



ATA DE REUNIÃO ORDINARIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

JUNHO/2020.

Aos dez dias do mes de julho de dois mil e vinte, as dez horas na sala de reunião do Igaprev estiveram presentes os membros do Comitê de Investimentos: Jacqueline da Silva Campelo-gerente de investimentos, Diógenes Coquita da Costa(presidente do conselho deliberativo), Héliida Luzia de Arruda Lima(presidente do conselho fiscal), Ezi Francisca da Silva Paulino (assistente administrativo-financeiro, Francisco Barreto de Menezes Leite(Gerente de Previdencia) e José Fernandes Paiva de Vasconcelos (representante do poder executivo). O Comitê de Investimentos no uso de suas atribuições se reuniu para deliberar e analisar sobre as Aplicações dos Recursos do Igarassu Previdência. Havendo quórum, passamos a analisar o desempenho dos investimentos, do cenário econômico, e outros assuntos no período de JUNHO/2020. Foi realizada a leitura do parecer sobre a pandemia (anexo) emitido pelo IGAPREV em conjunto com o Comitê de Investimento, que faz um resumo da estratégia e situação atual dos investimentos do instituto de previdência de Igarassu. O aumento da volatilidade intensificada no mês de fevereiro de 2020, especialmente durante o período de Carnaval, sinalizam cenários mais voláteis no curtíssimo prazo (próximos meses) o que pode ser visualizado no comportamento dos índices de renda fixa e variável. Isso impossibilita o alcance da meta atuarial. Conforme o relatório de rentabilidade, o risco se torna maior devido ao fluxo de caixa negativo provocado pela ausência de repasses integrais no período e, a crescente necessidade de resgate de recursos para pagamento dos benefícios previdenciários. O desempenho acumulado global foi -2,62% inferior a meta atuarial acumulada de 2,89%(IPCA+5,88%), rendimento global de R\$ 1.007.706,52 e saldo global de R\$ 32.759.641,99. Foram autorizadas operações nos fundos BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI, CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I, SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF, BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI. Em anexo, relatórios da carteira, planilhas de resgate/aplicação, posição financeira, outros. Assim, para constar, lavra-se a presente ata que segue assinada.


Héliida Luzia de Arruda Lima


Jose Fernando Paiva de Vasconcelos


Jacqueline da Silva Campelo


Diógenes Coquita da Costa


Francisco Barreto de Menezes de Leite


Ezi Francisca da Silva Paulino





REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL
IGAPREV – IGARASSU PREVIDÊNCIA LC 23/2012
CNPJ: 06.234.755/0001-37



Documento Assinado Digitalmente por: FRANCISCO BARRETO DE MENEZES LEITE
Acesse em: <https://stc.ce.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 124dc54c-8fa3-4193-4729-86f5cb0abb21

