Gráfico 2: Distribuição de Recursos por Estratégia – Junho 2022

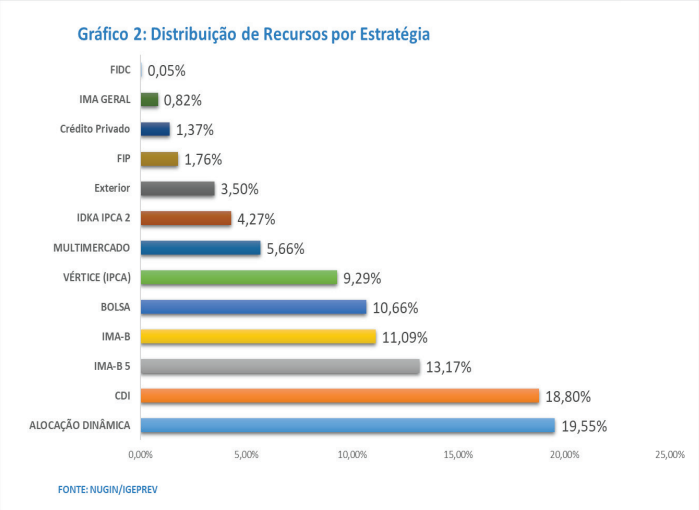
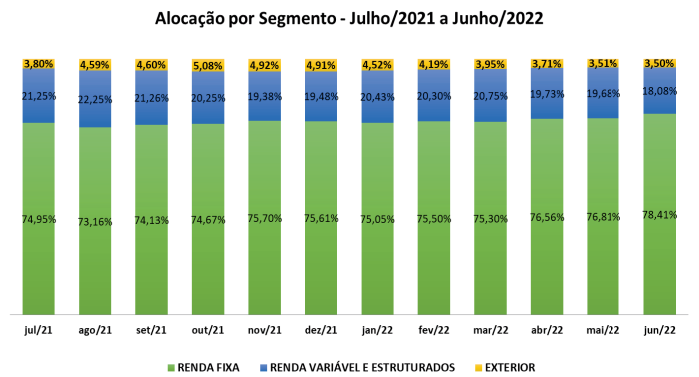


Gráfico 3: Alocação por Segmento – Julho 2021 a Junho 2022 (somente Fundos de Investimentos)



1.2. CARTEIRA FUNPREV

1.2.1. hISTÓRICO DE MOVIMENTAÇÕES 2022

Tabela 2: Historico de Movimentações 2022

MOVIMENTAÇÃO FUNPREV - MAIO/2022								
MÊS	SALDO ANTERIOR	RECEITA		RESGATE			RENDIMENTO	SALDO ATUAL
		ARRECADAÇÃO	AMORTIZAÇÃO	LC 125	TAXA DE ADM	AMORTIZAÇÃO		
JANEIRO	4.176.772.202,05	R$ 1.392.073,59		R$ -	R$ 4.300.000,00		R$ 10.806.719,09	R$ 4.184.670.994,73
FEVEREIRO	4.184.670.994,73	R$ 3.862.687,88		R$ -		R$ 15.671.768,89	R$ 23.197.325,57	R$ 4.196.059.239,29
MARÇO	4.196.059.239,29	R$ -	R$ 15.671.768,89	R$ -	R$ 14.000.000,00		R$ 94.353.777,88	R$ 4.292.084.786,05
ABRIL	4.292.084.786,05	R$ 3.000.000,00		R$ 45.996.401,51			R$ 42.852.521,90	R$ 4.206.235.862,64
MAIO	4.206.235.862,64	R$ -	R$ -	R$ -	R$ 6.000.000,00		R$ 30.165.767,52	R$ 4.230.401.630,16
JUNHO*	4.230.401.630,16	R$ -	R$ 6.388.503,82	R$ -	R$ 8.500.000,00	R$ 6.392.314,65	R$ 59.773.064,61	R$ 4.162.124.754,73
TOTAL	4.230.401.630,16	R$ 8.254.761,47	R$ 22.060.272,71	R$ 45.996.401,51	R$ 32.800.000,00	R$ 22.064.083,54	R$ 55.898.003,55	R$ 4.162.124.754,73

Fonte: NUGIN/IGEPREV

Obs: A receita a menor do recurso proveniente de amortização ocorreu devido a bloqueio judicial no valor R$ 3.810,83.

