



Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2020





Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

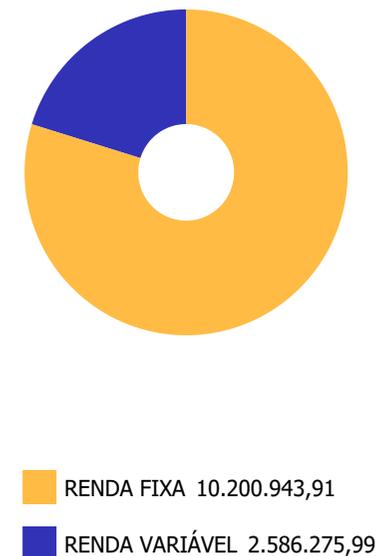
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	2.621.861,28	20,50%	885	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	827.798,07	6,47%	899	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.399.904,34	18,77%	1.361	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.596.757,55	12,49%	976	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.754.622,67	21,54%	1.005	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.384.583,34	10,83%	116	0,18%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.201.692,65	9,40%	5.634	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a
Total para cálculo dos limites da Resolução			12.787.219,90				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			4,88				Artigo 6º
PL Total			12.787.224,78				

Documento Assinado Digitalmente por: SILEIDE COSTA DA SILVA
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/ep/vvalidaDoc?seamCodigo=documento:4856780e-106b-4f8d-a54a-b2ad0313a10a>



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	12.787.219,90
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	10.200.943,91	79,77%	40,00%	62,00%	100,00%	2.586.275,99
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	12.787.219,90
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	639.361,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	7.672.331,94
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	7.672.331,94
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	40,00%	5.114.887,96
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	5.114.887,96
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	2.557.443,98
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.918.082,99
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.918.082,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	639.361,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	639.361,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	639.361,00
Total Renda Fixa	100,00%	10.200.943,91	79,77%	40,00%	82,00%	570,00%	



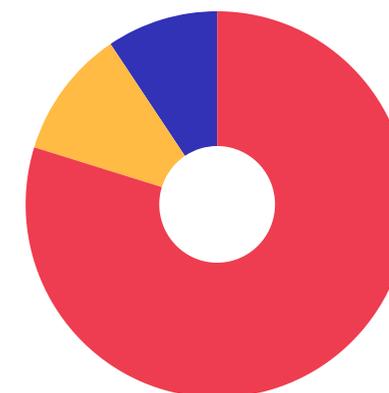
Documento Assinado Digitalmente por: SILEIDE COSTA DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: d856780e-106b-4f8d-a54a-b2ad0313a10a



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	1.384.583,34	10,83%	0,00%	6,00%	30,00%	2.451.582,63
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	3.836.165,97
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	1.201.692,65	9,40%	0,00%	5,00%	20,00%	1.355.751,33
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	2.557.443,98
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	10,00%	1.278.721,99
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	639.361,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	639.361,00
Total Renda Variável	30,00%	2.586.275,99	20,23%	0,00%	18,00%	120,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.278.721,99
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.278.721,99
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.278.721,99
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	



7º I b 8º I a 8º II a

Documento Assinado Digitalmente por: SILEIDE COSTA DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 4856780e-106b-4f8d-a54a-b2ad0313a10a



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Dezembro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	12.787.219,90	100,00	0,00

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	10.200.943,91	79,77	40,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	1.384.583,34	10,83	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	1.201.692,65	9,40	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Documento Assinado Digitalmente por: SILENE GOSPA DA SILVA
 Acesse em: https://www.tcece.tcece.gov.br/docapp/validarDocumento.aspx


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,73%	8,62%	3,05%	5,10%	8,62%	21,46%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,65%	8,03%	3,05%	4,76%	8,03%	20,12%	0,71%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,31%	3,84%	0,70%	1,21%	3,84%	10,86%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,29%	3,63%	0,65%	1,12%	3,63%	10,42%	0,10%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,83%	8,04%	3,38%	4,72%	8,04%	22,25%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,82%	7,75%	3,32%	4,57%	7,75%	21,60%	0,74%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	4,85%	6,41%	7,18%	8,21%	6,41%	30,83%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,84%	6,06%	7,13%	8,09%	6,06%	30,02%	2,04%	0,11%
IPCA (Benchmark)	1,35%	4,52%	3,13%	4,42%	4,52%	9,02%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,32%	6,67%	2,04%	1,95%	6,67%	24,19%	0,55%	0,02%

 Documento Assinado Digitalmente por: SILEIDE COSTA DA SILVA
 Acesse em: <https://etec.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: d856780e-106f-4f8d-a54a-b2ad0313a10a



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	9,30%	2,92%	25,81%	25,21%	2,92%	35,42%	-	-
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	9,24%	2,75%	25,53%	24,92%	2,75%	34,60%	7,04%	0,42%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	7,66%	-6,94%	25,11%	17,91%	-6,94%	31,92%	7,35%	0,39%

Documento Assinado Digitalmente por: SILEIDE COSTA DA SILVA
Acesse em: <https://etcc.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: d856780e-106b-4f8d-a54a-b2ad0313a10a