RELATÓRIO GERENCIAL

JUNHO/2020





CONTA CORRENTE FUNDOS	CORRENTE	FUNDOS	APLICAÇÃO	RESGATE	RENDIMENTO	SALDO ATUAL
CONTA CORRENTE 13000000-0	FRANCIERO	367.856,43				
FDI MA-5 TIT PUB RF LP	FRANCIERO	189.048,21			2.480,34	358,52
MA-5 INST TIT PUB RF LP	FRANCIERO					
FDI INSTITUCIONAL RF	FRANCIERO	283.324,96	206.890,08	848.880,00	482,31	17,27
CONTA CORRENTE 1300104-0	ADMINISTRATIVA	1.718,47				
FDI MA-5 TIT PUB RF LP	ADMINISTRATIVA	734.478,88			14.816,04	358,52
FDI INSTITUCIONAL RF	ADMINISTRATIVA	1.227.042,80	88.486,98	26.990,00	1.793,18	400,97
FDI MA-5 TIT PUB RF	ADMINISTRATIVA					
MA-5 INST TIT PUB RF LP	ADMINISTRATIVA					
CONTA CORRENTE 4000000-0	PREVIDENCIARIO					
FDI BPA-1 TIT PUB RF	PREVIDENCIARIO	340.083,74	68.706,48		821,53	204,75
FDI BPA-5 TIT PUB RF	PREVIDENCIARIO					
BOVESPA ATIVO INST AÇOOD	PREVIDENCIARIO	640.164,21			48.303,24	17,45
FDI INSTITUCIONAL RF	PREVIDENCIARIO	215.027,39	674,73		308,21	11,43
BPA-2 INST TIT PUB RF LP	PREVIDENCIARIO	757.533,45			12.704,43	724,36
TOTAL BANCO SANTANDER		369.878,91	4.374.284,28	218.836,28	884.800,00	88.652,42
CONTA CORRENTE 15021-0	FRANCIERO					
BB PREVIO RF MA-4 S	FRANCIERO					
BB PREVIO MA-8 TF	FRANCIERO	7.788.584,13		2.082.800,00	148.324,91	1.280,04
BB PREVIO PCA-13	FRANCIERO	1.860.771,54			21.785,23	18,77
DD AÇÕES GOVERNANÇA	FRANCIERO	374.385,93			33.267,48	3,11
DD PREVIO RF PCA-1	FRANCIERO	46.223,13		48.228,00	47,17	0,06
BB PREVIO RF MA-8 S+	FRANCIERO	730.385,98			22.773,49	169,43
BB PREVIO RF MA-2	FRANCIERO					
BB PREVIO RF ALIC	FRANCIERO	3.805.380,01			55.075,95	1.083,08
AÇÕES VALOR	FRANCIERO	377.417,58			28.012,88	2.010,26
CONTA CORRENTE 0304-7	PREVIDENCIARIO					
BB PREVIO MA-8 S	PREVIDENCIARIO	830.884,75			9.082,91	11,34
BB PREVIO MA-8 TF	PREVIDENCIARIO	1.879.836,16			32.025,50	1,28
AÇÕES GOVERNANÇA	PREVIDENCIARIO	224.879,70			18.079,48	14,38
BB PREVIO RF PCA-1	PREVIDENCIARIO	302.662,98			260,90	14,77
BB PREVIO RF MA-8 S+	PREVIDENCIARIO	36.283,14			2.387,97	1,68
BB PREVIO RF MA-2	PREVIDENCIARIO	407.726,23			4.944,77	12,00
TOTAL BANCO DO BRASIL		18.432.888,00		2.108.328,34	275.882,28	1.020,86
CONTA CORRENTE 30000-0	FRANCIERO	38,13				
0300-11 AÇÕES DIVIDENDO	FRANCIERO	1.802.820,79			79.908,97	30,45
0300-12 AÇÕES INFRAESTRUTURA	FRANCIERO	1.196.586,28			84.000,11	35,28
0304-11 AÇÕES BRASL SIX 30	FRANCIERO	870.584,36			82.789,87	32,00
0307-11 AÇÕES CONSTRUÇÃO CIVIL	FRANCIERO	744.881,38			67.008,91	27,08
0301-11 AÇÕES SMALL CAP LATAM	FRANCIERO	1.120.561,70			144.858,34	138,13
0443-11 CAXA BRASL BOVESPA	FRANCIERO	821.887,83			70.743,24	471,38
0300-11 BRASL DISPONIBILIDADE RF	FRANCIERO	2.519,36			3,89	1,50
0300-11 BRASL GESTÃO ESTRATÉGICA	FRANCIERO	2.595.035,70			19.464,44	1.089,82
FA-CK INST BDR NIVEL I	FRANCIERO	1.764.488,21		1.088.800,00	36.245,79	1.732,10
TOTAL CAXA ECONOMICA		38,13	18.258.442,37		888.018,82	1.149,78
CONTA CORRENTE FINCOS						
Santander		369.878,91	4.374.284,28	218.836,28	884.800,00	89.832,42
Brasil		20.432.068,40		2.108.328,34	375.882,28	1.238,34
Caixa		38,13	18.258.442,37		888.018,82	1.450,78
TOTAL GERAL		20.799,14	21.125.405,41	318.836,28	2.669.328,34	1.087.108,22
PLANO PREVIDENCIARIO			8.082.283,82	68.706,48		138.878,19
PLANO FRANCIERO		267.288,58	20.081.821,21	208.834,73	2.468.328,34	882.863,61
TAXA ADMINISTRATIVA		1.718,47	1.264.528,25	88.486,98	28.690,00	18.313,22

Documento Assinado Digitalmente por: FRANCISCO BARRETO DE MENEZES LEITE
 Acesse em: https://stce.tce.pe.gov.br/epv/validaDoc.seam?codigo_documento=124dc54c-8f83-4193-af79-86f5c16ad079



Regime Próprio Previdência Municipal
IGAPREV – Igarassu Previdência LC 23/2012 e LC 58/2016
CNPJ: 06.234.755/0001-37



Documento Assinado Digitalmente por: FRANCISCO BARRETO DE MENEZES LEITE
Acesse em: <https://stc.tee.pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 124d54c-8fa3-4193-8729-86f5c00abb21

APLICAÇÕES E RESGATES – JUNHO/2020

Data	Fundo	Aplicações	Resgates
01/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	0,00	-30.000,00
03/06/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TP RF	11.128,36	0,00
04/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	0,00	-192.000,00
05/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	0,00	-157.000,00
10/06/2020	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	0,00	-1.100.000,00
10/06/2020	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,00	-46.320,34
10/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	200.000,00	0,00
15/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	50.488,99	0,00
17/06/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TP RF	54.578,12	0,00
19/06/2020	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	0,00	-460.000,00
19/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	0,00	-200.000,00
22/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	0,00	-5.000,00
23/06/2020	CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	0,00	-1.000.000,00
26/06/2020	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	0,00	-500.000,00
29/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	634,73	0,00
TOTAL		316.830,20	-3.690.320,34

Mês/Ano	Aplicações	Resgates	Saldo
jan/20	R\$ 3.674.438,44	-R\$ 2.594.683,66	R\$ 1.079.754,78
fev/20	R\$ 2.685.037,83	-R\$ 3.794.896,21	R\$ 1.109.858,38
mar/20	R\$ 2.242.883,34	-R\$ 3.499.247,91	R\$ 1.256.364,57
abr/20	R\$ 379.601,63	-R\$ 2.000.000,00	R\$ 1.620.398,37
mai/20	R\$ 1.175.312,46	-R\$ 2.707.609,30	R\$ 1.532.296,84
jun/20	R\$ 316.830,20	-R\$ 3.690.320,34	R\$ 3.373.490,14
TOTAL	R\$ 10.474.103,90	-R\$ 18.286.757,42	-R\$ 7.812.653,52



ENDEREÇO: RUA DANIAS BARRETO, 16, CENTRO - IGARASSU - PE.
FONE: (81) 3543-1190 – igaprev@hotmail.com



Regime Próprio Previdência Municipal
IGAPREV – Igarassu Previdência LC 23/2012 e LC 58/2016
CNPJ: 06.234.755/0001-37

