

| | | | |
|----|--------------|-------------|-----------------------------------|
| 43 | 2022/1174129 | 516660/2017 | MARIA EDUARDA DE ARAÇÓ DE MENEZES |
| 44 | 2022/1174129 | 517095/2017 | RUTH GONÇALVES PAMPLONA |
| 45 | 2022/1174129 | 517140/2011 | MARIA HELENA PEREIRA DIAS |
| 46 | 2022/1174129 | 517140/2011 | JOÃO PEREIRA DIAS |
| 47 | 2022/1174129 | 517150/2011 | LELY DORADO ROCA DE JESUS |
| 48 | 2022/1174129 | 520847/2011 | EDILÉIA MONICA SILVA FERREIRA |
| 49 | 2022/1174389 | 505764/2020 | MARIA CRISTINA DE SOUZA PALHETA |
| 50 | 2022/1174389 | 506010/2020 | ELINAMARTA SOUZA DA CRUZ |
| 51 | 2022/1174389 | 520790/2011 | ANTONIO FERREIRA VIEIRA |

Belém, 16 de Setembro de 2022.

ILTON GIUSSEPP STIVAL MENDES DA ROCHA LOPES DA SILVA

Presidente do Instituto de Gestão Previdenciária do Estado do Pará – IGPREV.

Protocolo: 855707

O Presidente do Instituto de Gestão Previdenciária do Estado do Pará – IGPREV, 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 de Avaliação da Carteira de Investimentos – (FUNPREV/FINANPREV) – **MÊS DE JULHO/2022**.

1. INTRODUÇÃO

Os investimentos realizados ao longo de 2022 serão norteados pela Política de Investimento 2022, elaborada atendendo as disposições da Resolução CMN 4.963 publicada em 25/11/2021.

Considerando que a Política de Investimento 2022 foi aprovada pelo Conselho Estadual de Previdência - CEP no dia 15/07/2022, após a 1ª reunião ocorrida com a formação do novo conselho 2022.

Os investimentos realizados em **JULHO** de 2022 foram executadas de acordo com as estratégias de investimentos propostas na Política de 2022 e com as disposições contidas na nova Resolução 4.963/2021, tendo presentes os princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação à natureza de suas obrigações e transparência.

O **Relatório Mensal de Avaliação da Carteira de Investimento (FUNPREV/FINANPREV/SPSM)** contém um balanço geral do desempenho das carteiras de investimentos geridas pelo IGPREV, registrando todos os eventos relevantes ocorridos no **mês de JULHO/2022** para a gestão de recursos previdenciários.

2. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS IGPREV/PA

2.1. CARTEIRA GLOBAL IGPREV/PA

A carteira de investimentos do IGPREV Pará é composta por **67 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 – Julho de 2022

| CARTEIRA | RECEITA | | RENDIMENTO | PATRIMÔNIO LÍQUIDO | RETORNO MÊS | | RETORNO ANO | | |
|----------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|----------------------|-------------|--------|-------------|-------|--------|
| | APLICAÇÃO | RESGATE | | | TIR | MA | TIR | MA | TIR/MA |
| FUNPREV | R\$ 3.810,83 | R\$ 8.691.875,18 | R\$ 60.891.415,40 | R\$ 4.214.328.105,77 | 1,46% | -0,44% | 2,17% | 6,59% | 32,88% |
| FINANPREV-FUNDOS | R\$ - | R\$ - | R\$ 2.886.144,47 | R\$ 301.205.067,35 | 0,97% | -0,44% | 6,33% | 6,59% | 96,00% |
| FINANPREV-LFT | R\$ 214.423.568,11 | R\$ 232.871.308,79 | R\$ 872.544,05 | R\$ 24.392.843,85 | - | - | - | - | - |
| SPSM - LFT | R\$ 42.580.790,62 | R\$ 42.688.087,77 | R\$ 107.298,19 | - | - | - | - | - | - |
| Disponibilidade Financeira | - | - | R\$ 276.356.669,53 | - | - | - | - | - | - |
| IGPREV/PA | R\$ 257.008.169,56 | R\$ 284.251.271,74 | R\$ 64.577.402,11 | R\$ 4.816.282.686,50 | - | - | - | - | - |

