

	ESTRATÉGIA	STATUS
JUNHO	Realizar realocação da carteira FUNPREV para atendimento as estratégias da Política de Investimentos; • Aumentar participação da renda variável (Ibovespa, Multimercado e Fundos no Exterior) • Aumentar participação em fundos de Renda Fixa de Alocação Dinâmica; • Zerar participação nos ativos com risco inflacionário (IRF-M);	Continuar com a proposta de realocação
	Receita de Fundos desenquadrados Aplicar em fundos de renda variável (Ibovespa)	Aplicado receita do fundo Itaú Institucional Phoenix
	Resgates efetuados Resgatar de fundos atrelados ao IRFM.	Resgate para chamada de capital, atendimento LC 125/2019 e Taxa de Administração
JULHO	Realizar realocação da carteira FUNPREV para atendimento as estratégias da Política de Investimentos; • Aumentar participação da renda variável (Ibovespa e Fundos no Exterior - BDR) • Zerar participação nos ativos com risco inflacionário (IRF-M);	Realocação parcialmente realizada (R\$ 80.000.000,00 - Relatório de aplicação e resgate nº 040/2021 aprovado pela DIREX): • Foi reduzido a posição em IRFM, a estratégia é zerar posição • Aplicação em ações e BDR
	Resgates efetuados Resgatar de fundos atrelados ao IRFM.	Resgate para atendimento LC 125/2019 e Taxa de Administração
	Enviar Informações das carteiras para elaboração da ALM pela empresa LDB	Aguardando elaboração da ALM
AGOSTO	Realizar realocação da carteira FUNPREV para atendimento as estratégias da Política de Investimentos; • Aumentar participação da renda variável (Multimercado - S&P e Fundos no Exterior - BDR) • Zerar participação nos ativos com risco inflacionário (IRF-M);	Aguardando relatório de ALM para continuar com as propostas de realocações estratégicas.
	Receita de Fundos desenquadrados Aplicar em fundos de renda variável (Ibovespa, BDR e Multimercado S&P)	Aplicação da receita proveniente do fundo Itaú Alocação Dinâmica
	Receita de Arrecadação Previdenciária e Amortização Aplicar em fundos de renda variável (Ibovespa, Multimercado S&P)	Aplicação realizada em fundos de ações e multimercado S&P

5. CARTEIRA FINANPREV

Tabela 9: Carteira de Investimentos – FINANPREV – Janeiro a Agosto 2021

FUNDO DE INVESTIMENTOS	AGOSTO		ANO		RENDIMENTO		PATRIMÔNIO 31/08/2021
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	AGOSTO	ANO	
Art. 7º, I, "b" - FI 100% Títulos Públicos					26.911,09	48.449,52	13.875.532,12
CAIXA BRASIL IRE-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	0,00%	0,00%	-1,60%	-21,89%	-	182.753,66	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP	0,19%	27,85%	1,69%	23,13%	26.911,09	231.203,19	13.875.532,12
Art. 7º, IV, "a" - Fundos de Renda Fixa Geral					422.257,64	1.668.611,61	175.775.788,68
BRADESCO HI NULO RF	0,00%	0,00%	-0,65%	-8,87%	-	5.815,07	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	0,31%	43,93%	1,47%	20,12%	14.814,60	70.443,37	4.847.970,28
SANTANDER ATIVO FIC RF	0,23%	32,60%	0,58%	7,90%	60.106,08	84.918,38	26.480.914,95
BRADESCO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	0,49%	70,14%	2,34%	31,90%	94.890,44	445.089,44	19.484.279,24
BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO	0,45%	64,08%	2,17%	29,66%	7.759,66	37.082,13	1.748.205,95
WESTERN ASSET ATIVO FI RF	0,15%	21,50%	0,43%	5,92%	136.133,95	551.173,78	80.870.488,98
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	0,40%	57,69%	1,95%	26,62%	71.036,80	339.009,45	17.719.479,31
PORTO SEGURO CLASSICO FIC RF LP	0,26%	36,85%	0,71%	9,69%	37.516,10	146.710,12	14.629.450,00
Art. 7º, VII, "b" - Fundos de Crédito Privado					178.302,78	934.459,38	39.091.618,24
BTG PACTUAL YIELD FI RF REF. DI CRÉDITO PRIVADO	0,46%	65,67%	2,45%	33,42%	178.302,78	934.459,38	39.091.618,24
FINANPREV	0,28%	24,59%	1,21%	15,56%	627.471,50	2.651.520,51	228.742.939,04

