
REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE
ALTAMIRA - PA / ALTAPREV

RELATÓRIO MENSAL
DE
INVESTIMENTOS

FEVEREIRO
2022

29 de junho de 2022

(63)3602-1493 / (63)3602-2504 - economico@selfassessoria.com.br

Av. Castelo Branco - 1555 2º Andar, Centro - Cep: 77600-000 - Paraíso do Tocantins-TO

ÍNDICE

1 – INTRODUÇÃO	2
2 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA e POLÍTICA DE INVESTIMENTOS	4
2.1 - Movimentação Financeira da Carteira	4
2.2 - PAI - Limite de Segmento	5
2.3 - PAI - Limite de Benchmark	6
3 – ENQUADRAMENTO: RESOLUÇÃO CMN 4.963/2021	7
3.1 - Enquadramento sobre Segmentos e Fundos de Investimento	7
3.1.1 - Disponibilidade Financeira e Total por Segmento	10
3.2 - Enquadramento sobre Patrimônio Líquido dos Fundos de Investimento	11
3.3 - Enquadramento dos Fundos de Investimento que recebem cotas	12
3.4 - Movimentação das Cotas Aplicadas nos Fundos de Investimento	14
3.5 - Enquadramento sobre os recursos de terceiros dos Gestores	15
4 – SEPARAÇÃO DOS RECURSOS - PROVISÃO DE CAIXA	16
4.1 - Planejamento Financeiro	17
5 – DISTRIBUIÇÃO ESTATÍSTICA DA CARTEIRA	18
5.1 - Distribuição por Segmento (Renda Fixa e Renda Variável)	18
5.2 - Distribuição por índice (Benchmark)	19
5.3 - Distribuição por Instituição Financeira	20
5.4 - Distribuição dos Recursos Disponíveis e Imobilizado	21
5.4.1 - Distribuição da Disponibilidade dos Recursos nos próximos 25 anos	22
6 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTO	24
7 – RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	31
8 – RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO	42
8.1 - Rentabilidade Mensal da Carteira de Investimentos	42
8.2 - Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos	43
8.3 - Rentabilidade da Carteira de Investimentos	45
8.4 - Meta Atuarial	45
9 – ANÁLISE DO MERCADO	46
10 – ANÁLISE MACROECONÔMICA	50
11 – PROJEÇÃO DA META ATUARIAL E RENTABILIDADE DA CARTEIRA	53
12 – ANEXO	54

1 - INTRODUÇÃO

Atendendo a necessidade do Instituto Previdenciário quanto a Política anual de Investimentos e a Meta Atuarial, enviamos o parecer econômico referente ao mês de FEVEREIRO, sobre o desempenho mensal das rentabilidades das atuais aplicações financeiras do ALTAPREV.

Este Relatório contém uma análise do enquadramento de suas aplicações frente à Resolução CMN 4.963/2021, um resumo do Regulamento dos fundos de investimento, uma análise sobre o comportamento mensal das rentabilidades ao longo do ano, uma análise do retorno da carteira de investimento quanto a Meta Atuarial e uma projeção sobre o cumprimento da Meta.

Este relatório vem atender o **Inciso II, do Art. 3º da Portaria MPS 519/2011**, que exige a elaboração de **Relatórios Mensais**, para acompanhamento do desempenho das aplicações financeiras.

Art. 3. II – Exigir da entidade credenciada, mediante contrato, no mínimo mensalmente, relatório detalhado contendo informações sobre a rentabilidade e risco das aplicações.

2.1-MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2022 - ALTAPREV

Nº	MESES	SALDO INICIAL	APORTES (Aplicação)	RESGATES	VARIÇÃO PU - TÍTULOS PÚBLICOS	RENTABILIDADE			SALDO FINAL
						Positiva (a)	Negativa (b)	Consolidado c = (a) - (b)	
1	JANEIRO	52.026.358,65	1.000.000,00	(1.704.496,45)	162,39	186.998,84	(1.047.839,25)	(860.840,41)	50.461.184,19
2	FEVEREIRO	50.461.184,19	1.069.127,10	(928.974,30)	33.099,80	267.693,16	(281.420,33)	(13.727,17)	50.620.709,62
3	MARÇO	50.620.709,62	-	-	-	-	-	-	50.620.709,62
4	ABRIL	50.620.709,62	-	-	-	-	-	-	50.620.709,62
5	MAIO	50.620.709,62	-	-	-	-	-	-	50.620.709,62
6	JUNHO	50.620.709,62	-	-	-	-	-	-	50.620.709,62
7	JULHO	50.620.709,62	-	-	-	-	-	-	50.620.709,62
8	AGOSTO	50.620.709,62	-	-	-	-	-	-	50.620.709,62
9	SETEMBRO	50.620.709,62	-	-	-	-	-	-	50.620.709,62
10	OUTUBRO	50.620.709,62	-	-	-	-	-	-	50.620.709,62
11	NOVEMBRO	50.620.709,62	-	-	-	-	-	-	50.620.709,62
12	DEZEMBRO	50.620.709,62	-	-	-	-	-	-	50.620.709,62
13	ANO	52.026.358,65	2.069.127,10	(2.633.470,75)	33.262,19	454.692,00	(1.329.259,58)	(874.567,58)	50.620.709,62

*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

2.2-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2022 - LIMITE DE SEGMENTO - ALTAPREV

Nº	Segmentos da Resolução CMN 4.963/2021	Dispositivo Legal Resolução CMN 4.963/2021	Limites do PAI			Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
			Mínimo	Estratégia Alvo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
RENDA FIXA								
1	Títulos Públicos Federal	Art. 7, I, a (100%)	0,0%	8,0%	100,0%	8,4%	4.240.171,72	-
2	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissada	Art. 7, I, b (100%)	0,0%	49,8%	100,0%	48,8%	24.723.762,00	-
3	F.I. Índice de Renda Fixa 100% T.P.F. e/ou Oper	Art. 7, I, c (100%)	0,0%	0,0%	100,0%	0,0%	-	-
4	Operações Compromissadas	Art. 7, II (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
5	F.I. de Renda Fixa	Art. 7, III, a (60%)	0,0%	4,6%	60,0%	27,9%	14.116.827,59	-
6	F.I. de Índice de Renda Fixa	Art. 7, III, b (0%)	0,0%	24,0%	60,0%	0,0%	-	-
7	Ativos Financeiros de Renda Fixa de I.F.	Art. 7, IV (20%)	0,0%	0,0%	20,0%	0,0%	-	-
8	FIDC - Classe Sênior	Art. 7, V, a (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
9	F.I. Renda Fixa de "Crédito Privado"	Art. 7, V, b (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
10	F.I. em 85% de Debêntures	Art. 7, V, c (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
11	TOTAL - RENDA FIXA					85,1%	43.080.761,31	
RENDA VARIÁVEL								
12	F.I. Ações	Art. 8, I (30%)	0,0%	4,5%	30,0%	4,3%	2.160.202,62	-
13	F.I. Ações em Índices de Renda Variável	Art. 8, II (30%)	0,0%	0,0%	30,0%	0,0%	-	-
14	TOTAL - RENDA VARIÁVEL					4,3%	2.160.202,62	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS								
15	F.I. e F.I.C FI Multimercados	Art. 10, I (10%)	0,0%	0,6%	10,0%	2,6%	1.323.598,52	-
16	F.I. em Participações	Art. 10, II (5%)	0,0%	2,5%	5,0%	2,6%	1.308.898,48	-
17	F.I. Ações - Mercado de Acesso	Art. 10, III (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
18	TOTAL - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					5,2%	2.632.497,00	
FUNDOS IMOBILIÁRIOS								
19	F.I. Imobiliário	Art. 11 (5%)	0,0%	1,2%	5,0%	1,2%	598.778,33	-
20	TOTAL - FUNDOS IMOBILIÁRIOS					1,2%	598.778,33	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR								
21	FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa	Art. 9º, I (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
22	FIC - Aberto - Investimento no Exterior	Art. 9º, II (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
23	Fundos de Ações - BDR Nível I	Art. 9º, III (10%)	0,0%	4,9%	10,0%	4,2%	2.148.470,35	-
24	TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR					4,2%	2.148.470,35	
EMPRÉSTIMO CONSIGNADO								
25	Empréstimo Consignado	Art. 12 (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
26	TOTAL - EMPRÉSTIMO CONSIGNADO					0,0%	-	
27	DESENQUADRADO	-		100,0%		0,0%	-	-
28	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-				0,0%	21.515,37	
29	PATRIMÔNIO TOTAL					100,0%	50.642.224,99	

2.3-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2022 - LIMITE DE BENCHMARK - ALTAPREV

Nº	ÍNDICES DE BENCHMARK	Limites do PAI		Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
		Mínimo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
RENDA FIXA						
1	DI	0,0%	80,0%	10,1%	5.137.291,43	-
2	IRF - M 1	0,0%	50,0%	18,5%	9.389.112,03	-
3	IRF - M	0,0%	40,0%	0,0%	-	-
4	IRF - M 1+	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
5	IMA - B 5	0,0%	60,0%	3,1%	1.565.061,92	-
6	IMA - B	0,0%	53,1%	43,1%	21.821.972,18	-
7	IMA - B 5+	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
8	IMA - GERAL e IMA - GERAL ex-C	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
9	IDKA 2, IDKA 3	0,0%	50,0%	8,5%	4.291.140,35	-
10	IPCA	0,0%	30,0%	0,0%	-	-
11	IPCA + TAXA DE JUROS	0,0%	30,0%	5,1%	2.595.068,49	-
RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS NO EXTERIOR						
13	ÍNDICES DE RENDA VARIÁVEL	0,0%	30,0%	3,7%	1.865.570,09	-
14	ÍNDICES DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,0%	10,0%	7,8%	3.955.493,12	-
15	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	0,0%	0,0%	0,0%	21.515,37	-

Os demais índices (Benchmark) não listados acima, e que por ventura o RPPS venha aplicar, não possuem limitação de aplicação conforme PAI em vigor.

