Instituto de Previdência do Município de Jundiaí

IPREJUN

Prefeitura de Jundiaí

Relatório de Investimentos

Fevereiro, 2021

Sumário

1. Introdução 3
2. Cenário Econômico 3
3. Patrimônio Recursos Previdenciários 5
3.1. Distribuição dos Recursos por Segmento e Patrimônio x Resolução 5
3.2. Demonstração Gráfica 5
4. Investimentos 6
4.1. Alocação por Estratégia 6
4.2. Risco da Carteira 6
4.3. Detalhamento por Segmento 7
4.3.1. Renda Fixa 7
4.3.1.1. Risco x Retorno – Renda Fixa 7
4.3.2. Renda variável 8
4.3.2.1. Risco x retorno – Renda Variável 8
4.3.3. Fundos no Exterior 9
4.3.3.1. Risco x retorno – Fundos no Exterior 9
5. Alocação por Instituição 10
5.2. Recursos da Taxa de Administração 11
5.3. Demonstração gráfica 11
6. Acompanhamento Fundos Estressados na Carteira – Base Fevereiro/21 12
7. Resultados 13
7.1. Rentabilidade e Meta Atuarial 13
7.2. Rentabilidade Acumulada 13
8. Custos Decorrentes das Aplicações 14
8.1. Taxas de Administração dos Fundos de Investimentos 14

1. Introdução

Com foco no segurado e total transparência, o Instituto de Previdência do Município de Jundiaí, apresenta o relatório de investimentos, referente ao mês de fevereiro de 2021, refletindo todas as decisões do comitê de investimentos constadas em atas, afim de garantir a sustentabilidade e segurança das aplicações.

Neste relatório é possível observar a evolução, tanto quantitativa e qualitativa dos investimentos realizados, também realizamos a demonstração dos custos envolvendo essas aplicações.

2. Cenário Econômico

O mês de fevereiro começou muito bem, todos os ativos avançavam fortemente, mas o bom humor dos mercados durou até a metade do mês, o avanço dos casos de covid, as preocupações com as questões fiscais e a aceleração da inflação, pesaram no mercado e acabaram prejudicando a maioria dos ativos na carteira do IPREJUN. Na renda fixa, apesar dos títulos públicos puxarem o resultado, a abertura da curva de juros empurrou nossos fundos atrelados a inflação para baixo. Na renda variável, pesou a questão das incertezas econômicas e os índices acabaram fechando em queda. Novamente na contramão dos demais investimentos, os fundos no exterior, fecharam no positivo puxados pelos índices lá fora que subiram e também pela desvalorização do real frente ao dólar. No geral a carteira do IPREJUN fechou praticamente no zero-a-zero ficando 0,01 negativo.

Aqui no Brasil, seguem as incertezas com relação a capacidade do governo lidar com as questões fiscais, e também pesa na economia a dificuldade no enfrentamento da crise causada pela pandemia do Covid. A inflação subiu em fevereiro 0,48% um pouco abaixo da expectativa do mercado que era de 0,50%, contudo, a desvalorização do real e alta dos preços das comodities deverá continuar pressionando o índice no médio e longo prazo. Também tivemos o resultado do IBC-BR, que avançou 0,6% em dezembro, acima da expectativa de mercado que era de 0,4%. Como novo ingrediente nesse bolo todo, foi a decisão do ministro do supremo, Edson Fachin, que anulou os processos do ex-presidente Lula, e o tornou elegível para as próximas eleições.

Nos EUA, o FED divulgou comunicado referente a última reunião, reforçando a necessidade de manutenção dos estímulos de recompra de ativos de US$ 120 bilhões mês, para a recuperação da economia americana. Novos pacotes fiscais são fundamentais para continuidade da geração de emprego, não esquecendo que a materialização desses estímulos depende do avanço da aplicação das vacinas.

Na Europa, a divulgação do PMI europeu mostrou a continuidade da desaceleração da economia, o dado divulgado foi ligeiramente acima do anterior 48,1 x 47,8, mas mantendo abaixo de 50 pontos indica que a economia está em retração. A continuidade das restrições a movimentação na Europa, continuam como determinantes para o resultado da economia.

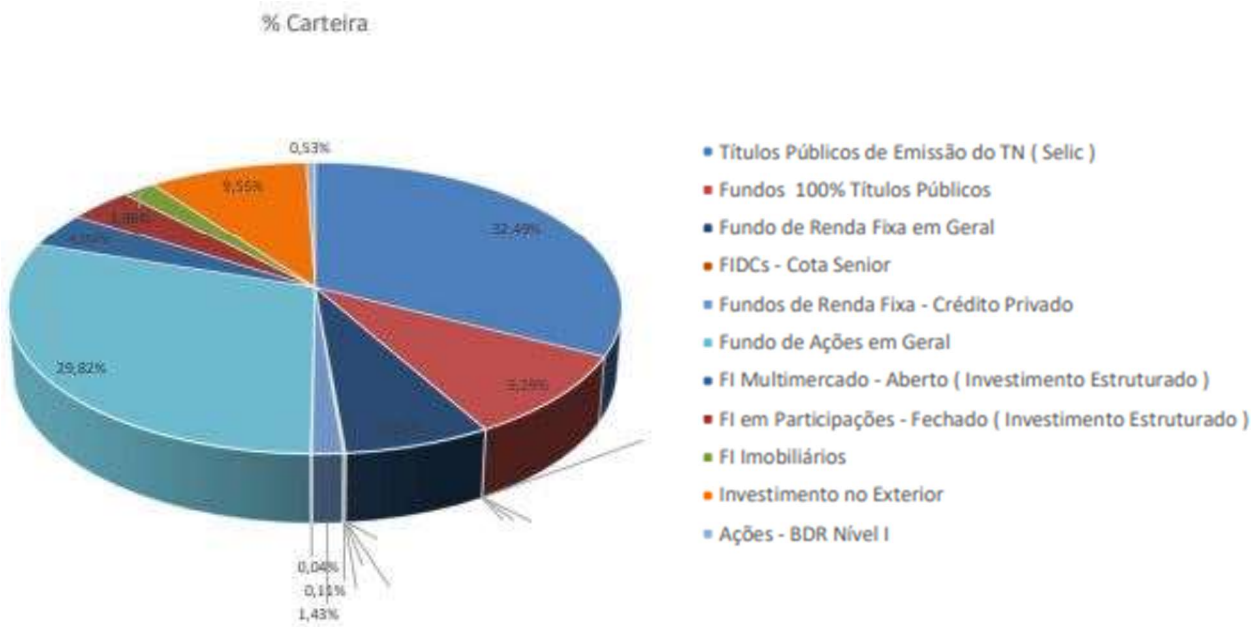
Na China, o PMI divulgado continua apontando para uma aceleração da economia chinesa e os efeitos da segunda onda sobre a economia chinesa serão bem mais brandos do que o impacto da primeira onda. Um ponto que surpreendeu foi o fato de a China registrar deflação em janeiro, o que reforça a dissipação dos choques e normalização dos preços.

