

2.5. EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FUNPREV

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

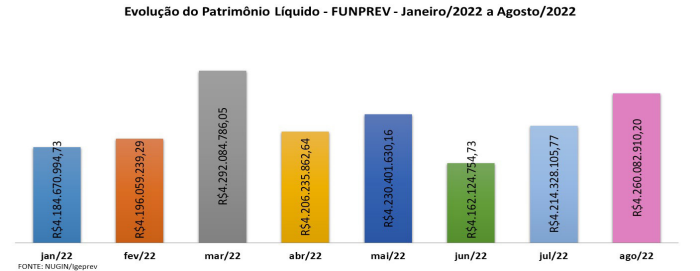
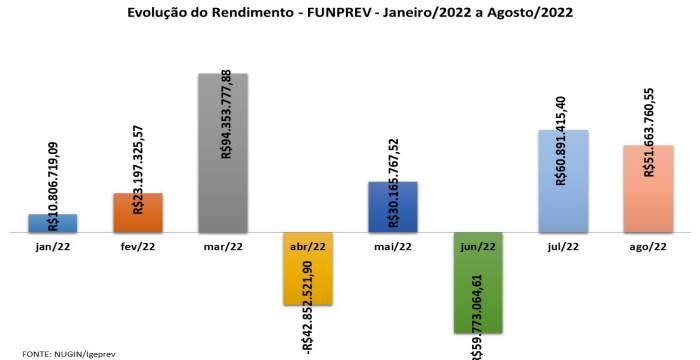


Gráfico 5: Evolução do Rendimento – FUNPREV – Janeiro/2022 a Agosto 2022



2.6. CARTEIRA FINANPREV

2.6.1. COMPOSIÇÃO POR FUNDOS DE INVESTIMENTOS E LFT

Tabela 7: Carteira de Investimentos – FINANPREV – Agosto 2022

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	AGOSTO		ANO		VOL	Taxa Adm	Taxa Performance	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
	TIR	META	TIR	META						
Art. 7º, inciso I, alínea "b" - F1 100% Títulos Públicos								R\$ 20.084,44	R\$ 16.578.246,18	4,72%
CANEA BRASIL IONIA IPCA 24 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	-0,11%	-0,11%	5,99%	87,33%	2,82%	0,20%	0,00%	R\$ 12.243,87	R\$ 11.246.390,46	3,20%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,63%	-0,11%	6,77%	98,72%	1,40%	0,40%	0,00%	R\$ 32.328,31	R\$ 5.331.855,72	1,52%
Art. 7º, inciso II								R\$ 978.275,61	R\$ 23.744.122,82	6,75%
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS								R\$ 2.905.370,78	R\$ 267.888.090,83	76,20%
Art. 7º, inciso III, alínea "a" - Limite % RPPS até 60% - Limite 5 PL até 15%								R\$ 22.523,96	R\$ 1.926.002,19	0,55%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,18%	-0,11%	7,90%	115,23%	0,16%	0,20%	0,00%	R\$ 577.894,66	R\$ 45.540.109,51	12,95%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	1,29%	-0,11%	7,63%	111,36%	0,91%	0,40%	0,00%	R\$ 23.868,09	R\$ 23.176.102,38	6,59%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,10%	-0,11%	0,10%	1,50%	0,16%	0,20%	0,00%	R\$ 191.179,63	R\$ 15.958.021,02	4,54%
PORTO SEGURO CLASSICO FIC RENDA FIXA LP	1,22%	-0,11%	6,98%	101,81%	1,19%	0,50%	0,00%	R\$ 226.991,68	R\$ 19.557.871,18	5,56%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,17%	-0,11%	7,85%	114,50%	0,17%	0,20%	0,00%	R\$ 258.338,69	R\$ 21.607.472,33	6,15%
BRASECO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,21%	-0,11%	8,14%	118,82%	0,16%	0,20%	0,00%	R\$ 374.798,13	R\$ 38.441.026,07	10,93%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,98%	-0,11%	6,01%	87,70%	1,30%	0,40%	0,00%	R\$ 339.130,50	R\$ 28.321.909,09	8,06%
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA	1,21%	-0,11%	8,00%	116,76%	0,25%	0,30%	0,00%	R\$ 890.745,55	R\$ 73.359.587,06	20,87%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,23%	-0,11%	7,97%	116,21%	0,17%	0,20%	0,00%	R\$ 514.289,51	R\$ 43.330.709,37	12,33%
Art. 7º, inciso V, alínea "b" - Limite % RPPS até 40% - Limite % PL de 15%								R\$ 514.289,51	R\$ 43.330.709,37	12,33%
BTG FUNDAL VILHO FI RF REF. DI CRÉDITO PRIVADO	1,20%	-0,11%	8,17%	119,15%	0,17%	0,30%	0,00%	R\$ 4.418.020,34	R\$ 351.541.169,20	100,00%
TOTAL FINANPREV	1,13%	-0,11%	7,53%	116,42%						

Observação:
1) Não foi calculada a Taxa de Retorno e Volatilidade das operações comprometidas em virtude dessa aplicação ser de curto prazo (até 12 meses).
2) Nessa planilha não consideramos informações do SPDM.
3) A meta em AGOSTO foi negativa devido a deflação do IPCA (-0,38%).
4) O fundo Santander Institucional premium entrou na carteira no dia 29/08/2022.

