



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

Documento assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDEIRO DE CARVALHO FILHO
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 72ef65ac-8105-4235-8529-5ee48a1be66f

LEMA
ECONOMIA & FINANÇAS

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 (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			1.751.452,22	4,50%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.763.450,75	7,10%	1.477	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BNB RPPS PREVIDÊNCIA FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B	D+1	Não há	574.328,63	1,47%	56	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.122.365,71	23,42%	306	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	545.879,25	1,40%	197	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	765.448,12	1,97%	724	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.505.337,82	3,87%	732	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.742.094,87	19,88%	86	1,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.071.507,17	2,75%	336	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	836.173,04	2,15%	31	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	4.272.687,11	10,97%	81	0,77%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	255.734,03	0,66%	26	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	265.476,47	0,68%	70	0,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.393.237,27	3,58%	33	0,62%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b
MULTINVEST FI AÇÕES	D+11	Não há	1.067.323,24	2,74%	103	3,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea a
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	3.665.670,84	9,41%	9	13,15%	Desenquadrado - RF
ÁTICO II IMA-B FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.349.573,70	3,47%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	38.947.740,24				

Documento Assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDIERO DE CARVALHO FILHO
Acesse em: <https://etcc.cef.gov.br/epi/validarDocumento.aspx?CodigoDocumento=72655-2655-05423585295ee48a1be66f>

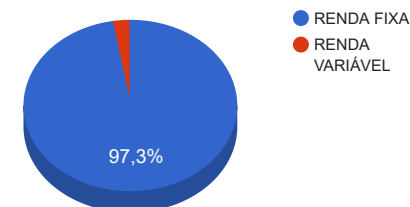


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (dezembro / 2018)

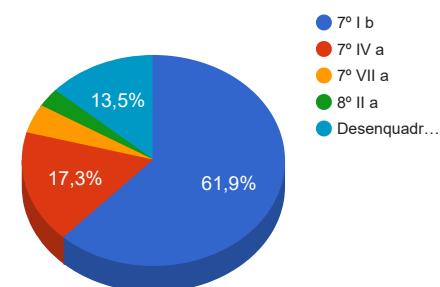
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	23.018.905,15	59,10%	30,00%	65,00%	100,00%	15.928.835,09
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	6.436.101,35	16,52%	0,00%	25,00%	40,00%	9.142.994,75
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.658.713,74	4,26%	0,00%	5,00%	5,00%	288.673,27
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.067.323,24	2,74%	0,00%	5,00%	20,00%	6.722.224,81
Desenquadrado - RF	0,00%	5.015.244,54	12,88%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.015.244,54
Total Carteira		37.196.288,02					

RENDA FIXA	37.880.417,00	101,84%
RENDA VARIÁVEL	1.067.323,24	2,87%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Documento Assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDEIRO DE CARVALHO FILHO
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 72ef65ac-8105-4235-8529-5ee48a9be66f



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 "	23.018.905,15	59,10%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	6.436.101,35	16,52%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.658.713,74	4,26%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.067.323,24	2,74%	0,00%	0,00%
Desenquadrado - RF	5.015.244,54	12,88%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	37.196.288,02	95,50%	0,00	0,00

Documento Assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDEIRO DE CARVALHO FILHO
Acesse em: <https://etcpe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 72ef65ac-8105-4235-8529-5ee48a1be66f



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
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	22.208.654,86	57,02%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.580.115,94	14,33%	0,00%
MULTINVEST CAPITAL	4.732.994,08	12,15%	3,26%
Horus GGR	1.393.237,27	3,58%	0,37%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.349.573,70	3,47%	4,11%
Elleven Gestora de Recursos	1.091.907,07	2,80%	0,15%
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	574.328,63	1,47%	0,01%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	265.476,47	0,68%	0,02%

Documento Assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDEIRO DE CARVALHO FILHO
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 72ef65ac-8105-4235-8529-5ee48a1be66f



Documento Assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDEIRO DE CARVALHO FILHO
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/pp/validaDoc.seam> Código do documento: 72ef65ac-8105-4235-8529-5ee48a0be60f

