

O Presidente do Instituto de Gestão Previdenciária do Estado do Pará – IGPREV, no uso das atribuições conferidas pelo Decreto Governamental de 29/06/2020, publicado no DOE nº 34.267, de 30/06/2020.

Considerando que cabe à Administração Pública garantir a transparência e efetiva publicidade de seus atos, em respeito ao art. 37 da CF/88, sendo exceção apenas àqueles dispostos no art. 5º, LX da Constituição da República;

**RESOLVE:**

I – Toma Público o Relatório de Avaliação da Carteira de Investimentos - (FUNPREV/FINANPREV) – PERÍODO DE JANEIRO A AGOSTO DE 2021

**1. INTRODUÇÃO**

Os investimentos realizados ao longo de 2021 serão norteados pela Política de Investimento 2021 aprovada pelo Conselho Estadual de Previdência e aplicados conforme as disposições da Resolução 3.922/2010 – CMN e suas alterações, tendo presentes as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez e transparência.

O NUGIN vem acompanhando a carteira Igeprev ao longo desse período pandêmico, propondo alternativas na busca de minimizar os impactos causados pela volatilidade da carteira em um cenário econômico instável.

O Relatório de Avaliação da Carteira de Investimento (FUNPREV/FINANPREV) contém um balanço geral do desempenho das carteiras de investimentos geridas pelo IGPREV, registrando os eventos relevantes ocorridos durante o período de **janeiro a agosto de 2021**, assim como a proposta de alteração da carteira FUNPREV visando uma estratégia de hedge.

**2. CARTEIRA GLOBAL IGPREV/PA**

A carteira de investimentos do IGPREV Pará é composta por **62** fundos de investimentos distribuídos entre **17** gestores, além das **operações compromissadas (LFT) executadas pelo banco do Estado – Banpará**, que estão vinculados ao seu respectivo plano, quais sejam: Fundo Previdenciário (FUNPREV), Fundo Financeiro (FINANPREV) e o Sistema de Proteção Social dos Militares (SPSM).

Tabela 1: Carteira de Investimento Global – Agosto 2021

CARTEIRA	RECEITA		RENDIMENTO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	RETORNO AGOSTO		
	APLICAÇÃO	RESGATE			TIR	MA	TIR/MA
FUNPREV	R\$ 93.876.967,47	R\$ 82.500.000,00	-33.103.462,65	R\$ 4.211.293.592,79	-0,85%	1,12%	-75,94%
FINANPREV-FUNDOS	R\$ -	R\$ -	627.471,50	R\$ 228.742.939,04	0,28%	1,12%	24,59%
FINANPREV-LFT	R\$ 190.499.550,54	R\$ 166.970.188,96	R\$ 305.491,06	R\$ 37.637.078,49			
SPSM - LFT	R\$ 28.283.176,33	R\$ 19.254.410,45	R\$ 47.068,48	R\$ 9.074.026,67			
IGPREV/PA	R\$ 312.659.694,34	R\$ 268.724.599,41	-R\$ 32.123.431,61	R\$ 4.486.747.636,99			

Fonte: NUGIN

Tabela 2: Carteira de Investimento Global – Janeiro a Agosto 2021

CARTEIRA	RECEITA		RENDIMENTO ACUMULADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO 31/08/2021	RETORNO ANO		
	APLICAÇÃO	RESGATE			TIR	MA	TIR/MA
FUNPREV	R\$ 757.652.491,67	R\$ 914.681.938,66	R\$ 26.124.029,45	R\$ 4.211.293.592,79	0,36%	7,78%	4,69%
FINANPREV-FUNDOS	R\$ 68.827.501,69	R\$ 12.762.911,33	R\$ 2.651.520,51	R\$ 228.742.939,04	1,21%	7,78%	15,56%
FINANPREV-LFT	R\$ 1.211.219.644,29	R\$ 1.294.647.504,40	R\$ 1.453.933,08	R\$ 37.637.078,49			
SPSM - LFT	R\$ 28.283.176,33	R\$ 19.254.410,45	R\$ 47.068,48	R\$ 9.074.026,67			
IGPREV/PA	R\$ 2.037.699.637,65	R\$ 2.222.092.354,39	-R\$ 30.229.483,04	R\$ 4.477.673.610,32			

