

A tabela 4 apresenta das atividades que foram planejadas para serem realizadas no mês de fevereiro, seus respectivos responsáveis, e o status da execução da atividade para as realocações do mês de fevereiro.

**Tabela 4: Procedimentos planejados e executados para fevereiro 2022.**

Procedimentos planejados para Fevereiro/2022		
Rotinas e Processos	Responsável	Status
Avaliação do FIP KINE V	Kelly, Utan, Henrique e Nayara	Realizado
Avaliação do FIP VSP Multiestratégia	Kelly, Utan, Henrique e Nayara	Realizado
Elaboração Nota Técnica Kine V	Nayara e Marcos Paulo	Realizado e enviado a DIXE (2022/165876)
Elaboração Nota Técnica VSP	Nayara e Marcos Paulo	Realizado e enviado a DIXE (2022/192178)
Memorando reiterando a necessidade de Deliberação sobre a Nota Técnica de Análise do Fundo SPX (Crédito Privado)	Nayara e Kelly	Realizado e enviado a DIXE (2022/129830)
Elaboração de Relatório de Aplicação e Resgate	Nayara, Marcos Paulo e Camila	Realizado - Foram elaborados 5 Relatórios
Execução das Movimentações - Realocação Alocação Dinâmica	Elvira e Camila	Realizado
Execução das Movimentações - Aplicação em Crédito Privado	Elvira e Camila	Pendente - O período de análise dos produtos disponíveis ultrapassou o mês de fevereiro. A aplicação será realizada em março de 2022.
Execução das Movimentações - Aplicação em Títulos Públicos	Elvira e Camila	Pendente - A Nota Técnica ainda não foi aprovada pela DIXE
Execução das Movimentações - Aplicação FIP's	Elvira e Camila	Pendente - As Notas Técnicas com as sugestões de aplicação ainda não foram aprovadas pela DIXE

Para a realização das realocações estratégicas planejadas para o mês de março algumas atividades deverão ser executadas pela equipe técnica do NUGIN.

**Tabela 5: Procedimentos planejados para março 2022.**

Procedimentos a serem executados em Março/2022	
Rotinas e Processos	Responsável
Avaliação do FIP Economia Real II	Kelly, Utan, Henrique e Nayara
Elaboração Nota Técnica Economia Real II	Kelly, Utan, Henrique e Nayara
Memorando reiterando a necessidade de Deliberação sobre a Nota Técnica Título Público.	Nayara e Kelly
Memorando reiterando a necessidade de Deliberação sobre a Nota Técnica FIP KINEA V	Nayara e Kelly
Memorando reiterando a necessidade de Deliberação sobre a Nota Técnica FIP VSP Multiestratégia	Nayara e Kelly
Reiterar a necessidade de aprovação da Política de Investimento 2022. O prazo da Secretária de Previdência encerra dia 31/03/2022	Kelly, Nayara e Camila
Análise de Fundos - Estratégia Exterior	Henrique, Nayara e Marcos Paulo
Elaboração de Relatório de Aplicação e Resgate	Nayara, Marcos Paulo e Camila
Execução das Movimentações - Aplicação em Crédito Privado	Elvira e Camila
Execução das Movimentações - Aplicação em Títulos Públicos	Elvira e Camila
Execução das Movimentações - Aplicação FIP's	Elvira e Camila

