



Prestação de Contas

3° Quadrimestre

2020



Receitas

Janeiro a Dezembro 2020

	Quantidade	Valor R\$
Repasse Servidor	3.006	12.865.750,75
Repasse Patronal	3.006	14.644.809,15
Repasse Déficit	3.006	24.509.960,76
Repasse Inativo e Pensionista	1.577	225.951,85
Comprev	-	394.953,68
Receita Aluguel	-	136.459,75
Rentabilidade	-	3.347.995,71
Cessão Direito Operac. Pgto.	-	2.537.306,48



Despesas

Janeiro a Dezembro 2020

	Quantidade	Valor R\$
Aposent. concedidas em 2020	148	534.907,29
Aposent. pagas jan a dez 2020	1.309	42.364.043,69
Pensões concedidas em 2020	16	35.990,57
Pensões pagas jan a dez 2020	268	5.070.153,67
Sentenças Judiciais e Acordos		44.880,08
Despesas Administrativas	-	3.731.511,71
Pasep	-	405.940,53
Tarifas bancárias	-	33.394,55
Folha de pagamento	45	2.482.496,74



Fundos de Investimentos

FUNDOS LÍQUIDOS	SALDO ATUAL	RENTABILIDADE 3º QUADRIMESTRE	RENTABILIDADE 12 MESES
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2024	R\$ 18.041.629,28	R\$ 552.144,11	R\$ 977.288,12
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2035	R\$ 18.133.508,21	R\$ 1.275.864,81	R\$ 1.391.349,31
Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais (NTN-B)2045	R\$13.732.528,32	R\$ 1.379.406,58	-R\$ 57.961,60
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	R\$0,00	R\$0,00	R\$ 370.174,44
CAIXA FI BRASIL IMAB 5 LP	R\$ 46.616.206,70	R\$ 1.099.865,18	R\$ 2.219.143,70
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	R\$ 4.102.341,50	R\$ 13.063,27	R\$ 64.797,20
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 2.030.470,29	R\$ 14.057,03	R\$ 64.110,97
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	R\$ 54.588.998,21	R\$ 821.520,31	R\$ 3.147.188,08
CAIXA FI INDEXA SHORT DOLAR MULT LP	R\$ 410.754,32	R\$ 10.754,32	R\$ 10.754,32

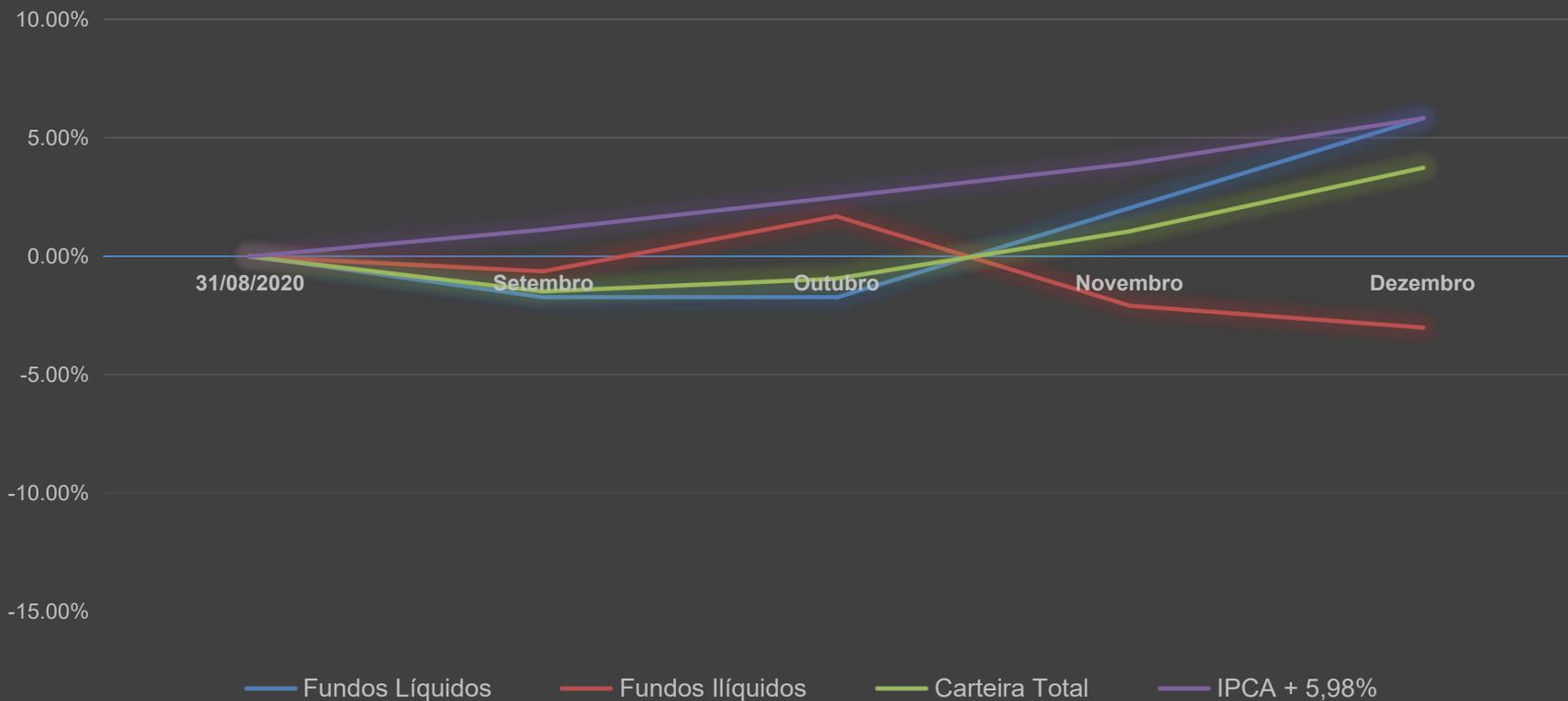
FUNDOS LÍQUIDOS	SALDO ATUAL	RENTABILIDADE 3º QUADRIMESTRE	RENTABILIDADE 12 MESES
CAIXA FI AÇÕES INFRAESTRUTURA	R\$ 6.358.421,16	R\$ 813.589,91	R\$ 234.222,37
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 125.938,55	R\$ 7.197,54	-R\$ 314.762,54
CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO	R\$ 7.503.677,08	R\$ 940.332,95	-R\$ 405.405,66
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$ 15.269.060,73	R\$ 2.552.749,54	R\$ 1.424.856,12
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	R\$ 2.802.678,18	-R\$ 19.967,57	R\$ 501.261,22
<i>SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI</i>	R\$ 0,00	-R\$ 5.857,54	R\$ 64.043,09
SANTANDER SELEÇÃO 30 AÇÕES FICFI	R\$ 5.102.487,06	R\$ 618.740,85	-R\$ 332.396,00
FI GLOBAL EQUITIES MM IE	R\$ 3.465.397,55	R\$ 92.102,29	R\$ 301.503,27
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	R\$ 19.246.154,32	R\$ 497.985,44	R\$ 955.023,65
BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FICFI	R\$ 10.746.936,20	R\$ 341.703,79	R\$ 944.760,93
<i>BB ENERGIA FI AÇÕES</i>	R\$ 9.144.166,66	R\$ 1.163.475,81	R\$ 1.144.489,78