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+	1,88%	15,41%	14,46%	16,23%	15,41%	30,12%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,80%	14,98%	14,17%	15,84%	14,98%	29,28%	0,20%	1,763%	7,83%
IMA-B	1,65%	13,06%	9,89%	11,77%	13,06%	27,52%	-	-	-
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,62%	12,66%	9,79%	11,56%	12,66%	26,42%	0,20%	1,225%	5,48%
BNB RPPS PREVIDÊNCIA FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B	1,49%	11,69%	8,21%	10,23%	11,69%	25,21%	0,20%	1,026%	4,83%
IMA-B 5	1,36%	9,87%	4,65%	6,86%	9,87%	23,68%	-	-	-
ÁTICO II IMA-B FI RENDA FIXA	1,41%	3,22%	-0,32%	1,37%	3,22%	14,67%	0,70%	0,738%	6,23%
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%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,36%	9,62%	4,73%	6,86%	9,62%	23,50%	0,20%	0,601%	3,18%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,55%	-17,91%	2,06%	-9,15%	-17,91%	-13,49%	0,70%	0,420%	14,65%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-0,91%	-11,41%	-0,46%	1,17%	-11,41%	-2,94%	0,70%	2,832%	8,52%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-2,20%	2,99%	-0,28%	-2,90%	2,99%	15,52%	0,70%	5,391%	7,23%
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%
IPCA + 7,00% ao ano	0,69%	10,95%	2,07%	4,59%	10,95%	22,12%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,77%	-16,38%	10,83%	6,85%	-16,38%	-13,14%	1,65%	0,338%	17,46%
LME REC IPCA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR	-0,34%	1.128,83%	2,01%	-	1.128,83%	-46,78%	0,00%	-	-



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,56%	6,97%	2,03%	3,78%	6,97%	18,87%	-	-	-
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%
BRAPRECO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,54%	6,72%	1,98%	3,67%	6,72%	18,37%	0,20%	0,046%	0,55%
CDI	0,49%	6,42%	1,54%	3,15%	6,42%	16,98%	-	-	-
BRAPRECO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,48%	6,22%	1,49%	3,06%	6,22%	16,74%	0,15%	0,000%	0,01%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Documento Assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDEIRO DE CARVALHO FILHO
 Acesso em: https://etc.ice.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 72ef65ac-8105-4235-8529-5ee48a0be66f



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

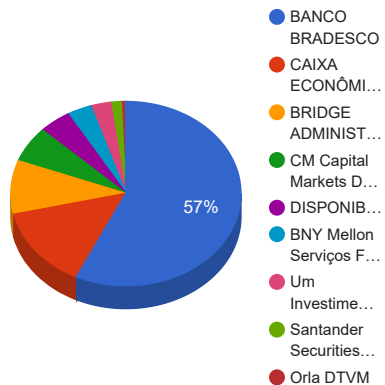
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	-1,81%	15,03%	10,77%	20,79%	15,03%	45,93%	-	-	-
MULTINVEST FI AÇÕES	-1,50%	22,89%	18,33%	24,88%	22,89%	59,22%	1,50%	8,480%	21,52%

Documento Assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDEIRO DE CARVALHO FILHO
Acesse em: <https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 72ef65ac-8105-4235-8529-5ee484be66f

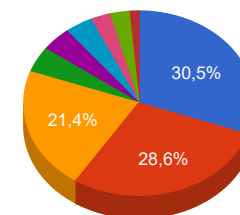


Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (dezembro / 2018)

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	22.208.654,86	57,02%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.580.115,94	14,33%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	3.665.670,84	9,41%
CM Capital Markets DTVM	2.460.560,51	6,32%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.751.452,22	4,50%
BNY Mellon Serviços Financeiros	1.349.573,70	3,47%
Um Investimentos	1.091.907,07	2,80%
Santander Securities Services	574.328,63	1,47%
Orla DTVM	265.476,47	0,68%



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	11.885.816,46	30,52%
IMA-B 5	11.145.286,84	28,62%
IMA-B	8.316.423,50	21,35%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.751.452,22	4,50%
FIDC - ABERTO	1.658.713,74	4,26%
IDKA IPCA 2A	1.505.337,82	3,87%
CDI	1.071.507,17	2,75%
AÇÕES - LIVRES	1.067.323,24	2,74%
IMA-B 5+	545.879,25	1,40%



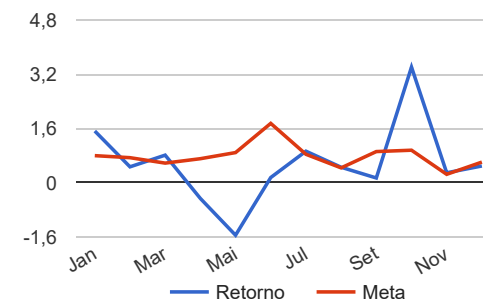
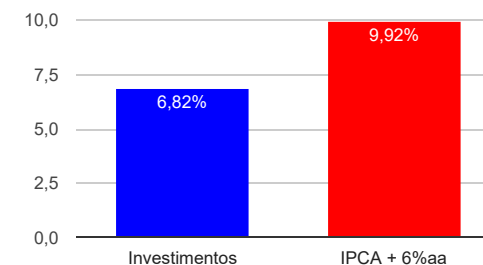
Documento Assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDEIRO DE CARVALHO FILHO
Acesse em: <https://app.leg.br/empresas/assinatura/72ef65ac-8105-4235-8529-5ee484be66f>



