

O Presidente do Instituto de Gestão Previdenciária do Estado do Pará – IGEPREV, 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 – Torna Público o **Relatório Anual de Avaliação da Carteira de Investimentos - (FUNPREV/FINANPREV) – Ano 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.

Em cumprimento as diretrizes da Política de Investimento 2021, o **Relatório Anual de Avaliação da Carteira de Investimento (FUNPREV/FINANPREV)** contém um balanço geral do desempenho das carteiras de investimentos geridas pelo IGEPREV, registrando todos os eventos relevantes ocorridos no **ano de 2021** para a gestão de recursos previdenciários.

2. CARTEIRA GLOBAL IGEPREV/PA

A carteira de investimentos do IGEPREV Pará é composta por **66 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 Sistema Social de Proteção dos Militares (SPSM).

Tabela 1: Carteira de Investimento Global – Dezembro 2021

GLOBAL DEZEMBRO	CARTEIRA	RECEITA		RENDIMENTO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	RETORNO MÊS		RETORNO ANO	
		APLICAÇÃO	RESGATE			TIR	MA	TIR	MA
FUNPREV	R\$	8.958.125,82	R\$	3.702.161,00	R\$	37.087.511,37	R\$	4.176.772.202,05	0,90%
									0,98%
FINANPREV-FUNDOS	R\$	56.280.172,45	R\$	50.000.000,00	R\$	2.108.355,68	R\$	251.648.562,21	-0,31%
									13,36%
FINANPREV-LFT	R\$	131.814.096,03	R\$	111.867.262,35	R\$	313.561,94	R\$	83.256.261,77	-2,32%
SPSM - LFT	R\$	8.596.218,59	R\$	8.634.967,93	R\$	26.157,75	R\$	8.602.193,87	
IGEPREV/PA	R\$	205.648.612,89	R\$	174.204.391,28	R\$	39.535.586,74	R\$	4.520.279.219,91	

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

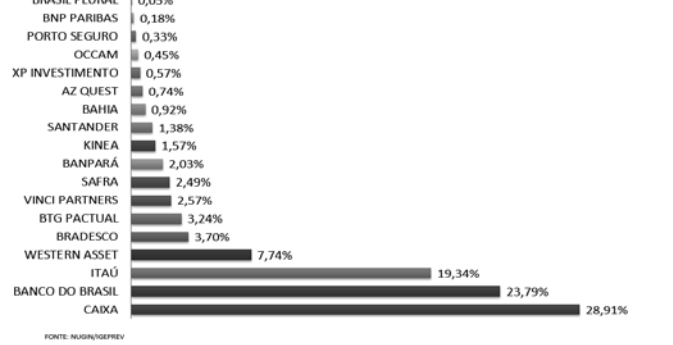


Gráfico 2: Distribuição de Recursos por Estratégia – Dezembro 2021

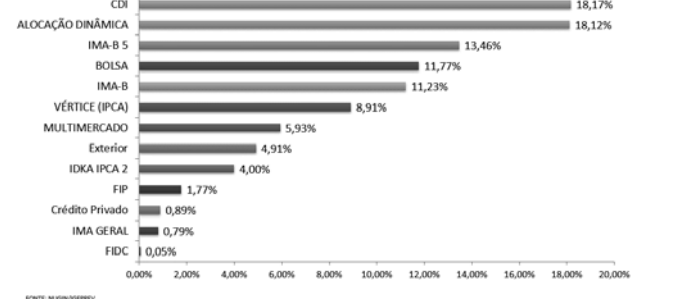
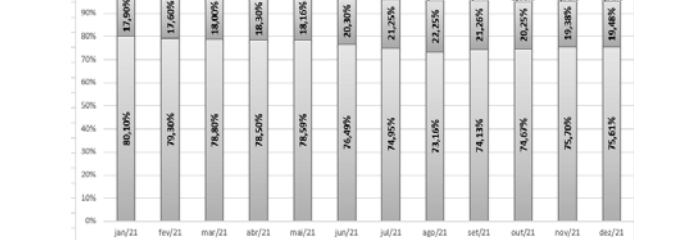


Gráfico 3: Participação por Segmento – somente fundos de Investimentos – Dezembro 2021



3. MONITORAMENTO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTO 2021.

Tabela 2: Distribuição e Enquadramento dos Investimentos IGEPREV/PA (FUNPREV+FINANPREV+SPSM) – Dezembro/2021

