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

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	JULHO TIR	JULHO META*	ANO TIR	ANO TIR/META	VOL 12 meses	Rendimento R$	PL (R$)	% CARTEIRA
Art. 9º, inciso II - FI Investimento no Exterior						***3.935.628***	***53.134.722,06***	***1,26%***
VINCI INTERNACIONAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	3,07%	-0,44%	-12,67%	-192,24%	14,91 %	236.036,32	7.928.307,18	0,19%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIM	6,04%	-0,44%	-15,34%	-232,77%	13,87 %	1.304.731,20	22.920.780,25	0,54%
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOI	12,04%	-0,44%	-21,51%	-326,25%	24,96 %	2.394.860,69	22.285.634,63	0,53%
Art. 9º, inciso III - FI Ações BDR Nível I						***9.437.424***	***117.978.231,80***	***2,80%***
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,88%	-0,44%	-22,14%	-335,94%	21,22 %	5.799.479,62	79.424.579,58	1,88%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10,42%	-0,44%	-30,46%	-462,12%	26,68 %	3.637.944,37	38.553.652,21	0,91%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR						***13.373.052,20***	***171.112.953,86***	***4,06%***

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - ESTRUTURADOS	JULHO TIR	JULHO META*	ANO TIR	ANO TIR/META	VOL 12 meses	Rendimento R$	PL (R$)	% CARTEIRA
Art. 10º, inciso I - FI ou FIC Multimercado						***11.115.762,59***	***266.134.925,72***	***6,32%***
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	10,02%	-0,44%	-9,17%	-139,06%	21,05 %	2.212.482,06	24.289.586,01	0,58%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	10,11%	-0,44%	-9,27%	-140,69%	21,23 %	4.364.378,10	47.541.477,49	1,13%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	0,00%	-0,44%	7,28%	110,50%	3,16 % -	363,42	37.836.880,24	0,90%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1,17%	-0,44%	6,30%	95,63%	2,36 %	87.523,47	7.537.098,15	0,18%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,20%	-0,44%	5,26%	79,81%	3,76 %	1.363.945,51	115.240.664,01	2,73%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	10,09%	-0,44%	-9,27%	-140,68%	21,21 %	3.087.796,87	33.689.219,82	0,80%
Art. 10º, inciso II - FI Participações						***505.329,93***	***79.856.203,49***	***1,89%***
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP*	0,34%	-0,44%	-87,51%	-1327,64%	87,14 %	4.012,16	1.169.048,06	0,03%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTIESTRATÉGIA FIP	0,64%	-0,44%	4,52%	68,56%	6,02 %	501.317,77	78.687.155,42	1,87%
TOTAL ESTRUTURADOS						***11.621.092,52***	***345.991.129,21***	***8,21%***
TOTAL FUNPREV	***1,46%***	***-0,44%***	***2,17%***	***32,88%***	***4,53%***	***60.891.415,40***	***4.214.328.105,77***	***100,00%***

* A meta em Julho foi negativa devido a deflação do IPCA (-0,68%)

2.2.4. FUNDO ESTRESSADO

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

FIDC BBIF MASTER	jul/22 Valor
APLICAÇÃO	12.000.000,00
Quant. Cotas	107,16
VALOR REAL(EXTRATO)	2.144.430,13
VALOR ATUALIZADO (IPCA + 8,5%)	55.528.800,00
RETORNO NO MËS (%)	-1,81%
RETORNO NO MËS ($)	- 39.426,96
PATRIMÔNIO DO FUNDO	27.979.072,91
VARIAÇÃO(atualizado - Valor Real)	- 53.384.369,87

