758.877,41	662.503,40	792.368,82	650.117,42	21.105,43	80.060,29	1,48%	6,64%	0,45%	5,18%	128,27%	2,77%
Julho	650.117,42	577.996,00	685.591,37	554.553,13	12.031,08	92.091,37	0,98%	7,69%	0,72%	5,94%	129,40%	1,89%
Agosto	554.553,13	641.691,27	633.466,44	560.302,50	-2.475,46	89.615,91	-0,21%	7,46%	0,62%	6,60%	113,13%	2,77%
Setembro	560.302,50	764.934,42	824.131,79	517.641,00	16.535,87	106.151,78	1,25%	8,80%	0,45%	7,07%	124,48%	1,89%
Outubro	517.641,00	590.316,72	644.690,23	475.453,13	12.185,64	118.337,42	1,10%	10,00%	0,63%	7,75%	129,02%	1,89%
Novembro	475.453,13	624.124,47	656.293,65	441.279,34	-2.004,61	116.332,81	-0,18%	9,80%	0,98%	8,80%	111,33%	1,89%

Investimentos x Meta Atuarial



Documento Assinado Digitalmente por JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: https://pcc.leg.br/pe/epv/b7Epp/vfidalHc:sesqinCofpgo:do:docu:ent:90b97012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba

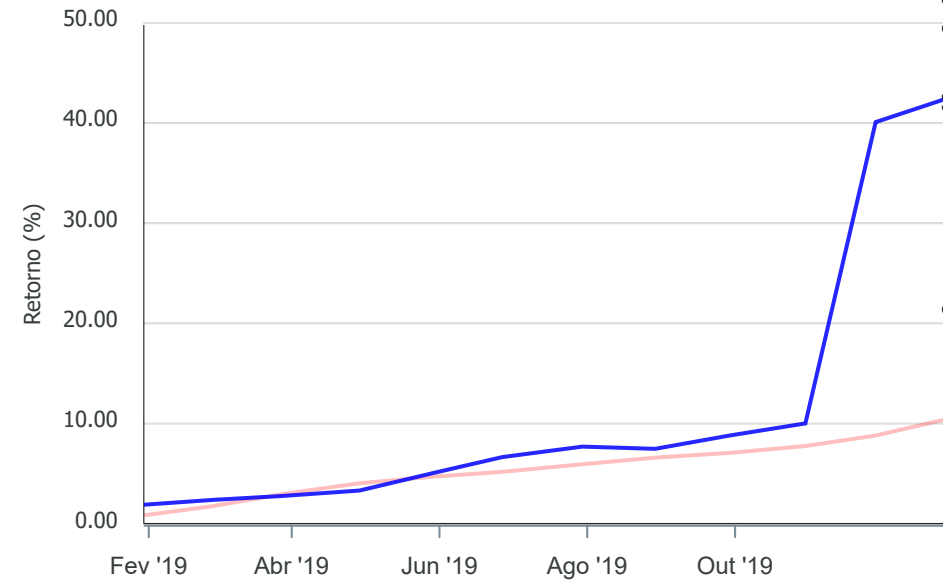


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebada0a





Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Novembro/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...	60.756,72	0,00	0,00	60.943,18	186,46	0,31%	0,31%	0,08
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.902,52	200.000,00	212.384,29	6.772,44	254,21	0,12%	0,31%	0,08
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	63.507,37	200.000,00	250.000,00	13.558,31	50,94	0,02%	0,01%	0,50
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,31%	0,00
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	69.598,58	224.124,47	123.911,04	169.193,93	-618,08	-0,21%	-0,51%	0,80
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	100.767,97	0,00	69.998,32	30.531,75	-237,90	-0,24%	-0,34%	0,65
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	106.614,79	0,00	0,00	103.902,44	-2.712,35	-2,54%	-2,54%	1,99
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>420.147,96</b>	<b>624.124,47</b>	<b>656.293,65</b>	<b>384.902,06</b>	<b>-3.076,72</b>	<b>-0,29%</b>		<b>0,97</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinse em: https://sccs.csp.br/gsp/vizualizacao.do?codigo\_documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6a