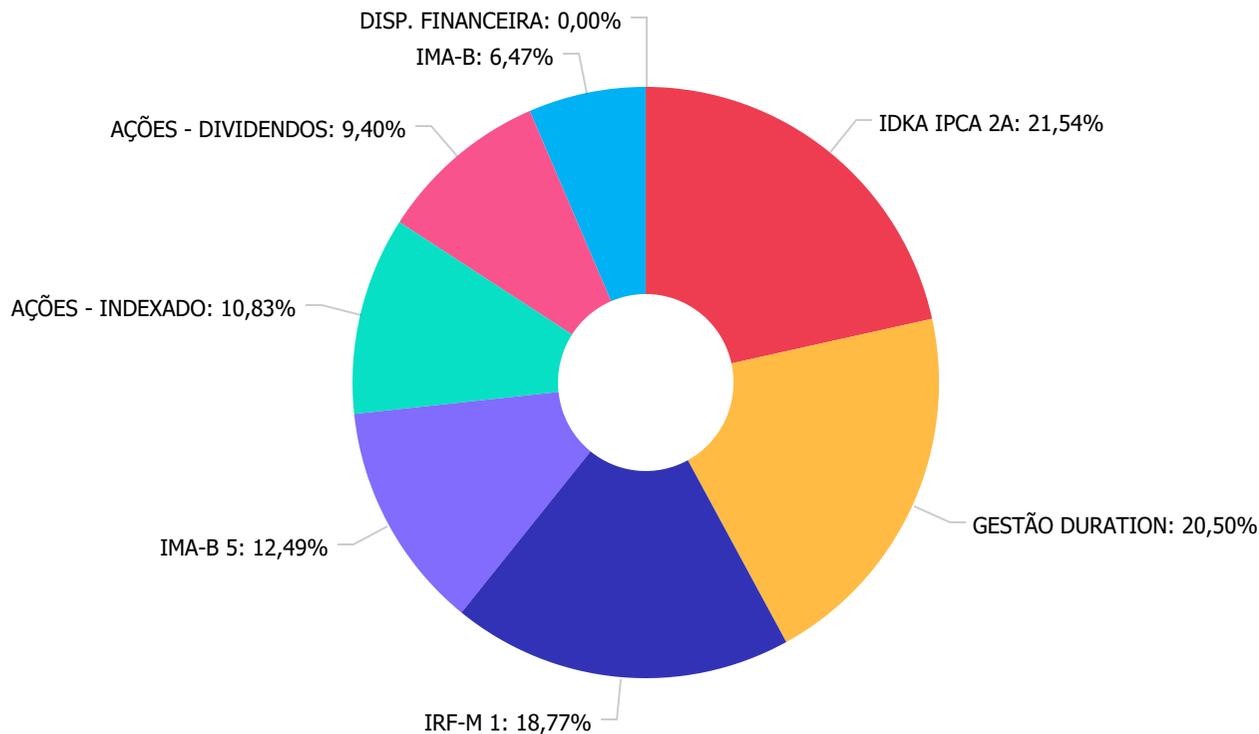
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2020)



Documento Assinado Digitalmente por: SILEIDE COSTA DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 4856780e-106b-4f8d-a54a-b2ad0313a10a



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2020)



IDKA IPCA 2A	2.754.620,65
GESTÃO DURATION	2.621.861,28
IRF-M 1	2.399.904,33
IMA-B 5	1.596.751,51
AÇÕES - INDEXADO	1.384.580,34
AÇÕES - DIVIDENDOS	1.201.691,65
IMA-B	827.798,07
DISP. FINANCEIRA	0,00

Documento Assinado Digitalmente por: SILEIDIA COSTA DA SILVA
 Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validador>