Artigo	Tipo de Ativo	Valor (R\$)	Carteira %	Política de Investimentos 2021			
				Limite Inferior	Estratégia Alvo	Limite Superior	Limite Legal
Renda Fixa							
Art. 7º, I, "b"	Fundos 100% Títulos Públicos	R\$ 1.513.705.930,59	33,49%	0,00%	40,00%	70,00%	100%
Art. 7º, II	Operações Compromissadas	R\$ 91.858.455,64	2,03%	0,00%	0,00%	5,00%	5%
Art. 7º, III "a"	Fundos de Renda Fixa Referenciado	R\$ 376.633.171,68	8,33%	0,00%	2,00%	20,00%	60%
Art. 7º, IV "a"	Fundos de Renda Fixa-Geral	R\$ 1.393.361.133,48	30,82%	0,00%	26,00%	40,00%	40%
Art. 7º, VII "b"	FIDC Cota Senior	R\$ 2.249.708,50	0,05%	0,00%	0,03%	1,00%	5%
Art. 7º, VII "b"	Fundos de Crédito Privado	R\$ 40.059.018,76	0,89%	0,00%	2,00%	5,00%	5%
Total Renda Fixa		R\$ 3.417.867.418,65	75,61%	-	70,03%	-	-
Renda Variável							
Art. 8º, I "a"	Fundos de Ações - Índices de Ações	R\$ 15.715.401,98	0,35%	0,00%	0,00%	5,00%	30%
Art. 8º, II "a"	Fundos de Ações - Geral	R\$ 516.439.318,17	11,42%	0,00%	11,47%	20,00%	20%
Art. 8º, III	Fundos Multimercados	R\$ 268.113.383,40	5,93%	0,00%	8,00%	10,00%	10%
Art. 8º, IV "a"	Fundos de Participações (FIP)	R\$ 80.141.259,01	1,77%	0,00%	2,00%	5,00%	5%
Total Renda Variável		R\$ 880.409.362,55	19,48%	-	21,47%	-	-
Investimento no Exterior							
Art. 9º, II "a"	Fic - Aberto: Investimento no Exterior	R\$ 64.545.108,28	1,43%	0,00%	7,50%	10,00%	10%
Art. 9º, III "a"	Fic - Fechado: Investimento no Exterior	R\$ 167.457.330,42	3,48%	0,00%	1,00%	5,00%	10%
Total Investimento Exterior		R\$ 222.002.438,70	4,91%	-	8,50%	-	-
Disponibilidade Financeira		R\$ -	0,00%	-	0,00%	-	-
Total da Carteira		R\$ 4.520.279.219,90	100,00%	-	100,00%	-	-

Fonte: NUBGestinvest

Observações:
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 II "a".

