

3. MONITORAMENTO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTO 2021.

Tabela 2: Distribuição e Enquadramento dos Investimentos IGPREV/PA (FUNPREV+FINANPREV+SFSM) – Setembro/2021

Artigo	Tipo de Ativo	Valor (R\$)	Carteira %	Política de Investimentos 2021			
				Limite Inferior	Estratégia Ativo	Limite Superior	Limite Legal
Renda Fixa							
Art. 7º, I "b"	Fundos 100% Títulos Públicos	RS 2.087.463.764,19	47,12%	0,00%	40,00%	70,00%	100%
Art. 7º, II	Operações Compromissadas	RS 27.351.866,19	0,62%	0,00%	0,00%	5,00%	5%
Art. 7º, III "a"	Fundos de Renda Fixa Referenciado	RS 372.657.807,73	8,41%	0,00%	2,00%	20,00%	60%
Art. 7º, IV "a"	Fundos de Renda Fixa-Geral	RS 762.431.771,16	17,21%	0,00%	26,00%	40,00%	40%
Art. 7º, VII "a"	FIDC Cota Senior	RS 2.272.355,72	0,05%	0,00%	0,03%	1,00%	5%
Art. 7º, VII "b"	Fundos de Crédito Privado	RS 39.287.280,36	0,89%	0,00%	2,00%	5,00%	5%
Total Renda Fixa							
		RS 3.291.464.845,35	74,29%	-	70,03%	-	-
Renda Variável							
Art. 8º, I "a"	Fundos de Ações - Índices de Ações	RS 17.182.964,91	0,39%	0,00%	0,00%	5,00%	30%
Art. 8º, II "a"	Fundos de Ações - Geral	RS 588.438.180,90	13,28%	0,00%	11,47%	20,00%	20%
Art. 8º, III	Fundos Multimercados	RS 253.646.297,83	5,73%	0,00%	8,00%	10,00%	10%
Art. 8º, IV "a"	Fundos de Participações (FIP)	RS 936.143.403,92	21,13%	-	21,47%	-	-
Total Renda Variável							
		RS 1.914.993.567,56	43,71%	-	42,44%	-	-
Investimento no Exterior							
Art. 9º, II "a"	Fic - Aberto- Investimento no Exterior	RS 61.007.549,01	1,38%	0,00%	7,60%	10,00%	10%
Art. 9º, III "a"	Fundos de Ações - BDR Nível I	RS 141.671.386,63	3,20%	0,00%	1,00%	5,00%	10%
Total Investimento Exterior							
		RS 202.678.935,64	4,57%	-	8,60%	-	-
Total da Carteira							
		RS 4.430.287.184,81	100,00%	-	100,00%	-	-

Fonte: NUGIN

Observacional:

Com a perda do status de Investidor Qualificado no mês de maio/2021, o Igprev/PA fica impossibilitado de realizar novos aportes em fundos exclusivos para este status de investidor, como é o caso dos fundos classificados no Art. 8º IV "a" e Art. 9º III "a".

4. CARTEIRA FUNPREV

4.1. COMPOSIÇÃO POR FUNDOS DE INVESTIMENTO

Tabela 3: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Fixa – Setembro 2021

