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 Anual de Avaliação da Carteira de Investimentos - (FUNPREV/FINANPREV) – ANO 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

GLOBAL DEZEMBRO 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

GLOBAL ANUAL 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

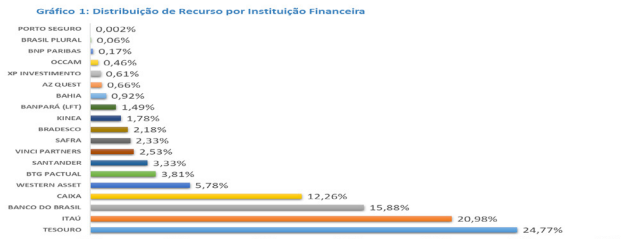


Gráfico 1: Distribuição de Recurso por Instituição Financeira – Dezembro de 2022
FONTE: NUGIN/IGEPREV

Gráfico 2: Distribuição de Recursos por Estratégia – Dezembro 2022

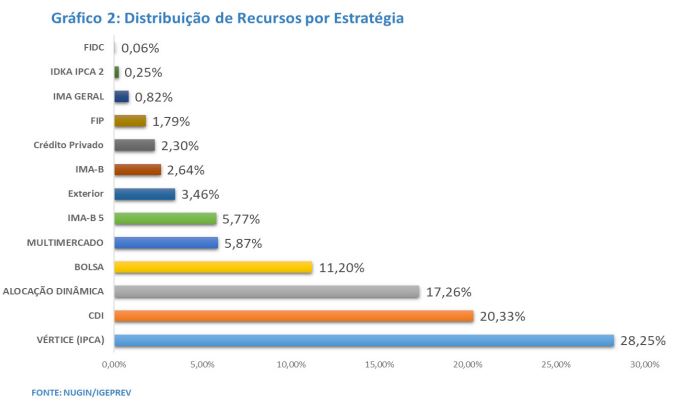
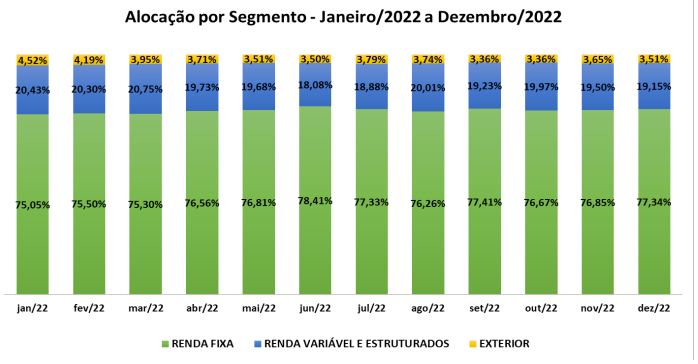


Gráfico 3: Alocação por Segmento – Janeiro 2022 a Dezembro 2022 (somente Fundos de Investimentos)