Fonte: NUGIN/IGPREV

Gráfico 1: Distribuição de Recurso por Instituição Financeira – Julho de 2022

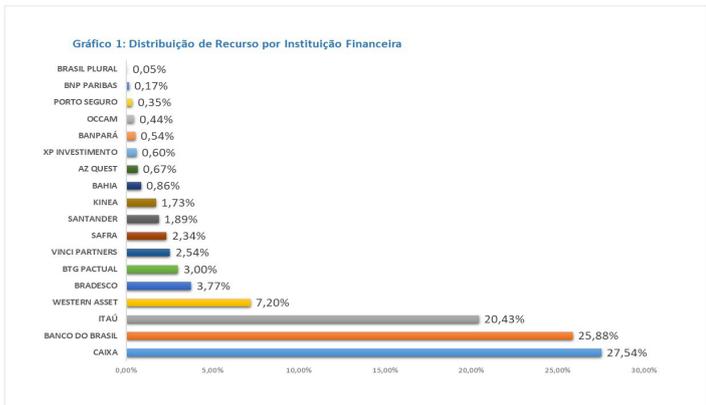


Gráfico 2: Distribuição de Recursos por Estratégia – Julho 2022

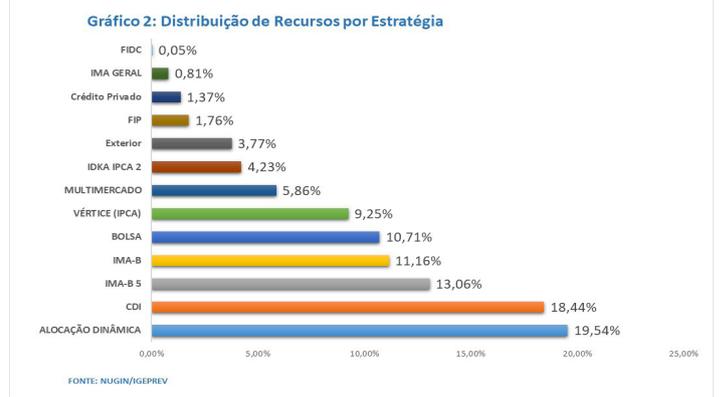
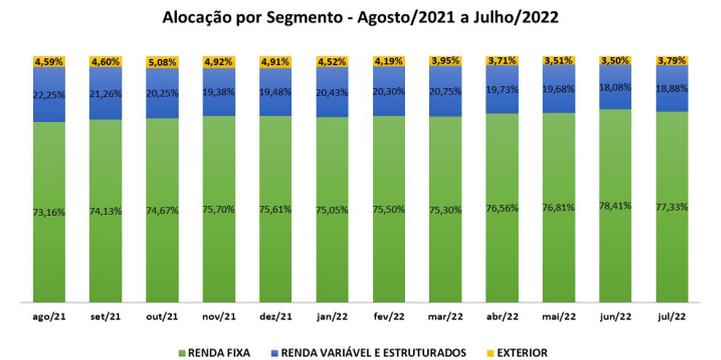


Gráfico 3: Alocação por Segmento – Agosto 2021 a Julho 2022 (somente Fundos de Investimentos)



2.2. CARTEIRA FUNPREV

2.2.1. HISTÓRICO DE MOVIMENTAÇÕES 2022

Tabela 2: Histórico de Movimentações 2022

| MÊS | SALDO | RECEITA | | RESGATE | | RENDIMENTO | SALDO |
|----------|------------------|------------------|-------------------|---------|-------------------|-------------------|-----------------------|
| | | ARRACAÇÃO | AMORTIZAÇÃO | LC 125 | PARA DE ADM | | |
| JANERO | 4.176.772.202,05 | R\$ 1.392.073,59 | R\$ - | R\$ - | R\$ 4.300.000,00 | R\$ 20.806.719,09 | R\$ 4.188.470.994,73 |
| FEBREIRO | 4.138.070.994,73 | R\$ 3.862.67,89 | R\$ - | R\$ - | R\$ 15.671.768,89 | R\$ 23.197.325,57 | R\$ 4.186.005.285,20 |
| MARÇO | 4.196.059.239,29 | R\$ - | R\$ 15.671.768,89 | R\$ - | R\$ 14.000.000,00 | R\$ 94.351.777,88 | R\$ 4.292.084.786,05 |
| ABRIL | 4.232.054.786,05 | R\$ 3.000.000,00 | R\$ - | R\$ - | R\$ 45.996.403,34 | R\$ 42.892.523,90 | R\$ 4.300.253.862,04 |
| MARÇO | 4.206.235.862,04 | 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\$ 6.392.316,65 | R\$ 59.773.064,61 |
| JULHO* | 4.162.124.754,73 | R\$ 3.810,83 | R\$ 22.068.003,54 | R\$ - | R\$ 8.500.000,00 | R\$ 8.591.875,18 | R\$ 63.163.234.754,73 |
| TOTAL | 4.162.124.754,73 | R\$ 8.254.761,47 | R\$ 22.068.003,54 | R\$ - | R\$ 49.996.403,34 | R\$ 41.991.875,18 | R\$ 22.068.003,54 |