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	55.305,17	0,00	0,00	56.377,28	1.072,11	1,94%	1,94%	6,69%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>55.305,17</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>56.377,28</b>	<b>1.072,11</b>	<b>1,94%</b>		<b>6,69%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinse em: https://cdec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



# Relatório Analítico dos Investimentos

## em dezembro, 4º trimestre e ano de 2010

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://sistemas.pec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba

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

**LEMA**  
ECONOMIA & FINANÇAS



**Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2019)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.658,70	3,66%	964	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	120,24	0,12%	1.198	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	23.748,30	<b>23,76%</b>	949	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	3.649,70	3,65%	695	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.266,75	5,27%	1.361	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.880,89	1,88%	923	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' b'
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	0,01	0,00%	324	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' a'
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	61.619,85	<b>61,65%</b>	2.570	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' a'
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>99.944,44</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>2.476,85</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>102.421,29</b>				

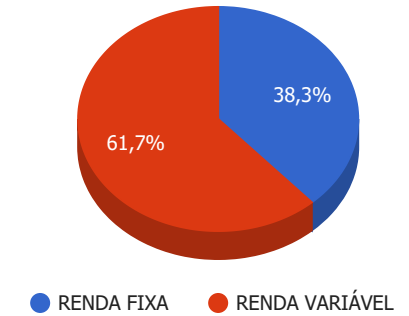
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epi/validaDoc?seamCodigoDoDocumento:90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba>



**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%	38.324,58	38,35%	50,00%	60,00%	100,00%	61.619,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	59.966,66
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,01	0,00%	0,00%	20,00%	40,00%	39.977,77
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>38.324,59</b>	<b>38,35%</b>	<b>50,00%</b>	<b>90,00%</b>	<b>200,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**



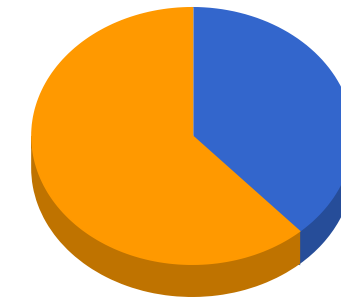
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



**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%	61.619,85	61,65%	0,00%	5,00%	20,00%	-41.630,96
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	9.994,44
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>61.619,85</b>	<b>61,65%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>30,00%</b>	

**Distribuição por Artigos**



- 7º I b
- 8º II a
- Outro

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	99.824,20	99,88	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	120,24	0,12	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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://pcc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa6ba



**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
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	1,20%	11,82%	2,46%	5,25%	11,82%	22,73%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	11,19%	2,40%	4,92%	11,19%	21,53%	0,01%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,42%	6,76%	1,38%	3,33%	6,76%	14,21%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	6,49%	1,31%	3,18%	6,49%	13,69%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,40%	6,55%	1,33%	3,22%	6,55%	13,80%	0,00%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	1,24%	13,15%	2,62%	5,47%	13,15%	24,32%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,21%	12,85%	2,52%	5,31%	12,85%	23,77%	0,01%	0,02%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	2,01%	22,95%	2,85%	6,72%	22,95%	39,01%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,99%	22,59%	2,70%	6,52%	22,59%	38,33%	0,03%	0,07%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,31%	5,07%	1,03%	2,36%	5,07%	10,90%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	1,15%	4,31%	1,77%	2,03%	4,31%	8,21%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,59%	16,43%	1,80%	4,97%	16,43%	25,53%	0,01%	0,04%

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etcc.cef.gov.br/epp/validarDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebaa0ba