RENTABILIDADE JUNHO/2020

PLAÇOS	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	2020
PLANO PREVIDENCIÁRIO	0,29%	-1,34%	-10,43%	2,41%	2,39%	2,42%							-4,82%
RESERVA ADMINISTRATIVA	0,34%	0,39%	-3,29%	0,63%	0,86%	0,93%							-0,21%
PLANO FINANCEIRO	0,65%	-2,27%	-9,88%	3,54%	2,62%	3,10%							-2,86%
RENTABILIDADE GLOBAL	0,57%	-1,92%	-9,27%	3,34%	2,48%	2,90%							-2,57%
IPCA + 5,86%	0,71%	0,66%	0,57%	0,14%	0,07%	0,74%							2,92%
P.P. INDX	-0,14%	-2,58%	-9,84%	3,09%	2,41%	2,16%							-5,40%

ENDEREÇO: RUA DANTAS BARRETO, 16, CENTRO – IGARASSU – PE.

Documento Assinado Digitalmente por: FRANCISCO BARRETO DE MENEZES LEITE
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 1244054081434193472956500000021E (18) FONE: 0611 3611 2121





Regime Próprio Previdência Municipal
IGAPREV – Igarassu Previdência LC 23/2012 e LC 58/2016
CNPJ: 06.234.755/0001-37



Documento Assinado Digitalmente por: FRANCISCO BARRETO DE MENEZES LEITE
Acesse em: <https://stc.ce.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 124dc54c-8fa3-4193-8729-86f5c60ab021

APLICAÇÕES E RESGATES – JUNHO/2020

Data	Fundo	Aplicações	Resgates
01/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	0,00	-30.000,00
03/06/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TP RF	11.128,36	0,00
04/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	0,00	-192.000,00
05/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	0,00	-157.000,00
10/06/2020	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	0,00	-1.100.000,00
10/06/2020	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,00	-46.320,34
10/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	200.000,00	0,00
15/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	50.488,99	0,00
17/06/2020	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TP RF	54.578,12	0,00
19/06/2020	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	0,00	-460.000,00
19/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	0,00	-200.000,00
22/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	0,00	-5.000,00
23/06/2020	CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	0,00	-1.000.000,00
26/06/2020	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	0,00	-500.000,00
29/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	634,73	0,00
TOTAL		316.830,20	-3.690.320,34

Mês/Ano	Aplicações	Resgates	Saldo
jan/20	R\$ 3.674.438,44	-R\$ 2.594.683,66	R\$ 1.079.754,78
fev/20	R\$ 2.685.037,83	-R\$ 3.794.896,21	R\$ 1.109.858,38
mar/20	R\$ 2.242.883,34	-R\$ 3.499.247,91	R\$ 1.256.364,57
abr/20	R\$ 379.601,63	-R\$ 2.000.000,00	R\$ 1.620.398,37
mai/20	R\$ 1.175.312,46	-R\$ 2.707.609,30	R\$ 1.532.296,84
jun/20	R\$ 316.830,20	-R\$ 3.690.320,34	R\$ 3.373.490,14
TOTAL	R\$ 10.474.103,90	-R\$ 18.286.757,42	-R\$ 7.812.653,52



ENDEREÇO: RUA DANTAS BARRETO, 16, CENTRO, IGARASSU – PE.
FONE: (81) 3543-1190 – igaprev@hotmail.com



Posição de Ativos

Gestor	Administrador	Ativos	Vol%	Mes	Ano	Agile/Reag	Valor (R\$)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	PL Fundo
							(30/06/2020)					
Renda Fixa												
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FZC FI	4,92%	1,06%	3,07%	DD/D+1	849.024,68	2,59%	100%	4.023.305.644,01	0,02%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP JPCA III FI	4,09%	1,09%	2,51%	DD/D0	2.021.609,92	6,27%	100%	883.499.894,69	0,23%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALDOÇÃO ATIVA FIC FI	6,08%	0,81%	1,01%	DD/D0	5.852.380,89	17,87%	100%	10.825.951.624,18	0,05%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97%	0,60%	4,47%	DD/D0	2.632.163,54	7,99%	100%	12.194.345.320,19	0,02%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	19,08%	2,31%	-0,83%	DD/D+2	843.713,56	2,58%	100%	1.038.300.866,72	0,04%	15%
SANTANDER Gest Rec	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INST TIT PUB RF LP	12,47%	1,74%	-2,29%	DD/D0	770.684,38	2,35%	100%	1.211.231.595,60	0,06%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMB-M 1 TP FIC FI	0,53%	0,84%	2,43%	DD/D0	104.212,45	0,32%	100%	7.738.338.913,40	0,00%	15%
SANTANDER Gest Rec	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B TIT PUB RF LP	12,47%	1,71%	-2,43%	DD/D0	855.532,23	2,61%	100%	14.630.447,31	0,01%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMB-6 TP FI	12,42%	1,75%	-2,01%	DD/D+1	7.528.534,43	22,99%	100%	5.527.046.060,67	0,14%	15%
SANTANDER Gest Rec	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMB-M 1 TP RF	0,53%	0,22%	2,21%	DD/D0	409.569,66	1,25%	100%	134.085.866,18	0,01%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMB-A 2	4,11%	1,23%	2,90%	DD/D+1	412.735,19	1,26%	100%	6.214.019.636,99	0,01%	15%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a - FI 100% Titulos TN							22.260.160,74	67,99%				
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL DISHONABILIDADES RF	0,07%	0,14%	1,33%	DD/D0	2.522,57	0,01%	20%	1.144.266.296,72	0,00%	15%
SANTANDER Gest Rec	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	0,97%	0,27%	1,33%	DD/D0	1.464.090,18	4,47%	20%	455.211.223,18	0,32%	15%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							1.466.632,75	4,48%				
Sub-total Renda Fixa							23.726.773,49	72,47%				
Renda Variável												
CAIXA	CAIXA	FI AÇÕES CAIXA BRASIL TBX-50	44,57%	10,32%	-17,79%	D+1/D+1	965.929,27	2,95%	30%	902.804.098,82	0,11%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALDOÇÃO ATIVA FIC FI	4,09%	1,09%	2,51%	DD/D0	2.021.609,92	6,27%	100%	883.499.894,69	0,23%	15%
SANTANDER Gest Rec	SANTANDER	SANTANDER FI BOVESPA ATIVO INSTI AÇÕES	44,33%	0,11%	-21,24%	D+1/D+1	602.031,09	2,11%	30%	746.442.298,07	0,09%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL BOVESPA	43,80%	9,38%	-17,17%	D+1/D+1	898.765,71	2,75%	30%	630.194.516,30	0,24%	15%
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices C/ no mínimo 50 ações							3.212.806,98	9,81%				
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS	38,19%	3,88%	-19,97%	D+1/D+1	1.064.987,35	5,09%	20%	309.357.859,92	0,62%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIA CONSTRUÇÃO CIVIL	58,90%	18,10%	-30,34%	D+1/D+1	407.063,30	1,24%	20%	499.511.286,28	0,08%	15%