FUNDOS LÍQUIDOS	SALDO ATUAL	RENTABILIDADE 3º QUADRIMESTRE	RENTABILIDADE 12 MESES
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALOR	R\$ 3.679.162,82	R\$ 761.007,26	R\$ 959.231,40
BB AÇÕES NORDEA	R\$ 1.005.972,30	R\$ 5.972,30	R\$ 236.221,00
BRADESCO FIA SELECTION	R\$ 4.587.079,63	R\$ 677.563,19	R\$ 215.695,44
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 9.302.926,33	R\$ 775.707,83	R\$ 134.098,95
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO FICFI	R\$ 21.295.638,46	R\$ 1.082.277,18	R\$ 440.552,77
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	R\$ 29.653.305,60	R\$ 46.493,43	R\$ 212.551,25
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RFLP FIC	R\$ 18.650.701,68	R\$ 112.724,86	R\$ 0,00
ITAÚ INSTITUCIONAL GENESIS FICFIA	R\$ 735.033,89	R\$ 83.504,08	R\$ 5.646,98
ITAU AÇÕS MERCADOS EMERGENTES FIC	R\$ 1.028.559,45	R\$ 28.559,45	R\$ 3.195,28
TOTAL	R\$ 353.307.106,29	R\$ 19.131.434,87	R\$ 13.363.295,25

FUNDOS ILÍQUIDOS	SALDO ATUAL	RENTABILIDADE 3º QUADRIMESTRE	RENTABILIDADE 12 MESES
FI RECUPERAÇÃO BRASIL RF LP	R\$ 8.311.961,45	-R\$ 1.137.282,02	-R\$ 121.729,32
FIC RF LP IMAB 1000	R\$1.830.563,78	-R\$ 30.259,91	-R\$ 994.600,81
FI SICILIA RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 295,93	-R\$ 22.729,32	-R\$5.419.361,76
FI RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	R\$ 5.794.199,82	-R\$ 170.573,98	-R\$1.032.132,02
TERRA NOVA IMA B FICFI RENDA FIXA	R\$ 2.273.345,58	-R\$ 3.615.491,44	-R\$5.185.616,91
SINGAPORE FI RENDA FIXA	R\$ -	-R\$ 0,00	R\$ 322.593,56
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	R\$ 9.319.162,10	R\$ 223.434,15	-R\$ 11.687,86
FI BARCELONA RENDA FIXA	R\$8.371.920,03	-R\$ 31.107,48	R\$ 38.115,76
GGR PRIME I FIDC	R\$6.388.521,50	R\$ 235.325,29	R\$ 71.105,17
ILLUMINATI FIDIC	R\$ 6.914.156,86	-R\$ 692.476,54	-R\$1.858.572,66

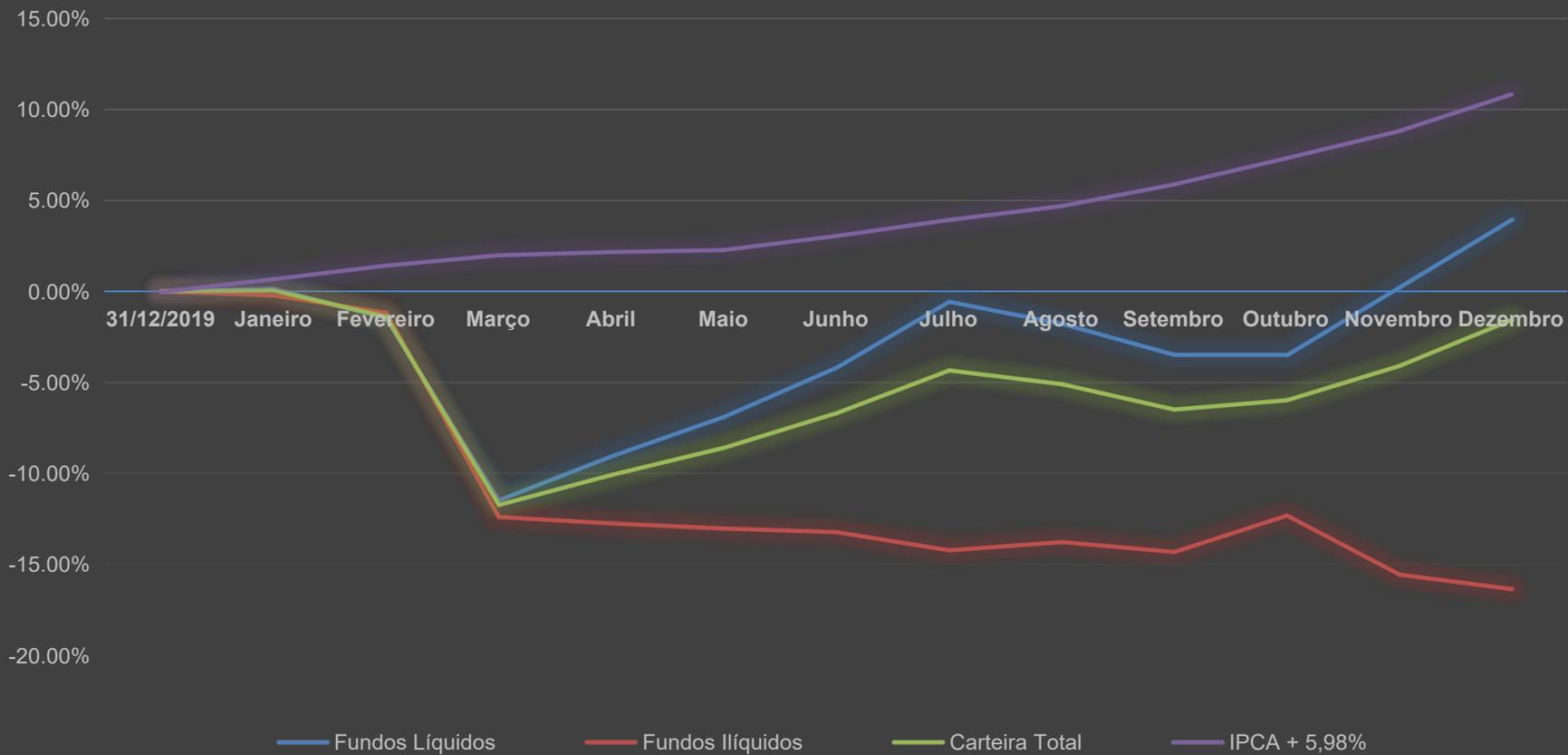
FUNDOS ILÍQUIDOS	SALDO ATUAL	RENTABILIDADE 3º QUADRIMESTRE	RENTABILIDADE 12 MESES
FIDC PREMIUM	R\$ 11.515.995,91	-R\$ 72.363,23	-R\$ 559.054,61
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO	R\$ 13.936.269,49	R\$ 124.482,04	-R\$ 1.204.010,02
CONQUEST FIP	R\$ 1.798.799,05	-R\$ 9.588,41	-R\$ 6.490,13
GESTAO EMPRESARIAL FIP	R\$ 458.493,81	-R\$ 30.307,63	-R\$ 32.438,12
FIP LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA	R\$ 7.620.459,78	-R\$ 55.372,23	-R\$ 127.204,91
CAM THRONE FIP MULTIESTRATÉGIA	R\$ 1.516.765,21	R\$ 0,00	-R\$ 6.320.064,47
AQUILLA FII	R\$ 5.225.115,29	R\$ 58.988,18	-R\$ 2.625,67
SÃO DOMINGOS FII	R\$ 6.846.225,93	R\$ 2.233.403,18	R\$ 2.267.596,89
TOTAL	R\$ 98.052.995,19	(R\$ 2.991.919,35)	(R\$ 20.245.434,22)