3. Patrimônio Recursos Previdenciários

3.1. Distribuição dos Recursos por Segmento e Patrimônio x Resolução

Divisão do Patrimônio X Resolução 3.922				
Inciso	**Descrição**	**Valor**	**% Carteira**	**Limite Resolução - Nível IV**
Art. 7º, I, a	Títulos Públicos de Emissão do TN (Selic)	R$ 637.296.243,99	32,49%	100%
Art. 7º, I, b	Fundos 100% Títulos Públicos	R$ 182.286.957,34	9,29%	
Art. 7º, I, c	Fundos de Índices Carteira 100% Títulos Públicos	R$ 0,00		
Art. 7º , II	Operações Compromissadas	R$ 0,00		
Art. 7º, III, a	Fundos Referenciados em Indicadores RF	R$ 0,00		80%
Art. 7º, III, b	Fundos de Índices (ETF) em Indicadores Títulos Públicos	R$ 0,00		
Art. 7º, IV, a	Fundo de Renda Fixa em Geral	R$ 133.885.693,97	6,83%	60%
Art. 7º, IV, b	Fundos de Índices (ETF) - quaisquer indicadores	R$ 0,00		
Art. 7º, V	Letras Imobiliárias Garantidas	R$ 0,00		20%
Art. 7º, VI, a	Certificado de Depósito Bancário - CDB	R$ 0,00		
Art. 7º, VI, b	Poupança	R$ 0,00		
Art. 7º, VII, a	FIDCs - Cota Senior	R$ 2.221.625,72	0,11%	
Art. 7º, VII, b	Fundos de Renda Fixa - Crédito Privado	R$ 27.994.951,89	1,43%	25%
Art. 7º, VII, c	Fundos de Debentures de Infraestrutura	R$ 780.005,23	0,04%	20%
TOTAL RENDA FIXA		R$ 984.465.478,14	**50,20%**	
Art. 8º, I, a	Fundo de Ações - com no mínimo 50 ações	R$ 0,00		50%
Art. 8º, I, b	ETF - (Índice com no mínimo 50 ações)	R$ 0,00		
Art. 8º, II, a	Fundo de Ações em Geral	R$ 584.931.516,28	29,82%	40%
Art. 8º, II, b	ETF - (Índices em geral)	R$ 0,00		
Art. 8º, III	FI Multimercado - Aberto (Investimento Estruturado)	R$ 78.894.701,30	4,02%	15%
Art. 8º, IV, a	FI em Participações - Fechado (Investimento Estruturado)	R$ 76.173.529,73	3,88%	
Art. 8º, IV, b	FI Imobiliários	R$ 39.078.306,56	1,99%	20%
Art. 8º, IV, c	Ações - Mercado de Acesso (Investimentos Estruturado)	R$ 0,00		15%
TOTAL RENDA VARIÁVEL		R$ 779.078.053,87	**39,72%**	
Art. 9º, I	Renda Fixa - Dívida Externa	R$ 0,00		10%
Art. 9º, II	Investimento no Exterior	R$ 187.383.566,08	9,55%	
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I	R$ 10.309.631,29	0,53%	
TOTAL INVESTIMENTO EXTERIOR		R$ 197.693.197,37	**10,08%**	**10%**
	TOTAL CARTEIRA	**R$ 1.961.236.729,38**	**100,00%**	

3.2. Demonstração Gráfica



4. Investimentos

4.1. Alocação por Estratégia

SEGMENTO	ESTRATÉGIA	VALOR	% ESTRATEGIA/SEGMENTO	
RENDA FIXA				
	CDI	R$ 119.856.823,63	6,11%	
	CRED. PRIVADO	R$ 27.994.951,89	1,43%	
	FIDC	R$ 2.221.625,72	0,11%	
	IMA-B	R$ 120.719.222,12	6,16%	
	IMA-B5	R$ 76.376.610,79	3,89%	
	TIT. PÚBLICO	R$ 637.296.243,99	32,49%	
	TOTAL	**R$ 984.465.478,14**		**50,20%**
RENDA VARIÁVEL				
	FII	R$ 39.078.306,56	1,99%	
	FIP	R$ 76.173.529,73	3,88%	
	IBOV	R$ 390.615.943,16	19,92%	
	IDIV	R$ 94.266.299,22	4,81%	
	S&P500	R$ 78.894.701,30	4,02%	
	SMALL	R$ 100.049.273,90	5,10%	
	TOTAL	**R$ 779.078.053,87**		**39,72%**
FUNDOS NO EXTERIOR				
	BDRX	R$ 10.309.631,29	0,53%	
	EXTERIOR	R$ 187.383.566,08	9,55%	
	TOTAL	**R$ 197.693.197,37**		**10,08%**
RECURSO PREVIDENCIÁRIO		**1.961.236.729,38**		

