

4. CARTEIRA FUNPREV

4.1. COMPOSIÇÃO POR FUNDOS DE INVESTIMENTO

Tabela 3: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Fixa – Outubro 2021

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	OUTUBRO	ANO	VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	CARTEIRA
TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses		
Art. 7º, § 1º, "F" - 100% Títulos Públicos						
BB IMB 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	-1,37%	-85,00%	0,98%	8,88%	2,69%	R\$ 2.629.454,75
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RF PREVIDENCIÁRIO	-0,49%	-32,88%	4,20%	38,40%	1,60%	R\$ 167.363,93
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RF PREVIDENCIÁRIO	-0,50%	-33,08%	4,16%	38,04%	1,59%	R\$ 484.245,52
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RF PREVIDENCIÁRIO	-0,83%	-52,23%	2,53%	23,13%	2,18%	R\$ 780.774,26
BB TÍTULOS PÚBLICOS VLI FI RF PREVIDENCIÁRIO	-0,50%	-33,09%	4,14%	37,89%	1,59%	R\$ 221.879,45
BB ASSOCIAÇÃO ATIVA FIC RF PREVIDENCIÁRIO	-0,40%	-26,34%	2,89%	20,05%	2,89%	R\$ 1.047.279,25
BB INF- M TÍTULOS PÚBLICOS FI RF PREVIDENCIÁRIO	-0,40%	-26,53%	-2,80%	-25,62%	3,33%	R\$ 1.266.942,59
BTG RACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	-1,38%	-91,83%	-3,00%	-32,96%	4,53%	R\$ 1.000.704,96
BRANCO INSTITUCIONAL IMB 5 FIC RF	-2,38%	-172,10%	-5,08%	-46,48%	5,57%	R\$ 1.184.484,31
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	-0,661%	-44,09%	-1,82%	-16,61%	2,40%	R\$ 1.587.310,11
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	-1,49%	-99,50%	-5,66%	-50,88%	5,14%	R\$ 543.031,20
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	-1,49%	-99,55%	-5,65%	-51,69%	5,13%	R\$ 451.060,00
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	-1,49%	-99,50%	-5,66%	-50,88%	5,14%	R\$ 725.760,00
CAIXA BRASIL IMB 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	-1,24%	-82,95%	1,03%	9,38%	2,68%	R\$ 2.292.975,29
CAIXA BRASIL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	-1,29%	-86,17%	1,46%	13,38%	2,64%	R\$ 1.765.820.710,3
ITAÚ INSTITUCIONAL IMB 5 FIC RF	-1,25%	-83,40%	1,04%	9,52%	2,67%	R\$ 2.626.323,56
SARFIA IMB 5 FIC RF	-3,25%	-216,90%	-8,00%	-73,18%	6,39%	R\$ 1.164.918,27
Art. 7º, § 1º, "G" - Fundos de Renda Fixa Referenciada						
CAIXA NOVO BRASIL FIC RF REFERENCIADA IMB 5 LP	-2,55%	-170,27%	-4,95%	-45,25%	5,58%	R\$ 8.868.128,63
ITAÚ INFLAÇÃO FI RENDA FIC REFERENCIADA IPCA LP	-1,43%	-95,59%	0,00%	-0,02%	3,71%	R\$ 35.607,29
Art. 7º, § 1º, "H" - Fundos de Renda Fixa Geral						
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIC	-2,09%	-199,40%	-6,56%	-60,02%	5,95%	R\$ 567.249,97
BRANCO IM N LO II RENDA FIC	-3,01%	-290,42%	-6,87%	-62,81%	6,36%	R\$ 2.146.663,94
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIC	-0,36%	-23,69%	1,96%	17,93%	0,95%	R\$ 1.217.880,33
WESTERN ASSET IMB 5 FIC RENDA FIC	-3,20%	-211,54%	-6,21%	-64,10%	7,03%	R\$ 1.225.994,95
WESTERN ASSET ATIVO MAC FIC RENDA FIC	-0,73%	-48,76%	-3,96%	-36,22%	3,77%	R\$ 176.886,56
ITAÚ INSTITUCIONAL LEGEND FIC RENDA FIC LP	0,82%	54,73%	0,82%	7,50%	1,40%	R\$ 632.804,82
BB PERFIL FIC RENDA FIC REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	0,36%	24,13%	0,36%	3,31%	1,13%	R\$ 1.707.327,95
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIC	0,06%	3,96%	0,06%	0,54%	1,36%	R\$ 47.565,44
Art. 7º, § 1º, "I" - FIDC Cota Senior						
BBF MASTER FIDC FIDP	-0,15%	-23,17%	27,54%	251,85%	21,65%	R\$ 7.895,67
SUBTOTAL RENDA FIXA						
						R\$ 27.165.999,67

Tabela 4: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Variável – Outubro 2021