RENTABILIDADE ACUMULADA 3º QUADRIMESTRE



Rentabilidade Acumulada 3Q	
Fundos Líquidos	5,80%
Fundos Ilíquidos	-2,99%
Carteira Total	3,71%
IPCA + 5,98%	5,83%

RENTABILIDADE ACUMULADA 12 MESES

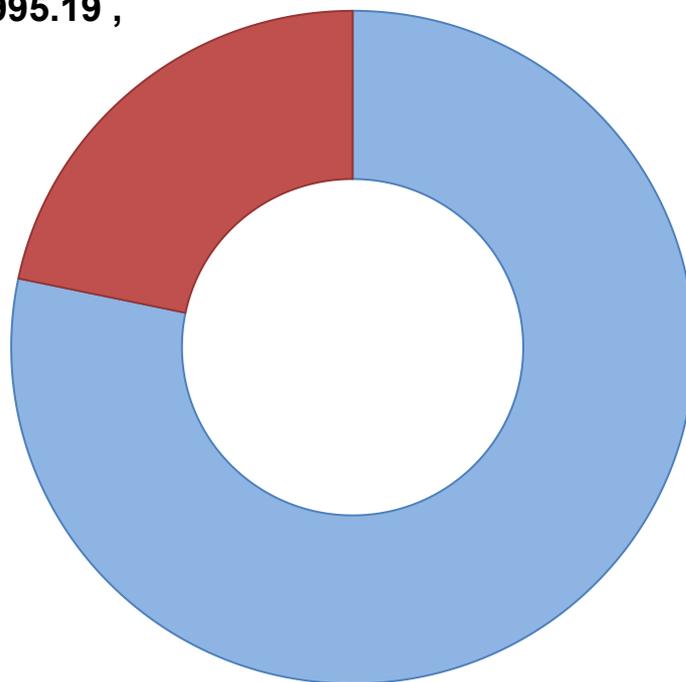


Rentabilidade Acumulada 12 meses	
Fundos Líquidos	3,92%
Fundos Ilíquidos	-16,31%
Carteira Total	-1,55%
IPCA + 5,98%	10,79%