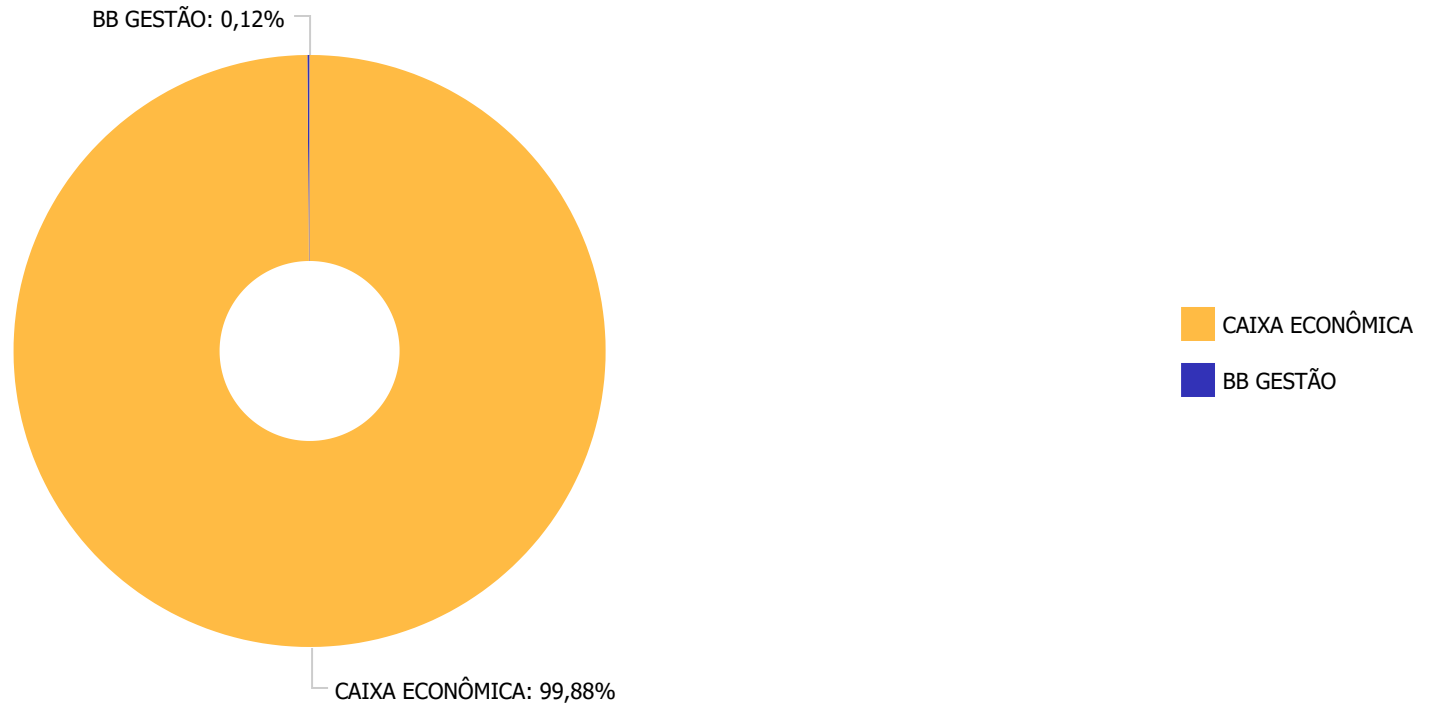
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	6,85%	31,58%	10,41%	14,54%	31,58%	51,36%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	9,30%	-	14,56%	23,24%	-	-	0,04%	-

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesse em: <https://etcc.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