1.2.2. MOVIMENTAÇÕES DA CARTEIRA JUNHO

Tabela 3: Movimentações FUNPREV – Junho de 2022

MOVIMENTAÇÕES - FUNPREV - JUNHO 2022					
DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	AMORTIZAÇÃO	FUNDO DE INVESTIMENTO	DESCRIÇÃO
06/06/2022		R$ 3.500.000,00		CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
07/06/2022			R$ 6.392.314,65	BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	AMORTIZAÇÃO
14/06/2022		R$ 2.000.000,00		CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
17/06/2022*	R$ 6.388.503,82			ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	RECURSO DE AMORTIZAÇÃO
22/06/2022		R$ 3.000.000,00		CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
23/06/2022		R$ 3.551.318,00		CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	CHAMADA DE CAPITAL DO FIP KINEA
23/06/2022	R$ 3.551.318,00			KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INST. I MULTIESTRATÉGIA FIP	CHAMADA DE CAPITAL DO FIP KINEA
TOTAL	R$ 9.939.821,82	R$ 12.051.318,00	R$ 6.392.314,65		

FONTE: NUGIN/Igeprev

Obs: A aplicação a menor do recurso proveniente de amortização ocorreu devido a bloqueio judicial no valor R$ 3.810,83. Informamos que em Julho, o recurso, após ser desbloqueado, foi efetivamento aplicado

1.2.3. COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR FUNDOS DE INVESTIMENTO

Tabela 4: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Fixa – Junho 2022

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	JUNHO		ANO		VOL	Rendimento R$	PL (R$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses			
Art. 7º, I, "b" - FI 100% Títulos Públicos						*7.176.157,63*	*1.970.865.842,43*	*47,35%*
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,32%	34,60%	6,47%	91,71%	2,61%	708.983,59	223.877.725,25	5,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	34,43%	7,21%	102,14%	1,69%	113.515,98	36.020.623,63	0,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	34,04%	7,18%	101,79%	1,69%	322.694,23	103.571.327,64	2,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,28%	30,60%	6,84%	96,95%	1,85%	279.713,39	99.812.897,45	2,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	33,90%	7,18%	101,69%	1,69%	147.107,09	47.408.954,18	1,14%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,34%	37,56%	3,55%	50,28%	4,40%	26.504,64	7.710.270,48	0,19%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,39%	-42,63%	4,16%	58,89%	5,41%	- 189.994,16	48.343.449,82	1,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,23%	25,09%	4,59%	65,00%	2,19%	575.963,11	250.546.169,09	6,02%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,22%	24,11%	3,51%	49,79%	4,74%	84.917,28	38.436.651,00	0,92%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,22%	23,88%	3,27%	46,32%	4,86%	69.640,00	31.820.960,00	0,76%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,22%	24,04%	3,27%	46,36%	4,87%	117.510,00	53.353.260,00	1,28%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,33%	36,33%	6,51%	92,26%	2,58%	488.699,27	140.966.311,33	3,39%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,22%	24,43%	6,41%	90,87%	2,67%	405.369,10	181.101.358,49	4,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	0,32%	34,95%	6,51%	92,30%	2,58%	729.707,23	228.100.376,99	5,48%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,47%	-51,46%	3,58%	50,69%	5,88%	- 175.626,26	36.989.773,58	0,89%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO RENDA FIXA	-0,52%	-56,88%	2,84%	40,25%	6,27%	- 207.514,44	39.523.957,69	0,95%
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	0,67%	72,68%	2,54%	36,03%	2,56%	165.495,47	24.961.989,18	0,60%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,79%	85,52%	5,28%	74,75%	1,18%	2.093.679,01	268.707.133,46	6,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1,31%	142,91%	5,52%	78,23%	1,96%	1.419.793,10	109.612.653,16	2,63%
Art. 7º, III, "a" - FI RENDA FIXA						*5.985.066,45*	*1.197.783.377,48*	*28,78%*
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,36%	-38,88%	4,21%	59,61%	5,49%	- 1.200.472,27	337.201.401,44	8,10%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	0,18%	19,63%	5,81%	82,32%	3,60%	49.355,83	27.423.767,01	0,66%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	-0,57%	-61,58%	3,59%	50,80%	6,13%	- 423.453,58	74.465.776,67	1,79%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,03%	111,72%	5,54%	78,54%	0,18%	5.517.109,18	543.293.453,47	13,05%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	1,02%	110,83%	5,08%	71,99%	0,96%	860.256,73	85.386.507,28	2,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINAMICO RF LP FIC	0,95%	103,10%	5,91%	83,77%	0,78%	1.164.945,59	128.294.747,79	3,08%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,02%	110,95%	3,93%	55,63%	0,19%	17.324,96	1.717.723,80	0,04%
Art. 7º, V, "a" - FIDC Cota Senior						*18.173,52*	*2.183.857,11*	*0,05%*
BBIF MASTER FIDC LP	-0,83%	-89,88%	-2,93%	-41,48%	14,31%	- 18.173,52	2.183.857,11	0,05%
Art. 7º, V, "b"						*206.654,56*	*19.391.267,29*	*0,47%*
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RF CP LP	1,08%	117,31%	4,11%	58,19%	0,29%	206.654,56	19.391.267,29	0,47%
TOTAL RENDA FIXA						13.349.705,13	*3.190.224.344,30*	*76,65%*