3.1-ENQUADRAMENTO SOBRE SEGMENTOS E FUNDOS DE INVESTIMENTOS

RENDA FIXA

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
1	-	LFT-POS-SELIC-Competitivo (2023)	3.774.230,45	7,45%	SIM	Títulos Públicos Federal, Art. 7, I, a (100%)	8,4%	SIM
2	-	LFT-POS-SELIC (2023)	465.941,27	0,92%	SIM			
3	10.740.670/0001-06	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF	5.632.648,83	11,12%	SIM	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	48,8%	SIM
4	00.834.074/0001-23	FIC FI CAIXA PRÁTICO RF CURTO PRAZO	27.306,62	0,05%	SIM			
5	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	8.574.957,68	16,93%	SIM			
6	19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA III	876.183,40	1,73%	SIM			
7	03.543.447/0001-03	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	1.565.061,92	3,09%	SIM			
8	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	4.291.140,35	8,47%	SIM			
9	11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	3.756.463,20	7,42%	SIM			
10	19.391.026/0001-36	AUSTRO IMA-B ATIVO FIC FI - RENDA FIXA	737.371,51	1,46%	SIM	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	27,9%	SIM
11	11.087.118/0001-15	SICREDI - FIC FI INSTITUCIONAL RF REF IMA - B LP	2.363.496,50	4,67%	SIM			
12	08.702.798/0001-25	BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA - B	2.022.745,85	3,99%	SIM			
13	07.861.554/0001-22	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	8.123.400,64	16,04%	SIM			
14	13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	869.813,09	1,72%	SIM			
(1) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA			43.080.761,31	85,07%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JANEIRO

RENDA VARIÁVEL

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
15	36.178.569/0001-99	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	1.807.022,77	3,57%	SIM	F.I. Ações, Art. 8, I (30%)	4,3%	SIM
16	40.054.357/0001-77	BB AÇÕES AGRO FIC FI	353.179,85	0,70%	SIM			
17	18.366.002/0001-64	AUSTRO MULTIPAR FIC FI MULT CRÉDITO PRIVADO	219.724,46	0,43%	SIM	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	2,6%	SIM
18	12.231.743/0001-51	FI EM PARTICIPAÇÕES AUSTRO MULTISSETORIAL	1.718.885,09	3,39%	SIM	F.I. em Participações, Art. 10, II (5%)	2,6%	SIM
19	10.625.626/0001-47	CONQUEST FI EM PARTICIPAÇÕES EMPRESAS EMERGENTES ***	(409.986,61)	-0,81%	NÃO			
20	13.555.918/0001-49	AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO **	598.778,33	1,18%	SIM	F.I. Imobiliário, Art. 11 (5%)	1,2%	SIM
(2) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL			4.287.603,89	8,47%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JANEIRO

** Informações referente ao FUNDO no Anexo 11, item 12.1 - AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO (CNPJ: 13.555.918/0001-49)

*** Informações referente ao FUNDO no Anexo 11, item 12.2 - CONQUEST FI EM PARTICIPAÇÕES EMPRESAS EMERGENTES (CNPJ: 10.625.626/0001-47).

INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
21	22.632.237/0001-28	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	2.148.470,35	4,24%	SIM	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)	4,2%	0,0%
(3) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			2.148.470,35	4,24%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JANEIRO

3.1.1-DISPONIBILIDADE FINANCEIRA E TOTAL POR SEGMENTO

Nº	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		
22	Banco do Brasil S.A.	19.201,64	0,04%
23	Caixa Econômica Federal	2.313,73	0,005%
(4)	TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)	21.515,37	0,04%

TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS			
(1)	TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	43.080.761,31	85,07%
(2)	TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL	4.287.603,89	8,47%
(3)	TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	2.148.470,35	4,24%
(4)	TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)	21.515,37	0,04%
PATRIMÔNIO LÍQUIDO TOTAL (1 + 2 + 3 + 4)		49.538.350,93	97,82%

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JANEIRO

3.2-ENQUADRAMENTO SOBRE O PATRIMÔNIO LÍQUIDO DOS FUNDOS

Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	Patrimônio Líquido do Fundo de Investimento	(%) Recursos do RPPS sobre o PL* do FUNDO	Enquadrado?
Art. 19 - As aplicações deverão representar até 15% do patrimônio líquido do fundo.	1	13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	869.813,09	7.639.104.845,31	0,011%	SIM
	2	11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	3.756.463,20	5.025.689.167,39	0,075%	SIM
	3	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	4.291.140,35	9.012.864.987,26	0,048%	SIM
	4	03.543.447/0001-03	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	1.565.061,92	6.375.804.434,87	0,025%	SIM
	5	19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA III	876.183,40	580.932.851,15	0,151%	SIM
	6	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	8.574.957,68	6.297.272.158,07	0,136%	SIM
	7	07.861.554/0001-22	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	8.123.400,64	778.022.116,28	1,044%	SIM
	8	22.632.237/0001-28	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	2.148.470,35	1.110.111.462,43	0,194%	SIM
	9	40.054.357/0001-77	BB AÇÕES AGRO FIC FI	353.179,85	384.750.775,23	0,092%	SIM
	10	36.178.569/0001-99	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	1.807.022,77	2.257.981.164,09	0,080%	SIM
	11	00.834.074/0001-23	FIC FI CAIXA PRÁTICO RF CURTO PRAZO	27.306,62	32.913.062.981,43	0,000%	SIM
	12	10.740.670/0001-06	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF	5.632.648,83	5.808.584.551,28	0,097%	SIM
	13	44.683.343/0001-73	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MUL	1.103.874,06	119.358.891,62	0,925%	SIM
	14	08.702.798/0001-25	BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA - B	2.022.745,85	898.293.883,59	0,225%	SIM
	15	11.087.118/0001-15	SICREDI - FIC FI INSTITUCIONAL RF REF IMA - B LP	2.363.496,50	427.493.217,35	0,553%	SIM
	16	19.391.026/0001-36	AUSTRO IMA-B ATIVO FIC FI - RENDA FIXA	737.371,51	51.588.855,57	1,429%	SIM
	17	18.366.002/0001-64	AUSTRO MULTIPAR FIC FI MULT CRÉDITO PRIVADO	219.724,46	8.555.747,25	2,568%	SIM
	18	13.555.918/0001-49	AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO **	598.778,33	92.887.389,62	0,645%	SIM
	19	10.625.626/0001-47	CONQUEST FI EM PARTICIPAÇÕES EMPRESAS EMERGENTES *	(409.986,61)	(50.457.584,58)	-0,813%	NÃO
	20	12.231.743/0001-51	FI EM PARTICIPAÇÕES AUSTRO MULTISSETORIAL	1.718.885,09	67.105.333,88	2,561%	SIM
TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO				44.661.652,81			
TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)				21.515,37			
PATRIMÔNIO LÍQUIDO				44.683.168,18			

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: FEVEREIRO

** Informações referente ao FUNDO no Anexo 11, item 12.1 - AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO (CNPJ: 13.555.918/0001-49)

*** Informações referente ao FUNDO no Anexo 11, item 12.2 - CONQUEST FI EM PARTICIPAÇÕES EMPRESAS EMERGENTES (CNPJ: 10.625.626/0001-47).

3.3-ENQUADRAMENTO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS QUE RECEBEM COTAS DE FI

FIC - Fundo de Investimento em Cotas	Distribuição das cotas do FIC	Valor Aplicado no Fundo (R\$)	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Patrimônio Líquido do FI	(%) Recursos do RPPS sobre o PL* do FUNDO	ENQUADRADO?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO		
FI - Fundo de Investimento										
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	100,00%	3.756.463,20	7,42%	5.025.689.167,39	0,075%	SIM	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	SIM		
BB IRF-M 1 FI DE RF	100,00%	3.756.542,86	7,42%	3.294.148.139,99	0,114037%	SIM				
BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	100,00%	1.565.061,92	3,09%	6.375.804.434,87	0,025%	SIM				
BB TOP RF IMA-B 5 LP FI	100,00%	1.565.094,79	3,09%	15.454.800.424,32	0,010127%	SIM				
FIC FI CAIXA PRÁTICO RF CURTO PRAZO	100,00%	27.306,62	0,05%	32.913.062.981,43	0,000%	SIM				
FI CAIXA MASTER LIQUIDEZ RF CP	100,03%	27.314,33	0,05%	2.907.017.295,14	0,000940%	SIM				
BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	100,00%	869.813,09	1,72%	7.639.104.845,31	0,011%	SIM			F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	SIM
BB TOP DI RF REFERENCIADO DI LP FI	100,00%	869.828,70	1,72%	23.706.910.627,67	0,003669%	SIM				
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA - B	100,00%	2.022.745,85	3,99%	898.293.883,59	0,225%	SIM				
BRAM FI RF IMA-B	100,02%	2.023.223,11	4,00%	1.995.373.780,57	0,101396%	SIM				
SICREDI - FIC FI INSTITUCIONAL RF REF IMA - B LP	100,00%	2.363.496,50	4,67%	427.493.217,35	0,553%	SIM	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	SIM		
FI RF REFERENCIADO IMA-B ALOCAÇÃO LP	100,01%	2.363.652,12	4,67%	2.468.885.553,44	0,095738%	SIM				
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	6,63%	1.807.022,77	3,57%	2.257.981.164,09	0,080%	SIM	F.I. Ações, Art. 8, I (30%)	SIM		
BB TOP MULTIMERCADO DELTA FI	0,23%	4.158,81	0,01%	735.810.531,11	0,000565%	SIM				
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	39,37%	711.399,92	1,40%	17.846.887.737,33	0,003986%	SIM				
ISHARES S&P 500 FIC FUNDO DE ÍNDICE - IE	0,03%	601,57	0,00%	1.207.020.694,73	0,000050%	SIM				
BB ETF IBOVESPA FUNDO DE INDICE	38,09%	688.336,64	1,36%	4.426.533.124,76	0,015550%	SIM				
BB AÇÕES AGRO FIC FI	100,00%	353.179,85	0,70%	384.750.775,23	0,092%	SIM	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	SIM		
BB TOP AÇÕES AGRO FI EM AÇÕES	100,01%	353.230,43	0,70%	8.343.292.175,37	0,004234%	SIM				

FIC - Fundo de Investimento em Cotas		Distribuição das cotas do FIC	Valor Aplicado no Fundo (R\$)	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Patrimônio Líquido do FI	(%) Recursos do RPPS sobre o PL* do FUNDO	ENQUADRADO?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO
FI - Fundo de Investimento									
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULT		100,00%	1.103.874,06	2,18%	119.358.891,62	0,925%	SIM	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	SIM
	<i>FI CAIXA MASTER CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULT</i>	93,24%	1.029.297,91	2,03%	936.227.822,67	0,109941%	<i>SIM</i>		
	<i>FI CAIXA MASTER TPF RF LP</i>	6,84%	75.462,88	0,15%	82.979.084,83	0,090942%	<i>SIM</i>		
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I		100,00%	2.148.470,35	4,24%	1.110.111.462,43	0,194%	SIM	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)	SIM
	<i>BB AÇÕES ESG FI EM AÇÕES - BDR NÍVEL I</i>	100,01%	2.148.685,15	4,24%	962.262.156,33	0,223295%	<i>SIM</i>		