Distribuição da Carteira

**R\$ 98,052,995.19 ,
22%**



**R\$ 353,307,106.29 ,
78%**

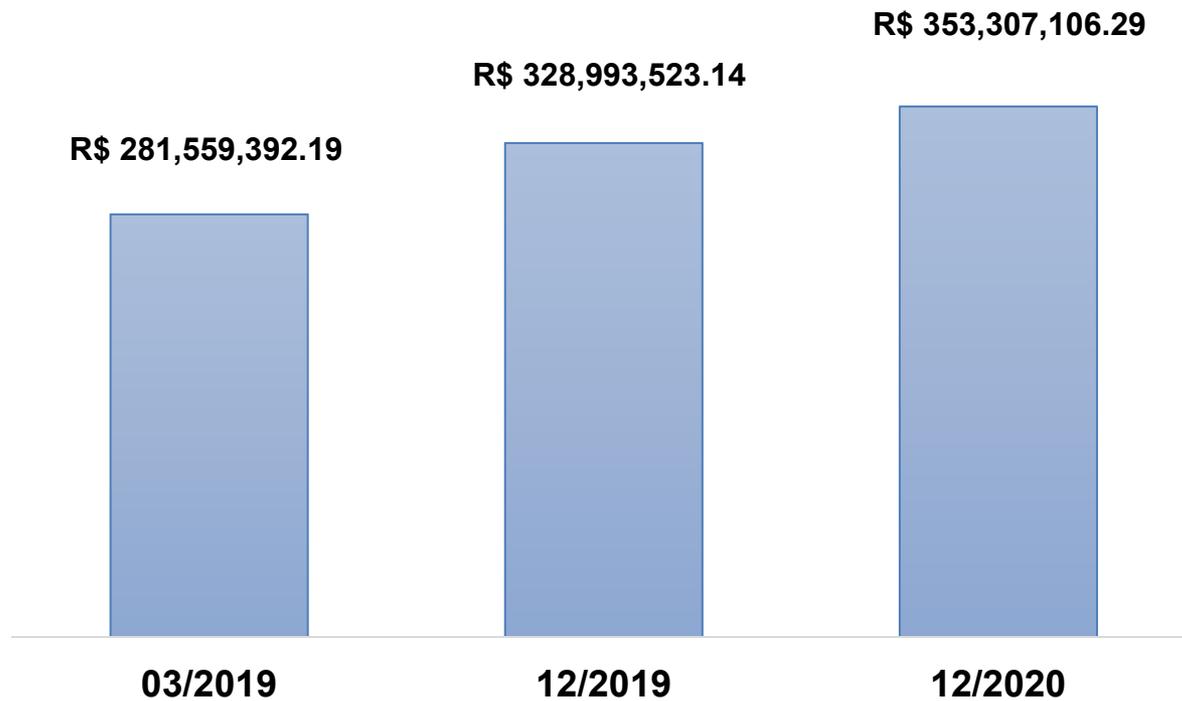
■ Fundos Líquidos

■ Fundos Ilíquidos



Evolução da Carteira

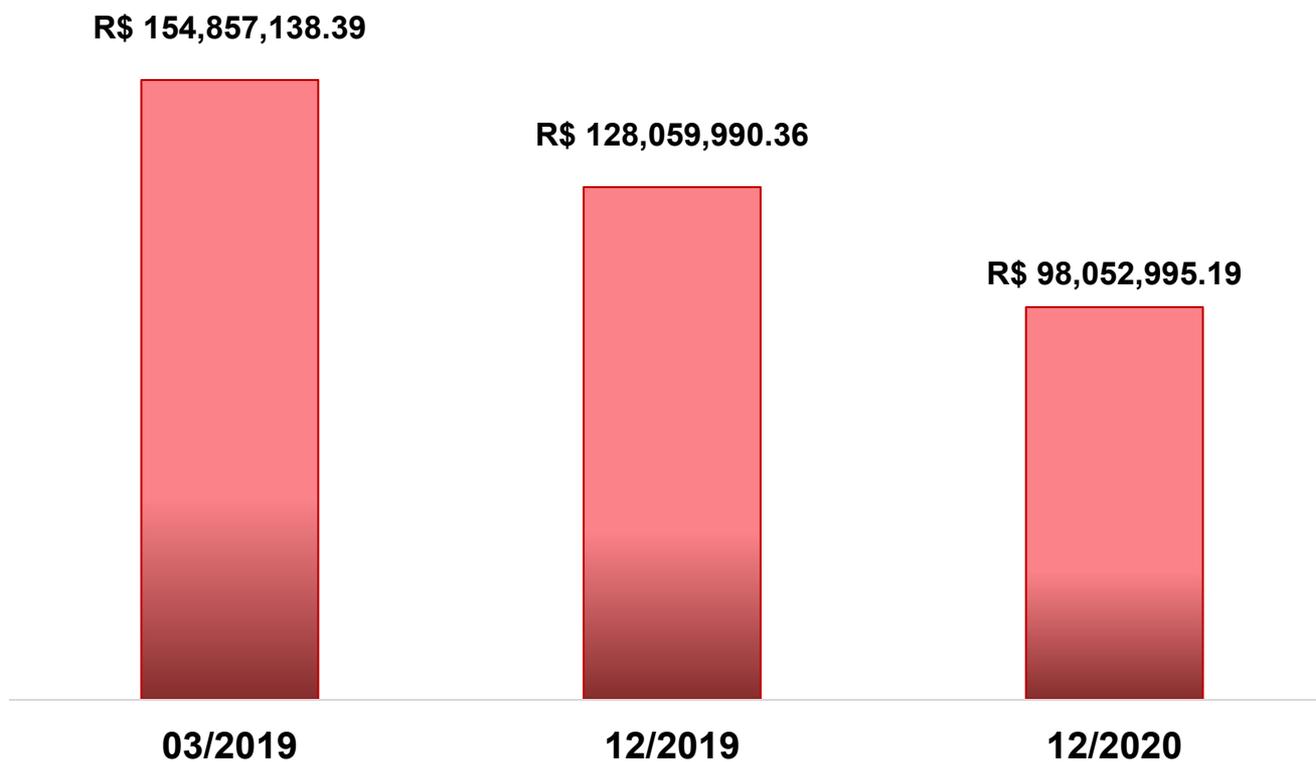
Fundos Líquidos





Evolução da Carteira

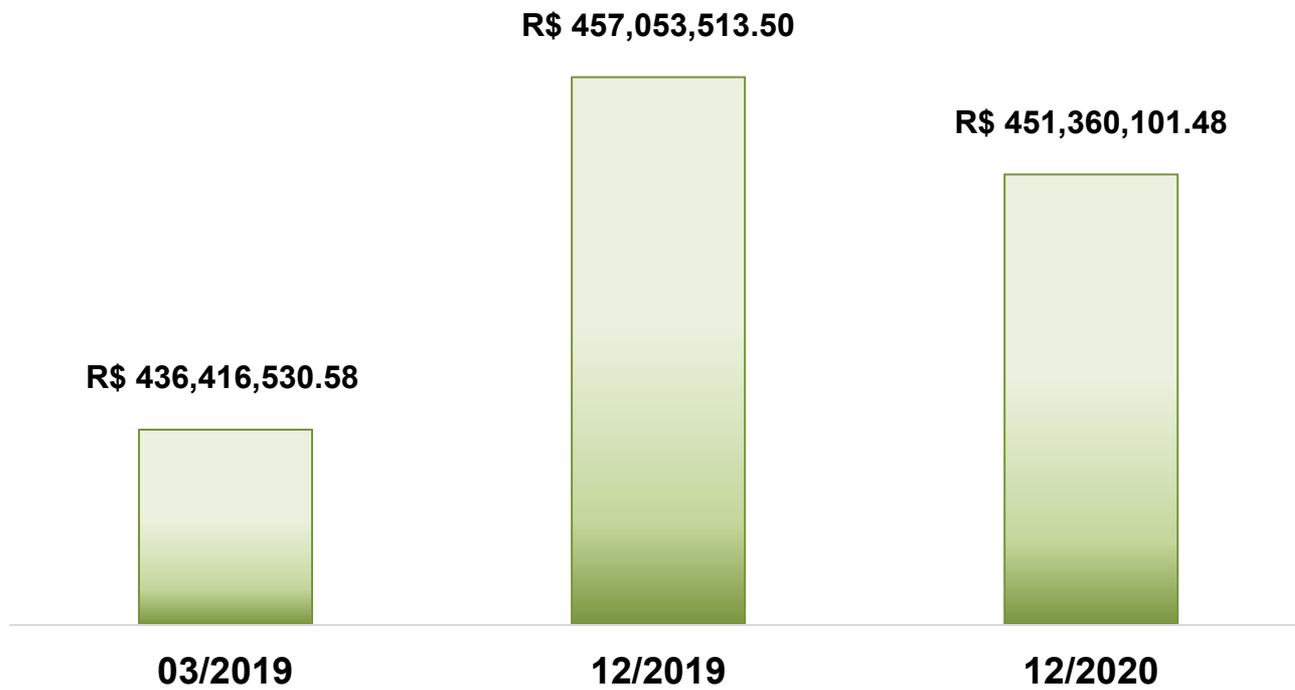
Fundos ILíquidos





Evolução da Carteira

Carteira Total





TOTAL FUNDOS ILÍQUIDOS

SALDO MAR/2019	R\$ 154.857.138,39
SALDO DEZ/2020	R\$ 98.052.995,19
RESGATES	R\$ 13.555.609,21
RETORNO NO PERÍODO	-R\$ 43.248.533,99



AMORTIZAÇÕES

FUNDOS ILÍQUIDOS	AMORTIZAÇÕES 04/2019 A 12/2020	RECUPERADO 2021
FI RECUPERAÇÃO BRASIL RF LP	R\$ 596.114,96	
FIC RF LP IMAB 1000	R\$ 4.356.957,92	
ILLUMINATI FIDIC	R\$ 3.383.927,06	
FI RF PYXIS INSTITUCIONAL IMA B	R\$ 555.527,92	
GGR PRIME I FIDC	R\$ 2.170.882,82	R\$ 236.823,57
SINGAPORE FI RENDA FIXA/FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	R\$ 1.377.775,92	
SÃO DOMINGOS FII	R\$ 662.059,22	
GESTAO EMPRESARIAL FIP	R\$ 217.932,96	
FI BARCELONA RENDA FIXA	R\$ 175.507,62	
TERRA NOVA IMA B FICFI RENDA FIXA	R\$ 58.922,81	
FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO		
FIP LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA		
FI SICILIA RENDA FIXA LONGO PRAZO		
CAM THRONE FIP MULTIESTRATÉGIA		
FIDC PREMIUM		
AQUILLA FII		
CONQUEST FIP		
TOTAL FUNDOS ILÍQUIDOS	R\$ 13.555.609,2100	R\$ 236.823,57000



Tipos de Fundos Líquidos

- FIDC - FUNDOS DE INVESTIMENTOS EM DIREITOS CREDITÓRIOS
- FII - FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO
- FIP - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES
- FIM - FUNDOS DE INVESTIMENTO EM MULTIMERCADO
- CASCATAS



FIDC

- ILLUMINATI FIDIC
 - Fundo envolvido na operação Encilhamento;
 - Possuía Vários ativos de crédito Privado Inadimplentes;
 - Foi realizada a troca do administrador e gestor durante o período de Intervenção;
 - A atual administração aprovou plano de liquidação e foram recuperados cerca de 3,4 milhões até o momento.



FIDC

- FIRF* PYXIS INSTITUCIONAL IMA-B
 - Fundo envolvido na Operação Encilhamento;
 - Possuía Vários ativos de crédito Privado Inadimplentes;
 - Durante a Intervenção foi realizada a troca de gestão e administração;
 - Durante a Intervenção foi aprovado plano de liquidação e foram recuperados cerca de 11,9 milhões;
 - Durante a atual gestão foram recuperados mais 550 mil e foi aprovada uma nova amortização de cerca de 1,9 milhões.



FIDC

- FIDC PREMIUM
