



Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2013

Documento assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA
Acesso em: 11/12/2013 10:51:11
https://etc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: a782344e-2172-4e61-9c46-a3784f580f70

LEMA
ECONOMIA & FINANÇAS

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



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA
 Acesse em: <https://etcd.cce.gov.br/epi/validarDocumento.aspx?Codigo=documento: a78234de-2172-4e61-9c46-a3784f580f70>

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			5.698,74	0,74%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	211.373,81	27,61%	1.477	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	75.099,79	9,81%	724	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	57.651,47	7,53%	1.266	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	189.775,81	24,79%	732	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	140.138,52	18,30%	827	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea b
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	18,04	0,00%	15.289	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	85.836,93	11,21%	345	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea b
		TOTAL -	765.593,11				

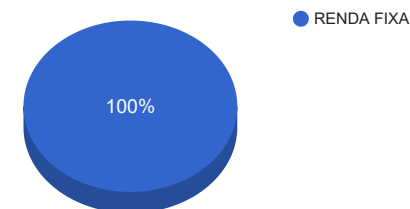


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (dezembro / 2018)

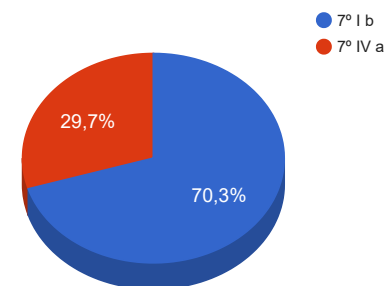
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	533.900,88	69,74%	50,00%	70,00%	100,00%	231.692,23
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	225.993,49	29,52%	0,00%	15,00%	40,00%	80.243,75
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	38.279,66
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	5,00%	38.279,66
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	153.118,62
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	76.559,31
Total Carteira		759.894,37					

RENDA FIXA	765.593,11	100,75%
------------	------------	---------

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: a7823a4e-2172-4e61-9c46-a3784f580f70



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: a7823a4e-2172-4e61-9c46-a3784f580f70

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: dezembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	533.900,88	69,74%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	225.993,49	29,52%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	759.894,37	99,26%	0,00	0,00



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: a7823a4e-2172-4e61-9c46-a3784f580f70

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

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	702.242,90	91,73%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	57.651,47	7,53%	0,00%



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA
Acesso em: https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validarDoc.seam Código do documento: a78234de-2172-4e61-9ca6-a3784f580f70

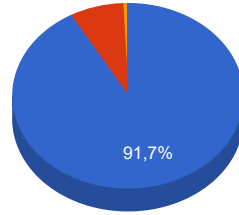
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	1,36%	9,87%	4,65%	6,86%	9,87%	23,68%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	9,67%	4,66%	6,81%	9,67%	23,25%	0,20%	0,598%	3,05%
IDKA IPCA 2 Anos	1,25%	9,75%	3,40%	6,58%	9,75%	24,69%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,16%	9,30%	3,40%	5,84%	9,30%	22,79%	0,20%	0,419%	2,35%
IRF-M 1	0,56%	6,97%	2,03%	3,78%	6,97%	18,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,54%	6,81%	2,02%	3,74%	6,81%	18,48%	0,20%	0,044%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	6,76%	2,00%	3,71%	6,76%	18,35%	0,10%	0,045%	0,55%
CDI	0,49%	6,42%	1,54%	3,15%	6,42%	16,98%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,48%	6,23%	1,51%	3,06%	6,23%	16,79%	0,20%	0,006%	0,02%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,09%	1,26%	0,29%	0,59%	1,26%	5,97%	5,00%	0,000%	0,01%
IPCA	0,15%	3,75%	0,39%	1,11%	3,75%	6,80%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,33%	7,82%	3,43%	5,24%	7,82%	19,91%	0,002	0,617%	1,81%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-



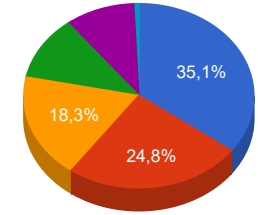
Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (dezembro / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	702.242,90	91,73%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	57.651,47	7,53%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	5.698,74	0,74%



- CAIXA ECONÔMI...
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- DISPONIB...

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	269.025,28	35,14%
IDKA IPCA 2A	189.775,81	24,79%
CDI	140.156,56	18,31%
GESTÃO DURATION	85.836,93	11,21%
IMA-B 5	75.099,79	9,81%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	5.698,74	0,74%



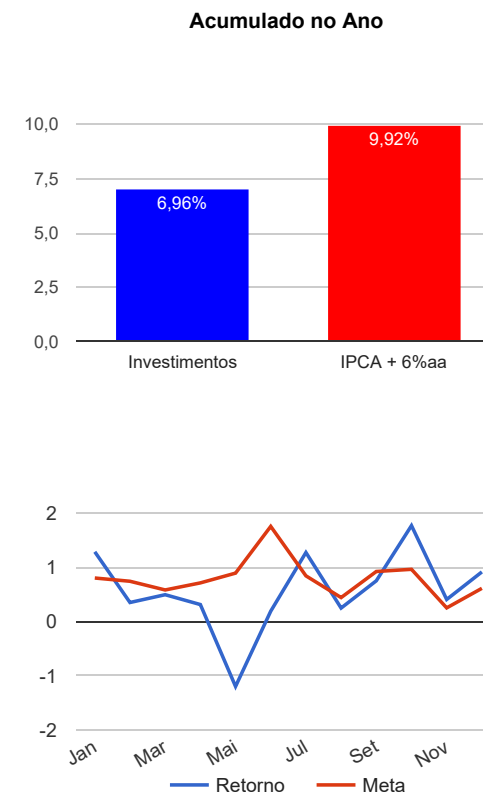
- IRF-M 1
- IDKA IPCA 2A
- CDI
- GESTÃO DURATION
- IMA-B 5
- DISPONIBILIDADE FINANCEIRA