4.2. Risco da Carteira

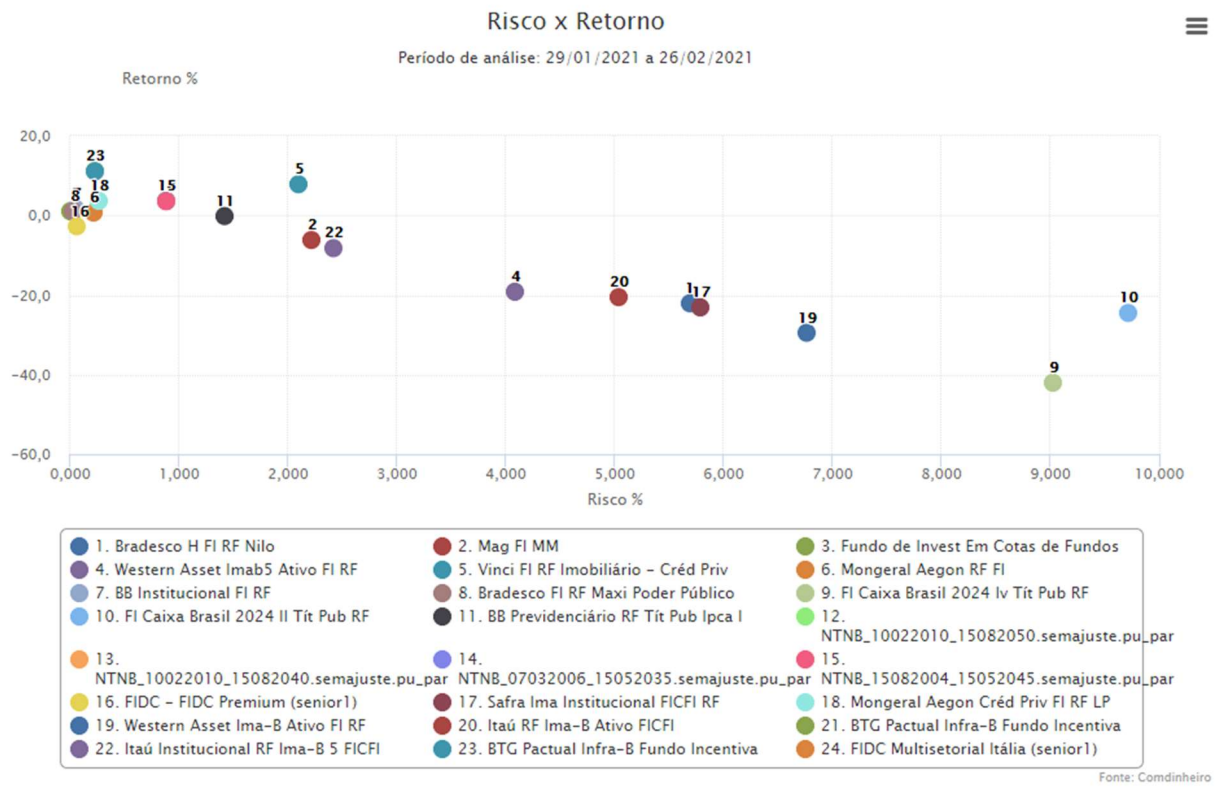
SEGMENTO	RISCO	
RENDA FIXA	1,22%	
RENDA VARIÁVEL	18,12%	Total Renda Variável 15,50%
FUNDOS NO EXTERIOR	11,44%	
TOTAL	**7,87%**	

4.3. Detalhamento por Segmento

4.3.1. Renda Fixa

Carteira Atual	Ativo	Último Preço	Quantidade	Valor Investido	Participação na Carteira	Risco anualizado	Retorno anualizado	VaR 1du 95	VaR % do PL
15.259.071/0001-80	Bradesco H FI RF Nilo	2,3044	1.933.633,9792	4.455.937,2993	0,4448%	5,6906%	-22,0781%	26.276,19388	0,00262%
14.115.116/0001-80	Mag FI MM	2,1184	2.661.098,5994	5.637.233,7514	0,5628%	2,2209%	-6,1757%	12.973,53768	0,00129%
14.508.643/0001-55	Fundo de Invest Em Cotas de Fundos de Invest Caixa Brasil Disponibilidades RF	1,8845	998.205,3503	1.881.163,9000	0,1878%	0,0004%	1,0436%	0,79751	0,00000%
17.517.577/0001-78	Western Asset Imab5 Ativo FI RF	2,3983	22.754.249,9247	54.571.160,3527	5,4479%	4,0884%	-19,1797%	231.197,96394	0,02306%
17.136.970/0001-11	Vinci FI RF Imobiliário - Créd Priv	95,7510	292.372,3798	27.994.951,8931	2,7948%	2,1032%	7,8432%	61.014,54971	0,00609%
11.435.287/0001-07	Mongeral Aegon RF FI	2,4863	6.792.174,3677	16.887.506,0689	1,6859%	0,2220%	0,6076%	3.884,79628	0,00039%
02.296.928/0001-90	BB Institucional FI RF	9,1587	4.408.195,1627	40.373.447,4400	4,0306%	0,0592%	1,7433%	2.476,08474	0,00025%
08.246.263/0001-97	Bradesco FI RF Maxi Poder Público	3,4452	1.651.277,2350	5.688.902,7200	0,5679%	0,0324%	1,1751%	191,21097	0,00002%
20.139.595/0001-78	FI Caixa Brasil 2024 Iv Tit Pub RF	1,5265	15.000.000,0000	22.897.185,0000	2,2859%	9,0296%	-42,0028%	214.248,18271	0,02137%
18.598.088/0001-50	FI Caixa Brasil 2024 II Tit Pub RF	1,4776	18.000.000,0000	26.596.080,0000	2,6551%	9,7158%	-24,5200%	267.769,24297	0,02671%
19.515.015/0001-10	BB Previdenciário RF Tit Pub Ipca Iv FI	2,3069	11.842.923,6029	27.320.004,1899	2,7274%	1,4193%	-0,1565%	40.180,78801	0,00401%
NTNB_10022010_15082050	NTNB_10022010_15082050	3.452,5089	131.177,0000	452.889.766,4030	45,2128%	0,8861%	3,5571%	415.848,36631	0,04148%
NTNB_10022010_15082040	NTNB_10022010_15082040	3.452,5089	20.000,0000	69.050.178,9800	6,8934%	0,8861%	3,5571%	63.402,63405	0,00632%
NTNB_07032006_15052035	NTNB_07032006_15052035	3.452,5089	20.000,0000	69.050.178,9800	6,8934%	0,8861%	3,5571%	63.402,63405	0,00632%
NTNB_15082004_15052045	NTNB_15082004_15052045	3.452,5089	10.000,0000	34.525.089,4900	3,4467%	0,8861%	3,5571%	31.701,31702	0,00316%
06.018.364/0001-85_senior1	FIDC - FIDC Premium	1,2544	675.768,8063	847.696,0206	0,0846%	0,0701%	-2,7380%	61,60352	0,00001%
30.659.168/0001-74	Safra Ima Institucional FICFI RF	133,4580	218.024,2716	29.097.077,3549	2,9048%	5,7880%	-23,1083%	174.520,45114	0,01741%
19.488.768/0001-84	Mongeral Aegon Créd Priv FI RF LP	1,6733	475.072,2517	794.930,1800	0,0794%	0,2703%	3,6701%	222,63979	0,00002%
09.087.301/0001-79	Western Asset Ima-B Ativo FI RF	3,6077	16.011.153,5540	57.762.695,7592	5,7666%	6,7719%	-29,4855%	405.344,99378	0,04043%
05.073.656/0001-58	Itaú RF Ima-B Ativo FICFI	11,2792	2.606.883,5750	29.403.511,6879	2,9354%	5,0461%	-20,5383%	153.751,13799	0,01534%
36.499.412/0001-65	BTG Pactual Infra-B Fundo Incentivado de Investimento Em Infraestrutura RF	249,6017	3.125,0000	780.005,2325	0,0779%	0,2357%	11,0860%	190,51155	0,00002%
09.093.819/0001-15	Itaú Institucional RF Ima-B 5 FICFI	34,8926	624.930,3345	21.805.450,4400	2,1769%	2,4199%	-8,2269%	54.679,15724	0,00545%
13.990.000/0001-28_senior1	FIDC Multisetorial Itália	206,7165	6.646,4455	1.373.929,6900	0,1372%	-	-29,6995%	0,00000	0,00000%
Carteira				**1.001.684.082,8334**		**1,2176%**	**-3,3479%**	**1.264.945,73227**	**12,61836%**