Posição de Ativos

Destor	Administrador	Ativos	Vol+	Mes	Ano	Contrapelo Aplíc./Rec29	Valor(%) (29/05/2020)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALOR FIC F2A	40,47%	8,63%	-18,01%	D+3/D+30	400,958,99	1,25%	20%	001.186.495,01	0,05%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO	47,34%	-12,58%	-21,67%	D+3/D+3	1.264.064,61	3,86%	20%	1.087.683.664,96	0,12%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES INFRAESTRUTURA	46,50%	7,13%	-16,43%	D+3/D+3	1.271.120,36	3,88%	20%	472.197.032,37	0,22%	15%
			Sub-total Artigo 9º II, Alínea a - FI de Ações - Geral:				5.017.995,01	15,33%				
			Sub-total Renda Variável				8.230.801,99	25,14%				
Investimentos no Exterior												
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL 1	26,25%	2,20%	30,00%	D+1/D+1	784.060,64	2,39%	10%	1.157.131.265,47	0,02%	15%
			Sub-total Artigo 9º III - Fundos de Ações BDR Nível 1				784.060,64	2,39%				
			Sub-total Investimentos no Exterior				784.060,64	2,39%				
Total							32.741.636,12	100%				



Enquadramento da Carteira

Artigo	Classe	Valor (R\$)	% Carteira	Posição Investimento	Limite Res. 3.922/2010
Renda Fixa					
Artigo 2º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	22.260.160,74	67,05%	48,00%	100,00%
Artigo 2º IV, Alínea n	FI Renda Fixa - Geral	1.460.612,75	4,43%	2,00%	40,00%
	Total Renda Fixa	23.720.773,49	72,47%		
Renda Variável					
Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	3.212.836,98	9,81%	6,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	5.017.995,01	15,33%	20,00%	20,00%
	Total Renda Variável	8.230.801,99	25,14%		
Investimentos no Exterior					
Artigo 9 A III	Fundo de Ações SOR Nivel 1	784.060,64	2,39%	10,00%	10,00%
	Total Investimentos no Exterior	784.060,64	2,39%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

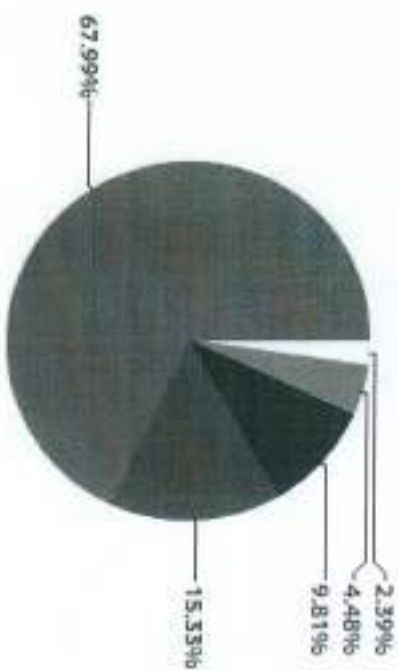
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 2º I, Alínea b % de CDI	1,29 626,0	0,65 39,1	--	--
Artigo 2º IV, Alínea n % de CDI	0,29 139,9	1,33 25,8	--	--
Artigo 8º I, Alínea a % de CDI	9,41 4.551,0	-18,45 -1.051,4	--	--
Artigo 8º II, Alínea n % de CDI	8,26 3.990,1	-20,08 -1.144,4	--	--
Artigo 9 A III Var. Dollar Comercial n.p.	1,20 1,9	30,09 -4,9	--	--

Ganhos Financeiros

Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 2º I, Alínea b	306.139,80
Artigo 2º IV, Alínea n	4.573,28
Artigo 8º I, Alínea a	276.385,67
Artigo 8º II, Alínea n	303.027,26
Artigo 9 A III	19.574,33
Total	909.700,64

