

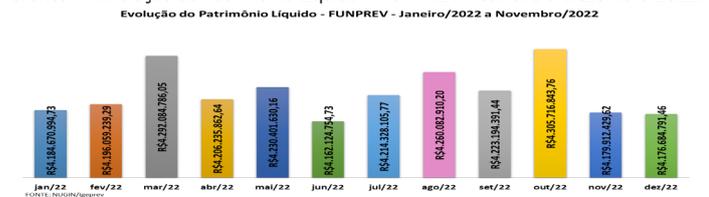
2.2.4. FUNDO ESTRESSADO

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

FIDC BBIF MASTER	Valor
APLICAÇÃO	12.000.000,00
Quant. Cotas	107,16
VALOR REAL(EXTRATO)	2.651.197,31
VALOR ATUALIZADO (IPCA + 8,5%)	58.024.800,00
RETORNO NO MÊS (%)	25,28%
RETORNO NO MÊS (\$)	534.910,87
PATRIMÔNIO DO FUNDO	34.591.028,13
VARIAÇÃO(atualizado - Valor Real)	- 55.373.602,69

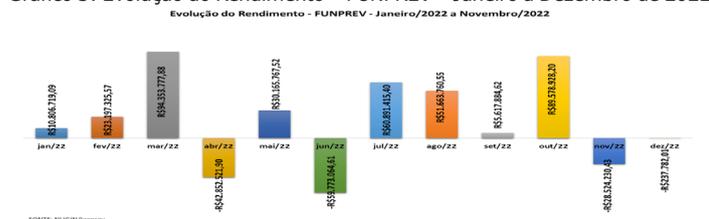
2.2.5. EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FUNPREV

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



Observação: Valor apenas do Patrimônio Investido sem a disponibilidade Financeira.

Gráfico 5: Evolução do Rendimento – FUNPREV – Janeiro a Dezembro de 2022



2.3. CARTEIRA FINANPREV

2.3.1. HISTÓRICO DE MOVIMENTAÇÕES 2022

DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	FUNDO DE INVESTIMENTO	DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO
27/05/2022	R\$ 26.049.665,23		BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	APLICAÇÃO SALDO PODERES
29/06/2022	R\$ 6.983.365,59		BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	APLICAÇÃO SALDO PODERES
29/08/2022	R\$ 23.152.234,29		SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	APLICAÇÃO SALDO PODERES
01/09/2022		R\$ 15.868.011,02	PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA	REALOCAÇÃO POR DESEQUILIBRAMENTO
05/09/2022	R\$ 15.868.011,02		SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	REALOCAÇÃO POR DESEQUILIBRAMENTO
29/09/2022	R\$ 7.415.112,49		SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	APLICAÇÃO SALDO PODERES
03/11/2022	R\$ 6.774.980,64		SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	APLICAÇÃO SALDO PODERES
30/11/2022	R\$ 8.273.128,67		SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	APLICAÇÃO SALDO PODERES
TOTAL	R\$ 38.331.232,82	R\$ 15.868.011,02		

2.3.2. COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR FUNDOS DE INVESTIMENTOS E LFT

Tabela 7: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Dezembro e Ano 2022

FUNDO DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	CARTEIRA FINANPREV (FUNDOS + LFT) - DEZEMBRO 2022												
	DEZEMBRO TIR	ANO META	TIR	TIR/META	ANO META	TIR	TIR/META	VOL Adm	Taxa Performance	Rendimento Dezembro	Rendimento Ano	PL (R\$)	% CARTEIRA
Art. 79 inciso I alínea "b" - FI 100% Titulos Públicos										221.046,22	1.350.254,44	16.955.369,03	4,02%
CAIXA BRASIL IDCA IPCA 24 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,23%	142,13%	9,04%	100,91%	2,92%	0,20%	0,00%			141.032,69	959.276,91	11.570.466,50	2,74%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,37%	-42,53%	7,83%	87,39%	3,08%	0,40%	0,00%			19.986,47	390.977,53	5.384.902,53	1,28%
Art. 79 inciso II										444.490,10	7.887.096,29	58.287.873,29	13,81%
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS										444.490,10	7.887.096,29	58.287.873,29	13,81%
Art. 79 inciso II alínea "b" - Limite % RPPS até 60% - Limite % PL até 15%										3.273.044,37	27.136.097,32	301.769.013,10	71,46%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,12%	129,29%	12,59%	140,50%	0,09%	0,20%	0,00%			22.306,67	224.678,84	2.009.694,10	0,48%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	1,08%	215,87%	11,61%	129,63%	1,26%	0,40%	0,00%			510.473,19	4.914.289,28	47.224.807,43	11,18%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,14%	131,05%	4,53%	50,61%	0,09%	0,20%	0,00%			716.492,40	2.207.978,27	63.691.445,38	15,08%
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	1,20%	138,33%	9,87%	110,22%	1,44%	0,50%	20,00%			1.243,96	1.055.851,99	104.830,33	0,02%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,09%	126,04%	12,43%	138,70%	0,10%	0,20%	0,00%			220.672,00	2.253.312,51	20.387.850,53	4,83%
BRASECO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,17%	134,29%	13,00%	145,10%	0,09%	0,20%	0,00%			260.186,11	2.597.111,24	22.577.266,80	5,35%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,88%	101,12%	9,28%	103,55%	1,47%	0,40%	0,00%			344.824,91	3.363.776,63	39.624.959,65	9,38%
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA	1,16%	133,11%	12,75%	142,35%	0,17%	0,30%	0,00%			337.764,63	3.343.989,27	29.567.238,44	7,00%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,13%	130,68%	12,71%	141,84%	0,11%	0,20%	0,00%			859.077,51	7.175.109,29	76.580.920,45	18,14%
Art. 79 inciso V alínea "b" - Limite % RPPS até 40% - Limite % PL até 15%										512.454,05	5.182.723,45	45.241.742,20	10,71%
BTG FUNDAL YIELD FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	1,15%	131,97%	12,94%	144,42%	0,10%	0,30%	0,00%			512.454,05	5.182.723,45	45.241.742,20	10,71%
TOTAL FINANPREV	1,08%	124,97%	11,89%	132,76%						4.581.031,74	41.556.171,50	422.265.997,62	100,00%

