

O Presidente do Instituto de Gestão Previdenciária do Estado do Pará – IGEPREV, 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 DEZEMBRO/2022.

1. INTRODUÇÃO

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

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 2022 foram executados de acordo com as estratégias de investimentos propostas na Política de Investimentos 2022 e com as disposições contidas na Resolução CMN 4.963/2021 e Portaria 1.467/2022, tendo presentes os princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação à natureza de suas obrigações e transparência.

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

2. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS IGEPREV/PA

2.1. CARTEIRA GLOBAL IGEPREV/PA

A carteira de investimentos do IGEPREV Pará é composta por 68 fundos de investimentos distribuídos entre 17 gestores, além das operações compromissadas (LFT) executadas pelo banco do Estado – Banpará, e Títulos Públicos e Títulos Privados 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 – Dezembro de 2022

CARTEIRA	RECEITA		RENDIMENTO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	RETORNO NO MÊS		
	APLICAÇÃO	RESGATE			TIR	MA	TIR/MA
FUNPREV	R\$ 295.955.866,72	R\$ 298.945.722,75	-R\$ 237.782,01	R\$ 4.176.684.791,46	0,00%	0,87%	0,00%
FINANPREV- FUNDOS	-	-	R\$ 3.906.541,64	R\$ 363.966.124,33	1,08%	0,87%	124,71%
FINANPREV-LFT	R\$ 202.512.680,63	R\$ 192.798.347,07	R\$ 444.490,10	R\$ 58.297.873,29	-	-	-
SPSM - LFT	R\$ 59.474.440,77	R\$ 49.934.282,33	R\$ 92.790,58	R\$ 10.281.214,86	-	-	-
Taxa ADM-LFT	-	-	-	-	-	-	-
Disponibilidade Financeira	-	-	-	R\$ 203.745.581,20	-	-	-
IGEPREV/PA	R\$ 557.942.988,12	R\$ 541.678.352,15	R\$ 4.206.040,31	R\$ 4.812.975.585,14	-	-	-

Fonte: NUGIN/IGEPREV

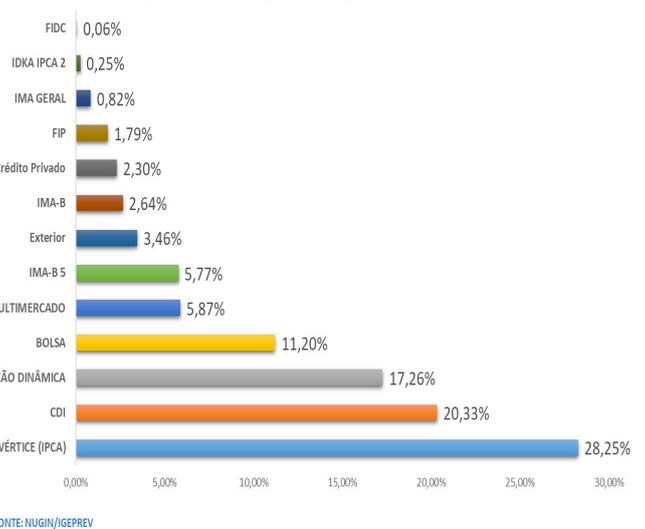
Tabela 2: Carteira de Investimento Global – Ano 2022

CARTEIRA	RECEITA		RENDIMENTO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	RETORNO NO ANO		
	APLICAÇÃO	RESGATE			TIR	MA	TIR/MA
FUNPREV	R\$ 1.343.289.482,16	R\$ 1.453.295.742,10	R\$ 234.887.992,53	R\$ 4.176.684.791,46	4,86%	8,96%	54,24%
FINANPREV- FUNDOS	R\$ 94.516.497,93	R\$ 15.868.011,02	R\$ 33.669.075,21	R\$ 363.966.124,33	11,89%	8,96%	132,74%
FINANPREV-LFT	R\$ 2.200.849.859,60	R\$ 2.150.091.233,08	R\$ 7.887.096,29	R\$ 58.297.873,29	-	-	-
SPSM - LFT	R\$ 432.935.968,89	R\$ 423.591.631,87	R\$ 916.597,12	R\$ 10.281.214,86	-	-	-
Taxa ADM-LFT	R\$ 14.472.172,29	R\$ 14.504.586,44	R\$ 32.414,23	-	-	-	-
Disponibilidade Financeira	-	-	-	R\$ 203.745.581,20	-	-	-
IGEPREV/PA	R\$ 4.086.063.980,87	R\$ 4.057.351.204,51	R\$ 277.393.175,37	R\$ 4.812.975.585,14	-	-	-