4. CARTEIRA FUNPREV

4.1. COMPOSIÇÃO POR FUNDOS DE INVESTIMENTO

Tabela 3: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Fixa – Dezembro 2021									
FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA		DEZEMBRO	TIR	ANO	VOL	Rendimento	PL (R\$)	%	CARTERA
Art. 7º, I, "b" - Fundos de Títulos Públicos		TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses	R\$	R\$		
BB-IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP		0,76%	77,90%	4,27%	31,94%	2,79%	R\$ 1.590.575,01	5,93%	210.268.053,24
BB-TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FIC RF PREVIDENCIÁRIO		0,59%	60,11%	6,64%	49,67%	1,63%	R\$ 202.083,34	0,07%	34.562.279,21
BB-TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FIC RF PREVIDENCIÁRIO		0,58%	59,69%	6,59%	49,80%	1,63%	R\$ 576.988,11	0,23%	99.376.718,17
BB-TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FIC RF PREVIDENCIÁRIO		0,67%	68,62%	5,34%	39,96%	2,18%	R\$ 640.701,66	0,23%	86.055.381,85
BB-TÍTULOS PÚBLICOS VII FIC RF PREVIDENCIÁRIO		0,58%	59,55%	6,57%	49,15%	1,63%	R\$ 263.735,59	0,10%	45.526.181,52
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF		0,68%	69,49%	-0,47%	-3,53%	4,33%	R\$ 50.282,64	0,01%	7.446.056,40
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RF		0,20%	20,50%	-1,63%	-12,12%	5,76%	R\$ 92.880,00	0,04%	46.414.286,07
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF		0,83%	84,39%	-0,11%	-0,82%	2,32%	R\$ 1.961.790,21	0,85%	239.557.103,37
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF		0,85%	86,94%	-2,18%	-16,33%	5,13%	R\$ 313.186,20	0,13%	37.131.895,56
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF		0,85%	86,73%	-2,23%	-17,04%	5,12%	R\$ 259.380,00	0,11%	30.813.720,00
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF		0,85%	86,90%	-2,20%	-16,49%	5,14%	R\$ 435.570,00	0,18%	51.663.090,00
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF LP		0,77%	78,44%	4,31%	32,27%	2,77%	R\$ 1.405.565,93	0,62%	184.219.040,97
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF LP		0,72%	73,56%	4,66%	34,89%	2,76%	R\$ 1.216.107,30	0,53%	170.187.663,75
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RF I		0,77%	78,99%	4,35%	32,56%	2,76%	R\$ 1.642.354,64	0,72%	214.151.121,30
SAFRA IMA FIC RF		-0,13%	-13,58%	-5,18%	-38,73%	6,49%	R\$ 47.527,59	0,01%	35.722.139,58
Art. 7º, II - Fundos de Renda Fixa Referenciada							R\$ 979.769,48	0,02%	376.633.171,68
CAIXA NOVO BRASIL FIC RF REFERENCIADO IMA-B LP		0,22%	22,61%	-1,50%	-11,20%	5,78%	R\$ 774.030,03	0,34%	150.715.159,18
XP INFLACÃO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP		0,76%	78,18%	3,67%	27,48%	3,86%	R\$ 196.739,45	0,09%	25.918.012,50
Art. 7º, III - Fundos de Renda Fixa Geral							R\$ 823.378,97	0,03%	1.192.382.779,42
BRADESCO H NILO FIC RENDA FIXA		0,11%	11,27%	-3,35%	-20,07%	6,56%	R\$ 79.151,40	0,01%	71.888.481,82
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA		0,86%	87,98%	4,53%	33,90%	1,10%	R\$ 1.021.470,64	0,44%	154.036.922,39
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO RENDA FIXA		0,23%	23,85%	-5,84%	-43,63%	6,91%	R\$ 80.456,35	0,04%	38.432.351,67
WESTERN ASSET ATIVO MAX FIC RENDA FIXA		0,82%	83,33%	-2,63%	-19,67%	3,39%	R\$ 196.865,85	0,08%	24.343.012,17
ITAÚ INSTITUCIONAL LEGEND FIC RENDA FIXA LP		-0,01%	-0,57%	1,27%	9,48%	1,56%	R\$ 101,87	0,00%	103.877.197,95
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP		0,09%	9,08%	0,09%	0,76%	0,76%	R\$ 1.361,94	0,00%	3.785.941,91
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DE PREVIDENCIÁRIO		0,80%	81,65%	1,80%	13,48%	0,15%	R\$ 4.079.711,22	1,75%	514.760.904,73
WESTERN ASSET ATIVO FIC RENDA FIXA		0,83%	84,62%	1,57%	13,77%	1,22%	R\$ 667.217,70	0,29%	81.257.966,99
Art. 7º, VII "b" - FIDC Cota Senior							R\$ 6.924,85	0,00%	2.249.708,50
BIBF MASTER FIDC LP		-0,31%	-31,36%	26,71%	199,86%	21,64%	R\$ 6.924,85	0,00%	2.249.708,50
SUBTOTAL RENDA FIXA							R\$ 12.704.764,64	28,11%	R\$ 3.074.360.400,80