Fonte: NUGIN

Gráfico 1: Distribuição de Recurso por Instituição Financeira – Agosto 2021

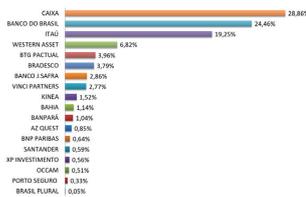


Gráfico 2: Distribuição de Recursos por Estratégia – Agosto 2021

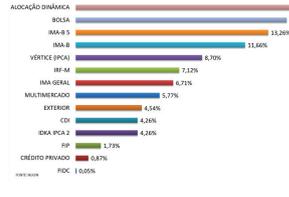
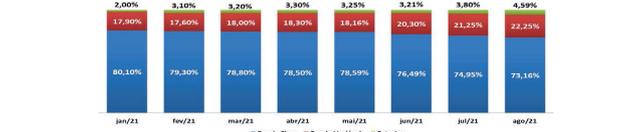


Gráfico 3: Participação por Segmento – Janeiro a Agosto 2021



**3. MONITORAMENTO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTO 2021.**

Tabela 3: Distribuição e Enquadramento dos Investimentos IGPREV/PA (FUNPREV+FINANPREV+SPSM) – 31/08/2021

Artigo	Tipo de Ativo	Valor (R\$)	Carteira %	Política de Investimentos 2021		
				Limite Inferior	Estratégia Alvo	Limite Superior
<b>Renda Fixa</b>						
Art. 7º, I "b"	Fundos 100% Títulos Públicos	R\$ 2.079.285.021,25	46,34%	0,00%	40,00%	70,00%
Art. 7º, II	Operações Compromissadas	R\$ 46.711.105,16	1,04%	0,00%	0,00%	5,00%
Art. 7º, III "a"	Fundos de Renda Fixa Referenciado	R\$ 372.977.281,08	8,31%	0,00%	2,00%	20,00%
Art. 7º, IV "a"	Fundos de Renda Fixa-Geral	R\$ 754.564.726,28	16,82%	0,00%	26,00%	40,00%
Art. 7º, VII "a"	FIDC Cota Senior	R\$ 2.280.642,06	0,05%	0,00%	0,03%	1,00%
Art. 7º, VIII "b"	Fundos de Crédito Privado	R\$ 39.091.618,24	0,87%	0,00%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>R\$ 3.294.910.394,07</b>	<b>73,44%</b>		<b>70,03%</b>	
<b>Renda Variável</b>						
Art. 8º, I "a"	Fundos de Ações - Índices de Ações	R\$ 18.396.650,75	0,41%	0,00%	0,00%	5,00%
Art. 8º, II "a"	Fundos de Ações - Geral	R\$ 633.027.896,52	14,14%	0,00%	11,41%	20,00%
Art. 8º, III	Fundos Multimercados	R\$ 258.954.510,09	5,77%	0,00%	9,00%	10,00%
Art. 8º, IV "a"	Fundos de Participações (FIP)	R\$ 77.626.917,22	1,73%	0,00%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>R\$ 988.006.974,68</b>	<b>22,02%</b>		<b>21,47%</b>	
<b>Investimento no Exterior</b>						
Art. 9º, II "a"	Fic - Aberto- Investimento no Exterior	R\$ 62.180.872,51	1,39%	0,00%	7,50%	10,00%
Art. 9º, III "a"	Fic - Fechado- BDR Nível I	R\$ 141.650.395,73	3,16%	0,00%	1,00%	5,00%
<b>Total Investimento Exterior</b>		<b>R\$ 203.831.268,24</b>	<b>4,64%</b>		<b>8,50%</b>	
<b>Total da Carteira</b>		<b>R\$ 4.486.747.636,99</b>	<b>100,00%</b>		<b>100,00%</b>	

Fonte: NUGIN

**4. CARTEIRA FUNPREV**

Tabela 4: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Fixa – Janeiro a Agosto 2021