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

2.2.2. MOVIMENTAÇÕES DA CARTEIRA JULHO

Tabela 3: Movimentações FUNPREV – Julho de 2022

| DATA | APLICAÇÃO | RESGATE | AMORTIZAÇÃO | FUNDO DE INVESTIMENTO | DESCRIÇÃO |
|------------|--------------|------------------|--------------|--|--|
| 20/07/2022 | R\$ 3.810,83 | R\$ - | R\$ - | ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP | APLICAÇÃO RECURSO PROVENIENTE DE AMORTIZAÇÃO - SALDO REMANESCENTE - RECURSO PREVIDENCIÁRIO |
| 25/07/2022 | R\$ - | R\$ 8.691.875,18 | R\$ - | CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | RESGATE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO |
| TOTAL | R\$ - | R\$ 8.691.875,18 | R\$ 3.810,83 | - | - |

Fonte: NUGIN/IGPREV
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 efetivamente aplicado.

2.2.3. COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR FUNDOS DE INVESTIMENTO

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

| FUNDO DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA | TIR | META* | TIR | TIR/META | VOL | Rendimento 12 meses | % CARTERA | |
|---|--------|--------|---------|----------|------------|---------------------|----------------|--------|
| | | | | | | | PL (R\$) | PL (%) |
| Art. 7º, I, "b" - FIC Renda Fixa | 0,00% | -0,44% | 4,47% | 98,14% | 2,54% | 6.741,82 | 223.870.853,42 | 5,31% |
| BB IMA-B FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 0,83% | -0,44% | 8,10% | 122,84% | 1,71% | 288.610,62 | 36.919.234,25 | 0,86% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,83% | -0,44% | 8,07% | 122,41% | 1,71% | 854.884,12 | 104.426.211,76 | 2,48% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,44% | -0,44% | 110,98% | 1,87% | 441.880,25 | 100.254.777,70 | 2,28% | |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,82% | -0,44% | 6,05% | 122,26% | 1,71% | 390.505,94 | 1,13% | |
| BTE PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 0,14% | -0,44% | 3,69% | 56,02% | 4,43% | 10.734,48 | 17.71.004,96 | 0,18% |
| BRASECO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | -0,91% | -0,44% | 5,21% | 48,72% | 5,48% | 438.592,57 | 47.904.857,24 | 1,14% |
| CAIXA BRASIL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | -0,32% | -0,44% | 3,18% | 48,27% | 4,71% | 133.328,98 | 38.313.322,02 | 0,91% |
| CAIXA BRASIL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | -0,33% | -0,44% | 2,99% | 48,46% | 4,89% | 104.142,60 | 31.716.817,40 | 0,75% |
| CAIXA BRASIL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 0,07% | -0,44% | 5,43% | 82,06% | 2,63% | 1.228.094,31 | 228.094.310,19 | 4,13% |
| CAIXA BRASIL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 0,02% | -0,44% | 6,53% | 99,12% | 2,62% | 29.152,53 | 140.995.463,86 | 3,26% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP | -0,29% | -0,44% | 6,10% | 92,36% | 2,76% | 529.044,14 | 180.571.712,15 | 4,28% |
| ITAU INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA I | 0,00% | -0,44% | 6,51% | 95,77% | 2,63% | 6.066,80 | 228.094.310,19 | 0,00% |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | -1,00% | -0,44% | 2,54% | 38,50% | 5,90% | 371.254,52 | 36.618.519,06 | 0,87% |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO RENDA FIXA | -0,97% | -0,44% | 1,85% | 28,00% | 0,91% | 382.296,71 | 39.241.660,98 | 0,93% |
| WESTERN ASSET ATIVO IMA-B RENDA FIXA | 0,91% | -0,44% | 4,40% | 52,78% | 2,41% | 327.883,27 | 25.189.872,40 | 0,60% |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,80% | -0,44% | 6,12% | 92,84% | 0,76% | 2.155.218,75 | 270.862.352,22 | 6,43% |
| ITAU INSTITUCIONAL LEGEND FIC RENDA FIXA LP | -0,78% | -0,44% | 9,00% | 95,52% | 1,96% | 804.748,96 | 110.417.402,12 | 2,82% |
| Art. 7º, II, "b" - FIC Renda Fixa | 0,83% | -0,44% | 4,47% | 98,14% | 2,54% | 3.810,83 | 223.870.853,42 | 5,31% |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | -0,89% | -0,44% | 3,27% | 49,67% | 5,56% | 3.068.121,53 | 325.441.404,73 | 7,72% |
| XP INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP | -0,55% | -0,44% | 5,28% | 79,37% | 3,68% | 149.826,74 | 27.713.940,27 | 0,60% |
| BRASECO INFLA FIC RENDA FIXA | -0,44% | -0,44% | 2,69% | 40,84% | 6,10% | 141.864,61 | 71.923.930,07 | 1,75% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 1,04% | -0,44% | 6,64% | 100,68% | 0,17% | 5.629.681,96 | 548.923.135,43 | 13,03% |
| WESTERN ASSET ATIVO FIC RENDA FIXA | 1,13% | -0,44% | 6,27% | 95,08% | 0,91% | 964.081,88 | 86.300.589,16 | 2,05% |
| ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF FIC | 0,84% | -0,44% | 6,40% | 102,24% | 0,26% | 1.082.469,76 | 129.381.038,39 | 3,07% |
| BB INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA | 1,05% | -0,44% | 5,01% | 76,06% | 0,14% | 17.969,50 | 1.735.693,31 | 0,04% |
| Art. 9º, V, "b" - FIC Renda Fixa | -1,81% | -0,44% | -4,68% | -70,95% | 1,54% | 39.426,96 | 2.144.430,15 | 0,05% |
| BB MASTER FIC LP | - | - | - | - | - | 213.368,66 | 19.604.635,95 | 0,47% |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FIC RF CP LP | 1,10% | -0,44% | 5,25% | 79,68% | 0,28% | 213.368,66 | 19.604.635,95 | 0,47% |

