
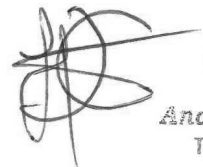



CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos
Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2021

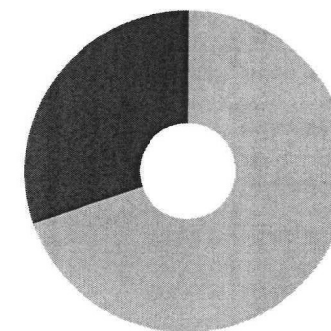
afu
anam   
Ana Cristina Faustino
Tesoureira do IPREVI
Matrícula: 1017
10 MAR 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.192.484,50	0,77%	2.036	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	5.640.131,98	3,62%	9.885	0,73%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIAÇÕES	D+4	Não há	4.618.968,02	2,96%	4.722	1,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
MULTINVEST FIAÇÕES	D+11	Não há	2.007.373,57	1,29%	279	2,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	D+15	Não há	3.314.863,09	2,13%	6.474	0,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
META VALOR FIAÇÕES	D+4	Não há	6.390.396,38	4,10%	175	2,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FIAÇÕES	D+4	Não há	2.122.161,42	1,36%	9.781	0,52%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	4.190.201,43	2,69%	40.797	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FIAÇÕES	D+7 du ...	Não há	1.250.889,03	0,80%	15	5,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.064.497,10	2,61%	18.112	0,09%	Artigo 8º, Inciso III
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.987.246,68	2,56%	32	1,34%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.190.709,18	0,76%	101	0,12%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.161.974,11	2,67%	17.605	0,19%	Artigo 8º, Inciso III
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	D+11	Não há	489.499,31	0,31%	167	1,39%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.960.000,00	1,26%		1,27%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	Término...	Não há	278.370,36	0,18%	749	0,63%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			155.829.016,25				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Fevereiro / 2021)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	71.651.800,71	45,98%	11,08%	47,41%	69,26%	36.275.375,94
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70,00%	1.484.550,13	0,95%	0,00%	2,00%	5,00%	6.306.900,68
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	50,00%	35.130.572,82	22,54%	4,07%	20,34%	40,00%	27.201.033,68
Desenquadrado - RF	0,00%	278.370,36	0,18%	0,00%	0,00%	0,00%	-278.370,36
Total Renda Fixa	100,00%	108.545.294,02	69,66%	15,15%	69,75%	114,26%	



RENDA FIXA 108.545.294,02
RENDA VARIÁVEL 47.283.722,23

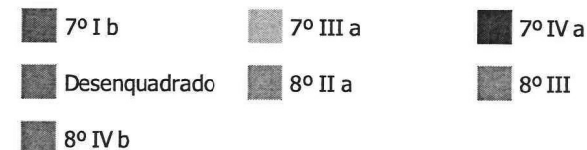
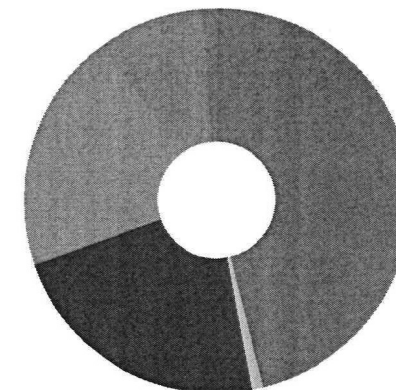
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

[Handwritten signatures]

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	30,00%	31.429.795,85	20,17%	3,68%	19,38%	30,00%	15.318.909,03
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.893.926,38	8,92%	3,08%	8,08%	20,00%	17.271.876,87
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	10,00%	1.960.000,00	1,26%	0,00%	2,15%	5,00%	5.831.450,81
Total Renda Variável	40,00%	47.283.722,23	30,34%	6,76%	29,61%	55,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,32%	5,00%	7.791.450,81
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,32%	5,00%	7.791.450,81
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,64%	10,00%	



[Handwritten signature]

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Fevereiro / 2021)