2.2.5. EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FUNPREV

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

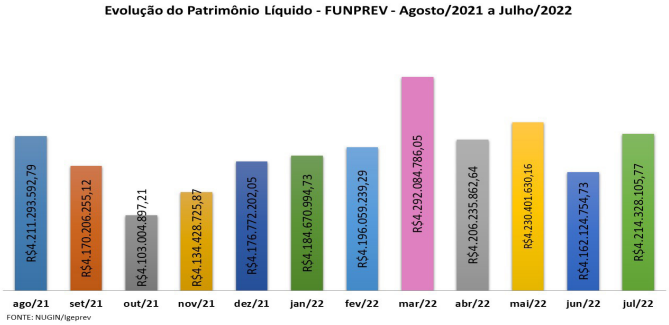
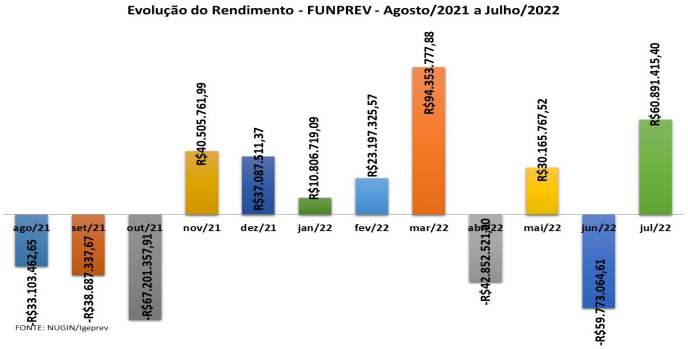


Gráfico 5: Evolução do Rendimento – FUNPREV – Agosto 2021 a Julho 2022



2.3. CARTEIRA FINANPREV

2.3.1. COMPOSIÇÃO POR FUNDOS DE INVESTIMENTOS E LFT

Tabela 7: Carteira de Investimentos – FINANPREV – Julho2022

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	JULHO TIR	JULHO META	ANO TIR	ANO TIR/META	VOL 12 meses	Rendimento R$	PL (R$)	% CARTEIRA
Art. 7º, inciso I, alínea "b" FI 100% Títulos Públicos						***R$ 9.144,28***	***R$ 16.558.161,74***	***5,09%***
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	-0,29%	-0,44%	6,10%	92,56%	3,82 %	-R$ 33.023,41	R$ 11.258.634,32	3,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,80%	-0,44%	6,12%	92,84%	1,67 %	R$ 42.167,69	R$ 5.299.527,41	1,63%
Art. 7º, inciso II.						***R$ 872.544,06***	***R$ 24.392.843,85***	***7,49%***
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS	*	*				R$ 872.544,06	R$ 24.392.843,85	7,49%
Art. 7º, inciso III, alínea "a" - Limite % RPPS até 60%- Limite 5 PL até 15%						***R$ 2.409.387,68***	***R$ 241.830.485,76***	***74,27%***
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,04%	-0,44%	6,64%	100,68%	0,78 %	R$ 19.521,82	R$ 1.903.478,23	0,58%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	1,13%	-0,44%	6,27%	95,08%	1,13 %	R$ 501.991,44	R$ 44.962.214,86	13,81%
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	1,18%	-0,44%	5,70%	86,43%	1,29 %	R$ 183.598,18	R$ 15.766.831,39	4,84%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	-0,44%	6,60%	100,08%	0,80 %	R$ 195.577,93	R$ 19.330.879,60	5,94%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,08%	-0,44%	6,85%	103,95%	0,76 %	R$ 227.571,20	R$ 21.349.233,65	6,56%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,63%	-0,44%	4,98%	75,52%	1,62 %	R$ 238.234,55	R$ 38.066.227,94	11,69%
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA	1,06%	-0,44%	6,71%	101,79%	0,86 %	R$ 292.628,10	R$ 27.982.778,59	8,59%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,05%	-0,44%	6,65%	100,95%	0,76 %	R$ 750.264,46	R$ 72.468.841,51	22,26%
Art. 7º, inciso V, alínea "b" - Limite % RPPS até 40% - Limite % PL de 15%						***R$ 467.612,51***	***R$ 42.816.419,86***	***13,15%***
BTG PACTUAL YIELD FI RF REF. DI CRÉDITO PRIVADO	1,10%	-0,44%	6,88%	104,42%	0,80 %	R$ 467.612,51	R$ 42.816.419,86	13,15%
TOTAL FINANPREV	***0,97%***	***-0,44%***	***6,33%***	***96,00%***	***1,03%***	***R$ 3.758.688,53***	***R$ 325.597.911,20***	***100,00%***