3.4-MOVIMENTAÇÃO DAS COTAS APLICADAS NOS FUNDOS DE INVESTIMENTO

N°	Agência	Conta	Fundo de Investimento	CNPJ	Valor da Cota		Quantidade de Cotas			
					Inicial *	Final **	Inicial *	Aplicação	Resgate	Final **
1	0551	006.0000020-0	FIC FI CAIXA PRÁTICO RF CURTO PRAZO	00.834.074/0001-23	6,1589440	6,1939140	4408,621230	0,0000000	0,0000000	4408,621230
2	0551	006.0000020-0	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2,6999320	2,7195010	2071206,747882	0,0000000	0,0000000	2071206,747882
3	567-3	450100-4	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	03.543.447/0001-03	21,5431664	21,7703092	47268,338198	24621,4042440	0,0000000	71889,742442
4	567-3	450100-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	07.861.554/0001-22	5,6729198	5,7040892	1424136,335579	0,0000000	0,0000000	1424136,335579
5	567-3	450100-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	07.442.078/0001-05	6,3928445	6,4269549	1334217,803788	0,0000000	0,0000000	1334217,803788
6	567-3	450100-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA III	19.303.795/0001-35	2,4460569	2,4731047	364313,627326	0,0000000	10028,8350110	354284,792315
7	567-3	450100-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	11.328.882/0001-35	2,8142776	11,3400939	1644160,722054	0,0000000	319140,5853820	1325020,136672
8	567-3	450100-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	13.322.205/0001-35	3,0258916	3,0608915	1401924,997059	0,0000000	0,0000000	1401924,997059
9	567-3	450100-4	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.077.418/0001-49	4,8541302	2,4464408	136357,320854	219184,9431170	0,0000000	355542,263971
10	0818	91095-3	SICREDI - FIC FI INSTITUCIONAL RF REF IMA - B LP	11.087.118/0001-15	3,8022025	3,8216845	618443,646059	0,0000000	0,0000000	618443,646059
11			BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA - B	08.702.798/0001-25	4,9852022	5,0120001	403580,569674	0,0000000	0,0000000	403580,569674
12			AUSTRO IMA-B ATIVO FIC FI - RENDA FIXA	19.391.026/0001-36	0,6977101	0,6860658	1074782,444811	0,0000000	0,0000000	1074782,444811
13			AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO ***	13.555.918/0001-49	874,1289445	874,1289445	685,000000	0,0000000	0,0000000	685,000000
14			FI EM PARTICIPAÇÕES AUSTRO MULTISSETORIAL	12.231.743/0001-51	480,2094182	479,6150476	3583,884823	0,0000000	0,0000000	3583,884823
15	567-3	450100-4	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	22.632.237/0001-28	2,4994391	2,3538776	912736,650372	0,0000000	0,0000000	912736,650372
16	567-3	450100-4	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	36.178.569/0001-99	1,5849119	1,5442988	1170125,126072	0,0000000	0,0000000	1170125,126072
17	567-3	450100-4	BB AÇÕES AGRO FIC FI	40.054.357/0001-77	1,0781368	1,0727277	329235,309196	0,0000000	0,0000000	329235,309196
18			CONQUEST FI EM PARTICIPAÇÕES EMPRESAS EMERGENTES ****	10.625.626/0001-47	-2,0864340	-2,0864459	196500,000000	0,0000000	0,0000000	196500,000000
19	0551	006.0000020-0	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULT	44.683.343/0001-73	1,1021387	1,1074779	996745,923583	0,0000000	0,0000000	996745,923583

* Informação baseada no último dia útil do mês anterior (31/12/2021).

** informações baseada no último dia útil do mês (31/01/2022).

*** Informações referente ao FUNDO no Anexo 11, item 12.1 - AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO (CNPJ: 13.555.918/0001-49).

**** Informações referente ao FUNDO no Anexo 11, item 12.2 - CONQUEST FI EM PARTICIPAÇÕES EMPRESAS EMERGENTES (CNPJ: 10.625.626/0001-47).

3.5-ENQUADRAMENTO SOBRE OS RECURSOS DE TERCEIROS DOS GESTORES

Nº	Gestor de Recursos	Recursos do RPPS aplicado no Gestor	Total de Recursos de Terceiros geridos pelo GESTOR	(%) Recursos do RPPS sobre o PL* do GESTOR	Enquadrado?
1	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	32.365.693,26	1.394.899.485.411,81	0,0023%	SIM
2	CAIXA ASSET DTVM	6.763.829,51	447.769.872.811,21	0,0015%	SIM
3	BRAM - Bradesco Asset Management S.A. DTVM	2.022.745,85	536.942.945.648,18	0,0004%	SIM
4	Confederação Interestadual das Cooperativas Ligadas ao Sicredi	2.363.496,50	51.535.156.674,23	0,0046%	SIM
5	BFL ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA	737.371,51	125.476.094,82	0,5877%	SIM
6	INDIGO DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA	(409.986,61)	3.586.117.174,00	-0,0114%	SIM
7	RENDA ASSET ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA.	1.718.885,09	9.927.361,82	17,3146%	NÃO
8	QUELUZ GESTÃO DE RECURSO FINANCEIROS LTDA	598.778,33	207.396.822,57	0,2887%	SIM
TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO		46.160.813,44			
TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		21.515,37			
PATRIMÔNIO LÍQUIDO		46.182.328,81			

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: FEVEREIRO

4-SEPARAÇÃO DOS RECURSOS - PROVISÃO DE CAIXA

PROVISÃO DE CAIXA DEFINIDA NO PAI/2022?

SEPARAÇÃO DOS RECURSOS	VALOR (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido *
PROVISÃO DE CAIXA CONTIDA NO PAI/2022?	18.027.902,04	34,7%

*POSICÃO DA CARTEIRA (R\$) EM 31/12/2021.

ATUALIZAÇÃO DOS VALORES EM PROVISÃO DE CAIXA

SEPARAÇÃO DOS RECURSOS	VALOR APLICADO (em R\$)	% dos Recursos em Fundos para Provisão de Caixa
Valor Atualizado em Fundos para Provisão de Caixa (Curto Prazo)	-	0,0%

Referência: FEVEREIRO

NECESSIDADE ATUAL DE PROVISÃO DE CAIXA

NECESSIDADE ATUAL DA PROVISÃO DE CAIXA	VALOR (em R\$)	% dos Recursos em Fundos para Provisão de Caixa
Valor Atual da Provisão da Caixa	15.254.378,65	30,1%

Referência: FEVEREIRO

A Política de Investimento determina que parte dos recursos acumulados sejam separados por **PROVISÃO DE CAIXA**. Essa separação tem o intuito de amenizar os efeitos da volatilidade do mercado, sobre os recursos utilizados no curto prazo, em casos de interrupção no Fluxo de caixa (repasse e outras receitas).

4.1-PLANEJAMENTO FINANCEIRO

Provisão de Caixa	Banco	Agência	Conta	Valor (R\$)	Fundo de Investimento
Reservas de Obrigações Previdenciárias no exercício					**
					**
					**
Total					-
Reservas para pagto da Despesa Adm no exercício					**
					**
Total					-
Sobra de Despesa Adm (exercício anteriores)					**
Total					-
Total					-

Referência: FEVEREIRO

** Conforme definido na Política Anual de Investimentos/2022, os responsáveis pela gestão do ALTAPREV, terão prazo máximo de 90 dias, a contar a partir de 01º de janeiro de 2022, para constituir um fundo (ou vários fundos) como PROVISÃO DE CAIXA.

*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

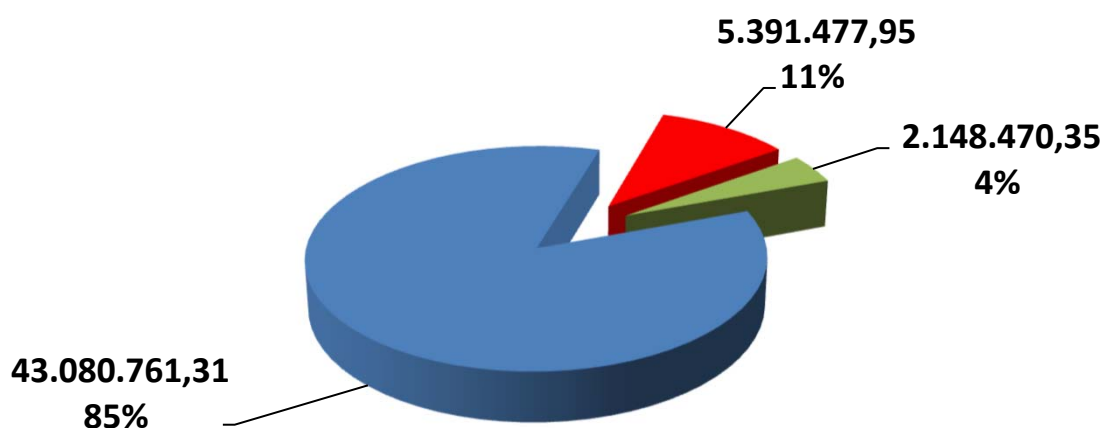
5. - DISTRIBUIÇÃO ESTATÍSTICA DA CARTEIRA

5.1-DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO (RENDA FIXA e RENDA VARIÁVEL)

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
RENDA FIXA	43.080.761,31	85,1%
RENDA VARIÁVEL	5.391.477,95	10,7%
INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.148.470,35	4,2%
TOTAL	50.620.709,62	100,0%

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / SEGMENTO

■ RENDA FIXA ■ RENDA VARIÁVEL ■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR

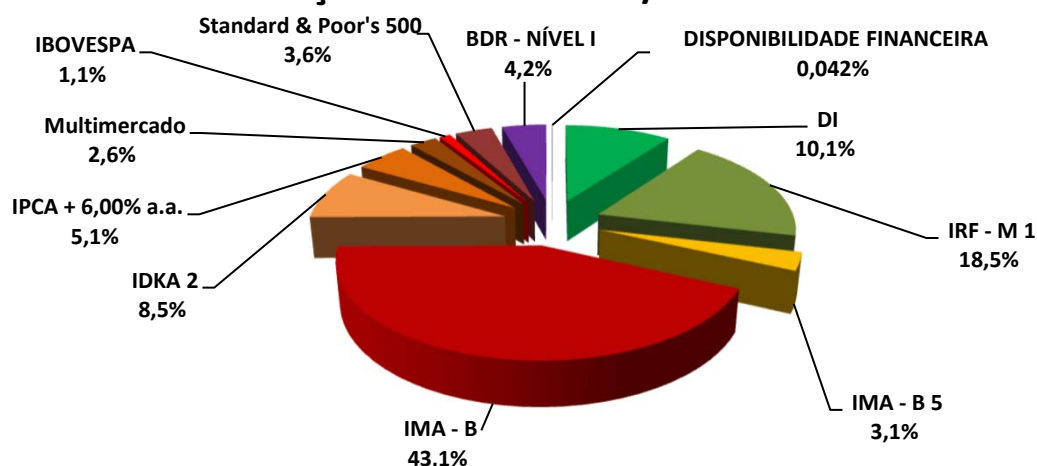


*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

5.2-DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICE (Benchmark)

