



25144000085779



AO

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL - IPE PREV

Empresa/Razão Social: SMI PRIME – Consultoria de Investimentos Ltda.
CNPJ: 11.882.190/0001-34
Endereço: Rua Fúlvio Aducci, 627 – Sala 209, CEP 88.075-001 – Estreito – Florianópolis/SC
Telefone: (48) 3027 5200
Email: comercial@smiconsult.com.br

1 OBJETO

- 1.1 Fornecimento de sistema que deverá ser parametrizado a fim de atender as necessidades de análise e gestão de ativos financeiros da carteira de investimentos dos Fundoprevs.

2 FUNCIONALIDADES DISPONIBILIZADAS

- 2.1 Monitoramento dos limites da Política Anual de Investimentos do IPE Prev e da Resolução CMN nº 4.963/2021, ou a que vier a substituí-la, com dispositivo de alerta, no momento do cadastro das movimentações de aplicação/resgate, para eventuais desenquadramentos de ativos;
- 2.2 Utilização apenas de bancos de dados oficiais: Anbima, B3, CVM, CMN, Ministério da Fazenda;
- 2.3 Disponibilização das cotações dos ativos da carteira, assim que divulgadas pela CVM;
- 2.4 Possibilidade de cadastramento de até 3 (três) carteiras;
- 2.5 Precificação dos ativos, no que couber, pelas seguintes formas:
- a. Marcação a mercado;
 - b. Marcação na curva;
- 2.6 Relatórios, a qualquer tempo, com eventual customização, com os dados das carteiras de investimentos contendo, no mínimo:
- a. Rentabilidade dos ativos;
 - b. Risco e rating dos ativos;
 - c. Concentração por artigo da Resolução CMN nº 4.963/2021;
 - d. Concentração por administrador;
 - e. Concentração por custodiante;
 - f. Concentração por gestor;
 - g. Concentração por benchmarks;
 - h. Comparação com benchmarks customizáveis (exemplo: meta de rentabilidade);

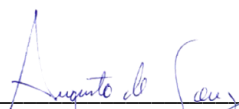


- 2.7 A pedido da contratante, para geração do Relatório de Gerenciamento de Ativos e Passivos (Asset Liability Management – ALM), realizar diagnóstico da carteira de investimentos, e gestão e revisão de alocação dos ativos, contendo:
- a. Estudo de otimização da carteira, com base em cenários econômicos, identificando os cenários que maximizam o retorno absoluto (estudo de fronteira eficiente tradicional), baseados no modelo de seleção de carteira de Markowitz;
 - b. Estudo de casamento de fluxo de caixa Cash Flow Matching – CFM.
- 2.8 Fornecimento de suporte técnico via e-mail, telefone e WhatsApp;
- 2.9 Entrega da totalidade dos dados e metadados da composição integral da carteira atualizada, sempre que solicitado pela contratante.

3 PROPOSTA

- 3.1 Valor mensal: R\$ 5.200,00 (CINCO MIL E DUZENTOS REAIS);
- 3.2 Valor anual: R\$ 62.400,00 (SESSENTA E DOIS MIL E QUATROCENTOS REAIS);
- 3.3 Validade da proposta: 90 (NOVENTA) dias.

Florianópolis/SC, 21 de outubro de 2025



Augusto de Souza
Sócio-Diretor
SMI PRIME - Consultoria de Investimentos Ltda