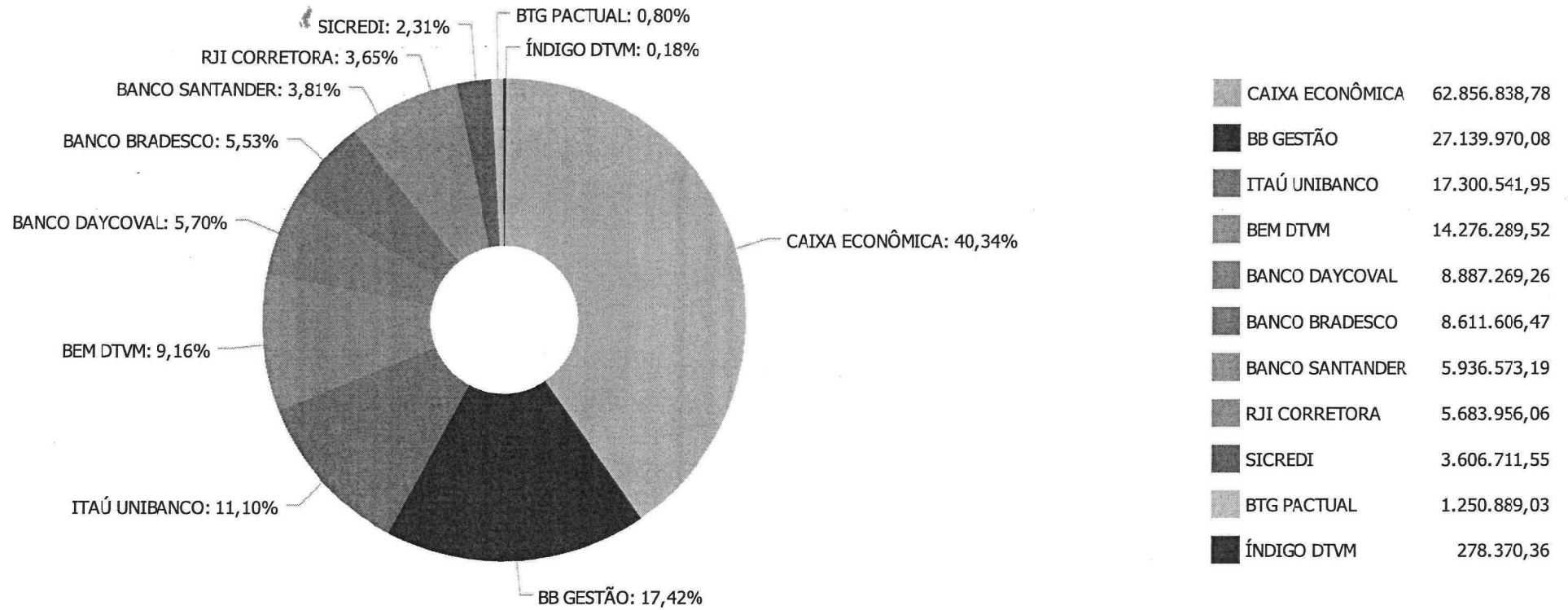
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	62.856.838,78	40,34	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTV/M	27.139.970,08	17,42	-
ITAÚ UNIBANCO	17.300.541,95	11,10	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	9.313.932,90	5,98	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	7.933.831,11	5,09	-
META ASSET MANAGEMENT	6.390.396,38	4,10	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	5.936.573,19	3,81	-
INFINITY ASSET MANAGEMENT	5.683.956,06	3,65	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	5.640.131,98	3,62	-
MULTINVEST CAPITAL	2.496.872,88	1,60	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	2.122.161,42	1,36	-
SICREDI	1.484.550,13	0,95	-
ATHENA CAPITAL	1.250.889,03	0,80	-
MACROINVEST GESTÃO DE RECURSOS	278.370,36	0,18	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