Fonte: NUGIN/IGEPREV

Gráfico 2: Distribuição de Recursos por Estratégia – Dezembro 2022

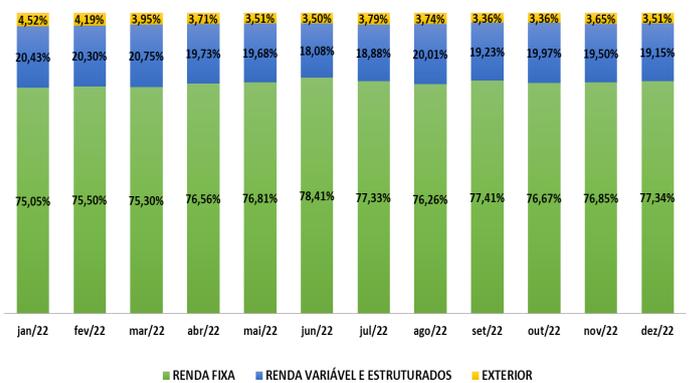
Gráfico 2: Distribuição de Recursos por Estratégia



Fonte: NUGIN/IGEPREV

Gráfico 3: Alocação por Segmento – Janeiro 2022 a Dezembro 2022 (so-mente Fundos de Investimentos)

Alocação por Segmento - Janeiro/2022 a Dezembro/2022



2.2. CARTEIRA FUNPREV

2.2.1. HISTÓRICO DE MOVIMENTAÇÕES 2022

Tabela 2: Historico de Movimentações 2022

MÊS	SALDO ANTERIOR	RECEITA APLICADA				RESGATE			RENDIMENTO	DISPONIBILIDADE	SALDO ATUAL
		ABREVIADA	OUTROS(*)	AMORTIZAÇÃO	LC 125	TAXA DE ADM.	OUTROS(*)	AMORTIZAÇÃO			
JANERO	4.176.772.202,05	R\$ 1.392.073,59	-	R\$ 100.000.000,00	R\$ 11.949.807,54	-	R\$ 100.000.000,00	R\$ 26.821.503,69	R\$ 10.806.713,09	R\$ 4.184.670.994,73	
FEBREIRO	4.184.670.994,73	R\$ 3.863.687,88	-	R\$ 15.671.768,89	-	-	-	-	R\$ 23.197.325,57	R\$ 4.184.969.432,15	
MARÇO	4.184.969.432,15	-	-	-	-	-	R\$ 14.000.000,00	-	R\$ 94.263.777,88	R\$ 4.280.934.978,91	
ABRIL	4.280.934.978,91	R\$ 3.000.000,00	-	-	-	R\$ 45.996.401,51	-	-	R\$ 42.862.521,90	R\$ 4.195.086.055,50	
MAIO	4.195.086.055,50	-	-	-	-	-	R\$ 6.000.000,00	-	R\$ 30.165.767,52	R\$ 4.219.251.823,02	
JUNHO	4.219.251.823,02	-	R\$ 3.551.318,00	R\$ 6.388.510,82	-	R\$ 8.500.000,00	R\$ 3.551.318,00	R\$ 6.392.214,65	R\$ 50.773.064,61	R\$ 4.150.974.947,59	
JULHO	4.150.974.947,59	-	-	R\$ 3.810,83	-	R\$ 8.801.875,18	-	-	R\$ 69.891.415,40	R\$ 4.203.178.298,63	
AGOSTO	4.203.178.298,63	-	R\$ 187.161.159,11	R\$ 76.138.761,40	-	R\$ 5.800.000,00	R\$ 343.584.534,16	R\$ 76.178.082,40	R\$ 51.663.760,55	R\$ 156.354.226,27	
SETEMBRO	4.203.178.298,63	-	R\$ 254.383.370,31	R\$ 39.920,00	-	R\$ 40.095.356,96	R\$ 2.400.000,00	R\$ 98.000.000,46	R\$ 15.617.884,62	R\$ 4.907.833,72	
OUTUBRO	4.222.732.405,36	-	R\$ 199.900.943,70	-	-	R\$ 5.617.884,62	R\$ 4.000.000,00	R\$ 201.000.000,00	R\$ 89.578.928,21	R\$ 5.916.855,58	
NOVEMBRO	4.302.623.414,54	-	R\$ 4.772.671,10	-	-	R\$ 74.003.657,55	R\$ 6.665.000,00	R\$ 182.143.980,91	R\$ 15.576.581,25	R\$ 28.524.293,43	
DEZEMBRO	4.179.828.375,15	-	R\$ 295.955.866,72	-	-	R\$ 5.500.000,00	R\$ 293.445.722,75	-	R\$ 237.782,13	R\$ 1.467.123,62	
TOTAL	R\$ 13.027.433,57	R\$ 1.220.869.476,51	R\$ 109.392.572,08	R\$ 165.713.300,64	R\$ 65.896.875,18	R\$ 1.221.725.566,28	R\$ 124.969.133,33	R\$ 234.887.979,76	R\$ 1.731.911.894,81	R\$ 4.178.067.860,61	