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	33.900.695,00	0,00	0,00	34.417.639,03	516.944,03	1,52%	0,80%	190,26%	1,02%
Fevereiro	34.417.639,03	0,00	0,00	34.579.617,16	161.978,13	0,47%	0,74%	63,74%	1,10%
Março	34.579.617,16	0,00	0,00	34.861.333,45	281.716,29	0,81%	0,58%	141,15%	1,06%
Abril	34.861.333,45	0,00	0,00	34.700.774,96	-160.558,49	-0,46%	0,71%	-65,07%	1,78%
Mai	34.700.774,96	0,00	0,00	34.165.458,79	-535.316,17	-1,54%	0,89%	-173,59%	1,73%
Junho	34.165.458,79	0,00	0,00	34.218.516,22	53.057,43	0,16%	1,75%	8,86%	3,00%
Julho	34.218.516,22	0,00	0,00	34.537.100,86	318.584,64	0,93%	0,84%	110,62%	2,23%
Agosto	34.537.100,86	15,97	0,00	34.695.331,96	158.215,13	0,46%	0,44%	103,47%	2,26%
Setembro	34.695.331,96	0,00	0,00	34.744.693,89	49.361,93	0,14%	0,92%	15,42%	1,58%
Outubro	34.744.693,89	0,00	0,00	35.928.542,01	1.183.848,12	3,41%	0,96%	354,08%	2,57%
Novembro	35.928.542,01	0,00	0,00	36.034.611,10	106.069,09	0,30%	0,25%	116,90%	1,57%
Dezembro	36.034.611,10	9.251.456,00	8.273.161,82	37.196.288,02	183.382,74	0,50%	0,61%	80,66%	1,26%
Acumulado no ano					2.317.282,87	6,82%	9,92%	68,77%	

Acumulado no Ano



Documento Assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDEIRO DE CARVALHO FILHO
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/ppv/validaDoc.seam> Código do documento: 72ef65ac-8105-4235-8529-5ee484be66f

Documento Assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDEIRO DE CARVALHO FILHO
 Acesso em: <https://sica.trf6.jus.br/proc/2016/5-ac-8915-1035-8529-5ee48a1be6661>

Documento Assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDEIRO DE CARVALHO FILHO
 Acesso em: <https://sica.trf6.jus.br/proc/2016/5-ac-8915-1035-8529-5ee48a1be6661>



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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição (R\$)
MULTINVEST FI AÇÕES	1.083.559,67	0,00	0,00	1.067.323,24	-16.236,43	-1,50%	8,48%	-1,50%
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	507.624,46	0,00	478.813,14	0,00	-28.811,32	-5,68%	10,62%	-4,96%
Total Renda Variável					-45.047,75	-2,83%	8,48%	

Documento Assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDEIRO DE CARVALHO FILHO
Assessoria em: https://eic-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 72ef65ac-8105-4235-8529-5ee48a1be66f



Documento Assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDEIRO DE CARVALHO FILHO
Acesso em: https://efce.fec-pe.gov.br/eppl/validarDoc.aspx?CodigoDocumento=72ef65ac-8c05-4235-8529-5ee48a1be66f

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 (%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	5.679.422,61	1.500.000,00	0,00	7.742.094,87	562.672,26	9,54%	9,79%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	5.036.886,58	0,00	1.000.000,00	4.272.687,11	235.800,53	4,68%	4,73%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.257.068,22	0,00	0,00	1.393.237,27	136.169,05	10,83%	10,83%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.322.903,65	0,00	5.394.348,68	0,00	71.445,03	1,34%	1,51%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	478.141,10	0,00	0,00	545.879,25	67.738,15	14,17%	14,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.708.769,45	0,00	0,00	2.763.450,75	54.681,30	2,02%	2,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.455.786,16	0,00	0,00	1.505.337,82	49.551,66	3,40%	3,40%
BNB RPPS PREVIDÊNCIA FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B	530.737,59	0,00	0,00	574.328,63	43.591,04	8,21%	8,21%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.333.285,09	7.751.456,00	0,00	9.122.365,71	37.624,62	1,64%	1,98%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	2.437.412,34	0,00	1.400.000,00	1.071.507,17	34.094,83	1,40%	1,49%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	731.372,05	0,00	0,00	765.448,12	34.076,07	4,66%	4,66%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	819.271,51	0,00	0,00	836.173,04	16.901,53	2,06%	2,06%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	266.026,22	0,00	0,00	265.476,47	-549,75	-0,21%	2,01%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	256.903,29	0,00	0,00	255.734,03	-1.169,26	-0,46%	-0,46%
ÁTICO II IMA-B FI RENDA FIXA	1.353.972,58	0,00	0,00	1.349.573,70	-4.398,88	-0,32%	-0,32%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.675.786,96	0,00	0,00	3.665.670,84	-10.116,12	-0,28%	-0,28%
Total Renda Fixa					1.328.112,06	3,96%	