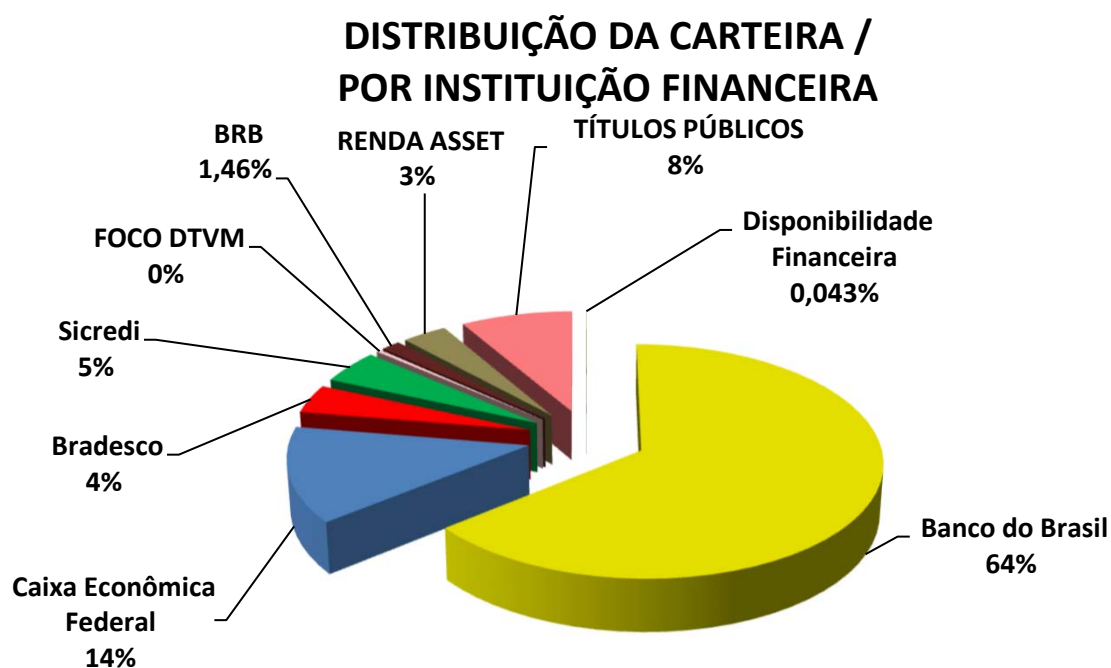
ÍNDICE (BENCHMARK)	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
DI	5.137.291,43	10,1%
IRF - M 1	9.389.112,03	18,5%
IRF - M	-	0,0%
IRF - M 1+	-	0,0%
IMA - B 5	1.565.061,92	3,1%
IMA - B	21.821.972,18	43,1%
IMA - B 5+	-	0,0%
IMA - GERAL	-	0,0%
IMA - GERAL EX - C	-	0,0%
IDKA 2	4.291.140,35	8,5%
IDKA 3	-	0,0%
IPCA	-	0,0%
IPCA + 6,00% a.a.	2.595.068,49	5,1%
IPCA + 7,50% a.a.	-	0,0%
Multimercado	1.323.598,52	2,6%
IBOVESPA	541.971,57	1,1%
IBR - X	-	0,0%
Imobiliário - IMOB	-	0,0%
Dividendos	-	0,0%
Imobiliário - IFIX	-	0,0%
ISE	-	0,0%
ICON	-	0,0%
Standard & Poor's 500	1.807.022,77	3,6%
IGC	-	0,0%
Petrobrás	-	0,0%
SMALL CAPS	-	0,0%
IFNC	-	0,0%
Standard & Poor's 500 (BRASIL)	-	0,0%
BDR - NÍVEL I	2.148.470,35	4,2%
MSCI ACWI	-	0,0%
MSCI WORLD	-	0,0%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	21.515,37	0,042%
TOTAL	50.642.224,99	100,0%

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / POR ÍNDICE



5.3-DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

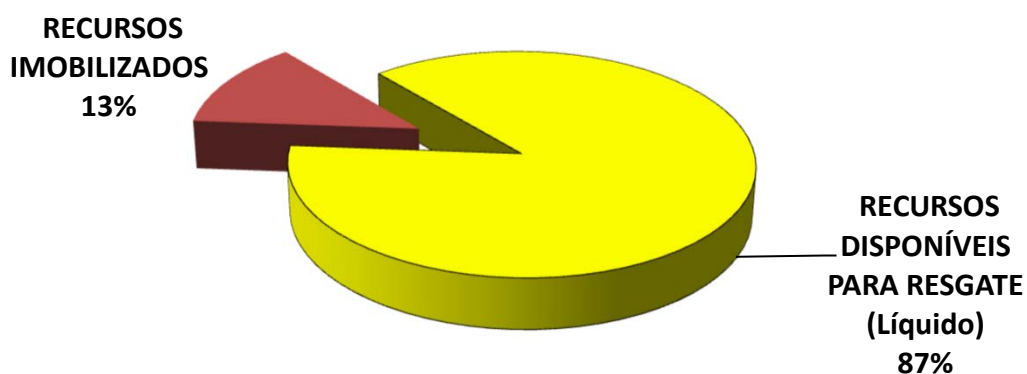
SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
Banco do Brasil	32.365.693,26	63,9%
Caixa Econômica Federal	6.763.829,51	13,4%
Bradesco	2.022.745,85	4,0%
Sicredi	2.363.496,50	4,7%
FOCO DTVM	188.791,72	0,4%
BRB	737.371,51	1,5%
RENDA ASSET	1.718.885,09	3%
TÍTULOS PÚBLICOS	4.240.171,72	8,4%
Disponibilidade Financeira	21.515,37	0,043%
TOTAL	50.422.500,53	99,6%



5.4-DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DISPONÍVEIS E IMOBILIZADO

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
RECURSOS DISPONÍVEIS PARA RESGATE (Líquido)	44.202.271,35	87,3%
RECURSOS IMOBILIZADOS	6.439.953,64	12,7%
TOTAL	50.642.224,99	100,0%

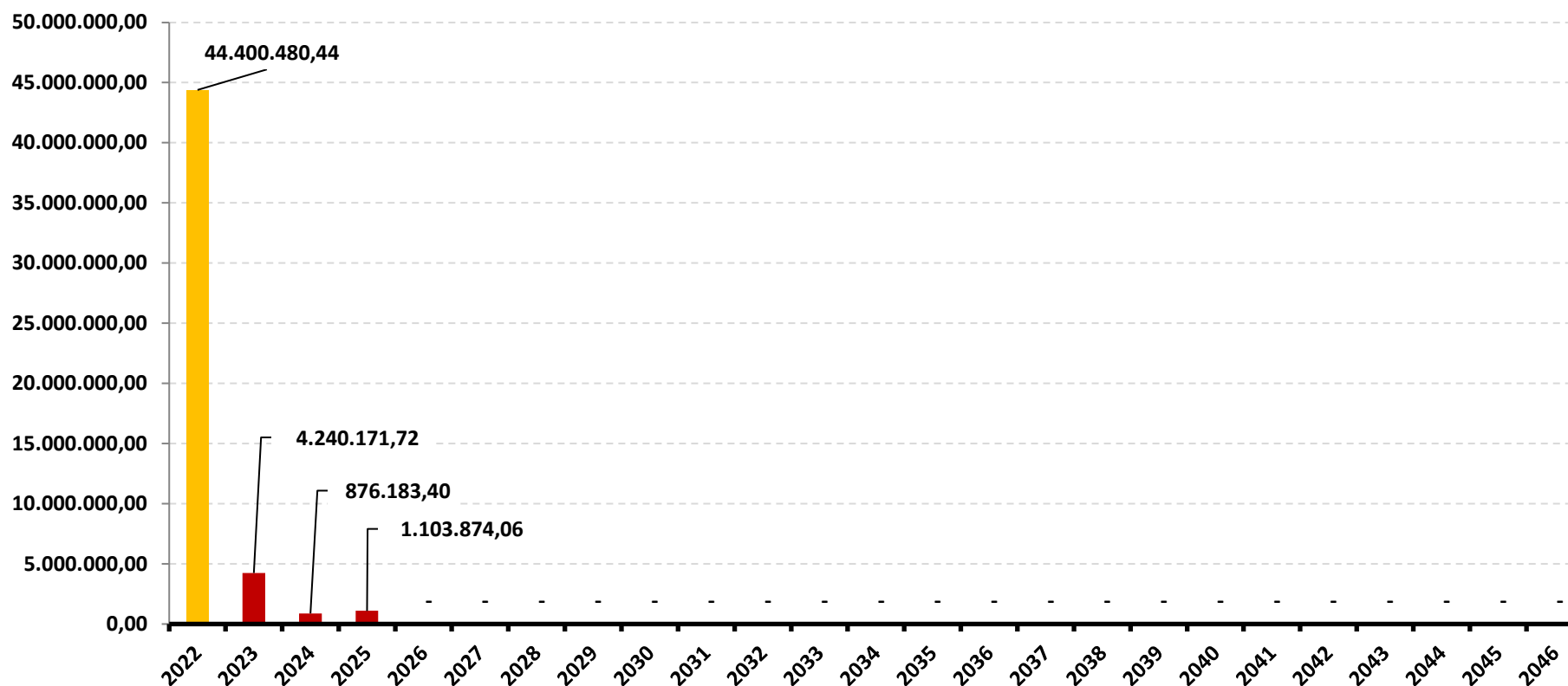
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA /POR LIQUIDEZ



5.4-DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DISPONÍVEIS E IMOBILIZADO

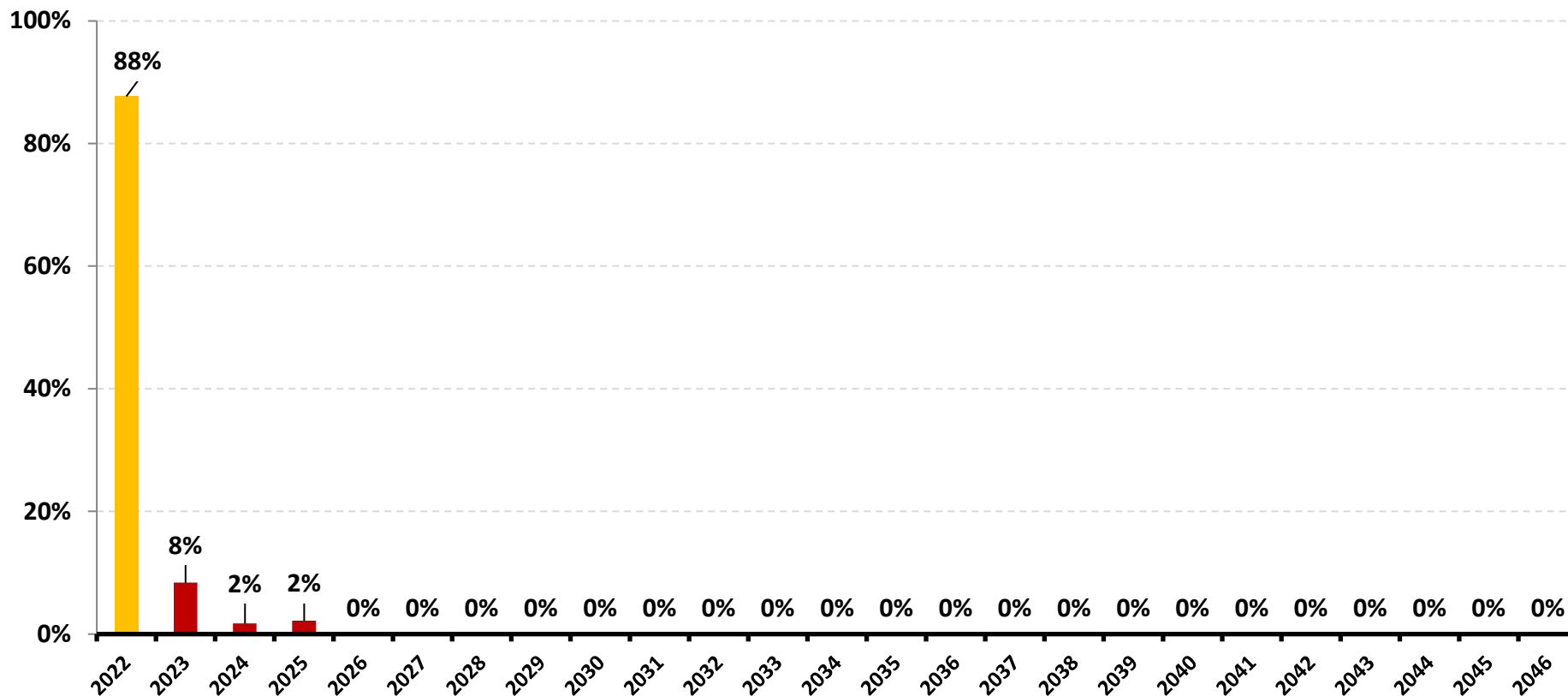
5.4.1-DISTRIBUIÇÃO DA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS NOS PRÓXIMOS 25 ANOS