FUNDOS DE INVESTIMENTOS	AGOSTO		ANO		RENDIMENTO		PATRIMÔNIO	
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	AGOSTO	ANO	LÍQUIDO	%
Art. 7º, III, "a" - FI 100% Títulos Públicos					(5.743.316,12)	(9.992.054,24)	2.065.409.489,13	49,06%
BB IMMA-B 5 Títulos Públicos FI RF Previdenciário	0,00%	0,00%	-2,82%	-36,29%			128.949,61	0,00%
BB IMMA-B 5 FIC RF Previdenciário LP	0,10%	9,26%	1,30%	16,67%	211.397,93	2.613.665,76	204.273.515,86	4,85%
BB IDK-IPCA 2 Títulos Públicos FI RF Previdenciário	0,00%	0,00%	0,50%	6,46%			113.238,14	0,00%
BB Títulos Públicos (PCA I) FI RF Previdenciário	0,46%	40,97%	3,37%	43,31%	154.577,78	1.125.035,89	33.502.519,24	0,80%
BB Títulos Públicos (PCA II) FI RF Previdenciário	0,35%	40,52%	3,34%	43,87%	440.733,79	3.055.922,54	95.345.485,36	2,39%
BB Títulos Públicos (PCA VI) FI RF Previdenciário	0,30%	26,42%	2,17%	27,95%	270.875,87	2.035.114,41	93.177.373,97	2,21%
BB Títulos Públicos (PCA VII) FI RF Previdenciário	0,45%	40,50%	3,32%	42,72%	201.418,19	1.464.451,05	44.139.816,35	1,05%
BB Alocação Ativa FIC RF Previdenciário	-0,45%	-40,12%	-1,37%	-17,67%	(1.195.269,05)	(3.692.329,39)	265.084.000,22	6,29%
BB IRF-M Títulos Públicos FI RF Previdenciário	-0,65%	-57,70%	-2,82%	-36,29%	(2.077.055,54)	(13.895.469,12)	319.590.699,96	7,59%
BGF Pactual 2024 Títulos Públicos FI RF	-2,62%	-234,00%	-3,49%	-42,80%	1.743,45	123.144,75	7.731.755,60	0,17%
Bradesco Institucional IMMA-B 7 FIC RF	-1,12%	-74,76%	-1,12%	-14,13%	(519.674,40)	(1.117.112,19)	46.041.578,40	1,09%
Caixa Brasil IRF-M 1 Títulos Públicos FI RF LP	0,00%	0,00%	-1,21%	-15,55%			(3.117.699,95)	0,00%
Caixa Brasil IRF-M 1 Títulos Públicos FI RF LP	0,00%	0,00%	-2,21%	-28,42%			(628.242,74)	0,00%
Caixa Brasil Gestão Estratégica FIC RF	-1,45%	-129,57%	-1,51%	-19,45%	(3.474.148,66)	(4.215.105,35)	236.191.116,06	5,61%
Caixa Brasil 2024 Títulos Públicos FI RF	-2,62%	-237,58%	-3,05%	-64,91%	(14.114,11)	(26.423,36)	36.044.137,68	0,86%
Caixa Brasil 2024 Títulos Públicos FI RF	-2,64%	-236,33%	-3,13%	-66,00%	(12.295,10)	(26.544,94)	29.912.420,00	0,71%
Caixa Brasil 2024 Títulos Públicos FI RF	-2,60%	-237,47%	-3,07%	-65,15%	(19.903,51)	(38.770,57)	50.150.520,00	1,19%
Caixa Brasil IMMA-B 5 Títulos Públicos FI RF LP	0,13%	11,96%	1,30%	16,77%	243.967,97	2.349.335,69	182.525.930,80	4,33%
Caixa Brasil IDK-IPCA 2A 2A FI RF LP	0,19%	17,37%	1,69%	21,79%	343.720,63	2.953.031,31	177.224.552,99	4,21%
Caixa Brasil IDK-IPCA 2A 2A FI RF LP	0,14%	12,14%	1,32%	17,01%	282.044,96	2.714.377,05	209.936.420,63	4,94%
Safra IMMA FIC RF	-1,59%	-141,86%	-4,31%	-55,44%	(581.165,83)	(1.623.678,41)	36.037.683,01	0,86%