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

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL	JUNHO		ANO		VOL	Rendimento R$	PL (R$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses			
Art. 8º, inciso I - FI Ações						*61.577.685,27*	*479.790.472,08*	*11,53%*
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-10,17%	-1107,14%	-5,66%	-80,22%	19,90%	- 1.451.210,94	12.823.003,83	0,31%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-11,26%	-1226,06%	-5,82%	-82,43%	20,01%	- 253.665,84	1.999.403,07	0,05%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-12,15%	-1322,78%	-7,39%	-104,76%	17,68%	- 172.595,24	1.248.309,89	0,03%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-12,05%	-1311,77%	-2,75%	-38,94%	19,57%	- 431.752,06	3.152.518,51	0,08%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-16,31%	-1776,58%	-15,23%	-215,80%	26,39%	- 829.417,40	4.254.685,01	0,10%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-15,24%	-1659,96%	-12,85%	-182,11%	24,17%	- 2.896.540,44	16.105.833,51	0,39%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	-11,17%	-1216,43%	-3,58%	-50,78%	20,44%	- 406.135,24	3.229.752,72	0,08%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-10,74%	-1169,23%	-13,21%	-187,21%	24,86%	- 9.363.389,80	77.844.900,10	1,87%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-10,99%	-1197,11%	-1,38%	-19,62%	17,69%	- 302.774,85	2.451.512,32	0,06%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-11,11%	-1209,50%	-8,68%	-123,00%	18,59%	- 4.325.587,93	34.620.602,85	0,83%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	-10,27%	-1118,89%	-10,39%	-147,23%	21,79%	- 3.005.823,35	26.249.267,88	0,63%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-10,46%	-1139,46%	-10,71%	-151,75%	22,10%	- 7.628.639,80	65.278.952,52	1,57%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-11,52%	-1254,70%	-8,87%	-125,72%	21,61%	- 6.029.401,01	46.301.441,21	1,11%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	-9,16%	-997,44%	-5,56%	-78,85%	17,62%	- 2.017.586,11	20.010.130,93	0,48%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-11,16%	-1215,18%	-11,97%	-169,59%	17,30%	- 3.535.675,30	28.149.479,53	0,68%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	-12,03%	-1310,09%	-11,42%	-161,82%	25,24%	- 1.775.789,98	12.985.206,91	0,31%
BAHIA AM VALUATION FIC AÇÕES	-12,72%	-1385,73%	-10,22%	-144,74%	22,30%	- 5.437.639,23	37.294.782,43	0,90%
OCCAM FIC AÇÕES	-8,92%	-971,43%	-4,02%	-56,93%	18,83%	- 1.912.603,33	19.528.025,64	0,47%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-12,76%	-1390,05%	-7,24%	-102,65%	19,17%	- 5.264.848,44	35.980.933,86	0,86%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-13,03%	-1418,89%	-14,07%	-199,34%	29,72%	- 4.536.608,98	30.281.729,36	0,73%
TOTAL RENDA VARIÁVEL						*(61.577.685,27)*	*479.790.472,08*	*11,53%*

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

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	JUNHO		ANO		VOL	Rendimento R$	PL (R$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses			
Art. 9º, inciso II - FI Investimento no Exterior						*1.688.796*	*49.199.093,85*	*1,18%*
VINCI INTERNACIONAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	5,45%	593,56%	-15,27%	-216,40%	14,54%	397.598,26	7.692.270,86	0,18%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-2,36%	-257,31%	-20,16%	-285,69%	11,78%	- 523.112,43	21.616.049,04	0,52%
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	-7,29%	-793,51%	-29,94%	-424,24%	25,78%	- 1.563.282,04	19.890.773,94	0,48%
Art. 9º, inciso III - FI Ações BDR Nível I						*1.005.974*	*108.540.807,81*	*2,61%*
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,83%	90,11%	-27,83%	-394,32%	21,13%	604.228,42	73.625.099,97	1,77%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,16%	126,76%	-37,02%	-524,60%	24,52%	401.745,49	34.915.707,85	0,84%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR						*(682.822,30)*	*157.739.901,66*	*3,79%*