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL	OUTUBRO	ANO	VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses		
Art. 8º, inciso II, alínea "a" - FI Ações - Índices de Ações						
ITAÚ FIDP RFI INVERSA ATIVO FI AÇÕES	-8,79%	-580,71%	-16,45%	-130,48%	20,00%	R\$ 1.464.462,77
CAIXA BRASIL INDESA INVERSA FI AÇÕES	-6,70%	-452,61%	-13,23%	-120,95%	20,88%	R\$ 1.311.829,18
Art. 8º, inciso II, alínea "a" - Fundos de Ações - Geral						
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-7,73%	-515,55%	-14,66%	-134,11%	18,93%	R\$ 62.226.849,80
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-8,24%	-549,53%	-16,79%	-153,54%	20,03%	R\$ 288.497,32
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIC AÇÕES	-11,79%	-919,78%	-16,76%	-151,29%	23,04%	R\$ 786.511,35
BRANCO SMALL SMALL CAPS FIC AÇÕES	-11,16%	-835,92%	-10,38%	-94,91%	21,18%	R\$ 2.613.062,47
BRANCO VALUATION INVERSA FI AÇÕES	-8,76%	-584,34%	-18,23%	-166,69%	20,76%	R\$ 324.181,52
BTG RACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-13,06%	-870,81%	-26,38%	-241,25%	22,25%	R\$ 14.541.676,91
ITAÚ DIVERSOS FI AÇÕES	-11,56%	-746,08%	-10,70%	-97,88%	19,89%	R\$ 2.458.181,04
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-7,54%	-502,53%	-8,00%	-73,71%	18,12%	R\$ 3.105.196,58
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	-11,07%	-777,78%	-11,07%	-107,78%	20,36%	R\$ 1.077.780,00
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-11,78%	-785,74%	-15,07%	-137,82%	22,39%	R\$ 10.004.035,94
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-8,38%	-558,56%	-15,88%	-145,27%	20,17%	R\$ 4.482.232,31
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	-8,12%	-541,60%	-6,28%	-76,15%	18,43%	R\$ 1.836.492,65
AZ QUEST SMALL MD CAPS FIC AÇÕES	-6,61%	-441,07%	-7,00%	-64,03%	19,48%	R\$ 2.305.601,53
SARFIA EQUITY PORTFOLIO FIC AÇÕES	-13,55%	-929,91%	-22,42%	-205,03%	20,89%	R\$ 2.458.181,04
BARISAM VALUATION FIC AÇÕES	-11,36%	-770,92%	-12,28%	-125,76%	20,89%	R\$ 5.545.005,87
OCAM FIC AÇÕES	-4,90%	-336,60%	-19,21%	-175,66%	20,18%	R\$ 1.040.279,85
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-11,07%	-774,89%	-11,89%	-108,71%	20,19%	R\$ 1.904.745,81
SARFIA AÇÕES LIVRES FIC AÇÕES	-16,09%	-1.073,06%	-28,08%	-256,77%	20,75%	R\$ 7.047.709,36
Art. 8º, inciso II, alínea "b" - Fundos Multimercados						
SARFIA S&P 500 FI RF MULTIMERCADO	7,55%	503,16%	25,96%	237,29%	13,05%	R\$ 6.478.704,47
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7,55%	503,16%	26,19%	239,51%	13,18%	R\$ 3.551.566,29
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	0,92%	61,12%	2,35%	21,49%	1,79%	R\$ 322.055,50
BRANCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-1,16%	-77,43%	-1,18%	-10,82%	2,23%	R\$ 41.462,20
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,89%	-59,29%	-0,30%	-2,77%	3,64%	R\$ 965.364,80
ITAÚ PRIVATE S&P500 BIL FIC MULTIMERCADO	7,63%	508,85%	5,76%	52,68%	13,20%	R\$ 2.507.207,67
Art. 8º, inciso II, alínea "c" - Fundos de Participações (FIP)						
BTG PARTICIPATE INFRAESTRUTURA II FICIP	-0,01%	-6,37%	-13,21%	-120,85%	29,77%	R\$ 8.963,87
KINEA PRIVATE EQUITY FIDECER INST. I - MULTI PL	-0,86%	-57,28%	24,28%	222,07%	54,97%	R\$ 579.731,24
SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL						
						R\$ 67.403.803,21

Tabela 5: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Investimento no Exterior e TOTAL – Outubro 2021

Tabela 5: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Investimento no Exterior e TOTAL – Outubro 2021

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - EXTERIOR	OUTUBRO	ANO	VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses		
Art. 9º, inciso II, alínea "a" - FIC - Aberto - Investimento no Exterior						
VINCI INTERNATIONAL INVEST - EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	5,02%	334,55%	14,07%	128,68%	15,05%	R\$ 432.029,45
WJ MACRO OPPORTUNITIES FIC MULTIMERCADO	0,07%	4,21%	6,69%	61,21%	6,63%	R\$ 10.240,24
LM CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH EXTERIOR FI AÇÕES	7,65%	513,08%	20,31%	185,75%	14,36%	R\$ 1.980.805,02
Art. 9º, inciso II, alínea "a" - Fundos de Ações - BDR Nível I						
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10,93%	728,73%	29,48%	265,59%	17,56%	R\$ 9.971.333,53
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10,62%	708,41%	34,80%	330,79%	18,19%	R\$ 5.358.024,89
SUBTOTAL INVESTIMENTO NO EXTERIOR						
						R\$ 17.761.540,13
TOTAL FUNPREV						
	-1,61%	-107,48%	-2,16%	-19,76%	4,18%	R\$ 67.201.357,91