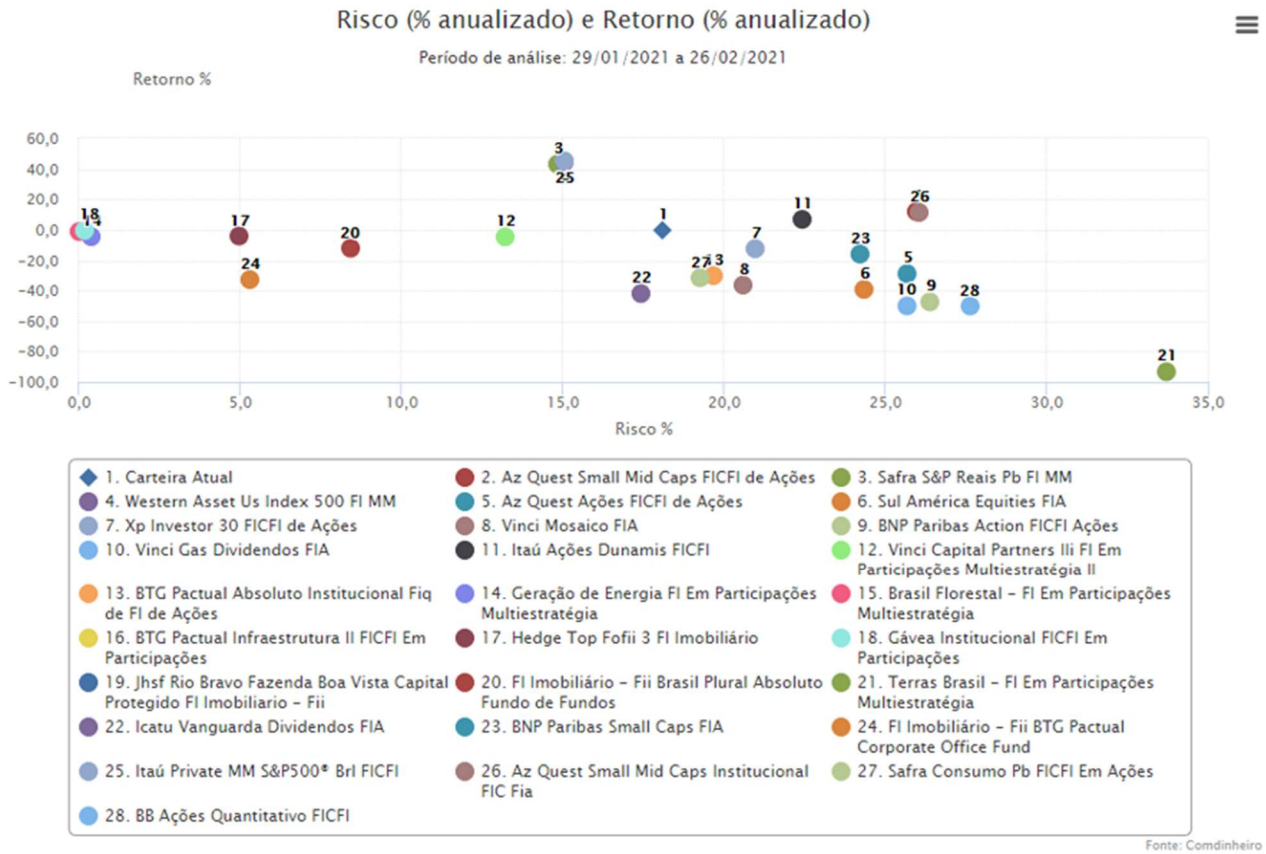
4.3.1.1. Risco x Retorno – Renda Fixa



4.3.2. Renda variável

Carteira Atual	Ativo	Último Preço	Quantidade	Valor Investido	Participação na Carteira	Risco anualizado	Retorno anualizado	VaR 1du 95	VaR % do PL
11.392.165/0001-72	Az Quest Small Mid Caps FICFI de Ações	6,8224	4.159.317,4813	28.376.349,1498	3,6494%	25,9849%	11,9468%	764.089,08339	0,09827%
21.595.829/0001-54	Safra S&P Reais Pb FI MM	248,4421	57.771,9330	14.352.978,0447	1,8459%	14,8460%	43,1274%	220.809,83776	0,02840%
17.453.850/0001-48	Western Asset Us Index 500 FI MM	4,0029	10.560.476,3036	42.272.114,5129	5,4365%	15,0469%	44,5550%	659.121,25039	0,08477%
07.279.657/0001-89	Az Quest Ações FICFI de Ações	13,3723	4.256.119,9325	56.914.158,1143	7,3196%	25,6787%	-28,8347%	1.514.464,49459	0,19477%
11.458.144/0001-02	Sul América Equities FIA	17,7464	941.744,3334	16.712.587,5543	2,1494%	24,3683%	-39,1833%	422.022,01191	0,05428%
26.718.169/0001-75	Xp Investor 30 FICFI de Ações	1,8684	8.166.874,5978	15.258.895,6412	1,9624%	20,9763%	-12,4051%	331.678,76381	0,04266%
28.470.587/0001-11	Vinci Mosaico FIA	7,1668	13.044.798,5054	93.489.729,3469	12,0235%	20,6249%	-36,3287%	1.998.117,84678	0,25697%
12.239.939/0001-92	BNP Paribas Action FICFI Ações	357,5191	56.740,7621	20.285.907,3771	2,6089%	26,4164%	-47,3755%	555.308,07236	0,07142%
07.488.106/0001-25	Vinci Gas Dividendos FIA	5,8969	9.414.014,3734	55.513.957,9382	7,1395%	25,6677%	-50,0355%	1.476.571,86714	0,18990%
24.571.992/0001-75	Itaú Ações Dunamis FICFI	22,3650	1.971.194,6371	44.085.770,0297	5,6698%	22,4515%	6,8342%	1.025.676,33642	0,13191%
30.507.217/0001-53_classeD	Vinci Capital Partners III FI Em Participações Multiestratégia II	1.150,9320	2.291,5784	2.637.450,9665	0,3392%	13,2441%	-4,6873%	36.197,06609	0,00466%
11.977.794/0001-64	BTG Pactual Absoluto Institucional Fiq de FI de Ações	4,7797	15.219.915,4807	72.746.754,8264	9,3558%	19,6721%	-30,1248%	1.482.962,03420	0,19072%
11.490.580/0001-69	Geração de Energia FI Em Participações Multiestratégia	0,0433	6.000.000,2209	259.546,3896	0,0334%	0,4051%	-4,5347%	108,95719	0,00001%
12.312.767/0001-35	Brasil Florestal - FI Em Participações Multiestratégia	753.927,0205	8,7753	6.615.939,3411	0,8509%	0,0186%	-1,1697%	127,43855	0,00002%