2.2. CARTEIRA FUNPREV

2.2.1. HISTÓRICO DE MOVIMENTAÇÕES 2022

Tabela 2: Historico de Movimentações 2022

MOVIMENTAÇÃO FUNPREV - Acumulado 2022

MÊS	SALDO ANTERIOR	RECEITA APLICADA			RESGATE				RENDIMENTO	DISPONIBILIDADE	SALDO ATUAL
		ARRECADAÇÃO	OUTROS(*)	AMORTIZAÇÃO	LC 125	TAXA DE ADM	OUTROS(*)	AMORTIZAÇÃO			
JANEIRO	4.176.772.202,05	R$ 1.392.073,59			-	R$ 4.300.000,00			R$ 10.806.719,09		R$ 4.184.670.994,73
FEVEREIRO	4.184.670.994,73	R$ 3.862.687,88	R$ 100.000.000,00	R$ 11.149.807,14	-		R$ 100.000.000,00	R$ 26.821.576,03	R$ 23.197.325,57		R$ 4.184.909.432,15
MARÇO	4.184.909.432,15	-		R$ 15.671.768,89	-	R$ 14.000.000,00			R$ 94.353.777,88		R$ 4.280.934.978,91
ABRIL	4.280.934.978,91	R$ 3.000.000,00			R$ 45.996.401,51				R$ 42.852.521,90		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$ 6.388.503,82	-	R$ 8.500.000,00	R$ 3.551.318,00	R$ 6.392.314,65	R$ 59.773.064,61		R$ 4.150.974.947,59
JULHO	4.150.974.947,59	-		R$ 3.810,83		R$ 8.691.875,18			R$ 80.891.415,40		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$ 76.178.681,40	R$ 51.663.760,55	R$ 156.354.326,27	R$ 4.254.733.090,40
SETEMBRO	4.254.733.090,40	-	R$ 254.303.370,31	R$ 39.920,00	R$ 40.095.356,96	R$ 2.400.000,00	R$ 98.000.010,46	R$ -	R$ 5.617.884,62	R$ 4.907.833,72	R$ 4.422.752.405,36
OUTUBRO	4.222.752.405,36	-	R$ 199.900.943,70		R$ 5.617.884,62	R$ 4.000.000,00	R$ 201.000.000,00	R$ -	R$ 89.578.928,21	R$ 5.916.855,61	R$ 4.302.623.414,54
NOVEMBRO	4.302.623.414,54	R$ 4.772.672,10	R$ 179.996.818,67	-	R$ 74.003.657,55	R$ 6.665.000,00	R$ 182.143.980,91	R$ 15.576.561,25	R$ 28.524.230,43	R$ 5.265.755,59	R$ 4.179.828.375,15
DEZEMBRO	4.179.828.375,15	-	R$ 295.955.866,72		R$ -	R$ 5.500.000,00	R$ 293.445.722,75	R$ -	-R$ 237.782,13	R$ 1.467.123,62	R$ 4.178.067.860,61
TOTAL		R$ 13.027.433,57	R$ 1.220.869.476,51	R$ 109.392.572,08	R$ 165.713.300,64	R$ 65.856.875,18	R$ 1.221.775.566,28	R$ 124.969.133,33	R$ 234.887.979,76	R$ 173.911.894,81	R$ 4.178.067.860,61

Fonte: NUGIN/IGEPREV

Observações:

1. Receita Aplicada (Outros): Identifica as receitas aplicada provenientes de realocação estrategica da propria carteira, chamadas de capital e saldo disponivel 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 NTN'Bs, 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, referes-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

MOVIMENTAÇÕES - FUNPREV - DEZEMBRO 2022

DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	TRANSFERÊNCIA	ATIVO	DESCRIÇÃO
01/12/2022		R$ 344.496,30		BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Sequestro por decisão judicial
07/12/2022		R$ 44.000,00		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$ 41.709,78		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$ 34.443,31		BRADESCO H VALUATION	Sequestro por decisão judicial
14/12/2022		R$ 37.609,10		SANTANDER RF CREDITO PRIVADO CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI	Sequestro por decisão judicial
15/12/2022		R$ 5.500.000,00		CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI 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 FI RENDA FIXA	Realocação Estratégica - Chamada de Capital Kinea e Compra NTN'Bs
22/12/2022		R$ 227.145.083,88		BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Realocação Estratégica - Chamada de Capital Kinea e Compra NTN'Bs
23/12/2022	R$ 40.000.000,00			LFSN BTG Pactual - VENC. DEZ/2032 - IPCA+8,4%	Realocação Estratégica - Compra LF
23/12/2022	R$ 3.189.768,00			11ª Chamada de Capital Kinea	Chamada de Capital Kinea
23/12/2022			-R$ 3.000.000,00	Recurso de aplicação utilizado indevidamente pela COAF para pagamento de taxa de administração	Recurso utilizado pelo COAF
27/12/2022			R$ 3.000.000,00	Devolução de valor pela COAF	Recurso devolvido pelo COAF
28/12/2022	R$ 120.224.000,76			NTN-B 760199 2050 - 6,312%	Realocação Estratégica - Compra NTN'Bs
28/12/2022	R$ 120.223.551,04			NTN-B 760199 2040 - 6,27%	Realocação Estratégica - Compra NTN'Bs
30/12/2022	R$ 12.318.546,92			ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	Aplicação de Recurso disponível em conta
TOTAL	R$ 295.955.866,72	R$ 298.945.722,75			

