

1.2.3. COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR FUNDOS DE INVESTIMENTO
Tabela 4: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Fixa – Maio 2022

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	MAIO		ANO		VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META				
Art. 7º, II, "a" - FI 100% Títulos Públicos						16.782.910,77	1.972.189.684,80	46,62%
BB IM-8 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,77%	107,26%	6,14%	100,86%	2,67%	1.705.019,87	223.168.741,65	5,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	90,96%	6,87%	112,94%	1,55%	232.926,84	35.907.107,65	0,85%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	90,42%	6,85%	112,60%	1,54%	60.816,34	103.248.633,41	2,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	107,35%	6,54%	107,55%	1,83%	718.881,47	98.533.184,06	2,53%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII R RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	90,27%	6,84%	112,50%	1,54%	304.263,96	47.261.847,09	1,12%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	84,52%	3,19%	52,48%	4,41%	46.339,60	7.688.765,84	0,18%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-8 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,90%	125,29%	4,57%	75,05%	5,47%	42.225,84	48.523.443,97	1,15%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,07%	148,38%	4,35%	71,45%	2,07%	2.634.195,86	249.970.205,98	5,91%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	123,67%	3,29%	54,00%	4,80%	337.448,28	38.351.733,72	0,91%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	123,60%	3,10%	50,07%	4,91%	279.220,00	31.751.320,00	0,75%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	123,82%	3,04%	50,04%	4,91%	468.960,00	53.225.750,00	1,26%
CAIXA BRASIL IMA-8 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,76%	106,53%	3,04%	101,22%	2,62%	1.130.499,90	148.977.612,06	3,52%
CAIXA BRASIL IMA-8 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,85%	118,86%	6,17%	101,50%	2,70%	1.528.613,23	180.699.989,39	4,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-8 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,77%	106,81%	6,17%	101,47%	2,64%	1.129.830,80	227.370.669,76	5,37%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,99%	138,11%	4,07%	66,89%	5,96%	364.819,86	37.165.399,84	0,88%
WESTERN ASSET IMA-8 ATIVO RENDA FIXA	0,83%	115,40%	3,38%	55,57%	6,35%	326.390,16	39.731.472,13	0,94%
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	0,75%	104,51%	3,86%	30,62%	2,65%	184.623,57	24.796.493,71	0,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,98%	137,68%	4,45%	73,23%	1,16%	2.699.133,67	266.634.454,46	6,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1,01%	140,95%	4,15%	68,29%	1,85%	1.083.675,52	108.192.860,07	2,56%
Art. 7º, III, "a" - FI Renda Fixa						12.217.829,96	1.188.961.126,20	28,11%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-8 LP	1,00%	139,45%	4,58%	75,29%	5,54%	343.854,14	31.924.191,71	0,81%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	0,94%	131,03%	5,62%	92,37%	3,64%	255.057,64	27.374.411,18	0,65%
BRASESCO NI RENDA FIXA	0,83%	115,92%	4,17%	68,62%	6,17%	617.981,72	74.889.230,25	1,77%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO FI RENDA FIXA	1,07%	148,54%	4,47%	73,50%	0,18%	5.673.160,25	537.776.344,30	12,71%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	1,11%	155,25%	4,02%	66,12%	0,99%	925.951,84	84.526.290,55	2,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP	1,10%	153,32%	4,92%	80,85%	0,81%	1.314.313,66	120.741.298,38	2,81%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,06%	147,82%	2,88%	47,31%	0,19%	17.852,61	1.700.398,84	0,04%
Art. 7º, IV - FIDC Cota Senior						14.466,827	2.202.030,63	0,05%
BBF MASTER FIDC LP	-0,29%	-40,80%	-1,76%	-20,01%	14,41%	-14.466,827	2.202.030,63	0,05%
Art. 7º, V, "a"						212.113,43	18.184.612,72	0,45%
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RF CP LP	1,14%	159,47%	3,00%	49,27%	0,29%	212.113,43	19.184.612,72	0,45%
TOTAL RENDA FIXA						30.201.338,89	3.161.150.811,02	74,73%

Tabela 5: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Variável – Maio 2022