14.584.094/0001-06	BTG Pactual Infraestrutura II FICFI Em Participações	1,7262	9.819.999,5812	16.951.725,7663	2,1801%	57,0553%	698,0617%	1.002.247,98625	0,12890%
hfof11	Hedge Top Fofii 3 FI Imobiliário	103,3600	148.871,0000	15.387.306,5600	1,9789%	4,9826%	-4,1060%	79.448,38540	0,01022%
19.997.628/0001-31_classeA	Gávea Institucional FICFI Em Participações	1,3722	3.199.400,3000	4.390.267,9621	0,5646%	0,2079%	-0,4090%	945,71300	0,00012%
rbbv11	Jhsf Rio Bravo Fazenda Boa Vista Capital Protegido FI Imobiliario - Fii	98,6500	100.000,0000	9.865.000,0000	1,2687%	9,0186%	76,2300%	92.194,19225	0,01186%
bpff11	FI Imobiliário - Fii Brasil Plural Absoluto Fundo de Fundos	79,0000	65.000,0000	5.135.000,0000	0,6604%	8,4169%	-12,0827%	44.787,70436	0,00576%
19.412.474/0001-79	Terras Brasil - FI Em Participações Multiestratégia	192,9149	8.000,0000	1.543.319,4037	0,1985%	33,7175%	-93,2824%	53.923,40552	0,00693%
08.279.304/0001-41	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	5,0010	7.748.995,9500	38.752.341,2962	4,9838%	17,4483%	-41,9077%	700.674,58640	0,09011%
11.108.013/0001-03	BNP Paribas Small Caps FIA	385,0216	102.848,3316	39.598.824,7752	5,0927%	24,2215%	-15,9635%	993.913,43340	0,12782%
brcr11	FI Imobiliário - Fii BTG Pactual Corporate Office Fund	86,9100	100.000,0000	8.691.000,0000	1,1177%	5,3118%	-32,7476%	47.838,22690	0,00615%
26.269.692/0001-61	Itaú Private MM S&P500® Brl FICFI	18,9994	1.172.124,2134	22.269.608,7224	2,8640%	15,0490%	45,2885%	347.286,00582	0,04466%
34.791.108/0001-61	Az Quest Small Mid Caps Institucional FIC Fia	1,0467	30.643.422,9032	32.074.099,9674	4,1250%	26,0667%	11,3778%	866.376,52168	0,11142%
28.580.812/0001-72	Safra Consumo Pb FICFI Em Ações	194,2310	238.267,2065	46.278.878,2671	5,9518%	19,2682%	-31,5466%	924.037,04048	0,11884%
07.882.792/0001-14	BB Ações Quantitativo FICFI	2,4176	10.275.812,5734	24.843.262,0286	3,1950%	27,6285%	-50,1126%	711.263,91650	0,09147%
BDIV11	BTG Pactual Infraestrutura Dividendos FI Em Participações Em Infraestrutura	103,5100	273.955,0000	28.357.082,0500	3,6469%	16,6742%	45,6712%	489.972,22137	0,06301%
35.640.811/0001-31_unica	BTG Pactual Economia Real FI Em Participaçoes Multiestrategia	0,9780	14.211.129,1182	13.898.640,6000	1,7875%	-	-3,4457%	0,00000	0,00000%
Carteira				**777.558.496,6316**	**100,0000%**	**18,1184%**	**0,0000%**	**13.987.964,50320**	**179,89598%**