FONTE: NUGIN/IGEPREV

OBSERVAÇÃO:

1) Não foi calculada a Taxa de Retorno e Volatilidade das operações compromissadas em virtude dessa aplicação ser de curtíssimo prazo(1 mês).
2) Nessa planilha não considerar informações do SPSM
3) A meta em Julho foi negativa devido a deflação do IPCA (-0,68%)

2.3.2. EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FINANPREV

Gráfico 6: Evolução do Patrimônio Líquido - FINANPREV (Fundos + LFT) - Agosto/2021 a Julho/2022

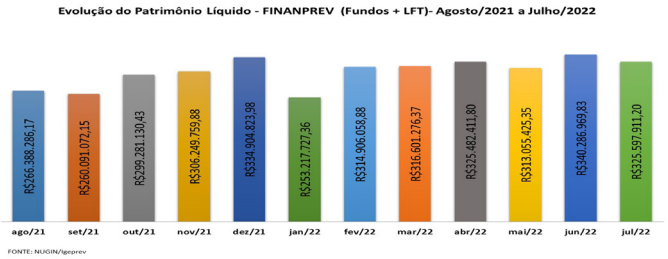
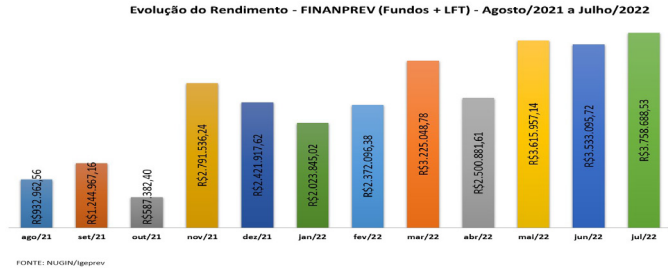


Gráfico 7: Evolução do Rendimento do FINANPREV (Fundos + LFT) – Agosto/2021 a Julho/2022



3. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

Para custear as despesas administrativas de **Julho de 2022**, foram utilizadas as receitas arrecadadas do FUNPREV diretamente pelo setor de arrecadação mais R$ 8.691.875,18 resgatados dos recursos aplicados no FUNPREV.

No ano já foram resgatados dos fundos de investimentos da carteira FUNPREV e repassado para o pagamento das despesas do Igeprev o valor de R$ 41.491.875,18 (quarenta e um milhões, quatrocentos e noventa e um mil, oitocentos e setenta e cinco reais e dezoito centavos).

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO		
MÊS	**VALOR REPASSADO**	
JANEIRO	R$	4.300.000,00
FEVEREIRO	R$	-
MARÇO	R$	14.000.000,00
ABRIL	R$	-
MAIO	R$	6.000.000,00
JUNHO	R$	8.500.000,00
JULHO	R$	8.691.875,18
TOTAL	**R$**	**41.491.875,18**

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

Tabela 8: Transferência FUNPREV para FINANPREV – 2016 A 2022

TRANSFERÊNCIAS FUNPREV PARA O FINANPREV			
PERÍODO	**DESCRIÇÃO**		**VALOR**
2016	TRANSFERÊNCA RENDIMENTO ANO DE 2016	R$	652.065.924,15
2017	TRANSFERÊNCA RENDIMENTO ANO DE 2017	R$	576.435.802,81
2018	TRANSFERÊNCA RENDIMENTO ANO DE 2018	R$	411.344.663,66
2019	TRANSFERÊNCA RENDIMENTO ANO DE 2019	R$	629.863.135,36
2020	TRANSFERÊNCA RENDIMENTO ANO DE 2020	R$	209.416.677,77
2021	TRANSFERÊNCA RENDIMENTO ANO DE 2021	R$	80.224.987,67
2022	TRANSFERÊNCA 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 Julho de 2022.

Tabela 9: 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	-
abr/22	- 42.852.521,90			- 42.852.521,90
mai/22	30.165.767,52	30.165.767,52		- 12.686.754,38
jun/22	- 59.773.064,61			- 72.459.818,99
jul/22	60.891.415,40	60.891.415,40		- 11.568.403,59
Total				

*O saldo é transferido no mês subsequente