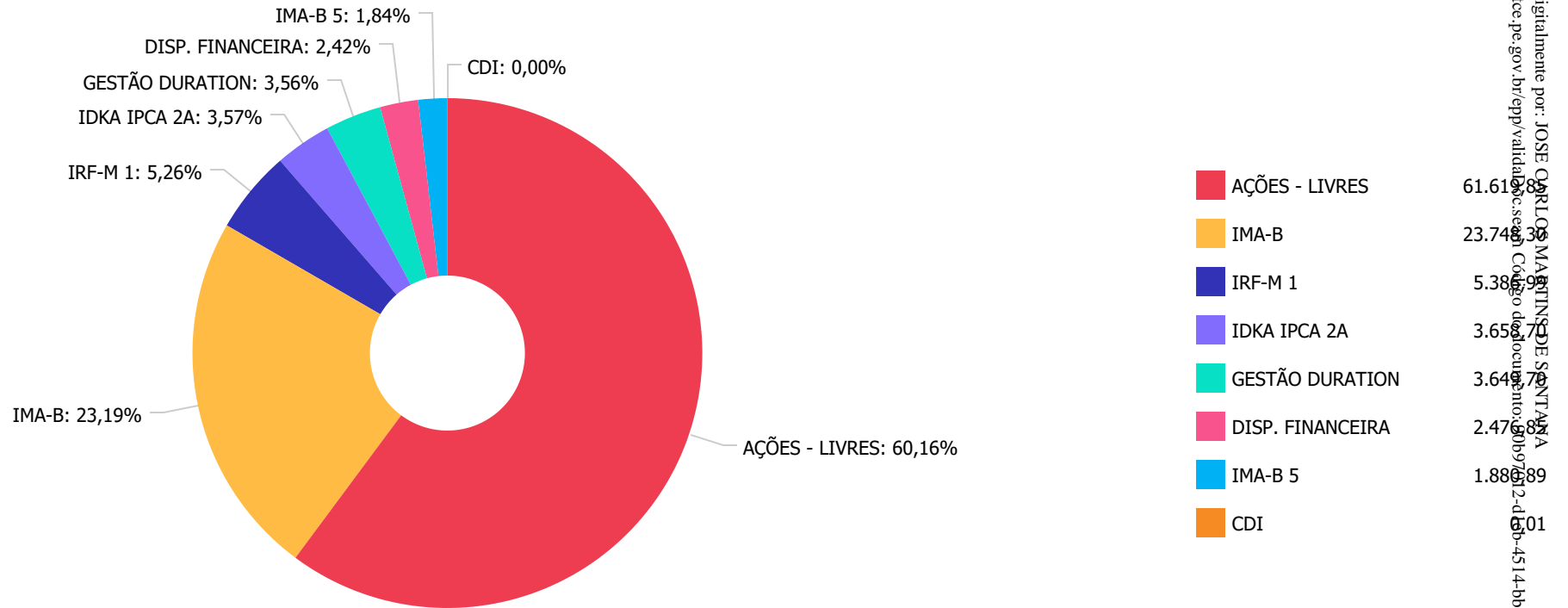
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2019)



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 90697012-11eb-4514-bb76-57777eba0ba



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



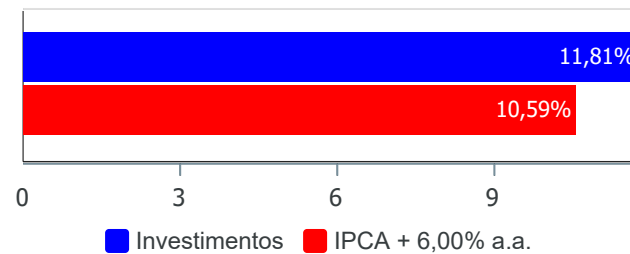
Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Acesso em: https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validarDoc.aspx?Codigo do documento: 201907012-45-45144b76-57777ebad6a



**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	759.894,37	898.600,00	466.835,22	1.214.194,54	22.535,39	22.535,39	1,89%	1,89%	0,83%	0,83%	227,40%	1,89%
Fevereiro	1.214.194,54	450.000,00	531.298,05	1.138.580,04	5.683,55	28.218,94	0,47%	2,37%	0,90%	1,73%	136,52%	1,89%
Março	1.138.580,04	0,00	83.200,00	1.059.798,76	4.418,72	32.637,66	0,39%	2,77%	1,19%	2,95%	93,77%	2,77%
Abril	1.059.798,76	1.226.962,99	1.460.963,04	837.660,60	11.861,89	44.499,55	0,52%	3,30%	1,06%	4,04%	81,65%	1,89%
Mai	837.660,60	526.504,33	619.742,83	758.877,41	14.455,31	58.954,86	1,73%	5,08%	0,64%	4,71%	107,96%	2,77%
Junho	758.877,41	662.503,40	792.368,82	650.117,42	21.105,43	80.060,29	1,48%	6,64%	0,45%	5,18%	128,27%	2,77%
Julho	650.117,42	577.996,00	685.591,37	554.553,13	12.031,08	92.091,37	0,98%	7,69%	0,72%	5,94%	129,40%	1,89%
Agosto	554.553,13	641.691,27	633.466,44	560.302,50	-2.475,46	89.615,91	-0,21%	7,46%	0,62%	6,60%	113,13%	2,77%
Setembro	560.302,50	764.934,42	824.131,79	517.641,00	16.535,87	106.151,78	1,25%	8,80%	0,45%	7,07%	124,48%	1,89%
Outubro	517.641,00	590.316,72	644.690,23	475.453,13	12.185,64	118.337,42	1,10%	10,00%	0,63%	7,75%	129,02%	1,89%
Novembro	475.453,13	624.124,47	656.293,65	441.279,34	-2.004,61	116.332,81	-0,18%	9,80%	0,98%	8,80%	111,33%	1,89%
Dezembro	441.279,34	0,00	349.432,04	99.944,44	8.097,14	124.429,95	1,83%	11,81%	1,64%	10,59%	111,57%	3,30%