 - Liquidação Extrajudicial do Banco Rural em 06/08/2013;
 - Desde então os Devedores do Banco estão sendo cobrados e restaram apenas processos judiciais no fundo;
 - Em 01/2020 foi aprovado pelos cotistas a contratação da empresa Ernst & Young para aprovar os ativos do fundo;
 - Esperada reprecificação de mais de 90% do fundo.



FIDC

- FI RECUPERAÇÃO BRASIL RF* LP
 - Fraudes envolvendo títulos de crédito superfaturados do Banco Rural, Banco BVA, Banco BMG e Banco PAN;
 - No dia 22/10/2012 foi decretada a Intervenção Extrajudicial pelo Banco Central no Banco BVA;
 - No dia 06/08/2013 ocorreu a Liquidação Extrajudicial do Banco Rural;
 - Fraudes no BVA e no Banco Rural constam no Relatório Final da CPI dos Fundos de Pensão da Câmara dos Deputados;
 - Os bancos BMG e PAN passaram por processo de reestruturação e quitaram suas dívidas, mas o sr. Adalberto Salgado Jr. que vendeu as CDBs do Banco PAN para o Recuperação Brasil por taxa consideravelmente inferior à taxa que realizou a compra está questionando judicialmente a venda e solicitando a devolução das CDBs sem ressarcimento.



FIDC

- GGR PRIME
 - Fundo com diversos ativos de crédito privado inadimplentes.
 - Ativos ligados à antiga gestora GGR com percentual de alocação superior ao permitido por lei;
 - Gestora Aurora comprou o fundo;
 - Funcionários da gestora Aurora foram presos na Operação Máfia das Falências;
 - A troca de gestão foi aprovada e está correndo processo na CVM para autorizar a troca.



FIDC

- FI Barcelona RF*
 - Fundo envolvido na Operação Encilhamento;
 - Foram utilizadas empresas não operacionais para a compra indireta de precatórios pelo fundo, uma vez que o investimento em precatórios é proibido para RPPSs;
 - Foi realizada a troca de gestão e administração;
 - A atual gestora está realizando acordo judicial para a recuperação dos recursos investidos.



FII

- ÁQUILLA FII
 - Fundo envolvido na Operação Fundo Fake da Polícia Federal;
 - Possui diversos empreendimentos imobiliários com sérios indícios de sobreprecificação;
 - Estamos tentando trocar os prestadores de serviço.
- SÃO DOMINGOS FII
 - Fundo envolvido na Operação Fundo Fake da Polícia Federal;
 - Possuía diversos empreendimentos imobiliários com sérios indícios de sobreprecificação
 - Foi realizada a troca de gestão e administração pela atual administração;
 - Foi Aprovado Plano de Liquidação pela atual administração;
 - Foram recuperados cerca de 0,7 milhões até o momento.