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL	MAIO		ANO		VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META				
Art. 8º, inciso I - FI Ações						6.216.207,99	541.368.157,34	12,80%
ITAÚ FOF 991 BIONESS ATIVO FI AÇÕES	3,10%	431,20%	5,02%	82,45%	19,39%	426.552,87	14.274.214,77	0,34%
CAIXA BRASIL INDEXA BIONESS FI AÇÕES	3,16%	440,40%	6,13%	100,75%	19,48%	69.040,14	2.253.068,01	0,05%
AZ QUEST ASSET INDEXA BIONESS FI AÇÕES	2,37%	330,31%	5,41%	88,95%	17,10%	32.908,68	1.180.921,13	0,03%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	1,71%	238,24%	10,57%	173,77%	18,90%	60.262,48	3.584.270,47	0,08%
INVESTIMENTOS SMALL CAPS FI AÇÕES	-2,50%	-345,51%	1,30%	21,30%	25,59%	130.457,62	5.084.102,41	0,12%
BRASESCO MID SMALL CAPS FIC AÇÕES	1,54%	215,07%	2,82%	46,37%	23,83%	389.804,13	31.685.195,89	0,51%
BRASESCO VALUATION BIONESS FI AÇÕES	2,52%	359,78%	8,54%	140,39%	19,86%	89.298,82	3.635.887,96	0,09%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,63%	-87,51%	-2,77%	-45,59%	24,48%	-551.363,75	87.208.289,90	2,00%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,91%	405,50%	10,80%	177,46%	17,26%	77.899,26	2.754.287,17	0,07%
BB DIVERSAS FIC AÇÕES	3,78%	536,23%	2,79%	44,87%	10,83%	412.532,92	38.946.190,78	0,93%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND DE FUNDOS GENESES FIC AÇÕES	0,79%	110,61%	0,11%	-1,12%	21,32%	230.441,51	29.255.093,23	0,69%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHENIX FIC AÇÕES	0,02%	2,49%	-0,27%	-4,52%	21,61%	13.035,83	72.907.592,32	1,72%
VINDO MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2,28%	317,83%	2,99%	49,22%	21,05%	1.167.210,09	52.330.842,22	1,24%
VINDO SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	2,59%	361,31%	3,96%	65,05%	17,31%	556.839,66	22.027.717,03	0,52%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-0,90%	-124,74%	-0,91%	-14,99%	16,79%	286.365,21	31.685.195,89	0,78%
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC AÇÕES	0,36%	49,98%	0,69%	11,40%	24,81%	52.762,74	14.760.996,89	0,35%
BAHIA AM VALUATION FIC AÇÕES	2,32%	323,38%	2,88%	47,27%	21,58%	969.402,50	42.732.421,66	1,01%
OCAM FIC AÇÕES	3,25%	452,69%	5,38%	88,48%	18,24%	674.748,70	21.440.628,97	0,51%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3,68%	512,81%	6,33%	104,00%	18,83%	1.464.300,60	41.245.762,20	0,97%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-1,16%	-182,10%	1,19%	-19,64%	29,10%	-409.886,34	34.818.338,33	0,82%
TOTAL RENDA VARIÁVEL						6.216.207,99	541.368.157,34	12,80%

Tabela 6: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Investimento no Exterior, Estruturado e Total FUNPREV – Maio 2022