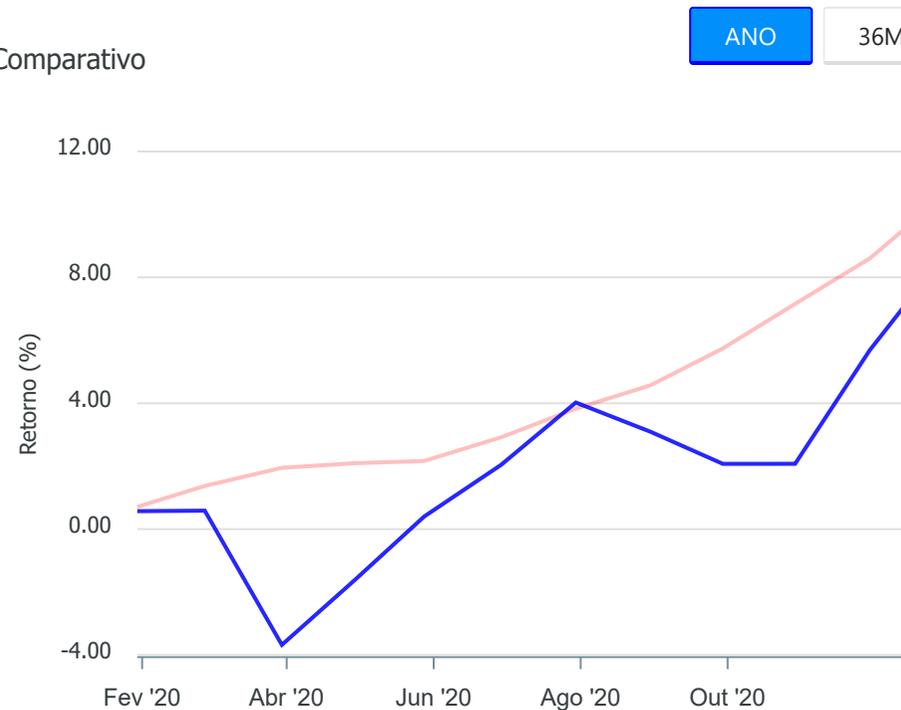


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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: SILEIDE COSTA DA SILVA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: d856780e-106b-4f8d-a54a-b2ad0313a10a



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2020

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 ...	744.114,02	45.944,00	0,00	827.798,07	37.740,05	4,78%	4,84%	2,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.568.219,18	0,00	0,00	1.596.757,55	28.538,37	1,82%	1,82%	0,74%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.583.392,10	126.865,00	0,00	2.754.622,67	44.365,57	1,64%	1,65%	0,71%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.755.354,72	0,00	169.250,00	2.621.861,28	35.756,56	1,30%	1,32%	0,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.240.494,84	179.258,58	26.285,50	2.399.904,34	6.436,42	0,27%	0,28%	0,10%
Total Renda Fixa	9.891.574,86	352.067,58	195.535,50	10.200.943,91	152.836,97	1,52%		0,64%

Documento Assinado Digitalmente por: SILEIDE COSTA DA SILVA
Assinatura em: https://sigetcepe.gov.br/gpp/vizualizarDocumento.aspx?Codigo=documento:4856780e-106b-4f8d-a54a-b2ad0313a10a



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	1.267.444,35	0,00	0,00	1.384.583,34	117.138,99	9,24%	9,24%	7,04%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.116.180,98	0,00	0,00	1.201.692,65	85.511,67	7,66%	7,66%	7,35%
Total Renda Variável	2.383.625,33	0,00	0,00	2.586.275,99	202.650,66	8,50%		7,18%

Documento Assinado Digitalmente por: SILEIDE COSTA DA SILVA
Assinatura em: https://docproc.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 4856780e-106b-4f8d-a54a-b2ad0313a10a



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.378.742,82	298.865,00	0,00	2.754.622,67	77.014,85	2,88%	3,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.142.644,98	8.851,80	585.950,00	2.621.861,28	56.314,50	1,79%	2,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	719.458,63	54.795,80	0,00	827.798,07	53.543,64	6,92%	7,13%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.545.478,67	0,00	0,00	1.596.757,55	51.278,88	3,32%	3,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.125.561,40	317.441,58	57.455,50	2.399.904,34	14.356,86	0,59%	0,64%
				Total Renda Fixa	252.508,73	2,54%	

Documento Assinado Digitalmente por: SILEIDE COSTA DA SILVA
Assinatura em: https://sccs.cas.br/gov.br/gpp/vvalida/Doc:sccs:seam Código do documento: d856780e-106b-4f8d-a54a-b2ad0313a10a



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Ins
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	1.103.008,57	0,00	0,00	1.384.583,34	281.574,77	25,53%	25,53%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	960.476,89	0,00	0,00	1.201.692,65	241.215,76	25,11%	25,11%
				Total Renda Variável	522.790,53	25,34%	

Documento Assinado Digitalmente por: SILEIDE COSTA DA SILVA
Assinse em: https://eodetec.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: d856780e-106b-4f8d-a54a-b2ad0313a10a



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.098.875,42	1.566.877,19	1.245.550,00	2.621.861,28	201.658,67	5,50%	6,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.142.401,67	1.441.193,00	0,00	2.754.622,67	171.028,00	6,62%	8,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.448.537,54	214.275,53	2.202.580,00	1.596.757,55	136.524,48	3,73%	7,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.286.405,91	1.826.611,58	784.939,50	2.399.904,34	71.826,35	2,31%	3,63%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.191.286,57	110.615,80	1.500.000,00	827.798,07	25.895,70	1,12%	6,06%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	723.718,85	0,00	725.953,41	0,00	2.234,56	0,31%	4,82%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,00	12.766,50	12.804,57	0,00	38,07	0,30%	1,90%
Total Renda Fixa					609.205,83	3,79%	

Documento Assinado Digitalmente por: SILEIDE COSTA DA SILVA
Assinse em: https://secc.rgspe.gov.br/gpp/validarDocumento.aspx?Codigo=documento:4856780e-106b-4f8d-a54a-b2ad0313a10a



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Ins
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	995.000,00	0,00	1.384.583,34	389.583,34	39,15%	2,75%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	678.447,43	500.000,00	0,00	1.201.692,65	23.245,22	1,97%	-6,94%
				Total Renda Variável	412.828,56	18,99%	

Documento Assinado Digitalmente por: SILEIDE COSTA DA SILVA
Assinse em: https://eicoc.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: d856780e-106b-4f8d-a54a-b2ad0313a10a