Observação: 1) Não foi calculada a Taxa de Retorno e Volatilidade das operações comprometidas em virtude dessa aplicação ser de curto prazo (até 1 mês).

2.3.3. EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FINANPREV

Gráfico 6: Evolução do Patrimônio Líquido do FINANPREV (Fundos + LFT) – Janeiro a Dezembro de 2022

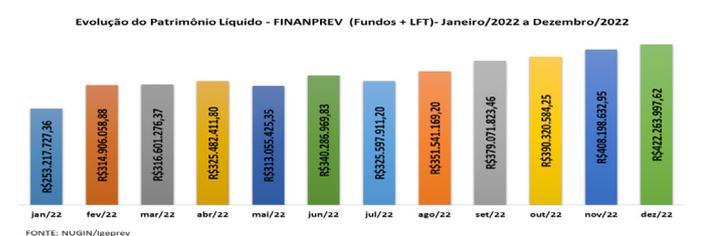
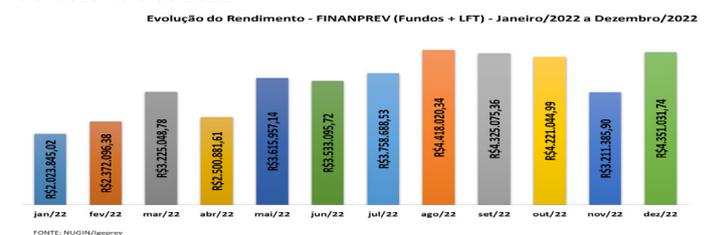


Gráfico 7: Evolução do Rendimento do FINANPREV (Fundos + LFT) – Janeiro a Dezembro de 2022



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 Dezembro de 2022, foram utilizadas as receitas arrecadadas do FUNPREV diretamente pelo setor de arrecadação mais o valor de R\$ 5.500.000,00, 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\$ 65.856.875,18 (sessenta e cinco milhões, oitocentos e cinquenta e seis 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 a seguir.

Tabela 8: Recurso utilizado para a taxa de administração

MÊS	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO		
	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
SETEMBRO	R\$ 2.400.000,00	R\$ 15.148.614,08	R\$ 17.548.614,08
OUTUBRO	R\$ 4.000.000,00	R\$ 20.944.700,35	R\$ 24.944.700,35
NOVEMBRO	R\$ 6.665.000,00	R\$ 9.154.539,81	R\$ 15.819.539,81
DEZEMBRO	R\$ 5.500.000,00	R\$ 16.837.688,43	R\$ 22.337.688,43
TOTAL	R\$ 65.856.875,18	R\$ 133.103.688,46	R\$ 198.960.563,64

Fonte: Nugin/Coaf

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

Tabela 9: Transferência FUNPREV para FINANPREV – 2016 A 2022

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\$ 181.288.571,28
TOTAL		R\$ 2.740.639.762,70

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\$ 2.740.639.762,70 no período de 2016 até 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	-
set/22	5.617.884,62		5.617.884,62	-
out/22	89.578.928,20		89.578.928,20	-
nov/22	- 28.524.230,43			- 28.524.230,43
dez/22	- 237.782,13			- 28.762.012,56

*O saldo é transferido no mês subsequente