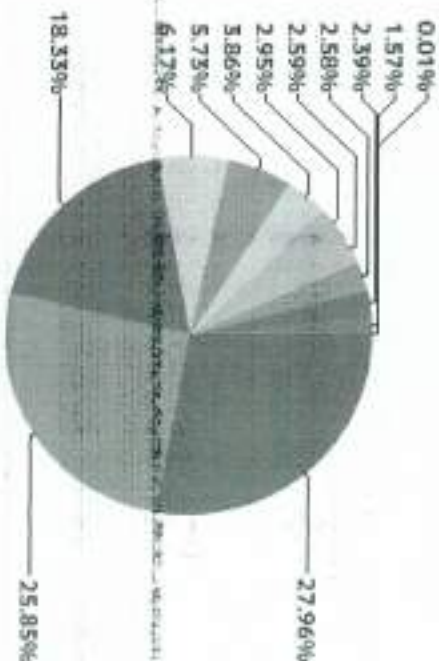


Alocação por Estratégia



- Artigo 9º A III (2,39%)
- Artigo 7º IV, Alínea a (4,48%)
- Artigo 8º I, Alínea a (9,81%)
- Artigo 8º II, Alínea a (15,33%)
- Artigo 7º I, Alínea b (67,99%)

Indexadores



- IMA - B (27,96%)
- IMA - GERAL (25,85%)
- IBOVESPA (18,33%)
- IPCA + 6% (6,17%)
- IPCA (5,73%)
- SMALL CAP (3,86%)
- IBOVX 50 (2,99%)
- IMA - B 5 (2,59%)
- IMA - B 5+ (2,58%)
- Dólar Comercial (2,39%)
- IRF - M 1 (1,57%)
- CDI (0,01%)

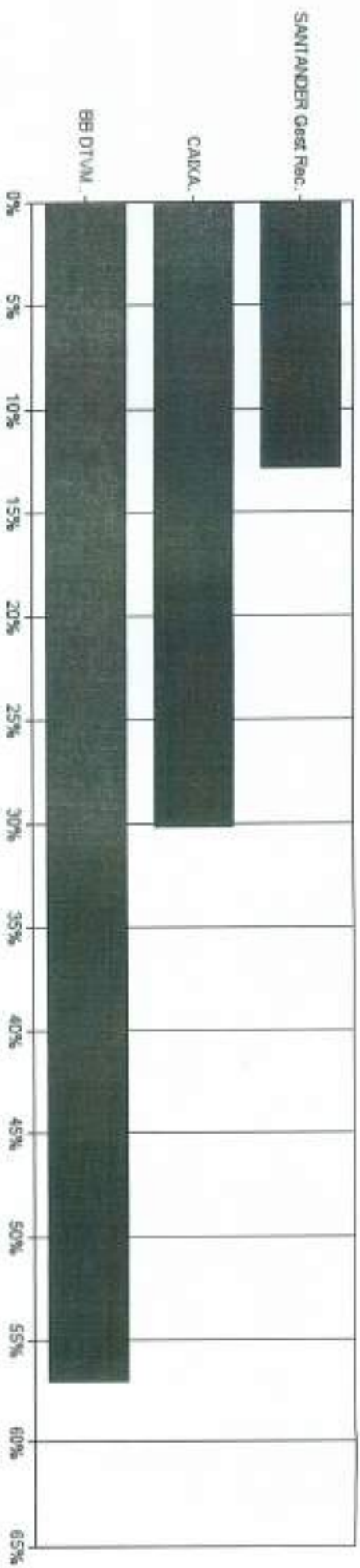


Documento Assinado Digitalmente por: FRANCISCO BARRETO DE MENEZES LEITE
Acesse em: <https://stc.tce.pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 124dc54c-8fa3-4193-a729-86f5cb0abb21



REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL
ICARASSU - ICARASSU PREVIDÊNCIA L.C. 2020/12
CNPJ: 06.234.756/0001-37

Alocação por Gestor



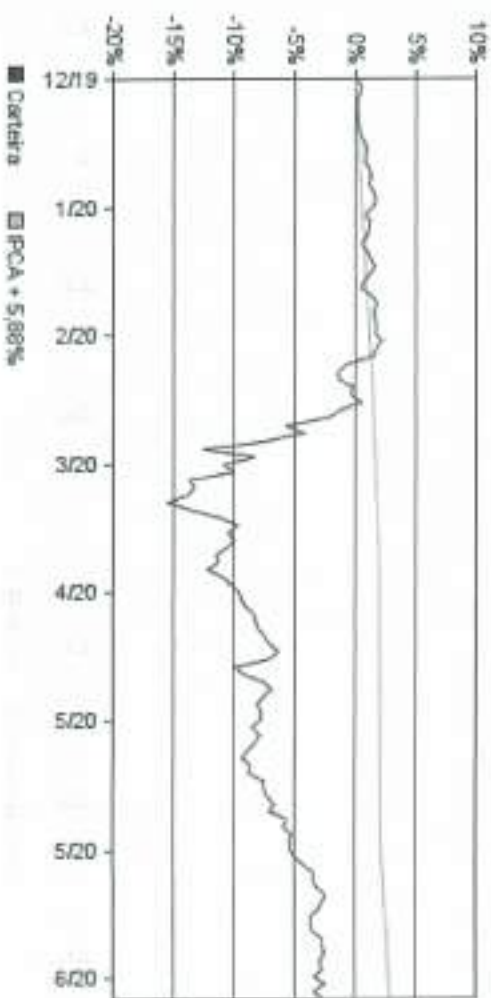


RECEIPE PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL
 ICARASSU PREVIDÊNCIA LC 252012
 CNPJ: 06.214.755/0001-37