FONTE: Nugin/igeprev

2.2.3. COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR FUNDOS DE INVESTIMENTOS

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

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	DEZEMBRO		ANO		VOL	Taxa	Taxa	Rendimento (R$)	Rendimento (R$)	PL (R$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	Ano	Adm	Performance	Dezembro	Ano		
Art. 7º, inciso I, alínea "a" - Limite 'N RPPS até 100%								***7.988.964,79***	***19.523.305,64***	***1.141.845.157,44***	***27,34%***
NTN-B 2055 25.08.22_5,882	0,87%	99,63%	2,59%	28,91%	*	0,00 %	0,00%	2.201.737,19	6.725.552,15	256.703.696,69	6,15%
NTN-B 2055 26.08.22_5,882	0,87%	99,65%	2,62%	29,24%	*	0,00 %	0,00%	49.633,36	153.283,97	5.786.824,46	0,14%
NTN-B 2055 01.09.2022_5,9730	0,87%	100,53%	2,61%	29,13%	*	0,00 %	0,00%	681.756,00	2.085.289,38	78.798.863,25 *	1,89%
NTN-B 2050 15.09.2022_5,9930	0,87%	100,15%	2,63%	29,35%	*	0,00 %	0,00%	659.863,85	1.958.220,36	76.555.029,62	1,83%
NTN-B 2050 27.09.2022_5,8460	0,86%	99,31%	2,46%	27,46%	*	0,00 %	0,00%	882.092,39	2.480.019,51	103.190.067,85	2,47%
NTN-B 2045 21.10.2022_5,8400	0,86%	99,26%	2,19%	24,44%	*	0,00 %	0,00%	848.182,95	2.211.696,18	99.279.957,08	2,38%
NTN-B 2045 31.10.2022_5,8510	0,86%	99,37%	1,89%	21,09%	*	0,00 %	0,00%	847.472,47	1.920.775,85	99.087.879,78	2,37%
NTN-B 2035 28.11.2022_6,2100	0,89%	102,79%	0,99%	11,05%	*	0,00 %	0,00%	803.912,28	894.091,80	90.890.518,23	2,18%
NTN-B 2055 28.11.2022_6,2120	0,89%	102,81%	0,99%	11,05%	*	0,00 %	0,00%	804.128,96	894.251,10	90.894.583,34	2,18%
NTN-B 2040 28.12.2022_6,2700	0,09%	10,05%	0,09%	1,00%	*	0,00 %	0,00%	104.883,15	104.883,15	120.328.434,19	2,88%
NTN-B 2050 28.12.2022_6,3120	0,09%	10,09%	0,09%	1,00%	*	0,00 %	0,00%	105.302,19	105.302,19	120.329.302,95	2,88%
Art. 7º, I, "b" - FI 100% Títulos Públicos								***7.366.113,69***	***163.518.124,99***	***1.093.264.125,58***	***26,18%***
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,91%	105,23%	9,51%	106,20%	2,62 %	0,20 %	0,00%	593.502,25	18.511.631,68	497.458,85	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**	0,00%	0,00%	8,85%	98,78%	1,79 %	0,20 %	0,00%	-	2.984.197,08	-	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**	0,00%	0,00%	8,71%	97,21%	1,79 %	0,20 %	0,00%	-	8.446.752,48	-	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,31%	150,98%	10,50%	117,23%	2,19 %	0,20%	0,00%	428.894,15	8.235.782,28	33.150.027,32	0,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**	0,00%	0,00%	8,80%	98,28%	1,78 %	0,20%	0,00%	-	3.909.368,60		0,00%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,58%	181,54%	-47,18%	-526,81%	50,89 %	0,15%	0,00%	61.009,92	642.999,60	3.932.012,16	0,09%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,22%	-25,90%	6,00%	67,01%	5,35 %	0,20%	0,00%	- 110.874,07	2.786.359,10	49.200.655,18	1,18%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,14%	131,23%	10,70%	119,44%	1,78 %	0,40%	0,00%	1.945.027,98	24.136.228,50	149.689.674,33	3,58%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,32%	151,89%	3,16%	35,26%	4,97 %	0,20%	0,00%	498.535,83	3.254.620,38	38.304.940,86	0,92%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,32%	151,65%	3,03%	33,79%	5,01 %	0,20%	0,00%	412.531,40	2.684.440,79	31.746.432,00	0,76%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,32%	151,80%	1,77%	19,78%	4,97 %	0,20%	0,00%	692.835,60	4.510.892,87	53.265.465,90	1,28%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	106,21%	9,67%	107,93%	2,60 %	0,20%	0,00%	273.040,47	14.259.153,78	30.816.783,51	0,74%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00%	0,00%	6,90%	77,05%	2,78 %	0,20%	0,00%		11.747.767,43		0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	0,92%	106,51%	9,60%	107,15%	2,61 %	0,18%	0,00%	2.150.304,69	20.555.279,85	234.706.401,15	5,62%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,11%	-12,33%	5,68%	63,38%	5,42 %	0,30%	0,00%	- 40.430,40	2.027.693,48	37.739.833,06	0,90%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO RENDA FIXA	-0,35%	-40,34%	3,66%	40,82%	6,57 %	0,50%	0,00%	- 140.023,39	1.405.298,03	39.837.649,70	0,95%
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	0,95%	109,56%	6,75%	75,30%	3,24 %	0,80%	0,00%	73.817,24	1.471.010,75	514.022,91	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,37%	-42,59%	7,83%	87,39%	3,08 %	0,40%	0,00%	- 1.021.521,92	21.189.008,53	275.225.930,92	6,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1,37%	157,82%	10,36%	115,62%	1,62 %	0,50%	20,00%	1.549.463,94	10.759.639,79	114.636.837,73	2,74%