**COMPOSIÇÃO POR FUNDOS DE INVESTIMENTO**

**Tabela 6: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Fixa – Fevereiro 2022**

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	FEVEREIRO		VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META				
<b>Art. 7º, "a", "b" - FI 100% Títulos Públicos</b>				<b>29.267.214,04</b>	<b>1.936.722.975,26</b>	<b>46,86%</b>
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,05%	83,74%	2,78%	2.228.687,94	212.648.254,05	5,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	89,76%	1,66%	387.467,56	34.171.729,85	0,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	89,49%	1,66%	1.120.822,46	98.270.548,00	2,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	87,62%	2,11%	1.051.167,31	94.797.114,22	2,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	89,40%	1,66%	508.171,84	44.984.838,06	1,07%
BGT PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-1,95%	-154,93%	5,17%	68.507,48	7.733.012,24	0,17%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,52%	40,98%	5,62%	237.681,13	46.298.496,89	1,10%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,81%	63,99%	2,25%	1.943.103,47	245.099.506,11	5,79%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-1,47%	-116,98%	5,0%	389.453,27	36.573.509,52	0,87%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-1,70%	-134,94%	5,21%	323.078,12	30.280.360,00	0,72%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-1,70%	-135,31%	5,22%	542.365,92	50.767.020,00	1,21%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,65%	83,47%	2,75%	1.931.752,78	185.233.296,90	4,44%
CAIXA BRASIL IDCA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	1,15%	91,04%	2,75%	1.951.144,04	172.170.824,89	4,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	1,05%	83,42%	2,75%	2.251.457,09	216.612.927,42	5,16%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,48%	38,07%	5,2%	1.021.729,79	35.514.123,83	0,85%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO RENDA FIXA	0,43%	34,34%	6,61%	164.366,76	38.175.584,46	0,91%
WESTERN ASSET ATIVO MAX FIC RENDA FIXA	0,50%	40,07%	1,08%	123.012,94	24.506.413,43	0,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,93%	73,74%	1,15%	3.072.208,91	218.950.948,78	6,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,90%	71,37%	1,06%	937.341,74	105.238.528,60	2,51%
<b>Art. 7º, "a", "b" - FI RENDA FIXA</b>				<b>21.773.440,14</b>	<b>1.166.666.931,15</b>	<b>27,80%</b>
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,48%	38,35%	5,65%	365.460,24	101.340.121,15	8,23%
PP INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,78%	61,72%	3,83%	201.079,58	26.074.152,06	0,62%
BRASESCO NILO FIC RENDA FIXA	0,40%	31,50%	6,33%	283.032,98	71.647.393,47	1,71%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,80%	63,40%	0,17%	1.412.613,11	523.934.943,17	12,46%
WESTERN ASSET ATIVO FIC RENDA FIXA	0,75%	59,54%	1,08%	612.580,35	82.330.174,84	1,96%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DÍNAMICO RF LP FIC	0,89%	70,35%	0,75%	275.219,49	116.626.097,08	2,78%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA				<b>1.650.945,92</b>	<b>101.040.969,29</b>	<b>0,46%</b>
<b>Art. 7º, "c", "d" - FIDC Cota Geral</b>				<b>8.271,24</b>	<b>2.234.679,20</b>	<b>0,05%</b>
BBF MASTER FIDC LP	-0,41%	-32,81%	14,45%	8.271,24	2.234.679,20	0,05%
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>				<b>26.558.126,52</b>	<b>1.166.666.931,15</b>	<b>76,01%</b>

\* O fundo BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA não possui rendimento no mês de Fevereiro, visto que a aplicação inicial no fundo ocorreu no último dia útil do mês (29/02/2022).

**Tabela 7: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Variável – Fevereiro 2022**

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL	FEVEREIRO		VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META				
<b>Art. 8º, inciso I - FI Ações</b>				<b>- 6.016.162,61</b>	<b>556.182.429,38</b>	<b>13,25%</b>
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,96%	76,36%	19,27%	139.281,46	14.625.566,23	0,53%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FIC AÇÕES	0,84%	67,08%	19,55%	151.172,04	12.280.165,00	0,50%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-0,56%	-76,58%	17,21%	14.001,74	1.438.067,82	0,03%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,03%	2,51%	18,59%	1.119,62	3.529.377,66	0,08%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIC AÇÕES	-3,24%	-257,19%	24,76%	- 171.611,91	5.127.723,24	0,12%
BRASESCO MID SMALL CAPS FIC AÇÕES	-1,44%	-114,12%	22,74%	276.071,15	18.937.260,67	0,45%
BRASESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	-0,20%	-16,17%	19,31%	7.346,48	3.601.012,22	0,09%
BGT PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,08%	-165,53%	24,06%	- 1.962.983,30	92.220.690,05	2,20%
ITAÚ DIVIDENDOS FIC AÇÕES	0,94%	74,91%	17,19%	24.872,14	2.662.023,50	0,06%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-1,21%	-96,23%	17,41%	- 465.537,09	37.954.605,96	0,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	0,00%	0,30%	20,91%	1.174,19	30.797.268,24	0,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-0,37%	-29,08%	21,54%	- 281.498,69	76.598.781,98	1,83%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,71%	-56,63%	20,21%	- 388.832,95	54.140.072,82	1,29%
VINCI SELECTION EQUITIES FIC AÇÕES	-0,48%	-38,43%	17,51%	- 107.806,58	22.170.121,00	0,53%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,47%	-117,02%	17,21%	- 485.604,19	32.337.142,69	0,77%
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PR FIC AÇÕES	-2,12%	-168,65%	23,86%	- 331.224,64	15.367.185,12	0,38%
BARNA AM VALUATION FIC AÇÕES	-1,47%	-116,81%	20,91%	- 648.744,55	43.458.780,47	1,04%
OCCAM FIC AÇÕES	1,05%	83,24%	18,22%	227.147,88	21.899.554,32	0,52%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,34%	-26,73%	17,84%	- 172.869,41	41.167.817,61	0,98%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-3,01%	-239,29%	26,96%	- 1.116.796,06	35.950.223,19	0,84%
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>				<b>- 6.016.162,61</b>	<b>556.182.429,38</b>	<b>13,25%</b>

**Tabela 8: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Investimento no Exterior, Estruturado e Total FUNPREV – Fevereiro 2022**