DISTRIBUIÇÃO DA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS (LIQUIDEZ x IMOBILIZADO)



*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

DISTRIBUIÇÃO DA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS (LIQUIDEZ x IMOBILIZADO)



*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

6-RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS

1

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI
CNPJ	13.077.418/0001-49	11.328.882/0001-35	13.322.205/0001-35	03.543.447/0001-03
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa	Renda Fixa índices	Previdência Renda Fixa	Renda Fixa Índices
ÍNDICE	CDI	IRF – M 1	IDKA 2	IMA - B 5
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
DATA DE INÍCIO	28/04/2011	08/12/2009	28/04/2011	17/12/1999
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,10% a.a.	0,20% a.a.	0,20%a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00	1.000,00	10.000,00	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor	0,01
RESGATE MÍNIMO	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor	0,01
SALDO MÍNIMO	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor	0,01
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	2 - Baixo	2 - Baixo	1 - Muito baixo	4 - Alto
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	7.639.104.845,31	5.025.689.167,39	9.012.864.987,26	6.375.804.434,87
NÚMERO DE COTISTAS **	895	1120	1027	789
VALOR DA COTA **	2,446440777	2,835023479	3,060891532	21,77030918
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	06/08/2018	05/02/2020	05/02/2020	05/02/2020
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

2

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA III	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I
CNPJ	19.303.795/0001-35	07.442.078/0001-05	07.861.554/0001-22	22.632.237/0001-28
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Investimento no Exterior
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa índice	Renda Fixa índices	Renda Fixa índices	Ações Livre
ÍNDICE	IPCA + 6,00%	IMA – B	IMA – B	IBOV
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Pessoas físicas e jurídicas
DATA DE INÍCIO	11/02/2014	24/07/2005	09/03/2006	29/12/2015
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,30% a.a.	1,90% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	300.000,00	10.000,00	10.000,00	200,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor	200,00
RESGATE MÍNIMO	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor	200,00
SALDO MÍNIMO	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor	200,00
CARÊNCIA	Até dia 15/08/2024	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)	D+4 (Quatro dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	3 - Médio	5 - Muito Alto	5 - Muito Alto	5 - Muito Alto
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	580.932.851,15	6.297.272.158,07	778.022.116,28	1.110.111.462,43
NÚMERO DE COTISTAS **	140	624	239	22543
VALOR DA COTA **	2,473104733	6,426954924	5,704089165	2,353877598
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	24/10/2017	11/10/2017	23/05/2016	08/12/2020
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

3

INFORMAÇÕES	BB AÇÕES AGRO FIC FI	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	FIC FI CAIXA PRÁTICO RF CURTO PRAZO	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF
CNPJ	40.054.357/0001-77	36.178.569/0001-99	00.834.074/0001-23	10.740.670/0001-06
SEGMENTO	Renda Variável	Renda Variável	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Ações	Fundo de Ações	Curto Prazo	Renda Fixa índices
ÍNDICE	IBOV	S&P500	CDI	IRF – M 1
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Pessoas físicas e jurídicas e Regimes Próprios de Previdência Social	Pessoas Jurídicas	Regimes Próprios de Previdência Social
DATA DE INÍCIO	11/02/2021	04/05/2020	02/10/1995	28/05/2010
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	1,00% a.a.	1,00% a.a.	5,00% a.a.	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	20% IBOV	10% do S&P 500	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	0,01	0,01	100,00	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01	0,01	10,00	0,00
RESGATE MÍNIMO	0,01	0,01	100,00	0,00
SALDO MÍNIMO	0,01	0,01	0,01	0,00
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
RISCO DE MERCADO *	4 - Alto	4 - Alto	1 - Muito baixo	2 - Baixo
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	384.750.775,23	2.257.981.164,09	32.913.062.981,43	5.808.584.551,28
NÚMERO DE COTISTAS **	7848	43456	16353	1226
VALOR DA COTA **	1,072727746	1,544298754	6,193914	2,719501
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	01/02/2021	22/04/2020	07/10/2020	25/09/2018
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

4

INFORMAÇÕES	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULT	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA - B	SICREDI - FIC FI INSTITUCIONAL RF REF IMA - B LP	AUSTRO IMA-B ATIVO FIC FI - RENDA FIXA
CNPJ	44.683.343/0001-73	08.702.798/0001-25	11.087.118/0001-15	19.391.026/0001-36
SEGMENTO	Investimentos Estruturados	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Multimercado	Renda Fixa índices	Renda Fixa Índices	Renda Fixa
ÍNDICE	Multimercado	IMA – B	IMA – B	IMA – B
PÚBLICO ALVO	Pessoas físicas, jurídicas e Regimes Próprio de Previdência Social	Regime Próprio de Previdência Social	Regimes Próprio de Previdência Social	Investidores Qualificados
DATA DE INÍCIO	10/01/2022	07/01/2008	18/12/2009	07/01/2014
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,90% a.a.	0,20% a.a.	0,20%a.a.	0,30% a 1,30% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	5000	50.000,00	50.000,00	10000
APLICAÇÕES ADICIONAIS	500	5.000,00	5.000,00	10000
RESGATE MÍNIMO	500	Qualquer valor	5.000,00	10000
SALDO MÍNIMO	4.000,00	5.000,00	50.000,00	10000
CARÊNCIA	Ate 25 meses a partir do dia útil anterior ao início da Operação	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	4 - Alto	2 - Baixo	3 - Médio	Não informado
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	119.358.891,62	898.293.883,59	427.493.217,35	51.588.855,57
NÚMERO DE COTISTAS **	83	109	328	25
VALOR DA COTA **	1,10747788	5,0120001	3,8216845	0,68606583
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	06/01/2022	06/07/2018	22/12/2020	18/06/2021
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

5

INFORMAÇÕES	AUSTRO MULTIPAR FIC FI MULT CRÉDITO PRIVADO	AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	CONQUEST FI EM PARTICIPAÇÕES EMPRESAS EMERGENTES	FI EM PARTICIPAÇÕES AUSTRO MULTISETORIAL
CNPJ	18.366.002/0001-64	13.555.918/0001-49	10.625.626/0001-47	12.231.743/0001-51
SEGMENTO	Investimentos Estruturados	Imobiliário	Investimentos Estruturados	Investimentos Estruturados
CLASSIFICAÇÃO	Multimercado	Fundo de Invest. Imobiliário	Fundo de Ações	Fundo de Participações
ÍNDICE	Multimercado	IBOV	IBOV	IPCA + 8,00% a.a.
PÚBLICO ALVO	Investidores Qualificados	Investidores Qualificados	Investidores qualificados	Investidores Qualificados
DATA DE INÍCIO	06/08/2013	15/08/2011	12/08/2009	00/01/1900
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	1,50% a.a.	1,50% a.a.	1,10% a.a.	0
TAXA DE PERFORMANCE	25%	25% IPCA	20%/ IPCA	0
APLICAÇÃO INICIAL	100.000,00	R\$ 1.000.000,00	100000	0
APLICAÇÕES ADICIONAIS	10.000,00	-	-	0
RESGATE MÍNIMO	10.000,00	-	-	0
SALDO MÍNIMO	100.000,00	-	-	0
CARÊNCIA	4 anos	Não determinado	Indefinido	0
CRÉDITO DO RESGATE	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	Não Especificado	Não Especificado	0
RISCO DE MERCADO *	4 - Alto	4 - Alto	4 - Alto	Não informado
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	8.555.747,25	92.887.389,62	-50.457.584,58	67.105.333,88
NÚMERO DE COTISTAS **	33	37	38	33
VALOR DA COTA **	0,97028987	858,979547	-2,08642078	480,8653307
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	-	-	09/06/2021	-
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. e F.I.CFI Multimercados, Art. 10, I (10%)	F.I. Imobiliário, Art. 11 (5%)	F.I. em Participações, Art. 10, II (5%)	F.I. em Participações, Art. 10, II (5%)

* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

6.1-RESUMO DO REGULAMENTO DOS TÍTULOS PÚBLICOS

6

INFORMAÇÕES	LFT-POS-SELIC-Competitivo (2023)
DESCRIÇÃO	Trata-se de um Título de responsabilidade do Tesouro Nacional, emitido para a cobertura de déficit orçamentário, exclusivamente sob a forma escriturada pela SELIC. A rentabilidade deste Título é determinada através da variação da Taxa Selic diária registrada entre a data de liquidação da compra e a data de vencimento do título.
RENDIMENTO	PÓS-FIXADO, com rentabilidade diária vinculada a taxa Selic.
PAGAMENTO DOS JUROS	No Vencimento
VALOR DO RESGATE	O Valor Nominal, acrescido de um rendimento desde a base do Título
ENQUADRAMENTO LEGAL	Esse tipo de investimento permite aplicação de até 100% do patrimônio líquido do RPPS em Títulos Públicos Federal, conforme alínea a, inciso I do Art. 7 da Resolução CMN 4.693/2021

7

INFORMAÇÕES	LFT-POS-SELIC (2023)
DESCRIÇÃO	Trata-se de um Título de responsabilidade do Tesouro Nacional, emitido para a cobertura de déficit orçamentário, exclusivamente sob a forma escriturada pela SELIC. A rentabilidade deste Título é determinada através da variação da Taxa Selic diária registrada entre a data de liquidação da compra e a data de vencimento do título.
RENDIMENTO	PÓS-FIXADO, com rentabilidade diária vinculada a taxa Selic.
PAGAMENTO DOS JUROS	No Vencimento
VALOR DO RESGATE	O Valor Nominal, acrescido de um rendimento desde a base do Título
ENQUADRAMENTO LEGAL	Esse tipo de investimento permite aplicação de até 100% do patrimônio líquido do RPPS em Títulos Públicos Federal, conforme alínea a, inciso I do Art. 7 da Resolução CMN 4.693/2021

8-RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

8.1-RENTABILIDADE MENSAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2022 - ALTAPREV

	JAN	FEV										
RENTABILIDADE MENSAL DA CARTEIRA	-1,65%	0,04%										
CDI	0,73%	0,76%										
IBOVESPA	6,98%	0,89%										
META ATUARIAL	0,91%	1,38%										

A RENTABILIDADE DA CARTEIRA DO ALTAPREV NO MÊS DE FEVEREIRO FOI DE:

R\$ 19.372,63

A META ATUARIAL NO MÊS DE FEVEREIRO FOI DE:

R\$ 695.093,19

8.2-RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2022 - ALTAPREV

	JAN	FEV									
RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA	-1,65%	-1,62%									
CDI	0,73%	1,50%									
IBOVESPA	6,98%	7,93%									
META ATUARIAL	0,91%	2,30%									

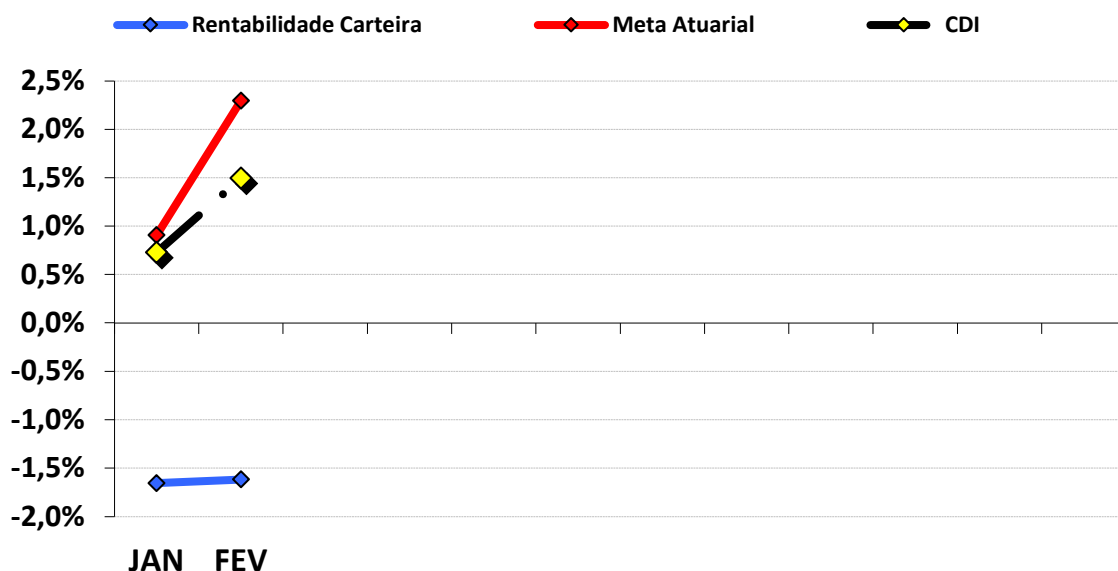
RENTABILIDADE ACUMULADA DO ALTAPREV: R\$ (841.305,39)

META ATUARIAL ACUMULADA: R\$ 1.167.222,48

DEFASAGEM PARA O CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL R\$ (2.008.527,87)

GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL

RENTABILIDADE DA CARTEIRA (Acumulada) 2022



RENTABILIDADE e ÍNDICES ACUMULADOS

	Rentabilidade Carteira	Meta Atuarial	CDI
JAN	-1,65%	0,91%	0,73%
FEV	-1,62%	2,30%	1,50%

8.3.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA

A Carteira de Investimentos do ALTAPREV, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada de -1,62% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado de 1,50% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou até o momento, uma rentabilidade de -51,94% sobre o índice de referência do mercado.

8.4-META ATUARIAL

Enquanto a rentabilidade acumulada do ALTAPREV é de -1,62% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de 2,30%, ou seja, até o momento, a carteira alcançou uma rentabilidade de -41,30% sobre a Meta Atuarial.

9-ANÁLISE DE MERCADO

9.1-TAXA SELIC

Na reunião nos dias 01 e 02 de fevereiro de 2022, o COPOM decidiu elevar a Taxa Selic para 10,75% a.a. A decisão foi unânime e o COPOM informou que a medida reflete o cenário econômico com variância maior do que a usual, sendo, uma decisão compatível com a convergência da meta de inflação projetada para 2022 e 2023.

O COPOM tira como base, a conjuntura macroeconômica nacional e internacional. No mercado interno, os indicadores do comércio e serviços mostraram evolução acima do esperado em novembro/2021, enquanto isso a indústria apresentou recuperação em dezembro/2021. Indicadores do Mercado de Trabalho mostraram recuperação dos empregos no 4º Trimestre de 2021. Segundo o Comitê, apesar da elevação dos prêmios de risco e o aperto das condições financeiras atuarem desestimulando a atividade econômica, o crescimento tende ser beneficiado pelo desempenho da agropecuária e a normalização da economia, com destaque para o setor de serviços e mercado de trabalho.

Em relação ao cenário internacional, o ambiente segue desfavorável, com a persistência inflacionária aumentando o risco de um aperto monetário mais firme dos EUA, piorando as condições financeiras de países emergentes. Além disso, a nova onda da Covid-19, traz incertezas ao ritmo da atividade econômica, postergando a normalização das cadeias globais de produção.

A principal mensagem que traz a nota sobre a reunião é que, diante do aumento de suas projeções e do risco de desancoragem das expectativas para prazos mais longos, é apropriado que o ciclo de aperto monetário avance significativamente em território contracionista. O Comitê, assegurou que continuará com sua estratégia até que o processo de desinflação e a ancoragem das expectativas em torno de suas meta se consolide. Até o final do ano o COPOM projeta a Selic em 5,50% e terminando o ano de 2023 em 3,50%.

A previsão do Boletim Focus, emitido pelo Banco Central no final de dezembro/2021, projetava a taxa de juros finalizando 2022 em 11,50% a.a..

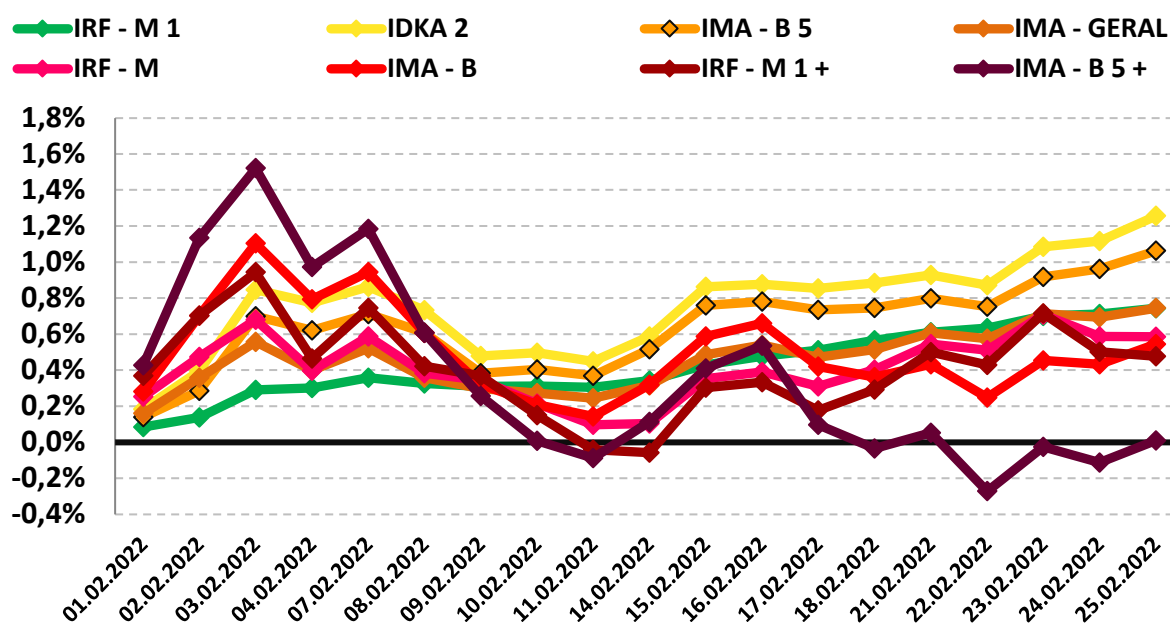
9.2-RENDA FIXA

Os Subíndices IMA iniciaram o mês de fevereiro com forte valorização, antes do dia 15 e depois "andando de lado" até o final do mês.

O destaque fica por conta dos Ativos de Curto e Médio Prazo (IRF - M 1; IDKA 2; IMA - B 5 e IMA-GERAL) que fecharam o mês positivo, além do IRF - M e IMA - B, que também finalizaram o mês com valorização. Somente o índice IMA - B 5+ chegou a rentabilizar -0,22% no dia 27, mas conseguiu recuperar e finalizou o mês com retorno positivo de 0,01%.

PERFIL	Conservad.	Moderado			(do menos) Arrojado (para o mais)			
ÍNDICE	IRF - M 1	IDKA 2	IMA - B 5	IMA - GERAL	IRF - M	IMA - B	IRF - M 1+	IMA - B 5+
FEVEREIRO	0,74%	1,26%	1,06%	0,74%	0,58%	0,54%	0,48%	0,01%
Acumulado/2022	1,38%	1,31%	1,18%	0,95%	0,50%	-0,19%	-0,02%	-1,60%

Rentabilidade Acumulada (Mês)



9.3-RENDA VARIÁVEL - AÇÕES BRASILEIRAS

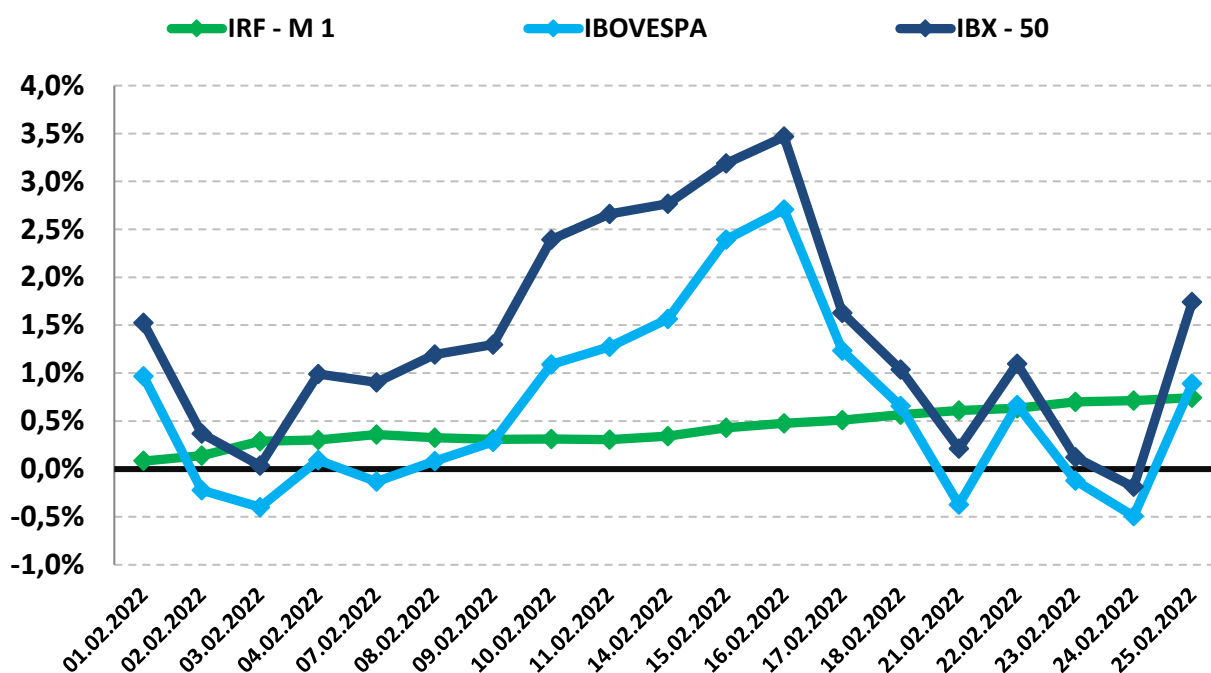
O segmento de Renda Variável apresentou forte valorização durante o mês de fevereiro, até o dia 16, quando passou a apresentar desvalorização, por conta dos rumores de uma Guerra entre Rússia e Ucrânia, que se confirmou no fechamento do mês.