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

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL		DEZEMBRO		ANO		VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	%
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses				CARTERA
Art. 8º, inciso I, alínea "a" - FIC Ações - Índices de Ações									
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1,88%	192,10%	-16,64%	-124,51%	20,01%	R\$ 309,870,80	R\$ 15.752,401,98	0,43%	13.592.500,65
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FIC AÇÕES	2,86%	292,72%	-12,11%	-90,64%	20,62%	R\$ 59.108,28	R\$ 2.122.901,33	0,05%	2.122.901,33
Art. 8º, inciso II, alínea "a" - Fundos de Ações - Geral									
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2,20%	224,39%	-16,49%	-123,41%	18,71%	R\$ 28.958,71	R\$ 1.347.967,52	0,04%	1.347.967,52
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3,75%	382,85%	-16,02%	-119,92%	19,86%	R\$ 117.042,90	R\$ 3.241.603,12	0,08%	3.241.603,12
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIC AÇÕES	5,23%	534,90%	-15,00%	-112,29%	24,27%	R\$ 249.612,99	R\$ 5.019.072,86	0,12%	5.019.072,86
BRADESCO MID SMALL CAPS FIC AÇÕES	3,89%	397,85%	-9,84%	-73,62%	22,45%	R\$ 692.453,59	R\$ 18.481.093,34	0,44%	18.481.093,34
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	1,30%	132,94%	-18,84%	-140,98%	20,48%	R\$ 43.012,03	R\$ 3.349.798,95	0,03%	3.349.798,95
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,69%	-70,05%	-31,79%	-237,87%	23,72%	R\$ 619.018,00	R\$ 89.695.674,92	2,15%	89.695.674,92
ITAÚ DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2,40%	245,13%	-7,65%	-57,22%	18,97%	R\$ 58.227,27	R\$ 2.485.928,45	0,06%	2.485.928,45
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,97%	99,24%	-8,51%	-63,67%	17,84%	R\$ 364.584,51	R\$ 37.911.429,13	0,91%	37.911.429,13
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	0,81%	82,78%	-20,97%	-156,96%	20,72%	R\$ 235.352,77	R\$ 29.292.954,13	0,70%	29.292.954,13
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	0,39%	40,11%	-17,09%	-127,91%	23,32%	R\$ 285.801,74	R\$ 37.108.576,72	1,05%	37.108.576,72
VINICI MOSAICO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,12%	12,48%	-12,82%	-95,95%	20,49%	R\$ 61.979,44	R\$ 50.809.526,16	1,22%	50.809.526,16
VINICI SELECTION EQUITIES FIC AÇÕES	2,66%	271,38%	-6,49%	-48,60%	18,60%	R\$ 548.075,40	R\$ 21.189.266,94	0,51%	21.189.266,94
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2,31%	236,56%	-8,64%	-64,64%	19,06%	R\$ 712.366,78	R\$ 31.976.774,93	0,77%	31.976.774,93
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC AÇÕES	2,47%	252,27%	-25,02%	-187,26%	23,32%	R\$ 353.121,66	R\$ 14.659.321,79	0,35%	14.659.321,79
BAHIA AM VALUATION FIC AÇÕES	0,02%	2,49%	-26,67%	-199,60%	21,09%	R\$ 10.100,06	R\$ 41.537.955,98	0,99%	41.537.955,98
OCCAM FIC AÇÕES	3,49%	356,98%	-18,62%	-139,33%	19,99%	R\$ 686.636,69	R\$ 20.545.522,11	0,88%	20.545.522,11
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3,56%	364,18%	-10,11%	-75,64%	19,52%	R\$ 1.264.338,85	R\$ 36.747.584,08	0,49%	36.747.584,08
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	3,38%	345,93%	-31,03%	-232,19%	24,40%	R\$ 1.513.679,07	R\$ 35.239.267,05	0,84%	35.239.267,05
Art. 8º, inciso III - Fundos Multimercados									
SAFRA S&P REALS PB FIC MULTIMERCADO	5,42%	554,39%	32,11%	240,31%	31,21%	R\$ 1.375.860,48	R\$ 27.400.696,66	0,64%	27.400.696,66
WESTERN ASSET US INDEX S&P FIC MULTIMERCADO	5,49%	561,06%	32,24%	242,80%	33,36%	R\$ 2.726.874,39	R\$ 52.640.874,78	1,25%	52.640.874,78
VALINER VALOREM FIC MULTIMERCADO	-0,05%	-5,14%	3,70%	27,66%	1,88%	-R\$ 17.734,11	R\$ 35.068.112,17	0,84%	35.068.112,17
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-1,23%	-126,22%	1,20%	7,66%	2,15%	R\$ 86.485,85	R\$ 70.299.146,83	0,17%	70.299.146,83
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,43%	146,56%	1,44%	18,00%	3,64%	R\$ 1.547.956,15	R\$ 109.481.041,57	2,62%	109.481.041,57
ITAÚ PRIVATE S&P00 "BRI" FIC MULTIMERCADO	5,54%	568,78%	11,00%	82,74%	13,38%	R\$ 1.950.978,43	R\$ 13.212.502,38	0,29%	13.212.502,38
Art. 8º, inciso IV, alínea "a" - Fundos de Participações (FPI)									
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC FIP	-0,10%	-9,82%	-13,37%	-100,08%	29,54%	R\$ 9.001,58	R\$ 93.682.580,23	1,92%	93.682.580,23
INVESTIMENTOS KINETA PRIVATE FUND IV FEEDER INT. I. MULTI. FIP	-1,14%	-116,39%	22,75%	170,22%	65,39%	R\$ 234.463,54	R\$ 70.778.678,38	2,69%	70.778.678,38
SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL							R\$ 14.462.919,69	80.089.362,55	11,11%