4.3.2.1. Risco x retorno – Renda Variável

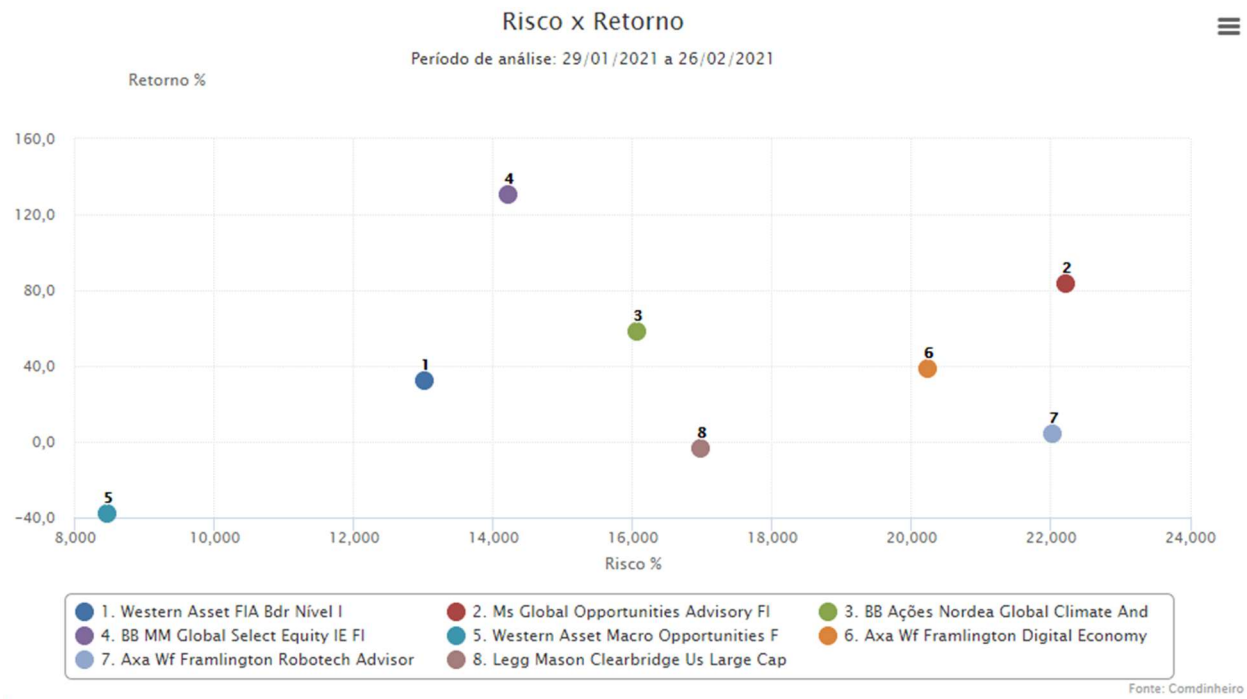


Fonte: Comdinheiro

4.3.3. Fundos no Exterior

Carteira Atual	Ativo	Último Preço	Quantidade	Valor Investido	Participação na Carteira	Risco anualizado	Retorno anualizado	VaR 1du 95	VaR % do PL
19.831.126/0001-36	Western Asset FIA Bdr Nível I	6.261,7251	1.646,4522	10.309.631,3192	5,215%	13,016%	32,569%	139.054,49280	0,07034%
33.913.562/0001-85	Ms Global Opportunities Advisory FIC FI Ações IE	214,5165	290.867,3016	62.395.835,7428	31,562%	22,223%	83,187%	1.436.909,22790	0,72684%
28.578.936/0001-13	BB Ações Nordea Global Climate And Environment IE FI	2,4301	4.832.160,8369	11.742.403,8166	5,940%	16,063%	58,021%	195.450,09721	0,09887%
17.413.636/0001-68	BB MM Global Select Equity IE FI	5,1413	7.168.796,1556	36.856.812,2496	18,643%	14,213%	130,716%	542.839,83212	0,27459%
22.282.992/0001-20	Western Asset Macro Opportunities FI MM IE	1.689,0340	6.136,0514	10.363.999,5459	5,242%	8,469%	-37,574%	90.953,56769	0,04601%
35.002.482/0001-01	Axa Wf Framlington Digital Economy Advisory FIC FIA Ie	145,3160	176.995,3060	25.720.250,8529	13,010%	20,247%	38,502%	539.646,73630	0,27297%
35.002.463/0001-77	Axa Wf Framlington Robotech Advisory FIC FIA Ie	139,6696	179.563,5076	25.079.569,2482	12,686%	22,032%	4,385%	572.573,50260	0,28963%
28.320.600/0001-56	Legg Mason Clearbridge Us Large Cap Growth FIA IE	1.656,9189	9.188,5576	15.224.694,6133	7,701%	16,983%	-3,776%	267.927,29075	0,13553%
Carteira				**197.693.197,3880**	**100,000%**	**11,441%**	**59,075%**	**2.343.724,08810**	**118,55360%**

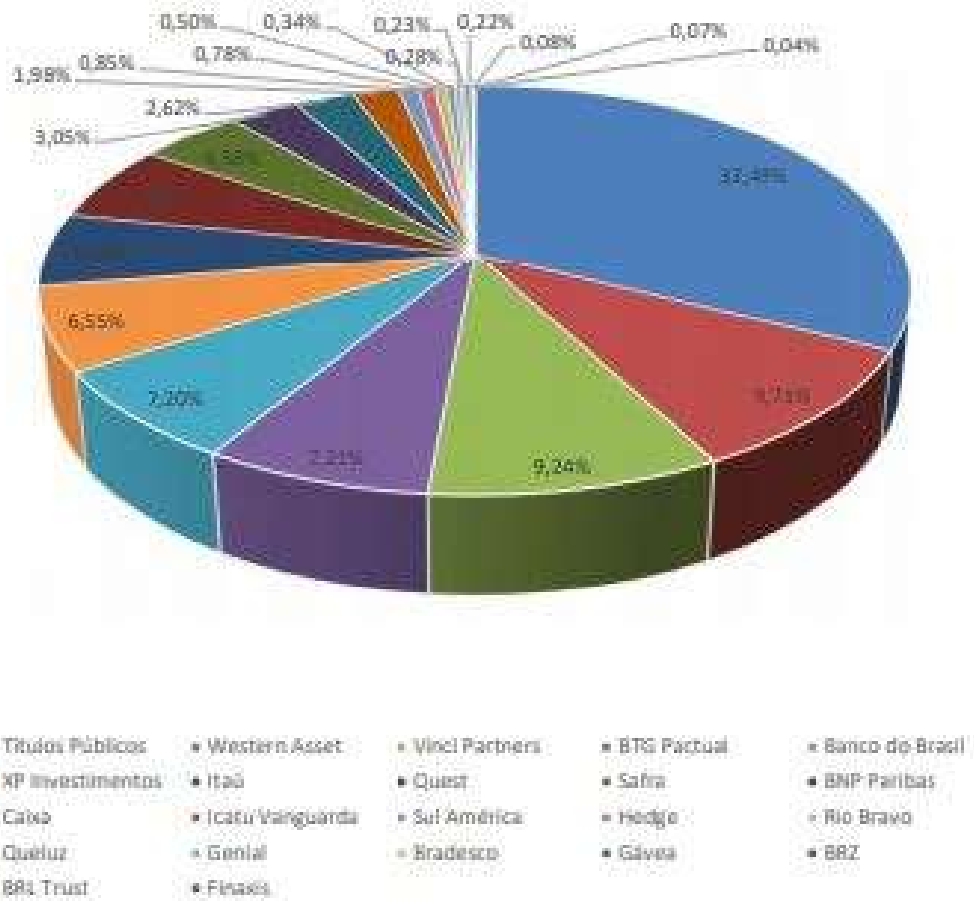
4.3.3.1. Risco x retorno – Fundos no Exterior