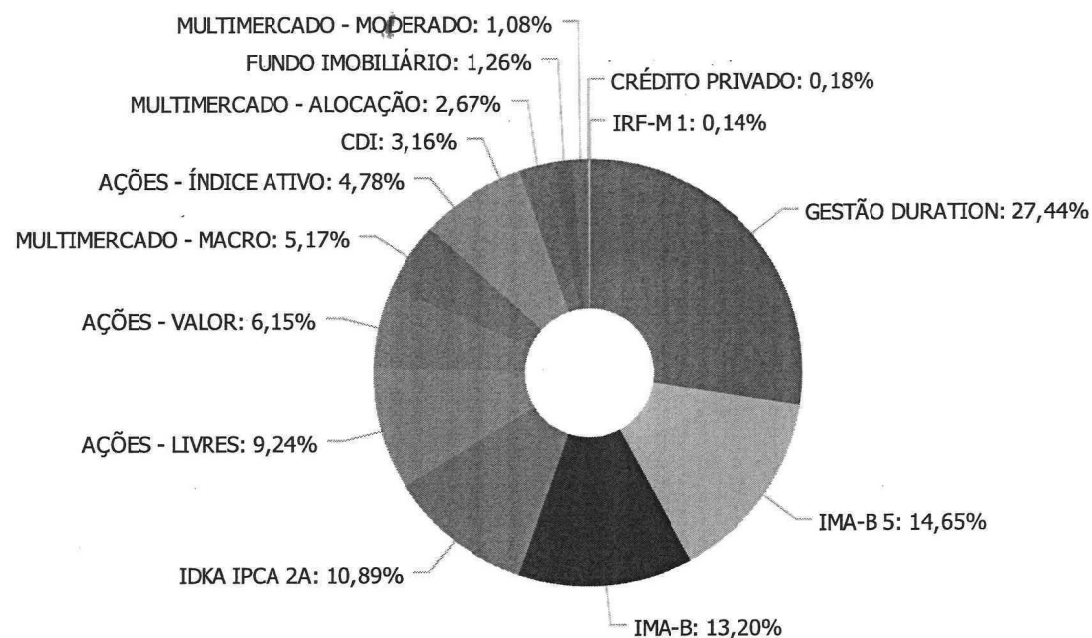
Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	71.651.800,71	45,98	11,08	69,26
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	1.484.550,13	0,95	0,00	0,57
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	35.130.572,82	22,54	4,07	40,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	31.429.795,85	20,17	18,38	30,00
Artigo 8º, Inciso III	13.893.926,38	8,92	3,08	20,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	1.960.000,00	1,26	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

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)

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Fevereiro / 2021)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Fevereiro / 2021)



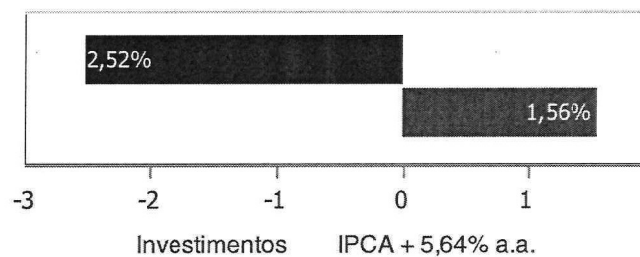
GESTÃO DURATION	42.753.326,00
IMA-B 5	22.836.154,30
IMA-B	20.574.971,21
IDKA IPCA 2A	16.966.421,66
AÇÕES - LIVRES	14.396.085,53
AÇÕES - VALOR	9.590.254,45
MULTIMERCADO - MACRO	8.051.743,78
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	7.443.455,87
CDI	4.921.562,94
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	4.161.974,11
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.960.000,00
MULTIMERCADO - MODERADO	1.680.208,49
CRÉDITO PRIVADO	278.370,36
IRF-M 1	214.487,55

[Handwritten signatures and initials]

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2021)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	155.538.272,80	13.522.647,22	13.433.035,03	153.903.972,44	-1.823.912,55	-1.823.912,55	-1,17%	-1,17%	0,69%	0,69%	-170,36%	3,59%
Fevereiro	153.903.972,44	1.850.524,03	2.171.325,33	151.487.917,05	-2.095.254,09	-3.919.166,64	-1,36%	-2,52%	0,86%	1,56%	-161,54%	3,62%