O índice IBOVESPA, principal indicador de ações negociadas na Bolsa brasileira fechou o mês com variação positiva de +0,89% aos 113.141,94 pontos. O índice acumula uma variação positiva de +7,93% no ano. O índice IBRX-50 que representa as 50 maiores empresas negociadas na Bolsa, finalizou o mês com uma variação positiva de +1,75% aos 19.172,01 pontos. O índice acumula uma variação positiva de 9,54% no ano.

Analisando por setor, os principais responsáveis pela valorização do IBOVESPA foram as ações de empresas ligadas ao setor de Minério (Vale) e Petróleo negociadas na B3, com valorização de +13,78% e +3,59%, respectivamente.

PERFIL	Conservad.	(do menos) Arrojado (para o mais)		
ÍNDICE	IRF - M 1	IBOVESPA	DESEMPENHO	
			MAIOR	MENOR
FEVEREIRO	0,74%	0,89%	13,86%	-6,91%
Acumulado/2022	1,38%	7,93%	17,89%	2,55%

Rentabilidade Acumulada (Mês)



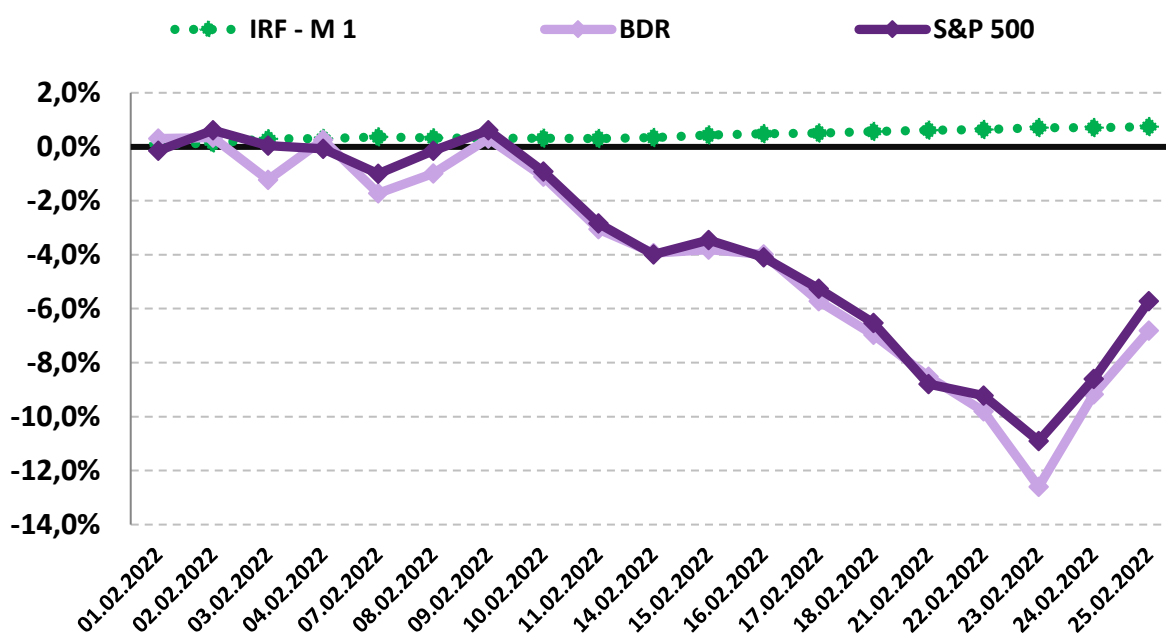
9.4-INVESTIMENTO NO EXTERIOR

O segmento de Investimento no Exterior permanece apresentando forte desvalorização no ano de 2022. Após um 2021 extraordinário, onde os índices do Exterior valorizaram acima de +30%, o início de 2022 vem sendo de forte devolução de parte desses ganhos.

O índice BDR, principal indicador de ações negociadas no Brasil de empresas do exterior fechou o mês com variação negativa de -6,82% com cotação de R\$ 12.923,48. O índice acumula uma variação negativa de -15,98% no ano. O índice S&P 500 que representa as 500 maiores empresas negociadas na Bolsa mundialmente, finalizou o mês com uma variação negativa de -3,14% com cotação de R\$ 245,50. O índice acumula uma variação negativa de -8,23% no ano.

PERFIL	Conservad.	(do menos) Arrojado (para o mais)	
ÍNDICE	IRF – M 1	BDR	S&P 500
FEVEREIRO	0,74%	-6,82%	-3,14%
Acumulado/2022	1,38%	-15,98%	-8,23%

Rentabilidade Acumulada (Mês)



10-ANÁLISE MACROECONÔMICA

10.1-IPCA

O IPCA de fevereiro/2022 (1,01%), apresentou uma forte elevação em relação ao mês anterior (janeiro/2022 = 0,54%). Foi a maior variação para um mês de fevereiro desde 2015 (1,22%).

No ano, o IPCA registra alta de 1,56%. Nos últimos doze meses o IPCA registra acumulação de 10,54%, acima dos últimos 12 meses anterior, que registrou acumulação de 10,38%.

Em fevereiro de 2021, o IPCA havia ficado em 0,86%.

10.1.1-MAIOR ALTA DE PREÇOS

O grupo que apresentou o maior impacto de alta no IPCA, foi o grupo EDUCAÇÃO cujo índice apresentou inflação de 0,31%, influenciado pelo reajuste natural dos preços dos cursos regulares no início do ano letivo.

10.1.2-MENOR ALTA DE PREÇOS

O grupo que apresentou o menor impacto de alta no IPCA foi o grupo COMUNICAÇÃO, cujo índice apresentou inflação de apenas 0,01% do IPCA.

10.1.3-ALIMENTAÇÃO E BEBIDAS ¹

No mês de fevereiro, o grupo ALIMENTAÇÃO E BEBIDAS apresentou inflação de 0,27%, uma pequena aceleração em relação ao mês anterior (janeiro/2022 = 0,23%). Os três produtos do grupo, com a maior alta de preços foram a Cenoura (55,41% a.m. e 98,36% a.a.), a Batata-inglesa (23,49% a.m. e 35,41% a.a.) e as Hortaliças e Verduras (15,42% a.m. e 24,77% a.a.). Os dois produtos do grupo, com a maior queda de preços (inclusive os únicos) foram o Frango Inteiro (-2,29% a.m. e -3,11% a.a.) e o Frango em pedaços (-1,35% a.m. e -2,06% a.a.).

10.1.4-INFLAÇÃO POR REGIÃO

No mês, São Luís - MA foi a capital que apresentou a maior inflação (1,33%), enquanto Porto Alegre - RS apresentou o menor resultado com inflação de 0,43%. No mesmo período, o IPCA registra inflação de 1,11%.

Nos últimos 12 meses, Aracaju - SE é a capital que apresenta a maior inflação (2,18%), enquanto Porto Alegre - RS apresenta deflação de -0,10%. No mesmo período, o IPCA registra alta de 1,56%.

1 O grupo Alimentação e Bebidas, que representa 25,84% do IPCA, é o maior peso entre os 9 grupos pesquisados pelo IBGE. 1% de alta dos preços deste grupo, tem uma representatividade maior do que o grupo Comunicação, por exemplo, que representa 3,74% do IPCA. Por isso, este grupo merece uma análise especial sobre o aumento de preços.

10.2-CENÁRIO ECONÔMICO EXTERNO E INTERNO

INTERNACIONAL

A Guerra na Ucrânia iniciada no fim de fevereiro irá alterar todo o cenário econômico e inflacionário a nível Mundial e provocar uma forte recessão na economia da Rússia. Em reação à Invasão na Ucrânia, diversos países anunciaram sanções econômicas contra a Rússia, principalmente os EUA, a União Europeia e o Reino Unido, além do fechamento a importações de produtos russos, restrições ao financiamento de dívidas das principais empresas russas, bloqueio do patrimônio de oligarcas russos ligados ao presidente da Rússia Vladimir Putin e a exclusão dos principais bancos Russos do Swift, Sistema de Transferências Internacionais que conecta os bancos ao redor do mundo e o congelamento das Reservas Internacionais russas. Por conta da Guerra, existe uma forte pressão do mercado internacional em retirar capital da Rússia, o que limita o Banco Central em proteger o Rublo (moeda russa), que já apresenta desvalorização no ano de 36,2%. A maior desvalorização de sua moeda pós-URSS. Caso a guerra continue, as próximas sanções deverão ser restrições à importação de óleo e gás vindos da Rússia, pressionando os preços das commodities como gás natural, petróleo, trigo, milho e alumínio, que possuem ligação com o país. Esse fato é devido tanto a continuação da Guerra, quanto as sanções impostas à Rússia que geram dúvidas sobre a oferta dessas commodities na economia global. Espera-se que devido ao quadro de inflação já elevada a nível mundial e a elevação de preços das commodities, os Banco Centrais de todo mundo tenderão a elevar suas Taxas de Juros, gerando menos crescimento econômico no mundo.

BRASIL

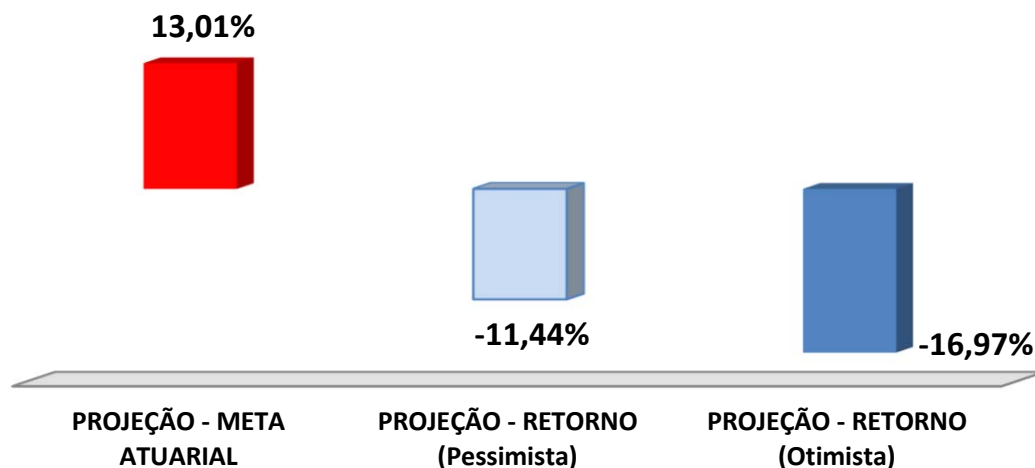
A Guerra na Ucrânia deverá ter um impacto limitado sobre o Brasil, tendo em visto a relação comercial não tão relevante entre os dois países. A Rússia representa 0,6% das nossas exportações, enquanto as importações representam 2,6%. Com relação ao PIB brasileiro, o comércio exterior com a Rússia representa 0,4% do PIB brasileiro. O principal impacto deverá ser sobre o preço das commodities e sobre o setor de agronegócio, principalmente a agricultura, já que a Rússia é um grande exportador de fertilizantes para o Brasil (25% das importações de fertilizantes). No Congresso, as discussões sobre cortes de impostos e preços de combustíveis deverão continuar no centro das atenções, com a possível votação no Congresso sobre o "o congelamento de impostos de ICMS e cortes de impostos para combustíveis" (PLP 11) e o "Fundo de estabilização de preços de combustíveis" (PL 1.472), além das propostas do Governo Federal acerca da liberação de recursos do FGTS para o pagamento de dívidas e do pacote de crédito para pequenas e médias empresas.