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA
 Acesse em: https://etc.br/epsa/br/epp/validaDoc.seam Código do documento: a78234e-2172-4e61-9c46-a37841580f70



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	733.052,76	968.230,69	461.150,86	1.256.036,40	15.903,81	1,28%	0,80%	160,01%	0,62%
Fevereiro	1.256.036,40	635.329,58	494.403,43	1.401.840,42	4.877,87	0,35%	0,74%	47,29%	0,56%
Março	1.401.840,42	545.969,71	548.795,30	1.405.922,81	6.907,98	0,49%	0,58%	85,38%	0,46%
Abril	1.405.922,81	1.210.943,17	1.294.998,17	1.326.247,77	4.379,96	0,31%	0,71%	44,01%	0,58%
Mai	1.326.247,77	886.038,39	828.971,51	1.366.779,01	-16.535,64	-1,20%	0,89%	-134,51%	1,29%
Junho	1.366.779,01	516.637,60	479.061,14	1.407.018,02	2.662,55	0,19%	1,75%	10,82%	1,93%
Julho	1.407.018,02	524.948,73	518.948,03	1.430.955,80	17.937,08	1,27%	0,84%	150,82%	0,81%
Agosto	1.430.955,80	1.563.317,88	1.544.143,01	1.457.526,13	7.395,46	0,25%	0,44%	55,78%	0,61%
Setembro	1.457.526,13	974.988,70	1.013.632,41	1.429.798,60	10.916,18	0,75%	0,92%	81,20%	0,39%
Outubro	1.429.798,60	1.021.229,42	1.072.231,64	1.404.024,75	25.228,37	1,76%	0,96%	183,36%	0,50%
Novembro	1.404.024,75	269.402,38	416.881,66	1.262.232,75	5.687,28	0,41%	0,25%	160,39%	0,58%
Dezembro	1.262.232,75	0,00	513.851,69	759.894,37	11.513,31	0,91%	0,61%	148,50%	0,25%
Acumulado no ano					96.874,21	6,96%	9,92%	70,16%	



Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: a7823a4e-2172-4e61-9ca6-a3784f580f70



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição (R\$)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	370.770,20	0,00	300.000,00	75.099,79	4.329,59	1,17%	0,60%	1,38
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	187.603,11	0,00	0,00	189.775,81	2.172,70	1,16%	0,42%	1,11
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	247.391,76	0,00	164.415,32	85.836,93	2.860,49	1,16%	0,62%	1,38
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	210.233,61	0,00	0,00	211.373,81	1.140,20	0,54%	0,04%	0,55
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	57.344,10	0,00	0,00	57.651,47	307,37	0,54%	0,04%	0,55
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	188.855,94	0,00	49.420,36	140.138,52	702,94	0,37%	0,01%	0,44
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	34,03	0,00	16,01	18,04	0,02	0,06%	0,00%	0,00
Total Renda Fixa					11.513,31	0,91%	0,25%	

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA
Asses em: 28/12/2018 10:00:00
DocId: 78234e-2172-4e61-9c46-a37841580f70



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	534.679,19	512.229,42	844.922,29	211.373,81	9.387,49	1,54%	2,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	97.336,85	269.402,38	300.000,00	75.099,79	8.360,56	4,59%	4,66%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	242.363,20	0,00	164.415,32	85.836,93	7.889,05	3,26%	3,43%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	225.035,05	0,00	41.721,14	189.775,81	6.461,90	3,11%	3,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	509.000,00	514.787,96	0,00	5.787,96	1,14%	8,28%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	195.553,42	0,00	58.108,13	140.138,52	2.693,23	1,39%	1,51%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	130.803,63	0,00	74.998,34	57.651,47	1.846,18	1,72%	2,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	4.027,26	0,00	4.011,81	18,04	2,59	0,19%	0,29%
Total Renda Fixa					42.428,96	3,11%	

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA
 Acesso em: https://etec.ce.gov.br/epm/validaDoc.aspx?CodigoDoDocumento: a78234e-2172-4e61-9c46-a3784f580f70



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	201.865,33	2.101.238,16	2.121.570,77	211.373,81	29.841,09	5,84%	6,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	394.225,42	330.457,84	741.835,44	0,00	17.152,18	4,73%	12,84%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	239.271,77	164.415,32	85.836,93	10.980,48	4,59%	7,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	366.489,20	300.000,00	75.099,79	8.610,59	4,86%	9,67%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	223.299,69	41.721,14	189.775,81	8.197,26	3,91%	9,30%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	104.059,29	21.352,66	74.998,34	57.651,47	7.237,86	6,40%	6,76%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	509.000,00	514.787,96	0,00	5.787,96	1,14%	12,30%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	15.557,00	504.173,54	385.119,05	140.138,52	5.527,03	4,21%	6,23%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	4.821.753,39	4.825.068,87	18,04	3.333,52	0,55%	1,26%
POUPANÇA BANCO DO BRASIL	17.345,72	0,00	17.551,96	0,00	206,24	1,19%	-
Total Renda Fixa					96.874,21	7,24%	

Documento Assinado Digitalmente por: JOSE CARLOS MARTINS DE SANTANA
 Acesso em: https://etec.ce.gov.br/epm/validarDoc.aspx?Codigo=documento: a78234de-2172-4e61-9c46-a3784f580f70