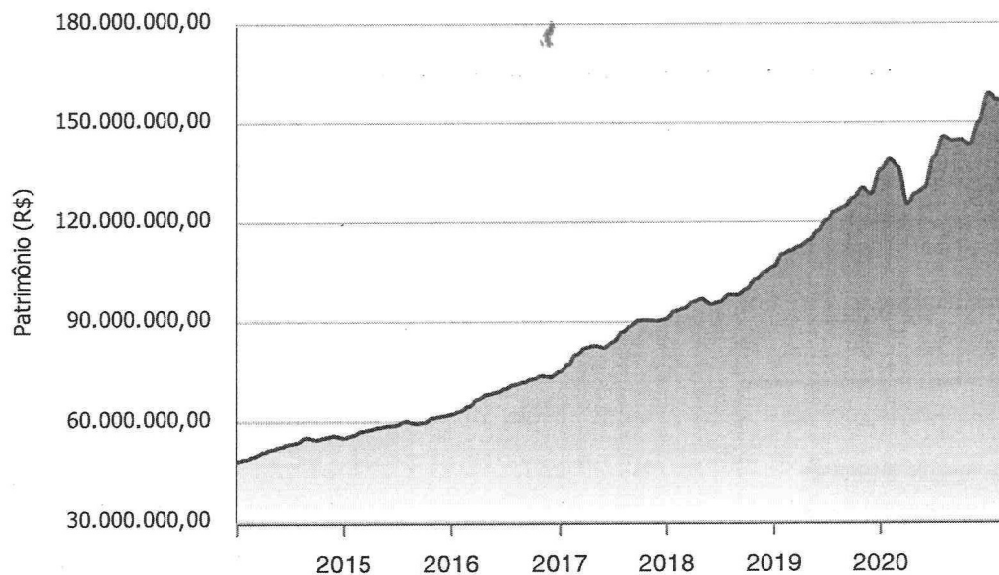
Investimentos x Meta Atuarial



[Handwritten signatures]

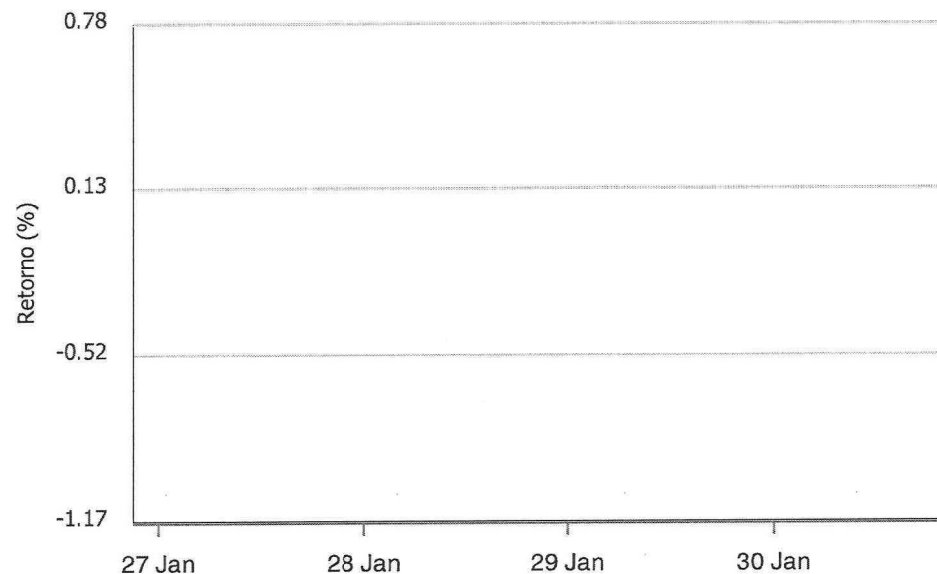
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- 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

Handwritten signatures and initials: *aram*, *[Signature]*, *[Signature]*, *feio*