* A meta foi negativa em virtude de deflação ocorrida em julho

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

| FUNDO DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL | TIR | META* | TIR | TIR/META | VOL | Rendimento 12 meses | % CARTERA | |
|--|-------|--------|---------|----------|--------|---------------------|----------------|--------|
| | | | | | | | PL (R\$) | PL (%) |
| Art. 8º, inciso I - FI Ações | 5,09% | -0,44% | -0,85% | -12,97% | 21,03% | 653.285,96 | 506.632.386,94 | 12,02% |
| ITAU FOF RP IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 4,63% | -0,44% | -1,46% | -22,08% | 21,70% | 92.602,11 | 2.092.005,18 | 0,05% |
| CAIXA BRASIL INDEMA IBOVESPA FIC AÇÕES | 4,55% | -0,44% | -5,31% | -85,21% | 21,12% | 56.816,01 | 1.305.127,90 | 0,03% |
| AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES | 4,89% | -0,44% | 2,01% | 30,42% | 22,52% | 154.092,93 | 3.306.511,44 | 0,08% |
| BNP PARIBAS SMALL CAPS FIC AÇÕES | 5,15% | -0,44% | -10,87% | -164,84% | 25,94% | 219.014,52 | 4.473.699,54 | 0,11% |
| BRASECO MID SMALL CAPS FIC AÇÕES | 5,81% | -0,44% | -7,79% | -118,20% | 25,88% | 935.297,53 | 17.041.131,04 | 0,40% |
| BRASECO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES | 6,61% | -0,44% | 2,79% | 42,27% | 23,27% | 213.371,02 | 3.443.123,74 | 0,08% |
| BTE PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 5,51% | -0,44% | -5,73% | -85,41% | 25,40% | 6.623.738,12 | 84.468.639,22 | 2,00% |
| ITAU DIVIDENDOS FIC AÇÕES | 2,55% | -0,44% | 1,13% | 17,17% | 18,82% | 62.551,47 | 2.514.063,79 | 0,06% |
| ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES | 6,01% | -0,44% | -3,20% | -48,49% | 18,85% | | | |