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	MAIO		ANO		VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META				
Art. 9º, inciso II - FI Investimento no Exterior						862,164	50.887.890,06	1,20%
VINCI INTERNACIONAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	-3,90%	-543,73%	-19,65%	-323,04%	14,40%	-296.258,33	7.294.672,60	0,17%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FII	1,32%	184,19%	-18,23%	-299,68%	11,40%	288.877,14	22.139.161,47	0,52%
WALTON CLEARBROOK LARGE CAP GROWTH INVESTIMENTO NO EX	-3,93%	-553,81%	-24,43%	-401,67%	29,90%	854.783,01	21.454.059,09	0,51%
Art. 9º, inciso III - FI Ações BDR Nivel 1						6.897,965	107.534.823,90	2,54%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NIVEL 1	-4,44%	-618,15%	-28,42%	-467,21%	20,93%	-3.390.359,69	73.020.871,55	1,73%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NIVEL 1	-8,02%	-118,72%	-37,75%	-620,52%	23,23%	1.071.660,64	24.511.863,35	0,52%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR						(7.250.129,53)	158.427.329,98	3,24%
FUNDOS DE INVESTIMENTOS - ESTRUTURADOS	MAIO		ANO		VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META				
Art. 10º, inciso I - FI FIC Multimercado						2.322.995,85	263.765.362,12	6,29%
SAFRA S&P REAIS PB FII MULTIMERCADO	0,95%	133,00%	-10,54%	-173,30%	18,13%	226.210,00	23.921.541,86	0,57%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FII MULTIMERCADO	0,89%	124,38%	-10,67%	-175,35%	18,29%	414.226,34	46.811.380,45	1,11%
VINDO VALORES FII MULTIMERCADO	0,61%	89,96%	6,79%	111,55%	1,90%	243.630,69	27.661.434,03	0,89%
BRASESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1,16%	160,96%	4,26%	70,05%	1,78%	84.431,57	7.392.265,62	0,17%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,92%	120,83%	4,85%	79,76%	3,30%	1.045.306,01	114.792.836,03	2,71%
ITAÚ PRIVATE SP500 BRL FIC MULTIMERCADO	0,95%	131,88%	-10,62%	-174,71%	18,31%	311.190,74	33.185.904,14	0,78%
Art. 10º, inciso II - FI Participações						316.693,127	68.807.938,99	1,89%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFP	-3,77%	-525,37%	-2,36%	-38,75%	4,25%	-358.251,30	9.141.874,17	0,22%
KINVA PRIVATE EQUITY FI FEEDER INSTITUCIONAL MULTISTRATÉGIA FIP	0,06%	7,71%	6,20%	101,90%	57,55%	41.560,12	75.166.059,21	1,78%
TOTAL ESTRUTURADOS						3.049.353,11	316.622.925,51	8,17%
TOTAL FUNPREV	0,21%	100,13%	2,29%	37,71%	4,46%	30.165.767,52	4.230.401.630,16	100,00%

1.2.4. FUNDO ESTRESSADO
O IGEPREV possui apenas 01(um) fundo estressado na carteira FUNPREV – FIDC BBIF MASTER.

FIDC BBIF MASTER	Valor
APLICAÇÃO	12.000.000,00
Quant. Cotas	107,16
VALOR REAL(EXTRATO)	2.202.030,63
VALOR ATUALIZADO (IPCA + 8,5%)	54.787.200,00
RETORNO NO MÊS (%)	0,29%
RETORNO NO MÊS (\$)	- 14.469,27
PATRIMÔNIO DO FUNDO	28.730.604,99
VARIAÇÃO(atualizado - Valor Real)	- 52.585.169,37

1.2.5. EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FUNPREV
Gráfico 4: Evolução do Patrimônio Líquido – FUNPREV – Junho 2021 a Maio 2022.

Evolução do Patrimônio Líquido - FUNPREV - Junho/2021 a Maio/2022

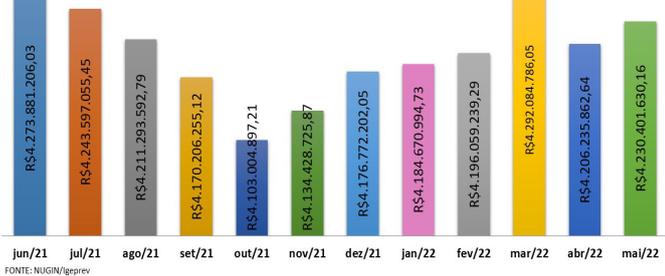
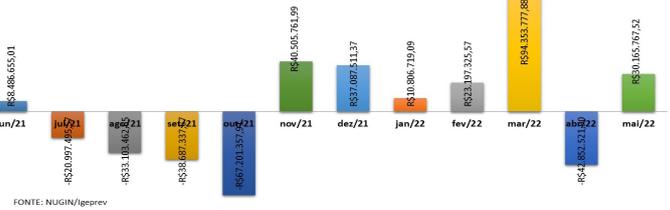


Gráfico 5: Evolução do Rendimento – FUNPREV – Junho 2021 a Maio 2022

Evolução do Rendimento - FUNPREV - Junho/2021 a Maio/2022



1.3