11-PROJEÇÃO DA META ATUARIAL E RENTABILIDADE DA CARTEIRA

Conforme o último Boletim FOCUS, emitido pelo Banco Central em 29/04/2022, a inflação projetada para o final do ano deverá ficar em 7,89% e a Meta Atuarial aproximadamente em 13,01%.

Se não tivermos grandes oscilações no mercado e a distribuição permanecer nos mesmos índices, conforme demonstra a página 19, a carteira deverá rentabilizar entre -11,44% a -16,97% no final do ano, podendo encontrar dificuldades para alcançar a Meta Atuarial.

Projeção da Carteira



As recomendações e as análises efetuadas seguem as disposições estabelecidas na **Resolução CMN 4.963/2021**, tendo presente as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação as obrigações previdenciárias e transparência.

É o Parecer.



Igor França Garcia
Atuário MIBA/RJ 1.659

Certificação de Especialista em Investimento - CEA
Consultor de Investimentos credenciado pela CVM

12-ANEXO

12.1 - AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO (CNPJ: 13.555.918/0001-49)

O Valor aplicado informado no Relatório do Fundo AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO (CNPJ: 13.555.918/0001-49), é referente ao **Saldo Final de Janeiro/2022 no valor de R\$ 598.778,33 reais.** Foi utilizado o valor de janeiro/2022, pois o ALTAPREV não recebeu os extratos do FUNDO, citado acima, devido a substituição da Administração para a RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA., e a Gestão, para a QUELUZ GESTÃO DE RECURSO FINANCEIROS LTDA. Foi informado pelo ALTAPREV que durante o processo de substituição do Administrador e Gestor do FUNDO não será fornecido os extratos. Conforme solicitado pelo ALTAPREV foi mantido o mesmo valor do saldo final de janeiro/2022.

Segue abaixo uma breve explicação da Ata de Reunião Geral de Cotistas, disponibilizada no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) no dia 12/05/2022, referente à reunião ocorrida no dia 25/04/2022 do Fundo AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO (CNPJ: 13.555.918/0001-49):

Conforme a Ata da Assembleia Geral de Cotistas ocorrida no dia 25/04/2022 do Fundo AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO (CNPJ: 13.555.918/0001-49), ANEXO I deste relatório, a entrega do FUNDO à Administradora RJI só ocorreu de fato, no dia 27/01/2022, ao invés de ocorrer no dia 31/12/2021, conforme previsto na Reunião do dia 16/12/2021. A demora na substituição da Administradora do FUNDO (RJI CORRETORA DE VALORES MOBILIÁRIOS) se deu devido a Índigo afirmar ter encontrado problemas operacionais junto à CVM na prestação de informações da incorporação, o que, por consequência, atrasou a transferência do Fundo AQUILLA, atrasando a emissão dos extratos do Fundo Aquilla para os cotistas.

Após a entrega do FUNDO, a Gestora QUELUZ GESTÃO DE RECURSO FINANCEIROS LTDA, juntamente com a Administradora RJI, encontraram algumas discrepâncias ocorridas nos ativos do FUNDO, principalmente com a incorporação do Fundo FIRENZE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO (Firenze), que possui ativos em decisão judicial, e, alguns valores que foram resgatados pela Índigo, sem aviso prévio ao novo Administrador e Gestor. Porém, a Índigo já foi notificada pela RJI e os Órgãos de Fiscalização CVM e ANBIMA.

Na Assembleia foi discutido também sobre a incorporação do Fundo AQ3, que até o momento o FUNDO AQUILLA possui 50% da sua carteira aplicado, e, após avaliação da Gestora QUELUZ, compensa o FUNDO AQUILLA incorporar o Fundo AQ3. Ademais, entre os outros assuntos relatados, o mais importante foi a proposta de liquidação do FUNDO, que deverá ocorrer no prazo previsto de 3 anos, e deverá ocorrer se o processo dos ativos do Fundo Firenze não demandar mais tempo para serem julgados, o que acarretaria na demora da liquidação do FUNDO. No final da reunião foi aprovado a liquidação pela maioria dos cotistas presentes.

12.2 - CONQUEST FI EM PARTICIPAÇÕES EMPRESAS EMERGENTES (CNPJ: 10.625.626/0001-47)

Conforme Fato Relevante (ANEXO II - FATO RELEVANTE CONQUEST (02.08.2021)), publicado no site da CVM no dia 02/08/2021, a Administradora Índigo informou aos cotistas e o mercado financeiro, que diante das dificuldades de recuperar os ativos do FUNDO CONQUEST, juntamente com o relatório dos assessores jurídicos com as medidas judiciais dos ativos da carteira do Fundo Conquest, decidiu atualizar a precificação dos ativos da carteira e adequá-los ao que entende como o mais correto. Sendo refletido no Patrimônio Líquido do Fundo Conquest a partir da data de publicação do Fato Relevante.

Foi informado, no Fato Relevante, "que foram realizadas provisões para integralização de ações da CIAFAL COMÉRCIO E INDÚSTRIA DE ARTEFATOS DE FERRO E AÇO S.A. e CISAM SIDERURGIA S.A. ("CIAFAL" e "CISAM", respectivamente) e outras despesas, em cumprimento da decisão proferida nos autos do processo nº 1071849-16.2017.8.26.0100, movido contra o Fundo por CIAFAL e CISAM." (Trecho retirado do Fato Relevante 02/08/2021).

Com a precificação dos Ativos da carteira, o Fundo sofreu uma desvalorização de cerca de **-30%**, ficando com o **Patrimônio Líquido negativo a partir de agosto/2021**. No site da CVM foi divulgado o Informe Trimestral referente a competência de jul/2021 até setembro/2021, com o Patrimônio Líquido negativo no valor de R\$ -50.457.888,21 reais, conforme imagem abaixo:

Nome do fundo: CONQUEST FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES EMPRESAS EMERGENTES	
CNPJ: 10.625.626/0001-47	
Administrador: INDIGO INVESTIMENTOS DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA CNPJ: 00.329.598/0001-67	
Diretor: EDUARDO ALVES SOBRINHO	
Categoria: Fundo de Investimento em Participações	
Entidade de Investimento? Não	
Público alvo: Investidores Qualificados	
Data de competência:	Jul/2021 até Set/2021 <input type="button" value="Exibir"/>
Data de envio: 21/10/2021 10:54:53	
ESPECIFICAÇÕES	VALORES/INFORMAÇÕES
Patrimônio líquido:	R\$ -50.457.888,21
Valor total do capital comprometido:	R\$ 158.920.580,28
Quantidade de cotas subscritas:	24.184.396,69086171
Valor total do capital subscrito:	R\$ 158.920.580,28
Quantidade de cotas integralizadas:	24.184.396,69086171
Valor total do capital integralizado:	R\$ 158.920.580,28
Valor total investido em cotas de outros FIP:	R\$ 0,00

Informe Trimestral na competência de julho/2021 até setembro/2021, retirado do site da CVM.

Conforme o extrato recebido do Fundo CONQUEST FI EM PARTICIPAÇÕES EMPRESAS EMERGENTES (CNPJ: 10.625.626/0001-47), referente ao mês de agosto/2021, o saldo final aplicado pelo ALTAPREV é de R\$ -409.971,58 reais. Desde então o Fundo vem sofrendo desvalorização, conforme extratos, até o mês de dezembro/2021, fechando o ano de 2021 com o Saldo negativo de R\$ -409.981,68 reais.

Conforme informado no site da CVM, a Ata de Assembleia Geral de Cotistas do Fundo, referente ao dia 06/10/2021 (ANEXO III - AGE 06.10.2021 CONQUEST), demonstra divergências nas informações divulgadas pela Administradora Índigo aos cotistas, sendo solicitado maiores explicações e documentos que comprovem a necessidade da atualização da precificação dos ativos da carteira do Fundo Conquest, sendo informado que a Administradora Índigo irá disponibilizar todos os documentos dentro do prazo de 60 dias.

Após deliberações e solicitações dos cotistas à Administradora Índigo, foi votado a suspensão da Assembleia Geral de Cotistas por até 60 dias, para que a Administradora Índigo possa disponibilizar todos os documentos solicitados e atender os requerimentos dos cotistas, sendo adiado a decisão de liquidação do fundo até a próxima reunião, marcada para o dia 05/12/2021.

A próxima Assembleia Geral de Cotistas (ANEXO IV - AGE CONQUEST (12.01.2022)), ocorreu no dia 12/01/2022, com a Administradora Índigo informando que enviou todos os documentos solicitados, e, que encaminhará a memória de cálculo abordando a remarcação das cotas do Fundo Conquest, até o dia 12/01/2022. Na Ata, é informado ainda que os Cotistas não receberam toda a documentação solicitada a Administradora Índigo, conforme informado por ela, e que estão incomodados com a Administradora estar forçando a liquidação do fundo sem disponibilizar os documentos exigidos. Sendo solicitado uma Assembleia Geral de Cotistas, de forma presencial de preferência, com as seguintes solicitações:

1. Apresentação e deliberação sobre plano de liquidação detalhado do fundo por parte da INDIGO contendo, não somente, mas inclusive:
 - a. usos e fontes dos recursos aportados no fundo;
 - b. expectativa para os ativos do fundo;
 - c. situação e organograma organizado dos investimentos e investidas, assim como seus diretores e conselheiros;
 - d. resumo dos litígios societários e contato dos advogados patronos da causa;

2. Apresentação das documentações e solicitações consignadas na ata dessa AGE, tanto antes quanto após sua reabertura;

Até a confecção deste relatório não foi publicado no site da CVM, Ata de Assembléia Geral de Cotistas com as deliberações e solicitações dos cotistas atendidas. Sendo informado aos cotistas, através do COMUNICADO AO MERCADO (ANEXO V - AVISO AO MERCADO CONQUEST (23.06.2022)) que a Administradora tentou enviar os documentos solicitados, porém, não foi possível pelo tamanho dos arquivos, e que os mesmos se encontram disponíveis na sede da Administradora para verificação.

Em 2022, o ALTAPREV recebeu os extratos do Fundo Conquest até o mês de fevereiro/2022, com Saldo negativo de R\$ -409.986,61.