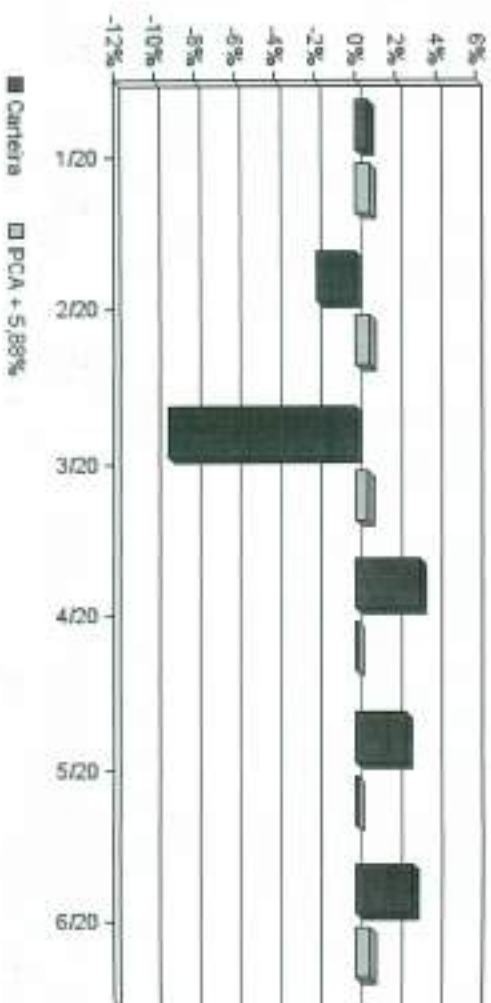
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Anual
2020	0,37	-1,92	-9,27	3,24	2,48	2,05	-	-	-	-	-	-	2,62
IFCA + 5,88%	0,71	-0,66	0,57	0,74	0,07	0,70	-	-	-	-	-	-	2,89
P.p. Índex	-0,34	-2,58	-9,84	3,09	2,41	2,14	-	-	-	-	-	-	-5,31

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses





Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Percl.
Mécs acima do Benchmark	1	50,0%
Mécs abaixo do Benchmark	1	50,0%

	Retornh.	Mécs
Mécs rentabilidade de Carteira	3,24%	abr/20
Menor rentabilidade da Carteira	-9,27%	mar/20

Período	Carteira	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
		TPCA + 5,88%	p.p. Inds.		
03 meses	8,29	0,97	7,8	11,904	
06 meses	--	--	--	--	
12 meses	--	--	--	--	
24 meses	--	--	--	--	
36 meses	--	--	--	--	
Desde o início	-2,62	2,89	-5,5	19,008	

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Fundo / Tradecedor	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREVIDENCIÁRIO RF JMA-B 5 LP FIC FI Var. do JMA-B 5 p.p.	1,06 -0,05	3,07 -0,10	4,41 -0,07	2,07 -0,10	3,07 -0,10	1,07 -0,10	3,07 -0,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP FIC III FI Var. do FIC = 6% o.B.	1,09 0,38	2,51 -0,43	3,86 2,86	2,51 -0,43	2,51 -0,43	2,51 -0,43	2,51 -0,43
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. do FIC-GENERAL TOTAL p.p.	0,81 -0,05	1,61 -0,13	3,10 0,09	1,61 -0,13	1,61 -0,13	1,61 -0,13	1,61 -0,13
CADIA/TIC ANALIS. GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. do JMA-GENERAL TOTAL p.p.	0,60 -0,26	4,47 2,73	3,63 0,62	4,47 2,73	4,47 2,73	4,47 2,73	4,47 2,73
BB PREVIDENCIÁRIO RF JMA-B 54 p.lli. Var. do JMA-B 54 p.lli.	2,11 -0,04	-0,10	4,99 -0,16	-5,83 -0,10	-5,83 -0,10	-5,83 -0,10	-5,83 -0,10
SANTANDER FIC FI JMA-B INSTI TIF PUBI RF LP Var. do JMA-B TOTAL a.B.	1,74 -0,04	2,29 -0,36	4,77 -0,11	2,29 -0,36	2,29 -0,36	2,29 -0,36	2,29 -0,36
BB PREVIDENCIÁRIO RF JMA-B 1 TP FIC FI Var. do JMA-B 1 p.p.	0,24 -0,02	2,43 -0,15	5,16 -0,08	2,43 -0,15	2,43 -0,15	2,43 -0,15	2,43 -0,15
SANTANDER FIC FI JMA-B TIF PUBI RF LP Var. do JMA-B TOTAL p.c.	1,71 -0,07	2,43 -0,51	4,66 -0,19	2,43 -0,51	2,43 -0,51	2,43 -0,51	2,43 -0,51



Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Rentabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Ativo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREVIDENCIÁRIO RF IM-A-9 TP FI Var. do IM-A-TOTAL P.P.	1,75	-2,01	4,78	-2,01	-2,01	-2,01	-2,01
SANTANDER TIC FI ISF-M 1 TP RF Var. do IRF-M 1 S.D.	-0,03	-0,09	-0,06	-0,09	-0,09	-0,09	-0,09
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDCA 2 Var. do IDCA S.D.	0,22	1,11	1,07	2,31	2,31	2,31	2,31
FI AÇÕES CAIXA BRASIL IRIX 50 Var. do IRIX 50 P.P.	-0,05	-0,27	-0,14	-0,27	0,17	-0,27	-0,27
FI AÇÕES CAIXA BRASIL IRIX 50 Var. do IRIX 50 P.P.	1,23	2,90	4,27	2,90	2,90	2,90	2,90
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF Var. do INCA S.D.	0,98	2,81	4,71	2,81	2,81	2,81	2,81
BB PREVIDENCIÁRIO RF IM-A-9 TP FI Var. do IM-A-TOTAL P.P.	0,14	1,33	0,35	1,33	1,33	1,33	1,33
FI AÇÕES CAIXA BRASIL IRIX 50 Var. do IRIX 50 P.P.	0,79	1,33	1,14	1,33	1,33	1,33	1,33
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. do GOVERNANÇA P.P.	0,04	1,25	1,57	1,25	1,25	1,25	1,25
SANTANDER FI BROVESPA ATIVO INSTIT AÇÕES Var. de BROVESPA P.P.	10,32	-17,79	30,96	-17,79	-17,79	-17,79	-17,79
FI AÇÕES CAIXA BRASIL IRIX 50 Var. do IRIX 50 P.P.	0,07	-0,72	-1,23	-0,72	-0,72	-0,72	-0,72
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. do GOVERNANÇA P.P.	9,53	-17,99	30,51	-17,99	-17,99	-17,99	-17,99
SANTANDER FI BROVESPA ATIVO INSTIT AÇÕES Var. de BROVESPA P.P.	-0,01	-0,51	0,14	-0,51	-0,51	-0,51	-0,51
FI AÇÕES BRASIL BROVESPA Var. de BROVESPA P.P.	8,11	-21,74	28,59	-21,74	-21,74	-21,74	-21,74
CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS Var. de BROVESPA P.P.	-1,43	-4,52	-1,79	-4,52	-4,52	-4,52	-4,52
CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS Var. de BROVESPA P.P.	9,38	-17,17	29,97	-17,17	-17,17	-17,17	-17,17
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALDES TIC ITA Var. do BROVESPA P.P.	-0,15	0,05	-0,41	0,05	0,05	0,05	0,05
CAIXA FIA CONSTRUÇÃO CIVIL Var. de BROVESPA P.P.	3,88	-19,97	15,56	-19,97	-19,97	-19,97	-19,97
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALDES TIC ITA Var. do BROVESPA P.P.	-5,66	-2,76	-14,83	-2,76	-2,76	-2,76	-2,76
CAIXA FIA CONSTRUÇÃO CIVIL Var. de BROVESPA P.P.	18,10	-30,34	45,00	-30,34	-30,34	-30,34	-30,34
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALDES TIC ITA Var. de Brodes SmatCap - SMALL P.P.	6,50	-13,12	-15,38	-13,12	-13,12	-13,12	-13,12
CAIXA FI AÇÕES INFRAESTRUTURA Var. de BROVESPA P.P.	6,63	-18,01	26,50	-18,01	-18,01	-18,01	-18,01
CAIXA FIA AÇÕES INFRAESTRUTURA Var. de BROVESPA P.P.	-0,91	-0,52	-3,87	-0,52	-0,52	-0,52	-0,52
CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO Var. de Brodes SmatCap - SMALL P.P.	12,58	-21,67	25,74	-21,67	-21,67	-21,67	-21,67
CAIXA FIA AÇÕES INFRAESTRUTURA Var. de BROVESPA P.P.	-1,57	-0,74	-1,80	-0,74	-0,74	-0,74	-0,74
CAIXA FIA AÇÕES INFRAESTRUTURA Var. de BROVESPA P.P.	7,13	-16,43	28,25	-16,43	-16,43	-16,43	-16,43
CAIXA FIA AÇÕES INFRAESTRUTURA Var. de BROVESPA P.P.	-2,41	0,79	-2,13	0,79	0,79	0,79	0,79
CAIXA FIA INSTITUCIONAL BOLL NIVEL 1 Var. do Dollar Comendat P.P.	2,20	30,09	27,63	30,09	30,09	30,09	30,09
CAIXA FIA INSTITUCIONAL BOLL NIVEL 1 Var. do Dollar Comendat P.P.	1,91	-4,92	21,10	-4,92	-4,92	-4,92	-4,92



Documento Assinado Digitalmente por: FRANCISCO BARRETO DE MENEZES LEITE
Acesse em: <https://ctce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 124954c-8fac-4193-4729-86f5e604abb21

GOVERNO DO ESTADO DE PERNAMBUCO
SECRETARIA DE FINANÇAS E TRIBUTAÇÃO
CONSELHO DE CONTAS ESTADUAIS
CNPJ: 06.234.050/0001-37



Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Rentabilidades em períodos fechados (%)

Fundo / Indicador	No. Mes	No. Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
CDV	0,22	1,75	0,70	-1,79	-4,61	12,22	19,46
FMA - F	1,79	-1,92	4,84	-1,30	-4,67	34,77	46,04
FMA - B 5	1,11	1,17	4,50	3,42	8,81	24,75	37,14
FMA - B 5+	2,34	-6,72	5,15	-4,94	1,48	42,06	61,90
FMA - GERAL	0,86	1,74	1,01	1,99	6,38	23,29	33,92
JRF - F	0,67	4,70	3,74	-4,87	9,65	26,08	38,54
JRF - F 1	0,27	2,58	1,22	2,81	5,99	13,65	22,59
JRF - F 1+	0,81	5,80	5,04	6,03	11,55	12,94	46,68
JROVESIM	9,53	-17,22	30,18	-12,85	-5,18	31,57	53,82
JFIX	4,87	-12,83	12,90	-12,06	6,14	37,15	34,98
SMALL CAP	14,15	-20,93	26,94	-21,12	4,89	48,65	71,75
IPCA + 4,61%	0,61	2,39	0,67	2,44	6,83	15,45	26,02
IPCA + 4,01%	0,62	2,39	0,72	2,54	7,03	15,89	26,74
IPCA + 5,06%	0,64	2,51	0,78	2,66	7,29	16,44	27,64
IPCA + 5,17%	0,66	2,61	0,83	2,76	7,50	16,90	28,40



