

MOVIMENTAÇÕES DA CARTEIRA
Tabela 5: Movimentações FUNPREV – Março de 2022

MOVIMENTAÇÕES - FUNPREV - MARÇO 2022				
DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	FUNDO DE INVESTIMENTO	DESCRIÇÃO
07/03/2022	R\$ 15.671.768,89		SANTANDER RF CRÉDITO PRIVADO CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	Recurso da Amortização do Kinea
22/03/2022		R\$ 2.000.000,00	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	RESGATE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
25/03/2022		R\$ 5.000.000,00	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	RESGATE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
30/03/2022		R\$ 7.000.000,00	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	RESGATE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
TOTAL	R\$ 15.671.768,89	R\$ 4.000.000,00		

FONTE: NUGIN/Igeprev

EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FUNPREV
Gráfico 4: Evolução do Patrimônio Líquido – FUNPREV – Abril 2021 a Março 2022.

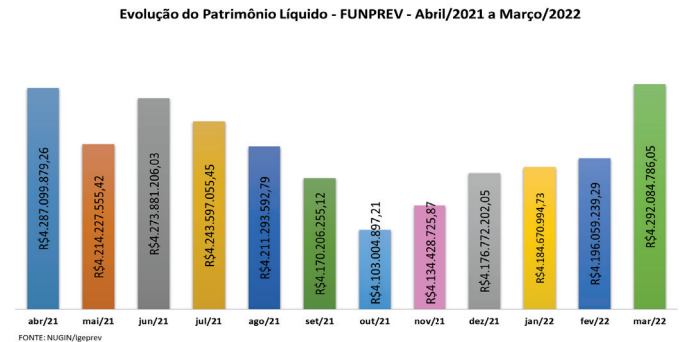
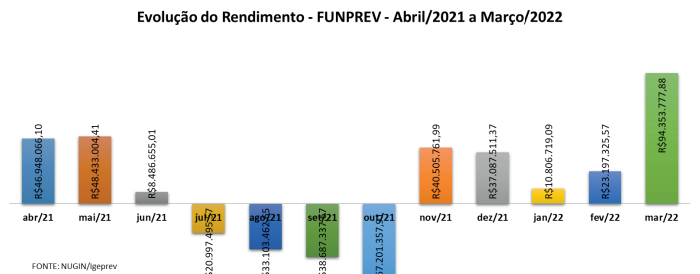


Gráfico 5: Evolução do Rendimento – FUNPREV – Abril 2021 a Março 2022



CARTEIRA FINANPREV
COMPOSIÇÃO POR FUNDOS DE INVESTIMENTOS
Tabela 6: Carteira de Investimentos – FINANPREV – Março 2022

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	MARÇO		ANO		VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses			
Art. 7º, inciso I, alínea "b" - FI 100% Títulos Públicos								
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	2,63%	140,41%	3,82%	96,38%	2,71%	R\$ 281.946,96	R\$ 11.016.786,52	3,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,16%	62,19%	2,64%	66,46%	1,16%	R\$ 58.937,72	R\$ 5.125.561,52	1,62%
Art. 7º, inciso II						R\$ 658.877,59	R\$ 58.757.816,97	18,56%
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS	*	*	*	*		R\$ 658.877,59	R\$ 58.757.816,97	18,56%
Art. 7º, inciso III, alínea "a" - Limite % RPPS até 60% - Limite 5 PL até 15%						R\$ 1.835.305,98	R\$ 200.612.308,64	63,36%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,96%	51,51%	2,57%	64,72%	0,18%	R\$ 17.473,05	R\$ 1.830.833,09	0,58%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	0,81%	43,47%	2,14%	54,04%	6,46%	R\$ 348.553,43	R\$ 43.217.363,54	13,65%
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	1,14%	60,73%	2,64%	66,64%	1,18%	R\$ 171.993,65	R\$ 15.311.264,09	4,84%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	47,10%	2,57%	64,90%	0,19%	R\$ 162.445,25	R\$ 18.601.300,42	5,88%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,94%	50,25%	2,57%	64,69%	0,18%	R\$ 190.817,82	R\$ 20.492.750,48	6,47%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,90%	47,94%	1,95%	49,22%	1,19%	R\$ 328.561,23	R\$ 36.969.095,34	11,68%
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA	0,97%	51,89%	2,55%	64,26%	0,30%	R\$ 258.531,65	R\$ 26.891.609,86	8,49%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,97%	51,65%	2,54%	64,14%	0,21%	R\$ 356.929,90	R\$ 37.298.091,82	11,78%
Art. 7º, inciso V, alínea "b" - Limite % RPPS até 40% - Limite % PL de 15%						R\$ 389.980,53	R\$ 41.088.802,73	12,98%
BTG PACTUAL YIELD FI RF REF. DI CRÉDITO PRIVADO	0,96%	51,22%	2,57%	64,82%	0,18%	R\$ 389.980,53	R\$ 41.088.802,73	12,98%
TOTAL FINANPREV	1,01%	53,74%	2,46%	62,07%	0,83%	R\$ 3.225.048,78	R\$ 316.601.276,37	100,00%