Fonte: NUGIN

FUNDOS DE INVESTIMENTOS	AGOSTO		ANO		RENDIMENTO		PATRIMÔNIO	
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	AGOSTO	ANO	LÍQUIDO	%
Art. 7º, III, "a" - FI De Renda Fixa Referenciado					(3.961.462,66)	(8.064.765,05)	372.977.281,08	8,86%
Caixa Novo Brasil FIC RF Referenciado IMMA-B LP	-1,12%	-100,33%	-2,32%	-29,80%	(3.948.259,10)	(8.251.764,68)	347.291.281,45	8,26%
Xp Inflação FI RF Referenciado (PCA) LP	-0,05%	-4,68%	0,75%	9,62%	(13.203,54)	(26.544,94)	25.185.999,53	0,59%
Art. 7º, IV, "a" - Fundos de Renda Fixa Geral					(1.244.797,14)	(4.744.988,81)	578.788.937,60	13,74%
BNP Paribas Inflação FIC RF	-1,37%	-122,32%	-3,34%	-42,92%	(264.141,03)	(657.256,07)	19.037.603,81	0,45%
Bradesco H Nilo FI RF	-1,59%	-141,95%	-3,69%	-47,45%	(1.156.003,06)	(2.744.389,82)	71.636.199,46	1,70%
Insti Institucional Alocação Dinâmica FIC RF	0,31%	27,40%	1,47%	18,96%	1.044.867,93	6.973.511,81	425.397.541,13	10,10%
Western Asset IMMA-B Ativo RF	-1,70%	-152,15%	-3,72%	-73,60%	(666.317,78)	(2.336.055,04)	38.478.412,27	0,91%
Western Asset IMMA-B Ativo RF	-0,83%	-74,31%	-5,24%	-39,14%	(203.923,21)	(703.112,95)	24.233.177,94	0,56%
Art. 7º, VII, "a" - FIDC Cota Senior					(8.083,63)	5.925.127,93	2.280.642,06	0,05%
BBF Master FIDC LP	-0,35%	-31,57%	28,45%	365,86%	(8.083,63)	5.925.127,93	2.280.642,06	0,05%
<b>SUBTOTAL RENDA FIXA</b>					<b>(10.957.659,58)</b>	<b>(17.076.662,54)</b>	<b>3.019.456.349,87</b>	<b>71,70%</b>

Fonte: NUGIN

**OBSERVAÇÕES:**

- No segmento de Renda fixa, a maioria dos fundos de investimentos apresentou desempenho negativo ao longo do ano principalmente os fundos atrelados ao indicador IRFM. O **FI BB IRF M Títulos Públicos FI RF Previdenciário** apresentou o pior desempenho para carteira, registrando uma **variação negativa** de **R\$ 13.895.469,12**. O fundo representa 7,59% da carteira FUNPREV;
- O fundo destaco no segmento de Renda Fixa foi o **FI Itaú Institucional Alocação Dinâmica FIC**, registrando no ano uma **variação positiva** de **R\$ 6.973.511,81**, representando 10,10% da carteira FUNPREV.

Tabela 5: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Variável – Janeiro a Agosto 2021

FUNDOS DE INVESTIMENTOS	AGOSTO		ANO		RENDIMENTO		PATRIMÔNIO	
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	AGOSTO	ANO	LÍQUIDO	%
Art. 8º, I, "a" - Fundos de Ações - Índices de Ações					(978.858,41)	(2.942.852,45)	28.896.692,75	0,44%
Itaú FOF RPI Ibovespa Ativo FIC Ações	-1,13%	-280,02%	-1,93%	-24,85%	(51.144,80)	(131.127,74)	15.990.248,60	0,38%
Caixa Brasil Índice Ibovespa FIC Ações	-2,50%	-224,31%	-4,83%	-4,83%	(61.689,11)	(9.064,71)	2.406.402,15	0,06%
Art. 8º, II, "a" - Fundos de Ações - Geral					(26.836.377,94)	(84.722.616,86)	633.027.896,52	15,03%
Ar Quasi Ações FIC Ações	-3,20%	-470,43%	-3,07%	-39,52%	(86.916,76)	(49.605,48)	1.564.549,12	0