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	FEVEREIRO		VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META				
<b>Art. 9º, inciso II - FI Investimento no Exterior</b>				<b>3.980,22</b>	<b>57.563.779,04</b>	<b>1,37%</b>
VINCI INTERNACIONAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	-3,76%	-298,46%	14,74%	- 313.867	8.038.272,12	0,19%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	-5,17%	-410,66%	7,97%	- 1.356,265	24.876.076,13	0,59%
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTMENT NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-5,41%	-429,71%	17,77%	- 1.410,089	24.651.832,80	0,59%
<b>Art. 9º, inciso III - FI Ações BDR Nível I</b>				<b>- 10.807,547</b>	<b>129.028.665,13</b>	<b>3,07%</b>
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,12%	-565,22%	18,43%	- 6.552.648	85.520.003,65	2,04%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-8,91%	-707,50%	20,50%	- 4.254.898	43.508.661,48	1,04%
<b>TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>				<b>- 14.635.191,35</b>	<b>186.592.444,18</b>	<b>4,45%</b>
FUNDOS DE INVESTIMENTOS - ESTRUTURADOS	FEVEREIRO		VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META				
<b>Art. 10º, inciso I - FI FIC Multimercado</b>				<b>- 1.023.870,24</b>	<b>262.714.009,84</b>	<b>6,26%</b>
SAFRA S&P REAIS PR FIC MULTIMERCADO	-2,17%	-177,51%	14,12%	- 550.709,06	24.803.551,91	0,59%
WESTERN ASSET US INDEX S&P FIC MULTIMERCADO	-2,09%	-165,92%	14,27%	- 1.037.693,44	48.634.579,44	1,16%
VINCI VALOREM FIC MULTIMERCADO	0,99%	78,40%	1,83%	350.761,34	35.883.577,96	0,86%
BRASESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,74%	58,81%	2,04%	52.782,30	7.185.629,87	0,17%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,84%	66,54%	3,46%	928.942,99	111.805.282,40	2,66%
ITAÚ PRIVATE EQUITY S&P500 <sup>®</sup> BR FIC MULTIMERCADO	-2,18%	-173,43%	14,29%	- 767.994,37	34.401.397,26	0,82%
<b>Art. 10º, inciso II - FI Participações</b>				<b>15.753.743,44</b>	<b>84.945.778,28</b>	<b>2,02%</b>
BGT PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFP	1,70%	135,25%	24,78%	159.305,18	9.515.854,57	0,23%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTIESTRATÉGIA FIP	2,36%	187,82%	17.414.438,26	75.431.915,72	1,80%	
<b>TOTAL ESTRUTURADOS</b>				<b>15.540.873,20</b>	<b>347.659.780,12</b>	<b>8,29%</b>
<b>TOTAL</b>				<b>23.197.325,57</b>	<b>4.196.059.239,29</b>	<b>100,00%</b>

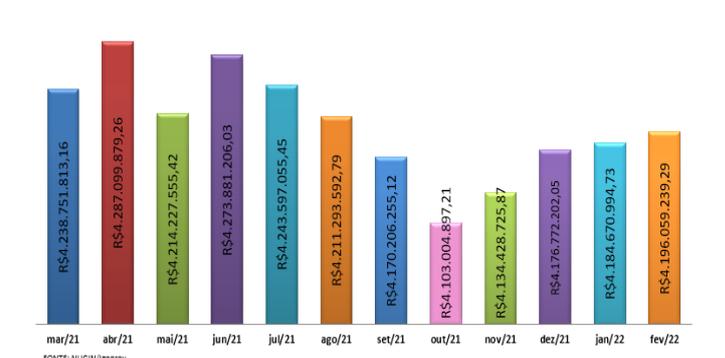
**MOVIMENTAÇÕES DA CARTEIRA**

**Tabela 9: Movimentações FUNPREV – Fevereiro 2022**

DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	AMORTIZAÇÃO	MOVIMENTAÇÕES - FUNPREV - FEVEREIRO 2022		DESCRIÇÃO
				FUNDO DE INVESTIMENTO	ARRECAÇÃO	
11/02/2022	R\$ 2.209.838,96					BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES
15/02/2022			R\$ 974.586,78			BB TP IPCA I FIC RF PREVIDENCIÁRIO
15/02/2022			R\$ 2.778.541,11			BB TP IPCA IV FIC RF PREVIDENCIÁRIO
15/02/2022			R\$ 2.670.956,56			BB TP IPCA V FIC RF PREVIDENCIÁRIO
15/02/2022			R\$ 1.306.428,02			BB TP VII FIC RF PREVIDENCIÁRIO
16/02/2022			R\$ 1.422.265,92			CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF
16/02/2022			R\$ 846.438,12			CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF
16/02/2022			R\$ 936.209,75			CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF
18/02/2022			R\$ 214.357,88			BGT PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA
22/02/2022	R\$ 11.149.807,14					ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA LP
22/02/2022		R\$ 100.000.000,00				ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA LP
23/02/2022	R\$ 100.000.000,00					BB INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA
25/02/2022	R\$ 1.652.828,92					BB INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA
25/02/2022			R\$ 15.671.768,89			KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INST. I FIP MULTIESTRATÉGIA
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 115.012.455,02</b>	<b>R\$ 100.000.000,00</b>	<b>R\$ 26.821.576,63</b>			

FONTE: NUGIN/Geprev

**EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FUNPREV**  
**Gráfico 4: Evolução do Patrimônio Líquido – FUNPREV – Março 2021 a Fevereiro 2022.**



FONTE: NUGIN/Geprev