FIP

- FIP LA SHOPPING CENTER
 - Investimento realizado em 2013;
 - Fundo investe em Shoppings Centers;
 - Fundo adquiriu Shopg Center em Brasília que possuía como um dos sócios o Banco BVA;
 - Fundo adquiriu projeto de Shopping em Belo Horizonte sem autorização de construção;
 - A gestão do fundo foi alterada para um braço da antiga gestora;
 - A administração do fundo foi alterada na atual gestão para o Banco Daycoval;
 - Os cotistas solicitaram laudos de avaliação atualizados dos empreendimentos;
 - Os shoppings de Brasília e o Projeto de Shoppng não aprovado em Belo Horizonte foram reprecificados com os lados de avaliação atualizados;



FIP

- **GESTÃO EMPRESARIAL FIP**
 - Foi alterada a Administração e Gestão do Fundos;
 - Fundo possui investimentos em duas empresas, sendo uma a SEED que realizou empréstimos ao Shopping Cidadão, empresa que administra postos de atendimento no Rio e em São Paulo (poupa tempo) e a empresa Song que administrava eventos musicais.
 - Durante a atual gestão foi realizado acordo com a empresa Shopping Cidadão que pagou parte da dívida e parcelou o restante em 24 meses.
 - O pagamento da primeira parcela culminou na recuperação de cerca de 0,2 milhões por Pouso Alegre;
 - Em 2020 a empresa Shopping Cidadão solicitou o adiamento da dívida em função da falta de pagamento por alguns entes, está previsto que os pagamentos voltem a ocorrer até abril de 2022.
 - A empresa SONG faliu e foi contratado escritório jurídico pela gestora para verificar possíveis responsabilidades.



FIP

- CAM THRONE FIP MULTIESTRATÉGIA
 - Fundo realizou investimentos sobreprecificados em 3 empresas, sendo Bonanza, Fluxo e Riviere Casa Nova;
 - Fundo possui apenas 3 cotistas, sendo o RPPS de Pouso Alegre, o RPPS de Betim (investe em diversos fundos em comum com Pouso Alegre, incluindo o LA Shopping Center) e o fundo Sculptor (investido por Pouso Alegre)
 - A atual gestão denunciou a sobreprecificação das empresas para a CVM;
 - Em janeiro de 2020 a CVM encaminhou ofício solicitando informações do antigo presidente acerca dos investimentos realizados no fundo;
 - A gestora Cygnus foi descredenciada pela CVM em março de 2020;
 - orado novo laudo de avaliação gerando forte reprecificação no fundo;
 - Foi realizada a troca de gestão;



FIP

- CONQUEST FIP
 - Fundo envolvido na Operação Fundo Fake;
 - A gestora do fundo ROMA foi descredenciada pela CVM;
 - Pouso Alegre realizou denúncia no Ministério Público a respeito de acordo arbitral realizado pelo fundo;
 - O fundo pertence à cascata do Sigapore/Monte Carlo, sendo considerado pelos gestores o ativo mais problemático da cascata.
 - O fundo de encontra sem gestora, uma vez que até o momento nenhum prestador de serviço se interessou em assumir a gestão;