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2021

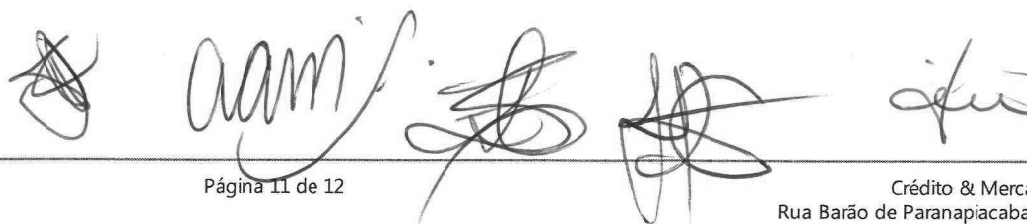
FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	5.439.449,45	0,00	0,00	5.534.539,08	95.089,63	1,75%	1,75%	1,71%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	147.818,77	0,00	0,00	149.416,98	1.598,21	1,08%	1,08%	0,55%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.615.610,60	0,00	0,00	2.618.104,06	2.493,46	0,10%	0,10%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	529.588,62	0,00	454.194,53	75.784,38	390,29	0,07%	0,08%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.320.325,04	0,00	1.191.718,94	129.527,50	921,40	0,07%	0,02%	0,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	84.915,53	0,00	0,00	84.960,05	44,52	0,05%	0,05%	0,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	552.538,30	2.094.688,53	569.887,30	2.078.257,52	917,99	0,03%	0,14%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	23.223.116,30	0,00	0,00	23.105.249,10	-117.867,20	-0,51%	-0,51%	0,95%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	10.023.807,61	61.556,22	0,00	10.032.039,78	-53.324,05	-0,53%	-0,53%	1,30%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.972.608,43	0,00	0,00	6.934.381,88	-38.226,55	-0,55%	-0,55%	1,09%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	10.538.668,07	476.076,62	0,00	10.947.122,95	-67.621,74	-0,61%	-0,61%	1,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.161.179,94	829.263,22	0,00	5.952.458,16	-37.985,00	-0,63%	-0,62%	1,17%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	5.983.429,70	0,00	0,00	5.936.573,19	-46.856,51	-0,78%	-0,78%	1,30%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	14.245.784,17	0,00	0,00	14.113.537,82	-132.246,35	-0,93%	-0,93%	1,29%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.572.426,00	0,00	37.994,51	1.512.549,00	-21.882,49	-1,39%	-3,81%	4,42%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO ...	1.507.610,52	0,00	0,00	1.484.550,13	-23.060,39	-1,53%	-1,53%	2,36%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.316.977,57	0,00	0,00	2.281.461,82	-35.515,75	-1,53%	-1,53%	2,31%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	10.839.030,77	0,00	0,00	10.672.050,47	-166.980,30	-1,54%	-1,54%	2,32%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.705.486,42	0,00	0,00	4.624.359,79	-81.126,63	-1,72%	-1,72%	2,88%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	289.763,75	0,00	0,00	278.370,36	-11.393,39	-3,93%	-4,51%	9,24%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Fixa	108.070.135,56	3.461.584,59	2.253.795,28	108.545.294,02	-732.630,85	-0,67%		1,42%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	4.170.462,05	0,00	0,00	4.190.201,43	19.739,38	0,47%	0,47%	10,10%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.195.635,47	0,00	0,00	1.190.709,18	-4.926,29	-0,41%	-0,41%	2,52%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.087.874,76	0,00	0,00	4.064.497,10	-23.377,66	-0,57%	-0,57%	2,21%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	4.014.169,37	0,00	0,00	3.987.246,68	-26.922,69	-0,67%	-0,67%	1,11%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.209.742,27	0,00	0,00	4.161.974,11	-47.768,16	-1,13%	-1,13%	3,60%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	495.614,39	0,00	0,00	489.499,31	-6.115,08	-1,23%	-1,23%	1,65%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIAÇÕES	4.727.609,91	0,00	0,00	4.618.968,02	-108.641,89	-2,30%	-2,30%	11,06%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	5.778.851,40	0,00	0,00	5.640.131,98	-138.719,42	-2,40%	-2,40%	11,82%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	3.402.197,26	0,00	0,00	3.314.863,09	-87.334,17	-2,57%	-2,57%	10,09%
MULTINVEST FIAÇÕES	2.061.821,67	0,00	0,00	2.007.373,57	-54.448,10	-2,64%	-2,64%	10,83%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	725.867,88	0,00	0,00	702.326,43	-23.541,45	-3,24%	-3,24%	13,26%
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FIAÇÕES	1.297.383,80	0,00	0,00	1.250.889,03	-46.494,77	-3,58%	-3,58%	9,35%
META VALOR FIAÇÕES	6.702.054,81	0,00	0,00	6.390.396,38	-311.658,43	-4,65%	-4,65%	10,15%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.255.616,54	0,00	0,00	1.192.484,50	-63.132,04	-5,03%	-5,03%	13,40%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FIAÇÕES	2.248.407,67	0,00	0,00	2.122.161,42	-126.246,25	-5,61%	-5,61%	13,75%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.282.200,00	0,00	12.000,00	1.960.000,00	-310.200,00	-13,59%	-14,12%	15,82%
Total Renda Variável	48.655.509,25	0,00	12.000,00	47.283.722,23	-1.359.787,02	-2,79%		8,66%