Fonte: NUGIN/IGEPREV

Observações:

1. Receita Aplicada (Outros): Identifica as receitas aplicadas provenientes de realocação estratégica da própria carteira, chamadas de capital e saldo disponível em conta
2. Resgate(Outros): Identifica os valores que foram resgatados para realocação da carteira, chamada de capital ou sequestro judicial
3. Em novembro, o valor de R\$ 15.575.270,66, referente a pagamento de cupons NTNFBs, amortização de fundo e saldo em conta, foi utilizado para complementar o valor da Transferência para atendimento da LC
4. Em dezembro, foi contabilizado o valor de R\$ 1.000.638,87 no resgate, referente a sequestro judicial
5. Disponibilidade Financeira: refere-se ao saldo nas contas correntes de investimentos apenas da carteira FUNPREV. A disponibilidade financeira informada estava bloqueada judicialmente na data de 30/12/2022, impossibilitando sua movimentação.

2.2.2. MOVIMENTAÇÕES DA CARTEIRA DEZEMBRO

Tabela 3: Movimentações FUNPREV – Dezembro de 2022

DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	TRANSFERÊNCIA	ATIVO		DESCRIÇÃO
				ATIVO	ATIVO	
01/12/2022		R\$ 344.496,30		BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP		Sequestro por decisão judicial
07/12/2022		R\$ 40.000,00		BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP		Sequestro por decisão judicial
08/12/2022		R\$ 263.755,45		BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP		Sequestro por decisão judicial
14/12/2022		R\$ 48.480,00		BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP		Sequestro por decisão judicial
15/12/2022		R\$ 42.705,78		BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP		Sequestro por decisão judicial
19/12/2022		R\$ 55.752,00		BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP		Sequestro por decisão judicial
20/12/2022		R\$ 130.398,93		BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP		Sequestro por decisão judicial
06/12/2022		R\$ 34.462,31		BRASESCO H VALUATION		Sequestro por decisão judicial
14/12/2022		R\$ 37.662,10		SANTANDER BR CREDITO PRIVADO CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI		Sequestro por decisão judicial
15/12/2022		R\$ 5.500.000,00		CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP		Taxa de Administração
21/12/2022		R\$ 40.000.000,00		CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA		Realocação Estratégica - Compra LF
21/12/2022		R\$ 25.300.000,00		WESTERN ASSET ATIVO MAX FIC RENDA FIXA		Realocação Estratégica - Chamado de Capital Kinea e Compra NTNFBs
21/12/2022		R\$ 227.145.089,88		BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP		Realocação Estratégica - Chamado de Capital Kinea e Compra NTNFBs
21/12/2022		R\$ 40.000.000,00		USBN BTG Pactual - VENC. 02/12/2022 - IPCA+4%		Realocação Estratégica - Compra LF
23/12/2022		R\$ 3.189.760,00		1º Chamada de Capital Kinea		Chamada de Capital Kinea
23/12/2022			R\$ 3.000.000,00	Recursos de aplicação utilizado individualmente pelo CDAF para pagamento de taxa de administração		Recursos utilizados pelo CDAF
27/12/2022			R\$ 3.000.000,00	Devolução de valor pela CDAF		Recursos devolvidos pelo CDAF
28/12/2022		R\$ 120.224.000,76		NTN-B 760299 2050 - 6,52%		Realocação Estratégica - Compra NTNFBs
28/12/2022		R\$ 120.223.551,04		NTN-B 760299 2040 - 6,27%		Realocação Estratégica - Compra NTNFBs
30/12/2022		R\$ 12.318.546,92		ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP		Aplicação de Recursos disponível em conta
TOTAL	R\$ 295.955.866,72	R\$ 298.945.722,75				

Fonte: Nugin/igeprev

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



Gráfico 1: Distribuição de Recurso por Instituição Financeira – Dezembro de 2022
 FONTE: NUGIN/IGEPREV