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	SETEMBRO		ANO		VOL 12 meses	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META				
Art. 7º, I, "b" - FIDC 100% Títulos Públicos								
BB IMA-85 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	0,98%	69,36%	2,29%	24,60%	2,50%	RS 1.996.947,56	RS 206.270.463,43	4,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FIC RF PREVIDENCIÁRIO	1,30%	92,47%	4,72%	50,73%	1,60%	RS 436.629,23	RS 33.939.188,47	0,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FIC RF PREVIDENCIÁRIO	1,30%	92,17%	4,68%	50,33%	1,59%	RS 1.251.659,97	RS 97.596.105,32	2,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FIC RF PREVIDENCIÁRIO	1,19%	84,11%	3,38%	36,41%	2,14%	RS 1.104.671,73	RS 94.282.045,70	2,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VII FIC RF PREVIDENCIÁRIO	1,30%	92,01%	4,66%	50,15%	1,59%	RS 572.411,86	RS 44.712.228,22	1,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	-0,38%	-1,38%	-14,84%	2,69%	RS 14.081,51	RS 265.069.918,71	6,36%
BB IFI ATIVOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	-0,38%	-26,66%	-3,19%	-34,29%	2,92%	RS 1.201.115,34	RS 218.389.584,62	7,63%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF	1,11%	79,07%	-2,26%	-24,29%	4,30%	RS 80.601,12	RS 7.312.356,72	0,18%
BRASECO INSTITUCIONAL IMA-B5 FIC RF	-0,16%	-11,45%	-2,57%	-27,62%	5,33%	RS 74.324,59	RS 45.967.253,81	1,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	0,355%	25,18%	-1,16%	-12,51%	2,44%	RS 838.369,18	RS 237.029.485,24	5,68%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF	0,98%	68,28%	-4,13%	-44,47%	5,02%	RS 346.904,76	RS 36.391.042,44	0,87%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF	0,98%	68,13%	-4,22%	-45,42%	5,01%	RS 287.260,07	RS 30.200.890,00	0,72%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF	0,98%	68,24%	-4,15%	-44,58%	5,03%	RS 482.400,00	RS 50.623.920,00	1,21%
CAIXA BRASIL IMA-B5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF LP	0,98%	69,60%	2,30%	24,72%	2,48%	RS 1.790.698,14	RS 184.216.633,94	4,42%
CAIXA BRASIL IDCA ICA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF LP	1,08%	76,50%	2,79%	30,03%	2,45%	RS 1.911.037,27	RS 179.135.590,27	4,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B5 FIC RF I	0,98%	69,86%	2,32%	24,96%	2,48%	RS 2.047.549,29	RS 209.983.969,92	5,04%
SAPRA IMA FIC RF	-0,62%	-44,27%	-4,91%	-52,80%	6,22%	RS 224.873,12	RS 35.812.809,89	0,86%
Art. 7º, III, "a" - Fundos de Renda Fixa Referenciado								
CAIXA NOVO BRASIL FIC RF REFERENCIADO IMA-B LP	-0,14%	-10,11%	-2,46%	-26,43%	5,33%	RS 456.534,89	RS 347.294.746,56	8,33%
IPCA INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	0,70%	49,59%	1,45%	15,62%	3,51%	RS 176.061,51	RS 25.363.061,17	0,61%
Art. 7º, IV, "a" - Fundos de Renda Fixa Geral								
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	-0,36%	-25,30%	-3,68%	-39,61%	5,73%	RS 67.877,87	RS 18.969.725,93	0,45%
BRASECO H NILO FIC RENDA FIXA	-0,30%	-21,52%	-3,98%	-42,84%	6,12%	RS 217.242,27	RS 71.418.957,19	1,71%
ITAÚ INSTIT. ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,84%	59,38%	2,32%	25,00%	0,68%	RS 3.555.086,43	RS 46.552.627,56	10,23%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO RENDA FIXA	-0,51%	-35,98%	-6,20%	-66,72%	6,89%	RS 195.128,59	RS 38.285.286,67	0,92%
WESTERN ASSET ATIVO RENDA FIXA	-0,22%	-15,31%	-3,25%	-34,99%	4,03%	RS 52.327,15	RS 24.180.890,11	0,55%
Art. 7º, VII "a" - FIDC Cota Senior								
BBIF MASTER FIDC LP	-0,36%	-25,78%	27,98%	301,04%	21,65%	RS 8.286,34	RS 2.272.355,72	0,05%
SUBTOTAL RENDA FIXA						RS 14.327.565,79	RS 3.031.383.915,66	72,69%

Fonte: NUGIN

Tabela 4: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Variável – Setembro 2021