2.6.2. EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FINANPREV

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

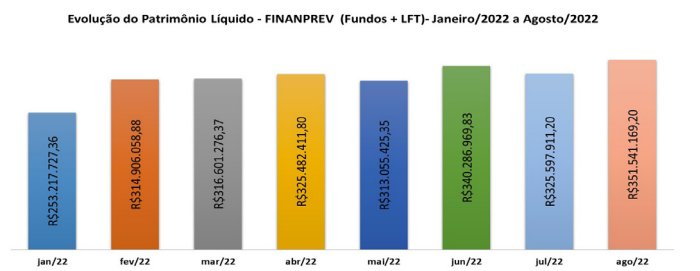
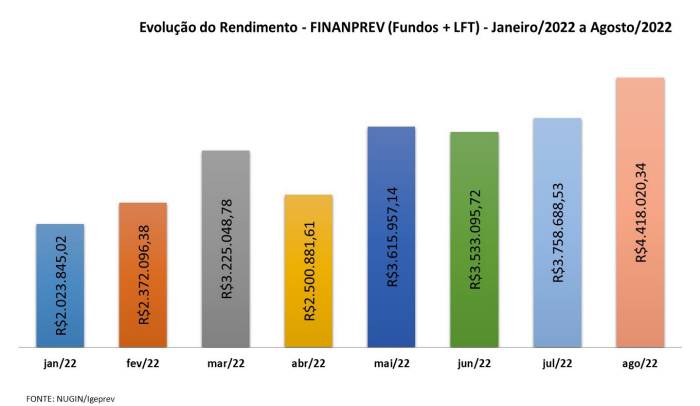


Gráfico 7: Evolução do Rendimento do FINANPREV (Fundos + LFT) – Janeiro/2022 a Agosto/2022



3. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

A taxa de administração é a taxa de manutenção para atender as despesas administrativas do Igeprev/PA. Ela é custeada exclusivamente pelos recursos provenientes da arrecadação previdenciária do FUNPREV. Nos casos em que a arrecadação não cobre a taxa de administração, é solicitado o resgate dos recursos capitalizados nos fundos de investimentos da carteira FUNPREV.

Para custear as despesas administrativas de Agosto de 2022, foram utilizadas as receitas arrecadadas do FUNPREV diretamente pelo setor de arrecadação mais o valor de R\$ 5.800.000,00, recurso resgatado dos fundos de investimentos da carteira 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\$ 47.291.875,18 (quarenta e sete milhões, duzentos e noventa e um mil, oitocentos e setenta e cinco reais e dezoito centavos). O valor total utilizado para pagamento das despesas com taxa de administração está demonstrado no quadro abaixo.

Tabela 8: Recurso utilizado para a taxa de administração

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO			
MÊS	Resgatado dos fundos de investimentos do FUNPREV	Proveniente da Receita Arrecadada do FUNPREV	Total
JANEIRO	R\$ 4.300.000,00	R\$ 7.500.000,00	R\$ 11.800.000,00
FEVEREIRO	R\$ 0,00	R\$ 9.000.000,00	R\$ 9.000.000,00
MARÇO	R\$ 14.000.000,00	R\$ 7.000.000,00	R\$ 21.000.000,00
ABRIL	R\$ 0,00	R\$ 8.000.000,00	R\$ 8.000.000,00
MAIO	R\$ 6.000.000,00	R\$ 8.031.675,91	R\$ 14.031.675,91
JUNHO	R\$ 8.500.000,00	R\$ 10.269.148,19	R\$ 18.769.148,19
JULHO	R\$ 8.691.875,18	R\$ 10.495.937,61	R\$ 19.187.812,79
AGOSTO	R\$ 5.800.000,00	R\$ 10.721.384,08	R\$ 16.521.384,08
TOTAL	R\$ 47.291.875,18	R\$ 71.018.145,79	R\$ 118.310.020,97

Fonte: Nugin/Coaf

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

Tabela 9: 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\$ 86.091.758,47
TOTAL		R\$ 2.645.442.949,89

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\$ 2.645.442.949,89 no período de 2016 até Agosto de 2022.

Tabela 10: 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
ago/22	51.663.760,55	11.568.403,59	40.095.356,96	-
Total				

*O saldo é transferido no mês subsequente