Gráfico 7: Evolução do Patrimônio Líquido – FINANPREV – Janeiro a Agosto 2021

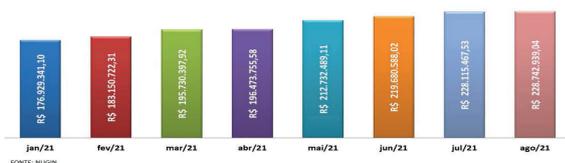
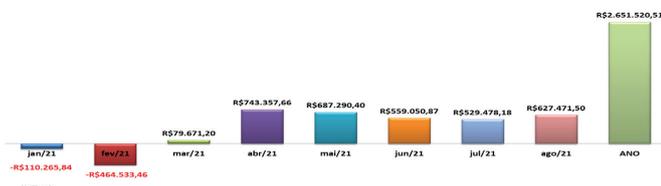


Gráfico 8: Evolução do Rendimento do FINANPREV – Janeiro a Agosto 2021



5.1. MOVIMENTAÇÕES NA CARTEIRA FINANPREV

Tabela 10: Movimentação FINANPREV – Fundos de Investimentos– Janeiro a Agosto 2021

MÊS	Aplicação Saldo Poderes	Resgate	Realocação Estratégica
JAN	R\$ 7.012.778,77	-	-
FEV	R\$ 6.685.914,67	-	-
MAR	R\$ 13.161.368,55	R\$ 661.364,13	-
MAI	R\$ 15.571.443,13	-	-
JUN	R\$ 6.389.048,04	-	-
JUL	R\$ 7.905.401,33	-	R\$ 12.101.547,20
TOTAL	R\$ 56.725.954,49	R\$ 661.364,13	R\$ 12.101.547,20

Observações:

- No período informado foi aplicado o valor de R\$ 56.725.954,49, proveniente do Saldo Positivo dos Poderes (TJE, DEFENSORIA PÚBLICA, MPCM, MPE e ALEPA);

- Em março, a ALEPA solicitou o resgate no valor de R\$ 661.364,13 para pagamento de folha e antecipação de 13º dos servidores.
- Em Julho, o NUGIN recomendou a realocação do Finanprev, visando adequar a carteira ao cenário atual, solicitando resgate das categorias IMA-B e IRF-M, e destinando o recurso para categoria Alocação Dinâmica. A realocação no valor de R\$ 12.101.547,20 foi aprovada pela Diretoria Executiva e executada pelo NUGIN.
- Em Abril e Agosto não houve movimentações na carteira.

Tabela 11: Movimentação FINANPREV – Op. Compromissada (LFT) – Janeiro a Agosto 2021

	Aplicação	Resgate	Rendimento
JANEIRO	R\$ 48.398.226,63	R\$ 151.590.733,25	R\$ 110.569,94
FEVEREIRO	R\$ 99.340.264,93	R\$ 91.937.234,65	R\$ 49.630,26
MARÇO	R\$ 139.112.489,53	R\$ 149.837.286,65	R\$ 91.026,39
ABRIL	R\$ 188.708.896,55	R\$ 180.845.460,44	R\$ 145.757,36
MAIO	R\$ 176.420.228,34	R\$ 184.882.911,12	R\$ 211.237,83
JUNHO	R\$ 211.372.903,72	R\$ 182.353.368,34	R\$ 225.431,35
JULHO	R\$ 157.367.084,05	R\$ 186.230.320,99	R\$ 314.788,89
AGOSTO	R\$ 190.499.550,54	R\$ 166.970.188,96	R\$ 305.491,06
TOTAL	R\$ 1.211.219.644,29	R\$ 1.294.647.504,40	R\$ 1.453.933,08