Investimentos x Meta Atuarial

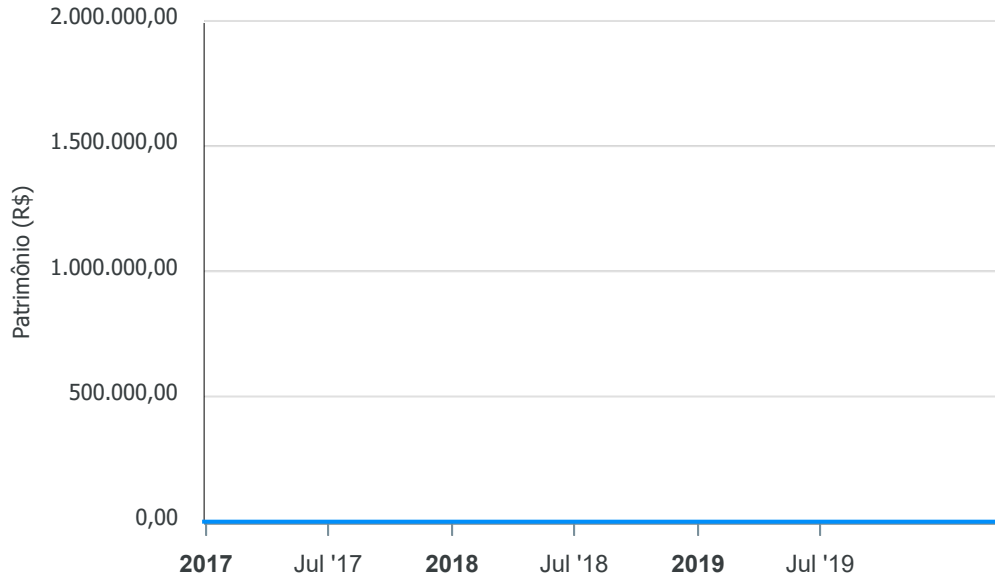


Documento Assinado Digitalmente por JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: https://pcc.lem.pe.gov.br/IPP/vfidalhc/seguriCodigoDocumento/90092012-d1eb-4514-bb76-57777ebaad0a