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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
MULTINVEST FI AÇÕES	901.976,70	0,00	0,00	1.067.323,24	165.346,54	18,33%	18,33%
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	498.971,79	0,00	478.813,14	0,00	-20.158,65	-4,04%	-3,25%
Total Renda Variável					145.187,89	10,36%	

Documento Assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDEIRO DE CARVALHO FILHO
 Acesso em: https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 72ef65ac-8105-4235-8529-5ee484be66f

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 (%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	5.534.835,62	1.500.000,00	0,00	7.742.094,87	707.259,25	12,40%	12,66%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	4.812.218,79	0,00	1.000.000,00	4.272.687,11	460.468,32	9,57%	9,62%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.081.796,90	0,00	5.394.348,68	0,00	312.551,78	6,15%	6,33%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	21.604,06	0,00	0,00	265.476,47	243.872,41	1.128,83%	1.128,83%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.587.374,06	0,00	0,00	2.763.450,75	176.076,69	6,81%	6,81%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	2.328.888,42	0,00	1.400.000,00	1.071.507,17	142.618,75	6,12%	6,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.377.215,72	0,00	0,00	1.505.337,82	128.122,10	9,30%	9,30%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.559.237,72	0,00	0,00	3.665.670,84	106.433,12	2,99%	2,99%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.274.012,88	7.751.471,97	0,00	9.122.365,71	96.880,86	6,36%	6,72%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	474.771,85	0,00	0,00	545.879,25	71.107,40	14,98%	14,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	697.971,39	0,00	0,00	765.448,12	67.476,73	9,67%	9,67%
BNB RPPS PREVIDÊNCIA FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B	514.220,93	0,00	0,00	574.328,63	60.107,70	11,69%	11,69%
ÁTICO II IMA-B FI RENDA FIXA	1.307.535,14	0,00	0,00	1.349.573,70	42.038,56	3,22%	3,22%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	288.680,63	0,00	0,00	255.734,03	-32.946,60	-11,41%	-11,41%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.018.640,38	0,00	0,00	836.173,04	-182.467,34	-17,91%	-17,91%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.666.198,27	0,00	0,00	1.393.237,27	-272.961,00	-16,38%	-16,38%
Total Renda Fixa					2.126.638,73	6,51%	

Documento Assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDEIRO DE CARVALHO FILHO
Assinado em: 31/12/2018
Acesso em: https://efc.br.gov.br/epm/validarDoc.aspx?CodigoDocumento=72ef65c-8405-4235-8529-5ee48a1be66f



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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição
MULTINVEST FI AÇÕES	868.507,35	0,00	0,00	1.067.323,24	198.815,89	22,89%	22,89%
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	486.984,89	0,00	478.813,14	0,00	-8.171,75	-1,68%	-0,86%
Total Renda Variável					190.644,14	14,06%	

Documento Assinado Digitalmente por: SEBASTIAO CORDEIRO DE CARVALHO FILHO
Assinatura em: https://etce.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 72ef65ac-8105-4235-8529-5ee484be66f



ESTADO DE PERNAMBUCO
TRIBUNAL DE CONTAS

Resolução TC nº 48, de 19 de dezembro de 2018

ANEXO XII

DEMONSTRATIVO DE CUMPRIMENTO DOS LIMITES DE ALOCAÇÃO DOS RECURSOS EM MOEDA CORRENTE DO REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA, POR SEGMENTO DE APLICAÇÃO

Em R\$

Segmento de Aplicação	Tipo de Investimento	Limite estabelecido pelo Conselho Monetário Nacional (CMN)		Valor Aplicado	Porcentual Aplicado
		Base Legal	Porcentual		
REND A FIXA	FI RENDA FIXA 100% TP	RES. CMN 3922/2010, ART 7, I, b	100%	23.018.905,15	59,10%
REND A FIXA	FI RENDA FIXA	RES. CMN 3922/2010, ART 7, IV, a	40%	6.436.101,35	16,52%
REND A FIXA	FIDC SÊNIOR	RES. CMN 3922/2010, ART 7, VII, a	5%	1.658.713,74	4,26%
REND A VARIÁVEL	FI EM AÇÕES LIVRES	RES. CMN 3922/2010, ART 8, II, b	20%	1.067.323,24	2,74%
DISPONIBILIDADES	-	RES. CMN 3922/2010, ART 20	100%	1.751.452,22	4,50%
REND A FIXA	DESENQUADRADO	-	-	5.015.244,54	12,88%