Documento Assinado Digitalmente por: FRANCISCO BARETO DE MENEZES LEITE
 Acesse em: <https://ctce.tce.pe.gov.br/epv/validaDoc.seam> Código do documento: 124454c-8fa5-4193-4729-86f5e604bb21

FRANCISCO BARETO DE MENEZES LEITE
 PREFEITO MUNICIPAL
 CNPJ: 06324735000137



Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Retornabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
JPCA + S.43%	0,67	2,68	0,87	2,84	7,65	17,26	28,99
JPCA + S.5%	0,67	2,71	0,88	2,87	7,74	17,41	29,24
JPCA + S.54%	0,66	2,73	0,89	2,89	7,78	17,50	29,39
JPCA + S.01%	0,69	2,77	0,91	2,92	7,86	17,66	29,64
JPCA + S.67%	0,69	2,79	0,92	2,95	7,91	17,79	29,96
JPCA + S.71%	0,69	2,81	0,93	2,97	7,95	17,88	30,01
JPCA + S.74%	0,69	2,83	0,94	2,98	7,98	17,94	30,12
JPCA + S.77%	0,69	2,84	0,95	3,00	8,01	18,01	30,23
JPCA + S.78%	0,70	2,85	0,95	3,00	8,02	18,02	30,27
JPCA + S.80%	0,70	2,86	0,95	3,01	8,04	18,08	30,34
JPCA + S.82%	0,70	2,88	0,96	3,02	8,05	18,10	30,38
JPCA + S.82%	0,70	2,86	0,96	3,02	8,06	18,12	30,42
JPCA + S.83%	0,70	2,87	0,96	3,03	8,07	18,14	30,45
JPCA + S.94%	0,70	2,82	0,96	3,03	8,08	18,17	30,49
JPCA + S.85%	0,70	2,88	0,97	3,04	8,09	18,19	30,52



Documento Assinado Digitalmente por: FRANCISCO BARETO DE MENEZES LEITE

CPF: 41.934.729-8615604bb21

CNPJ: 06.234.755/0001-37

CPF: 41.934.729-8615604bb21

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Rentabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
JMCA + 5,00%	0,70	2,88	0,97	3,04	8,10	18,21	30,58
JPCA + 5,87%	0,70	2,69	0,97	3,05	8,11	18,21	30,60
JPCA + 5,88%	0,70	2,69	0,97	3,05	8,12	18,26	30,61
JPCA + 5,89%	0,70	2,90	0,98	3,06	8,13	18,28	30,67
JPCA + 0%	0,71	2,95	1,00	3,11	8,25	18,52	31,07
JMNC + 4,61%	0,65	2,56	0,93	2,71	7,05	15,61	25,17
JMNC + 4,81%	0,66	2,65	0,96	2,81	7,25	16,07	25,88
JMNC + 5,06%	0,68	2,77	1,04	2,93	7,51	16,63	26,79
JMNC + 5,27%	0,70	2,87	1,09	3,03	7,73	17,09	27,54
JMNC + 5,43%	0,71	2,95	1,23	3,11	7,89	17,44	28,12
JMNC + 5,581%	0,72	3,00	1,15	3,16	8,00	17,69	28,52
JMNC + 5,61%	0,72	3,03	1,17	3,20	8,07	17,84	28,77
JMNC + 5,67%	0,73	3,06	1,18	3,22	8,13	17,98	28,90
JMNC + 5,71%	0,73	3,09	1,19	3,24	8,18	18,08	29,13
JMNC + 5,74%	0,73	3,09	1,20	3,26	8,21	18,13	29,24



Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Fundo / Tradecedor	Rentabilidades em Períodos Fechados (%)									
	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses			
JWNC + 5,77%	0,75	3,11	1,21	3,27	8,24	18,20	29,35			
JWNC + 5,78%	0,78	3,11	1,21	3,28	8,25	18,22	29,39			
JWNC + 5,80%	0,78	3,12	1,22	3,29	8,27	18,26	29,46			
JWNC + 5,81%	0,78	3,13	1,22	3,29	8,28	18,29	29,50			
JWNC + 5,82%	0,78	3,13	1,22	3,30	8,29	18,31	29,53			
JWNC + 5,83%	0,78	3,14	1,22	3,30	8,30	18,33	29,57			
JWNC + 5,84%	0,78	3,14	1,22	3,31	8,31	18,35	29,61			
JWNC + 5,85%	0,78	3,15	1,23	3,31	8,32	18,38	29,64			
JWNC + 5,86%	0,78	3,15	1,23	3,32	8,33	18,40	29,68			
JWNC + 5,87%	0,78	3,15	1,23	3,32	8,34	18,42	29,72			
JWNC + 5,88%	0,78	3,16	1,23	3,33	8,35	18,44	29,75			
JWNC + 5,89%	0,78	3,16	1,24	3,33	8,36	18,46	29,79			
JWNC + 6%	0,75	3,22	1,26	3,38	8,47	18,71	30,19			