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - ESTRUTURADOS	JUNHO		ANO		VOL	Rendimento R$	PL (R$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses			
Art. 10º, inciso I - FI ou FIC Multimercado						*8.746.198,99*	*255.019.163,13*	*6,13%*
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-7,71%	-839,65%	-17,44%	-247,12%	19,70%	- 1.844.437,91	22.077.103,95	0,53%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-7,76%	-845,46%	-17,60%	-249,42%	19,89%	- 3.634.281,06	43.177.099,39	1,04%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	0,47%	50,84%	7,28%	103,22%	1,92%	175.809,64	37.837.243,66	0,91%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,78%	84,42%	5,07%	71,83%	1,61%	57.309,06	7.449.574,68	0,18%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,80%	-86,91%	4,02%	56,89%	3,34%	- 916.117,53	113.876.718,50	2,74%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-7,79%	-848,10%	-17,59%	-249,22%	19,90%	- 2.584.481,19	30.601.422,95	0,74%
Art. 10º, inciso II - FI Participações						*2.116.063,18*	*79.350.873,56*	*1,91%*
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP*	-87,26%	-9502,12%	-87,56%	-1240,63%	87,36%	- 1.584.523,62	1.165.035,91	0,03%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTIESTRATÉGIA FIP	-2,21%	-240,53%	3,85%	54,60%	56,67%	- 531.539,56	78.185.837,65	1,88%
TOTAL ESTRUTURADOS						- 10.862.262,17	*334.370.036,69*	*8,03%*
TOTAL FUNPREV	*-1,57%*	*-170,45%*	*0,69%*	*9,81%*		- *59.773.064,61*	*4.162.124.754,73*	*100,00%*

* No mês de Junho/2022, o fundo BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP pagou amortização no valor de R$ 6.392.314,65, o que impactou no valor da cota do fundo.

1.2.4. FUNDO ESTRESSADO

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

FIDC BBIF MASTER	jun/22 Valor
APLICAÇÃO	12.000.000,00
Quant. Cotas	107,16
VALOR REAL(EXTRATO)	2.183.857,11
VALOR ATUALIZADO (IPCA + 8,5%)	55.530.650,50
RETORNO NO MËS (%)	-0,83%
RETORNO NO MËS ($)	- 18.173,52
PATRIMÔNIO DO FUNDO	28.641.828,97
VARIAÇÃO(atualizado - Valor Real)	- 53.346.793,39

1.2.5. EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FUNPREV

Gráfico 4: Evolução do Patrimônio Líquido – FUNPREV – Julho 2021 a Junho 2022.

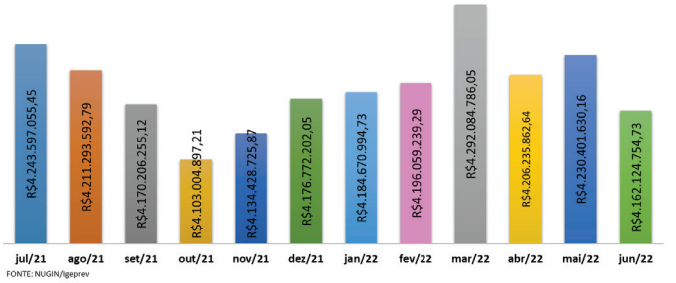
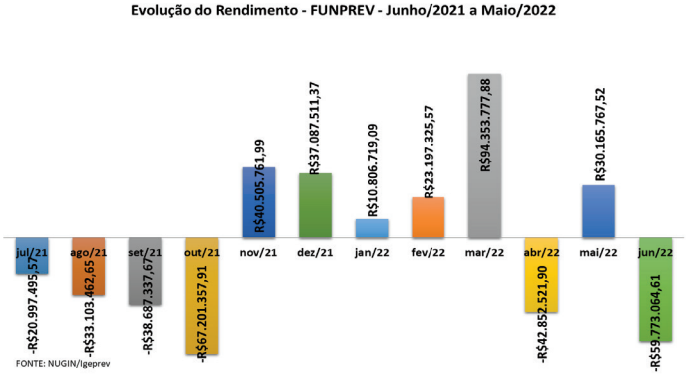



Gráfico 5: Evolução do Rendimento – FUNPREV – Julho 2021 a Junho 2022