FONTE: NUGIN/Igeprev

EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FINANPREV
Gráfico 6: Evolução do Patrimônio Líquido – FINANPREV (Fundos + LFT) – Abril/2021 a Março/2022

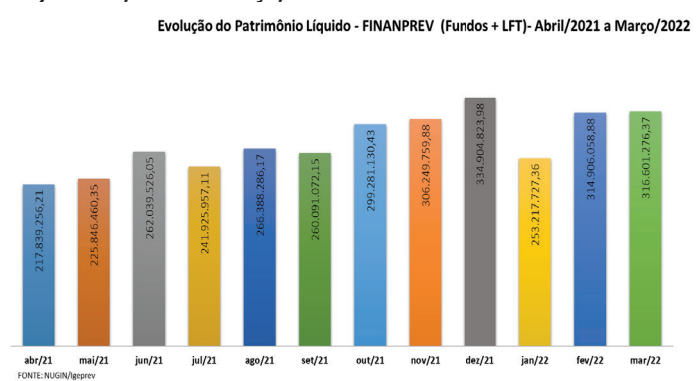
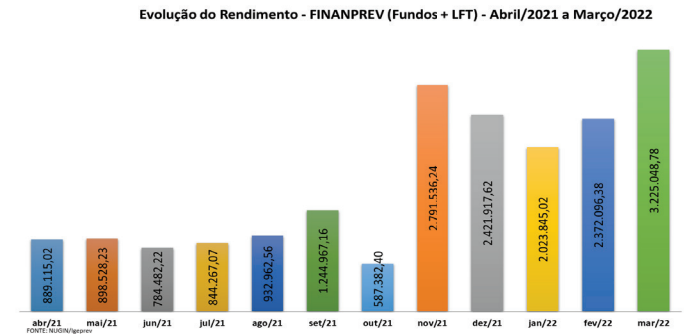


Gráfico 7: Evolução do Rendimento do FINANPREV (Fundos + LFT) – Abril/2021 a Março/2022



TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
Para custear as despesas administrativas de Março de 2022, foram utilizadas as receitas arrecadadas do FUNPREV diretamente pelo setor de arrecadação, assim como o resgate de R\$14.000.000,00 (quatorze milhões de reais) da carteira FUNPREV.

TRANSFERÊNCIA FUNPREV PARA FINANPREV – LEI COMPLEMENTAR 115/2017 E 125/2019.

Tabela 7: Transferência FUNPREV para FINANPREV – 2016 A 2022

TRANSFERÊNCIAS FUNPREV PARA O FINANPREV		
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
2022	TRANSFERÊNCIA RENDIMENTO ANO DE 2022	R\$ 45.996.401,51
TOTAL		R\$ 2.605.347.592,93

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\$ 2.605.347.592,93, no período de 2016 até Março de 2022. Em Março de 2022, o FUNPREV apresentou variação positiva no valor de R\$ 94.353.777,88. No entanto somente foi possível realizar a transferência do valor de R\$ 45.996.401,51 do recurso para atendimento da Lei Complementar, visto que ainda faltava realizar compensação da variação negativa de R\$ 48.357.376,37, referente ao período de Julho a Outubro de 2021, conforme apresentado na tabela a seguir.

Tabela 8: Compensação

Meses	Rendimento mensal	Compensação	Saldo a transferir*	Saldo a compensar
jan/21	- 18.759.789,79		-	- 18.759.789,79
fev/21	- 21.008.057,53		-	- 39.767.847,32
mar/21	16.125.109,46	16.125.109,46	-	- 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
set/21	- 38.687.337,67			- 92.788.295,90
out/21	- 67.201.357,91			-159.989.653,81
nov/21	40.505.761,99	40.505.761,99		-119.483.891,81
dez/21	37.122.470,79	37.122.470,79		- 82.361.421,02
jan/22	10.806.719,09	10.806.719,09		- 71.554.701,93
fev/22	23.197.325,57	23.197.325,57		- 48.357.376,37
mar/22	94.353.777,88	48.357.376,37	45.996.401,51	-
Total				

*O saldo é transferido no mês subsequente

POLÍTICA DE INVESTIMENTO 2022.

Considerando as alterações trazidas pela Resolução 4.963/2021, que passou a vigorar a partir de 03/01/2022.

Considerando que a Política de Investimento ainda não foi aprovada pelo Conselho Estadual de Previdência.

Considerando que as estratégias adotadas na execução da carteira de investimento devem atender aos limites mínimos e máximos propostos para a Política de Investimentos 2022.

Diante do exposto, em Março de 2022, o NUGIN vem monitorando a carteira de investimentos do Igeprev, observando as mudanças ocasionadas pela Nova Resolução e as estratégias propostas na minuta da Política de Investimentos 2022.

Na tabela 9, observamos que os investimentos da Carteira estão dentro dos limites mínimos e máximos propostos para a Política de Investimentos 2022, no entanto é necessário realizar realocações visando atender as estratégias-alvo.