5. Alocação por Instituição

Divisão do Patrimônio X Instituição Financeira				
Posição	Instituição	Valor	% Carteira	Acumulada
1º	Títulos Públicos	R$ 637.296.243,99	32,49%	32,49%
2º	Western Asset	R$ 190.504.296,07	9,71%	42,21%
3º	Vinci Partners	R$ 181.155.647,40	9,24%	51,44%
4º	BTG Pactual	R$ 141.425.208,46	7,21%	58,66%
5º	Banco do Brasil	R$ 141.135.929,73	7,20%	65,85%
6º	XP Investimentos	R$ 128.454.551,48	6,55%	72,40%
7º	Itaú	R$ 117.564.340,89	5,99%	78,40%
8º	Quest	R$ 117.364.607,23	5,98%	84,38%
9º	Safra	R$ 89.728.933,68	4,58%	88,96%
10º	BNP Paribas	R$ 59.884.732,16	3,05%	92,01%
11º	Caixa	R$ 51.374.428,90	2,62%	94,63%
12º	Icatu Vanguarda	R$ 38.752.341,28	1,98%	96,60%
13º	Sul América	R$ 16.712.587,56	0,85%	97,46%
14º	Hedge	R$ 15.387.306,56	0,78%	98,24%
15º	Rio Bravo	R$ 9.865.000,00	0,50%	98,74%
16º	Queluz	R$ 6.615.939,35	0,34%	99,08%
17º	Genial	R$ 5.394.546,38	0,28%	99,36%
18º	Bradesco	R$ 4.464.875,18	0,23%	99,58%
19º	Gávea	R$ 4.390.267,96	0,22%	99,81%
20º	BRZ	R$ 1.543.319,40	0,08%	99,89%
21º	BRL Trust	R$ 1.373.929,69	0,07%	99,96%
22º	Finaxis	R$ 847.696,03	0,04%	100,00%
		R$ 1.961.236.729,38	**100,00%**	

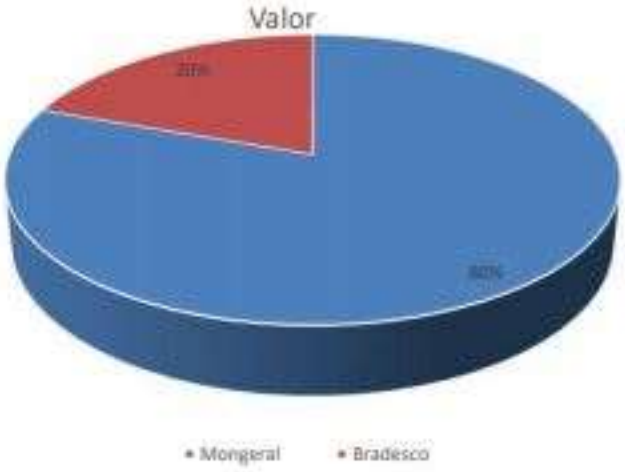
5.1. Demonstração gráfica



5.2. Recursos da Taxa de Administração

Divisão do Patrimônio X Instituição Financeira					
Posição	Instituição	Valor		% Carteira	Acumulada
1º	Mongeral	R$	23.319.669,99	80,39%	80,39%
2º	Bradesco	R$	5.688.902,72	19,61%	100,00%
		R$	29.008.572,71	**100,00%**	

5.3. Demonstração gráfica



6. Acompanhamento Fundos Estressados na Carteira – Base Fevereiro/21

				VARIAÇÃO
RURAL FIDC PREMIUM				
APLICAÇÃO (dez/12)	R$	2.200.000,00		
ULTIMO EXTRATO	**R$**	**847.696,03**		
TOTAL AMORTIZADO	-R$	1.923.615,87		
VALOR ATUALIZADO IPCA+5,41%	R$	5.638.565,41	-R$	2.867.253,51
PERFORMANCE NO MÊS		-0,20%	R$	(1.682,66)
FIDC ITÁLIA				
APLICAÇÃO (jul/12)	R$	6.607.325,82		
ULTIMO EXTRATO	**R$**	**1.373.929,69**		
TOTAL AMORTIZADO	-R$	5.100.826,48		
VALOR ATUALIZADO IPCA+5,41%	R$	17.393.584,15	-R$	10.918.827,98
PERFORMANCE NO MÊS		-0,51%	R$	(35.021,89)
ATICO FLORESTAL				
APLICAÇÃO (set/12)	R$	8.500.000,00		
ULTIMO EXTRATO	**R$**	**6.615.939,35**		
VALOR ATUALIZADO IPCA+5,41%	R$	21.920.104,10	-R$	15.304.164,75
PERFORMANCE NO MÊS		-0,08%	R$	(5.562,35)
FAZENDA BOA VISTA				
APLICAÇÃO (jul/13)	R$	10.000.000,00		
ULTIMO EXTRATO	**R$**	**9.865.000,00**		
TOTAL AMORTIZADO	-R$	4.888.646,45		
VALOR ATUALIZADO IPCA+5,41%	R$	23.349.231,57	-R$	8.595.585,12
PERFORMANCE NO MÊS		4,10%	R$	251.000,00
TERRAS BRASIL				
APLICAÇÃO (mai-jun/13)	R$	8.000.000,00		
ULTIMO EXTRATO	**R$**	**1.543.319,40**		
VALOR ATUALIZADO IPCA+6%	R$	16.640.753,52	-R$	15.097.434,12
PERFORMANCE NO MÊS		-17,54%	R$	(328.337,11)
ATICO ENERGIA				
APLICAÇÃO (dez/11)	R$	6.000.000,00		
ULTIMO EXTRATO	**R$**	**259.546,38**		
VALOR ATUALIZADO IPCA+5,41%	R$	16.770.707,15	-R$	16.511.160,77
PERFORMANCE NO MÊS		-0,33%	R$	(861,78)
TRENDBANK				
APLICAÇÃO (nov/11)	R$	5.000.000,00		
ULTIMO EXTRATO	**R$**	**-**		
TOTAL AMORTIZADO	-R$	876.389,61		
VALOR ATUALIZADO IPCA+5,41%	R$	13.766.677,87	-R$	12.890.288,26
PERFORMANCE NO MÊS	-		R$	-

DIFERENÇA SALDO REAL X VALOR IPCA+5,41% **R$ (82.184.714,51)**

7. Resultados

7.1. Rentabilidade e Meta Atuarial

FEVEREIRO		
	Mês	Ano
Rentabilidade	-0,0837%	-0,1887%
IPCA + 6%	1,3038%	2,0039%
S / IPCA+6%	-1,3875%	-2,1926%

7.2. Rentabilidade Acumulada

RENTABILIDADE ANUAL												
	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO
IPREJUN	-0,1051%	-0,0837%										
IPREJUN - AC	-0,1051%	-0,1887%										
Meta Atuarial	0,6911%	1,3038%										
Meta - AC	0,6911%	2,0039%										
Diferença	-0,7962%	-1,3875%										
Diferença - AC	-0,7962%	-2,1926%										