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL	JULHO		ANO		VOL 12 meses	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META				
Art. 8º, inciso I, alínea "a" - FIDC - Índices de Ações								
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-6,60%	-468,51%	-8,41%	-90,46%	19,44%	RS 1.055.925,50	RS 14.934.323,10	0,36%
CAIXA BRASIL IDCA IBOVESPA FIC AÇÕES	-6,56%	-465,12%	-6,91%	-74,30%	20,71%	RS 157.760,34	RS 2.426.641,81	0,05%
Art. 8º, inciso II, alínea "a" - Fundos de Ações - Geral								
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-4,58%	-324,99%	-7,51%	-90,83%	18,91%	RS 71.666,21	RS 1.492.882,91	0,04%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-6,13%	-435,23%	-9,10%	-100,21%	19,75%	RS 228.781,19	RS 3.500.635,09	0,14%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIC AÇÕES	-5,27%	-373,58%	-3,44%	-37,03%	21,58%	RS 316.926,86	RS 570.853,56	0,14%
BRASECO MID SMALL CAPS FIC AÇÕES	-3,91%	-277,16%	2,47%	26,55%	20,07%	RS 853.861,41	RS 21.003.485,18	0,50%
BRASECO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	-7,36%	-522,02%	-10,37%	-111,59%	20,07%	RS 298.801,51	RS 3.699.255,38	0,09%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-8,84%	-627,25%	-15,32%	-164,81%	20,84%	RS 10.799.181,09	RS 111.348.624,75	2,67%
ITAÚ DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-4,87%	-345,46%	-7,28%	-78,33%	19,62%	RS 127.743,02	RS 2.495.762,45	0,06%
ITAÚ DYNAMIS FIC AÇÕES	-6,52%	-462,71%	-6,57%	-6,09%	18,86%	RS 2.874.502,47	RS 41.202.215,89	0,99%
ITAÚ INSTITUCIONAL FOF GENESIS FIC AÇÕES	-6,72%	-476,41%	-9,41%	-101,23%	21,70%	RS 2.417.200,07	RS 33.580.074,73	0,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-8,10%	-574,40%	-3,72%	-40,07%	21,70%	RS 7.478.743,12	RS 84.896.037,79	2,04%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-6,97%	-494,79%	-8,19%	-88,15%	19,10%	RS 4.011.335,22	RS 53.507.381,52	1,28%
VINCI SELECTION EQUITIES FIC AÇÕES	-5,28%	-374,64%	-0,22%	-2,40%	17,81%	RS 1.260.504,16	RS 22.610.331,74	0,54%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-4,19%	-297,22%	-4,11%	-4,46%	19,57%	RS 1.524.016,31	RS 34.855.104,14	0,84%
SAPRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC AÇÕES	-8,34%	-591,44%	-9,85%	-105,93%	19,17%	RS 1.603.024,14	RS 17.626.568,74	0,42%
BANIIA AM VALUATION FIC AÇÕES	-6,39%	-455,68%	-15,33%	-164,97%	19,86%	RS 3.276.359,03	RS 47.960.462,64	1,15%
OCOM FIC AÇÕES	-6,93%	-491,51%	-15,05%	-161,87%	15,11%	RS 1.580.868,59	RS 21.232.473,90	0,51%
BB QUANTITATIVE FIC AÇÕES	-3,98%	-282,52%	-7,23%	-77,76%	20,20%	RS 1.572.805,00	RS 37.924.878,82	1,01%
SAPRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-8,94%	-634,10%	-14,28%	-153,65%	18,49%	RS 4.298.285,71	RS 43.794.238,63	0,95%
Art. 8º, inciso III - Fundos Multimercados								
SAPRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	-4,57%	-324,29%	17,12%	184,18%	13,75%	RS 1.135.443,56	RS 23.705.965,82	0,57%
WESTERN ASSET US INDEX SDI FIC MULTIMERCADO	-4,60%	-326,49%	17,21%	185,18%	13,89%	RS 2.236.997,90	RS 46.374.075,85	1,11%
VINCI VALOREM FIC MULTIMERCADO	1,33%	94,60%	3,30%	35,47%	1,65%	RS 462.288,75	RS 35.132.248,01	0,84%
BRASECO MACRO INST. FIC MULTIMERCADO	-0,83%	-2,14%	-0,23%	2,10%	1,00%	RS 2.105,50	RS 7.016.758,88	0,17%
CAIXA ALCAO MACRO BDR FIC MULTIMERCADO LP	-0,74%	-52,49%	0,59%	6,37%	1,71%	RS 809.134,57	RS 106.565.744,95	2,60%
ITAÚ PRIVATE SP&SOP BRL FIC MULTIMERCADO	-4,61%	-326,88%	-1,74%	-18,70%	13,90%	RS 1.586.828,09	RS 32.854.503,31	0,79%
Art. 8º, inciso IV, alínea "a" - Fundos de Participações (FIP)								
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FIP	-0,10%	-7,43%	-13,13%	-141,27%	29,77%	RS 9.844,50	RS 9.388.814,68	0,23%
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDEER INST. I MULT. FIP	-1,09%	-77,07%	25,36%	272,82%	55,01%	RS 741.123,43	RS 67.147.185,60	1,62%
SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL						RS 51.862.570,76	RS 936.143.403,92	22,45%

Fonte: NUGIN

Tabela 5: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Investimento no Exterior e TOTAL – Setembro 2021

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - EXTERIOR	SETEMBRO		ANO		VOL 12 meses	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META				
Art. 9º, inciso II, alínea "a" - Fic - Aberto- Investimento no Exterior								
VINCI INTERNACIONAL INVEST. EXTERIOR FIC MULTIME	2,36%	167,58%	8,62%	92,74%	14,68%	RS 198.695,25	RS 8.610.942,62	0,21%
WA MACRO OPPORTUNITIES EXTERIOR FIC MULTIMERC	-0,66%	-46,91%	6,62%	71,17%	6,64%	RS 177.425,10	RS 26.653.936,87	0,64%
LM CLEARBRIEF US LARGE CAP GROWTH EXTERIOR FIC	-4,43%	-314,63%	11,71%	126,02%	15,11%	RS 1.194.593,64	RS 25.742.669,52	0,62%
Art. 9º, inciso III, alínea "a" - Fundos de Ações - BDR Nível I								
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,25%	-17,74%	16,72%	179,90%	18,25%	RS 228.756,17	RS 91.238.684,43	2,19%
WESTERN ASSET FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,50%	35,31%	3,32%	35,76%	18,30%	RS 249.746,97	RS 50.432.702,10	1,21%
SUBTOTAL INVESTIMENTO NO EXTERIOR						RS 1.152.332,70	RS 202.678.935,64	4,86%
TOTAL FUNPREV						RS 38.687.337,67	RS 4.170.206.255,12	100,00%

Fonte: NUGIN

4.2. MOVIMENTAÇÕES DA CARTEIRA

Tabela 6: Movimentações FUNPREV – Setembro 2021

MOVIMENTAÇÕES - FUNPREV-SETEMBRO 2021			
DATA	RESGATE	FUNDO DE INVESTIMENTO	DESCRIÇÃO
15/09/2021	RS 900.000,00	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	Taxa de Administração
21/09/2021	RS 1.500.000,00	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	Taxa de Administração
TOTAL	RS 2.400.000,00		

4.3. EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FUNPREV

Gráfico 4: Evolução do Patrimônio Líquido – FUNPREV – Janeiro a Setembro 2021.