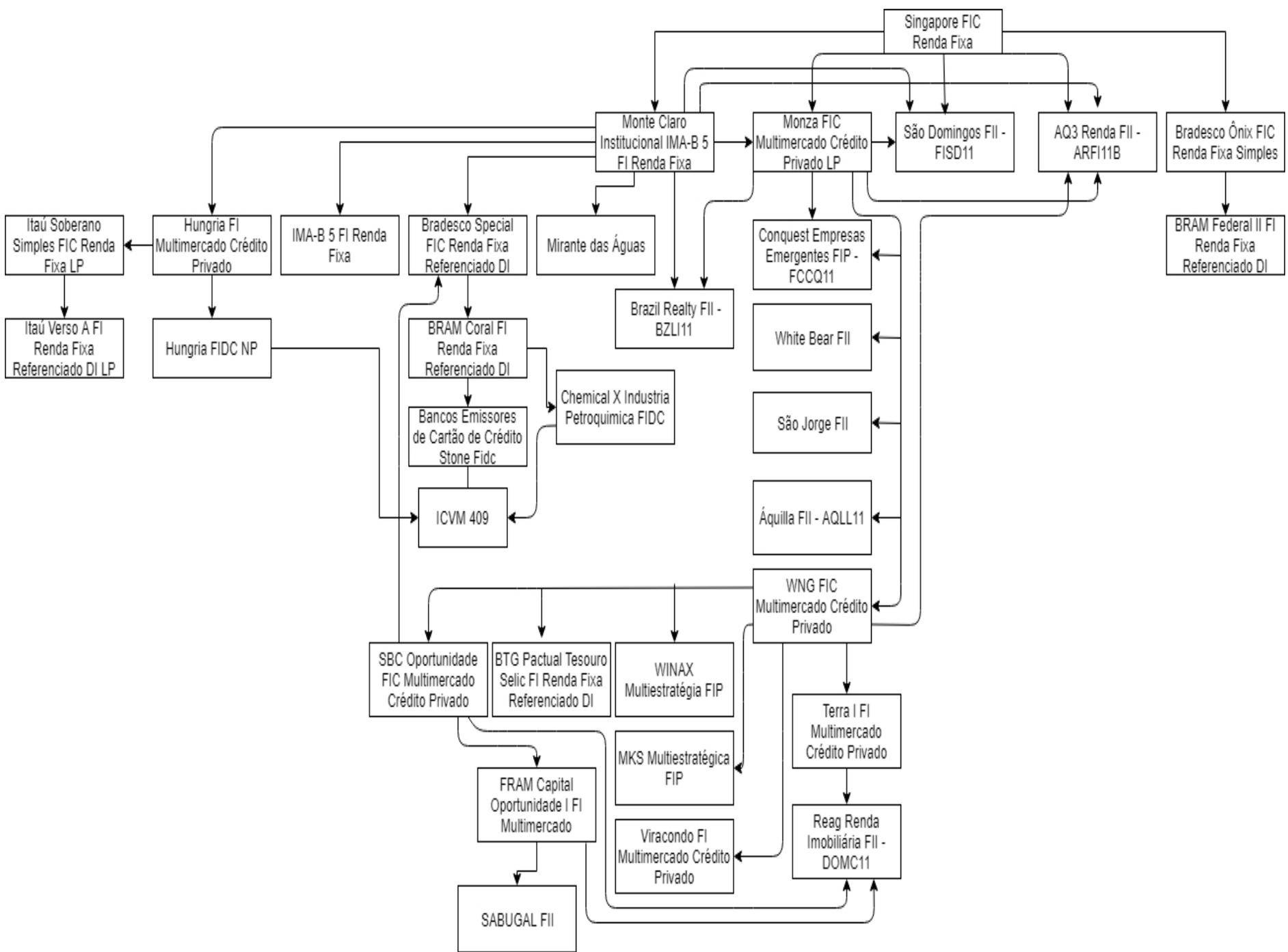
FIM

- FI MULTIMERCADO SCULPTOR CREDITO PRIVADO
 - Fundo envolvido na Operação Encilhamento
 - Possui diversos ativos de crédito privado em comum com os fundos Illuminati, Pyxis e com a cascata do fundo IMA-B 1000;
 - Fundo investe em diversos fundos estressados incluindo o CAM Throne;
 - Foi realizada a troca de gestão e administração do fundo pela atual administração;
 - Foi aprovado Plano de Liquidação do Fundo pela atual administração;
 - A previsão é de que o fundo comece a amortizar recursos ainda em 2021.
 - O fundo ainda deve passar por novas reprecificações haja visto a participação em fundos estressados



CASCATAS

- SINGAPORE FI RENDA FIXA/FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5
 - Fundo envolvido na Operação Fundo Fake;
 - Foi realizada a troca de gestão e administração do Fundo pela atual gestão;
 - Foi Aprovado Plano de liquidação pela atual gestão
 - O fundo Singapore foi liquidado sendo recebido R\$9.997,82 reais e participação no Fundo Monte Carlo;
 - Até o momento foi recuperado cerca de 1,4 milhões;
 - Segue representação da cascata antes da aprovação do Plano de Liquidação:

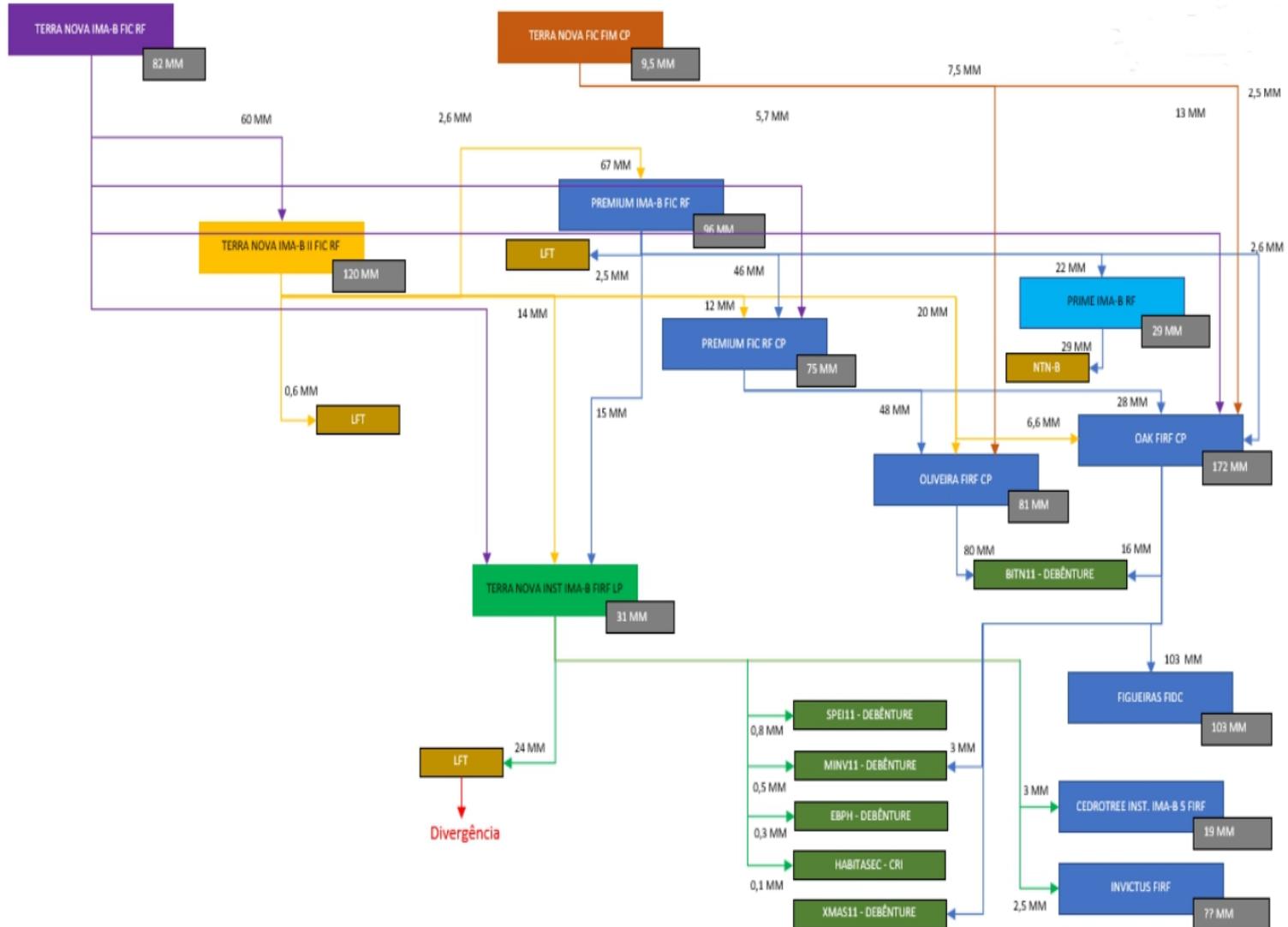




CASCATAS

- TERRA NOVA IMA B FICFI RENDA FIXA
 - Fundo envolvido na Operação Abismo;
 - Ativo do Fundo envolvido na Operação Torre Negra;
 - Foi realizada a troca de gestão e administração do fundo;
 - Foi aprovado Plano de Liquidação;
 - Pouso Alegre questionou à administradora indícios de sobreprecificação, em especial nas debêntures BITN11, XMAS11 e MINV11;
 - O fundo foi reprecificado, mas ainda se encontra sobreprecificado;
 - Até o momento foram recuperados cerca de 60 mil reais.
 - Segue a cascata do fundo antes das troca de gestor e liquidações para redução de custos:

Cascata Pré Veritas



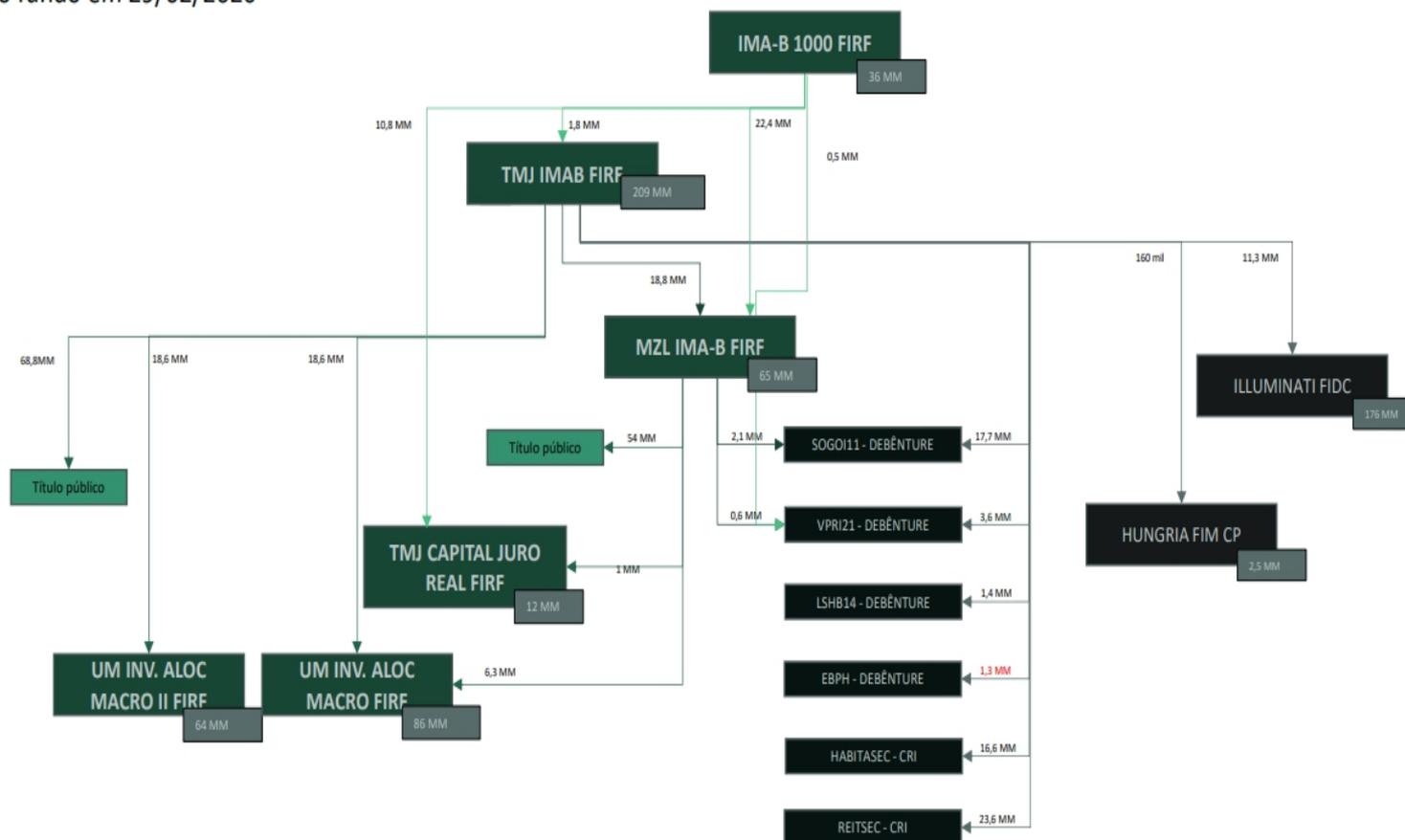


CASCATAS

- FIC RF LP IMAB 1000
 - Fundo foi “vítima” das “divergências em títulos públicos” que culminaram na liquidação pelo Banco Central da Corretora Um Investimentos;
 - Foi realizada a troca de gestão do Fundo;
 - Foi aprovado Plano de Liquidação do Fundo;
 - Pouso Alegre denunciou à CVM movimento realizado por alguns RPPSs para trocar a gestão e evitar amortizações no fundo MZL pertencente à cascata;
 - A CVM determinou que os os planos de liquidação aprovados deveriam ser cumpridos e as aplicações líquidas amortizadas;
 - A cascata devolveu cerca de 100 milhões aos RPPSs e Pouso Alegre recuperou 4,4 milhões, sendo que estão previstas novas amortizações.
 - Segue a cascata antes da troca de gestão:

IMPACTOS E AMORTIZAÇÕES

- Cascata do fundo em 29/02/2020





FI SICILIA RF* LONGO PRAZO

- Fundo foi “vítima” das “divergências em títulos públicos” que culminaram na liquidação pelo Banco Central da Corretora Um Investimentos;
- Ativo do fundo envolvido na Operação Gatekeepers;
- Ativo do fundo envolvido na Operação Torre Negra;
- Ativo do fundo envolvido na Operação Abismo;
- O fundo possuía apenas três ativos, sendo cotas do Fundo Botafogo, que teoricamente possuía títulos públicos, cotas do FIP Cais Mauá e as debêntures MINV11;
- Antes da Operação do Banco Central Pouso Alegre havia aprovado em Assembléia Geral de Cotistas o resgate das cotas do Fundo Botafogo e a amortização dos títulos públicos presentes no fundo, mas os valores não foram amortizados uma vez que, conforme apurado pelo Banco Central, o fundo Botafogo já não possuía a custódia dos títulos;



FI SICILIA RF* LONGO PRAZO

- Foi contratado escritório de advocacia para apurar responsabilidades na “divergência de títulos públicos”, mas a chance de recuperação é remota;
- Foi decretada a empresa M.Invest emissora da debênture MINV11 e os antigos prestadores de serviços não se qualificaram na massa falida. A atual gestora contratou escritório de advocacia para tentar qualificar o fundo e apurar possíveis responsabilidades, mas a chance de recuperação é remota;
- O fundo FIP Cais Mauá foi liquidado e o fundo recebeu ações da empresa Cais Mauá S.A. A empresa foi alvo de investigação da operação Gatekeepers e possui como “ativo” uma demanda judicial contra o Estado do Rio Grande do Sul. A chance de recuperação é remota.



Obrigada!

Fátima A. Belani