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	DEZEMBRO		ANO		VOL	Taxa	Taxa	Rendimento (R$)	Rendimento (R$)	PL (R$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	Ano	Adm	Performance	Dezembro	Ano		
Art. 7º, III, "a" - FI RENDA FIXA								***8.651.778,91***	***109.233.522,10***	***849.162.079,44***	***20,32%***
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,26%	-30,34%	6,02%	67,19%	5,51 %	0,20%	0,00%	- 86.465,89	18.680.284,27	32.738.998,22	0,78%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	0,38%	43,55%	7,65%	85,40%	4,05 %	0,50%	0,00%	105.090,85	1.982.833,85	27.900.846,34	0,67%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	0,00%	0,00%	3,83%	42,70%	9,48 %	0,30%	20,00%	-	2.750.134,19		0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,12%	128,29%	12,59%	140,50%	0,09 %	0,20%	0,00%	6.432.776,00	64.752.657,99	579.553.562,72	13,88%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	1,09%	125,87%	11,61%	129,65%	1,26 %	0,40%	0,00%	586.911,44	8.038.282,04	54.296.249,03	1,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINAMICO RF LP FIC	1,15%	132,07%	11,81%	131,86%	0,78 %	0,50%	20,00%	1.592.890,84	12.807.977,42	152.838.241,87	3,66%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,13%	130,68%	10,97%	122,48%	0,11 %	0,20%	0,00%	20.575,67	181.352,34	1.834.181,26	0,04%
Art. 7º, IV,								***105.016,12***	***105.016,12***	***40.105.016,00***	***0,96%***
LFSN BTG Pactual - VENC. DEZ/2032 - IPCA+8,4%	0,26%	30,24%	0,26%	2,93%	*	0,00 %	0,00%	105.016,12	105.016,12	40.105.016,00	0,96%
Art. 7º, V, "a" - FIDC Cota Senior								***534.910,88***	***401.488,83***	***2.651.197,33***	***0,06%***
BBIF MASTER FIDC LP	25,28%	2911,45%	17,85%	199,21%	25,82 %	0,23 %	0,00%	534.910,88	401.488,83	2.651.197,33	0,06%
Art. 7º, V, "b"								***241.993,87***	***2.093.349,28***	***20.727.515,07***	***0,50%***
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RF CP LP	1,18%	135,96%	11,48%	128,19%	0,14 %	0,30 %	20,00 %	241.993,87	2.093.349,28	20.727.515,07	0,50%
TOTAL RENDA FIXA								24.888.778,25	294.884.806,96	3.147.755.050,87	75,36%

Observações
*Considerando que os Títulos Públicos e os Títulos Privados estão marcados na curva, ou seja, estão precificados de acordo com a taxa acordada na negociação. Logo, a remuneração informada desses ativos não está incorporando a volatilidade do mercado.
** Os fundos vértices BB IPCA I, IV e VII foram finalizados em agosto/2022, portanto a volatilidade está calculada no período de Janeiro a Agosto de 2022