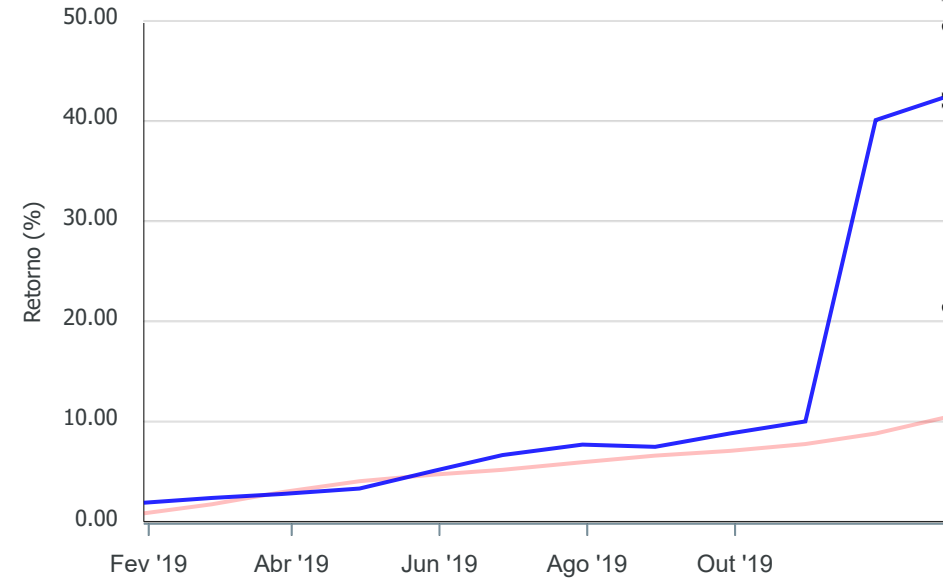


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6a

ANO 36M



**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
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	103.902,44	0,00	82.174,10	23.748,30	2.019,96	1,94%	1,99%	2,80%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	13.558,31	0,00	10.000,00	3.658,70	100,39	0,74%	1,10%	0,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	30.531,75	0,00	28.873,03	1.880,89	222,17	0,73%	1,21%	1,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.772,44	0,00	1.530,00	5.266,75	24,31	0,36%	0,40%	0,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	60.943,18	0,00	61.000,00	120,24	177,06	0,29%	0,40%	0,07%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	169.193,93	0,00	165.854,91	3.649,70	310,68	0,18%	0,59%	0,93%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,31%	0,01%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>384.902,06</b>	<b>0,00</b>	<b>349.432,04</b>	<b>38.324,59</b>	<b>2.854,57</b>	<b>0,74%</b>		<b>1,95%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinatura em: https://sistemas.gestor.gov.br/gpp/vizualizacaoDocumentoCodigo do documento: 90b97012-d1eb-4514-bb76-57777ebad0ba



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	56.377,28	0,00	0,00	61.619,85	5.242,57	9,30%	9,30%	3,97%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>56.377,28</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>61.619,85</b>	<b>5.242,57</b>	<b>9,30%</b>		<b>3,97%</b>

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinse em: https://cdec.ic.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba



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
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	50.797,67	102.348,91	133.292,58	23.748,30	3.894,30	2,54%	2,70%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	111.590,96	479.436,34	589.765,95	3.649,70	2.388,35	0,40%	1,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	60.808,03	70.000,00	130.389,32	1.880,89	1.462,18	1,12%	2,52%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,00	362.655,94	360.000,00	3.658,70	1.002,76	0,28%	2,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	180.262,24	200.000,00	375.968,07	5.266,75	972,58	0,26%	1,33%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	60.395,11	0,00	61.000,00	120,24	725,13	1,20%	1,31%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	1,03%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>10.445,30</b>	<b>0,62%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinatura em: https://sistemas.fundos.gov.br/gpp/vvalidaDocumentoCodigo.do?codigo=90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba





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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Ins...
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	53.786,98	0,00	0,00	61.619,85	7.832,87	14,56%	14,56%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>7.832,87</b>	<b>14,56%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
 Assine em: <https://doc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 90697012-41eb-4514-bb76-57777eba0ba



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
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	1.967.590,47	1.981.863,57	23.748,30	38.021,40	1,93%	22,59%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	85.836,93	1.328.654,07	1.437.002,73	3.649,70	26.161,43	1,85%	16,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	75.099,79	632.932,15	722.030,42	1.880,89	15.879,37	2,24%	12,85%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	189.775,81	807.655,94	1.002.193,17	3.658,70	8.420,12	0,84%	11,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	211.373,81	1.022.959,47	1.234.316,56	5.266,75	5.250,03	0,43%	6,55%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	201.600,00	206.144,09	0,00	4.544,09	2,25%	11,68%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	57.651,47	0,00	61.198,05	120,24	3.666,82	6,36%	6,49%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	140.138,52	0,00	141.080,99	0,00	942,47	0,67%	5,72%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	179.379,77	179.790,36	0,00	410,59	0,23%	13,89%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00	67.918,10	68.081,52	0,01	163,43	0,24%	5,07%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	18,04	577.500,00	577.600,58	0,00	82,54	0,01%	0,98%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>103.542,29</b>	<b>1,37%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinatura em: https://sistemas.pe.gov.br/validarDocumento.aspx?CodigoDocumento:90697012-d1eb-4514-bb76-57777ebad6ba



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Ins...
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,00	50.000,00	0,00	61.619,85	11.619,85	23,24%	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	80.000,00	85.603,24	0,00	5.603,24	7,00%	41,75%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	47.443,63	51.108,20	0,00	3.664,57	7,72%	31,00%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>20.887,66</b>	<b>51,28%</b>	

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA  
Assinse em: https://etec.br/pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 90697012-d1eb-4514-bb76-57777eba0ba