6. SISTEMA DE PROTEÇÃO SOCIAL DOS MILITARES – SPSM

Tabela 12: Movimentação SPSM – Op. Compromissada (LFT) – Agosto 2021

	Aplicação	Resgate	Rendimento
AGOSTO	R\$ 28.283.176,33	R\$ 19.254.410,45	R\$ 47.068,48
TOTAL	R\$ 28.283.176,33	R\$ 19.254.410,45	R\$ 47.068,48

7. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO – TA

Para custear as despesas administrativas do Instituto, além das receitas arrecadadas do FUNPREV pelo setor de arrecadação, também foram utilizados, no período de **janeiro a agosto de 2021**, recursos da carteira FUNPREV no valor de **R\$ 5.669.770,00** (cinco milhões, seiscentos e sessenta e nove mil, setecentos e setenta reais). Os recursos foram resgatados do fundo **BB IRF-M Títulos Públicos FI Renda Fixa Previdenciário**.

8. TRANSFERÊNCIA RENDIMENTO FUNPREV PARA FINANPREV – ATENDIMENTO A LEI COMPLEMENTAR 115/2017 E 125/2019.

Tabela 13: Transferência FUNPREV para FINANPREV – 2016 A 2021 (até 31/08/2021).

PERÍODO	DESCRIÇÃO	VALOR
2016	TRANSFERÊNCIA RENDIMENTO ANO DE 2016	R\$ 652.065.924,15
2017	TRANSFERÊNCIA RENDIMENTO ANO DE 2017	R\$ 576.435.802,81
2018	TRANSFERÊNCIA RENDIMENTO ANO DE 2018	R\$ 411.344.663,66
2019	TRANSFERÊNCIA RENDIMENTO ANO DE 2019	R\$ 629.863.135,36
2020	TRANSFERÊNCIA RENDIMENTO ANO DE 2020	R\$ 209.416.677,77
2021	TRANSFERÊNCIA RENDIMENTO ANO DE 2021	R\$ 80.224.987,67
TOTAL		R\$ 2.559.351.191,42

Fonte: NUGIN

Para atendimento da Lei Complementar 115/2017, alterada pela 125/2019, já foram transferidos do Funprev para o Finanprev o valor de R\$ 2.559.351.191,42, no período de 2016 até agosto de 2021. Em 2021 foi transferido o valor de **R\$ 80.224.987,67** (oitenta milhões, duzentos e vinte e quatro mil, novecentos e oitenta e sete reais e sessenta e sete centavos) para pagamento de benefícios previdenciários.

Conforme apresentado na tabela a seguir, a carteira FUNPREV, em 2021, apresentou uma variação negativa no valor de **R\$ 93.868.805,54**. Com o objetivo de compensar o saldo negativo e preservar o Patrimônio do FUNPREV, já foi compensado no 1º semestre o valor de **R\$ 39.767.847,31**.

A variação negativa dos meses de julho e agosto no total de **R\$ 54.100.958,22** ainda serão compensadas nos meses subsequentes quando o resultado for positivo, dessa forma o patrimônio líquido do FUNPREV será preservado.

Tabela 14: Compensação

Meses	Rendimento mensal	Compensação	Saldo a transferir*	Saldo a compensar
jan/21	-18.759.789,79		0,00	-18.759.789,79
fev/21	-21.008.057,53		0,00	-39.767.847,32
mar/21	16.125.109,46	16.125.109,46	0,00	-23.642.737,85
abr/21	46.948.066,10	23.642.737,85	23.305.328,25	
mai/21	48.433.004,41		48.433.004,41	
jun/21	8.486.655,01		8.486.655,01	
jul/21	-20.997.495,57			-20.997.495,57
ago/21	-33.103.462,65			-54.100.958,22
Total	26.124.029,44	39.767.847,31	80.224.987,67	

*O saldo é transferido no mês subsequente