8. Custos Decorrentes das Aplicações

8.1. Taxas de Administração dos Fundos de Investimentos

- Renda Fixa

nome_fundo	Taxa de Administracao	Taxa de Performance	Taxa de Saída
BB Institucional FI RF	0,20	0,00	0,00
BB Previdenciário RF Tit Pub Ipca Iv FI	0,20	0,00	0,00
Bradesco FI RF Maxi Poder Público	0,20	0,00	0,00
Bradesco H FI RF Nilo	0,30	20% do que excede 100% do IMAB	0,00
BTG Pactual Infra-B Fundo Incentivado de Investimento Em Infraestrutura RF	0,40	0,00	0,00
FI Caixa Brasil 2024 II Tit Pub RF	0,20	0,00	0,00
FI Caixa Brasil 2024 Iv Tit Pub RF	0,20	0,00	0,00
FIDC - FIDC Premium	0,25	0,00	0,00
FIDC Multisetorial Italia	0,39	0,00	0,00
Fundo de Invest Em Cotas de Fundos de Invest Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,80	0,00	0,00
Itaú Institucional RF Ima-B 5 FICFI	0,18	0,00	0,00
Itaú RF Ima-B Ativo FICFI	0,50	0,00	0,00
Mag FI MM	0,80	20% do que excede 100% do CDI	0,00
Mongeral Aegon Cred Priv FI RF LP	0,45	0,00	0,00
Mongeral Aegon RF FI	0,30	0,00	0,00
Safra Ima Institucional FICFI RF	0,15	0,00	0,00
Vinci FI RF Imobiliario - Cred Priv	1,06	0,00	0,00
Western Asset Ima-B Ativo FI RF	0,50	0,00	0,00
Western Asset Imab5 Ativo FI RF	0,40	0,00	0,00

- Renda Variável

nome_fundo	Taxa de Administracao	Taxa de Performance	Taxa de Saída
Az Quest Ações FICFI de Ações	2,00	20% do que excede 100% do Ibovespa	0,00
Az Quest Small Mid Caps FICFI de Ações	2,00	20% do que excede 100% do SMLL	0,00
Az Quest Small Mid Caps Institucional FIC Fia	2,00	20% do que excede 100% do SMLL	0,00
BB Ações Quantitativo FICFI	1,00	20% do que excede 100% do Ibovespa	0,00
BDIV 11	1,10	0,00	0,00
BNP Paribas Action FICFI Ações	2,00	20% do que excede 100% do Ibovespa	0,00
BNP Paribas Small Caps FIA	2,00	20% do que excede 100% do SMLL	0,00
bpffi 1	0,40	20% do que exceder 100% do IFIX	0,00
Brasil Florestal - FI Em Participações Multiestrategia	1,10	0,00	0,00
brcr11	2,05	nd	
BTG Pactual Absoluto Institucional Fiq de FI de Ações	3,00	0,00	5,00
BTG Pactual Economia Real FI Em Participações Multiestrategia	2,00	20% do que excede 100% do IPCA + 6,5%aa	0,00
BTG Pactual Infraestrutura II FICFI Em Participações	2,00	20% do que excede 100% do IPCA+8%a.a.	0,00
Gávea Institucional FICFI Em Participações	2,01	(vide regulamento)	0,00
Geração de Energia FI Em Participações Multiestratégia	0,30	(vide regulamento)	0,00
hfofi 1	0,60	20% do que excede 100% do IFIX	nd
Icatu Vanguarda Dividendos FIA	2,00	0,00	0,00
Itaú Ações Dunamis FICFI	1,90	20% do que excede 100% do Ibovespa	0,00
Itaú Private MM S&P500® Brl FICFI	0,80	0,00	0,00
rbbv11	0,60	30% do que excede 100% do IPCA+9%a.a.	0,00
Safra Consumo Pb FICFI Em Ações	1,50	20% do que excede 100% do Ibovespa	0,00
Safra S&P Reais Pb FI MM	1,00	0,00	0,00
Sul America Equities FIA	1,50	20% do que excede 100% do Ibovespa	0,00
Terras Brasil - FI Em Participações Multiestratégia	2,00	(vide regulamento)	0,00
Vinci Capital Partners III FI Em Participações Multiestratégia II	2,80	20% do que excede 100% do IPCA+8%a.a.	0,00
Vinci Gas Dividendos FIA	1,97	20% do que excede 100% do Ibovespa	5,00
Vinci Mosaico FIA	1,97	20% do que excede 100% do Ibovespa	5,00
Western Asset Us Index 500 FI MM	1,00	0,00	0,00
Xp Investor 30 FICFI de Ações	2,00	20% do que excede 100% do Ibovespa	0,00

- Fundos no Exterior

nome_fundo	Taxa de Administracao	Taxa de Performance	Taxa de Saída
Axa Wf Framlington Digital Economy Advisory FIC FIA Ie	0,80	0,00	0,00
Axa Wf Framlington Robotech Advisory FIC FIA Ie	0,80	0,00	0,00
BB Ações Nordea Global Climate And Environment IE FI	0,30	0,00	0,00
BB MM Global Select Equity IE FI	0,08	0,00	0,00
Legg Mason Clearbridge Us Large Cap Growth FIA IE	1,00	0,00	0,00
Ms Global Opportunities Advisory FIC FI Ações IE	0,80	0,00	0,00
Western Asset FIA Bdr Nivel I	1,50	0,00	0,00
Western Asset Macro Opportunities FI MM IE	0,10	0,00	0,00

8.2. Taxas e Despesas

Descrição	Taxa (R$)
CBLC (CCBA)	155,77
CETIP	11.504,43
CUSTÓDIA	19.573,82
SELIC	1.918,80

Jundiaí, 14 de abril de 2021.

SERPRO
Assinado digitalmente por:
JOAO CARLOS FIGUEIREDO
CPF:/CNPJ 05754657862
Assinado em: 15/04/2021
Sua autenticidade pode ser confirmada no endereço :
<http://www.serpro.gov.br/assinador-digital>

João Carlos Figueiredo
Diretor Presidente
IPREJUN

SERPRO
Assinado digitalmente por:
CLAUDIA GEORGE MUSSELI CEZAR
CPF:/CNPJ 27079307848
Assinado em: 15/04/2021
Sua autenticidade pode ser confirmada no endereço :
<http://www.serpro.gov.br/assinador-digital>

Cláudia George Musseli Cézar
Diretora do Departamento de
Planejamento, Gestão e Finanças
IPREJUN