4.2. MOVIMENTAÇÕES DA CARTEIRA

Tabela 6: Movimentações FUNPREV – Outubro 2021

Tabela 6: Movimentações FUNPREV – Outubro 2021

DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	FUNDO DE INVESTIMENTO	DESCRIÇÃO
06/10/2021		R\$ 319.656.527,21	BB INF- M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO	
06/10/2021	R\$ 80.000.000,00		WESTERN ASSET ATIVO RENDA FISA	
06/10/2021	R\$ 229.104.043,28		BB PERFIL FIC REFERENCIADO PREVIDENCIÁRIO LP	
07/10/2021	R\$ 10.552.483,93		BB PERFIL FIC REFERENCIADO PREVIDENCIÁRIO LP	
08/10/2021		R\$ 266.117.205,96	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO	
08/10/2021	R\$ 257.584.425,13		BB PERFIL FIC REFERENCIADO PREVIDENCIÁRIO LP	
11/10/2021	R\$ 8.532.780,83		BB PERFIL FIC REFERENCIADO PREVIDENCIÁRIO LP	
22/10/2021	R\$ 80.000.000,00		ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	
25/10/2021	R\$ 80.000.000,00		ITAÚ INSTITUCIONAL LEGEND FIC RENDA FISA LP	
26/10/2021	R\$ 18.402.277,96		BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FISA	
28/10/2021		R\$ 18.402.277,96	ITAÚ INSTITUCIONAL LEGEND FIC RENDA FISA LP	
TOTAL	R\$ 684.176.011,13	R\$ 684.176.011,13		

4.3. EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FUNPREV

Gráfico 4: Evolução do Patrimônio Líquido – FUNPREV – Janeiro a Outubro 2021.

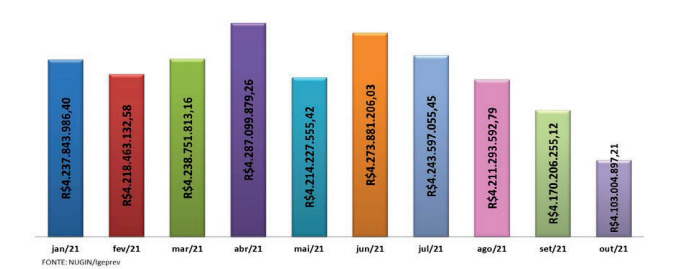
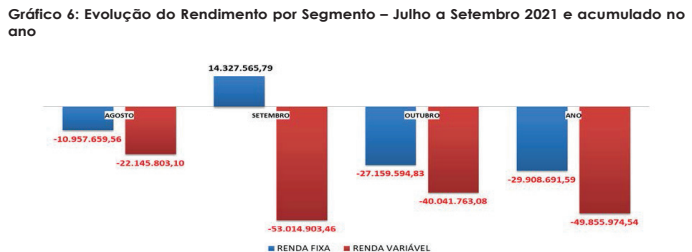
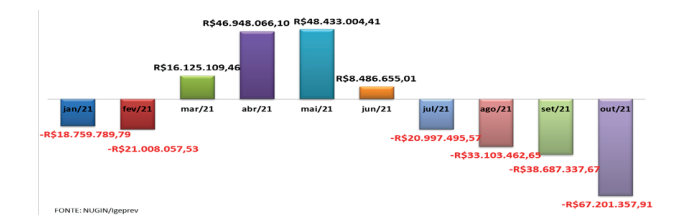


Gráfico 5: Evolução do Rendimento – FUNPREV – Janeiro a Outubro 2021



5. CARTEIRA FINANPREV

5.1. COMPOSIÇÃO POR FUNDOS DE INVESTIMENTOS

Tabela 7: Carteira de Investimentos – FINANPREV – Outubro 2021

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA								
	OUTUBRO		ANO	VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA	
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses			
Art. 7º, inciso I, alínea "b" - FI 100% Títulos Públicos								
CAIXA BRASIL IDCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	-1,29%	-86,17%	1,46%	13,38%	2,64%	R\$ 134.671,73	R\$ 126.896,719	3,44%
Art. 7º, inciso II, alínea "a" - Fundos de Renda Fixa Geral								
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS	0,33%	22,27%	*	*	*	R\$ 309.473,49	R\$ 60.123,201	21,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	-0,36%	-23,69%	1,96%	17,93%	0,95%	R\$ 207.804,81	R\$ 183.308,954	6,12%
SANTANDER ATIVO FIC RF	-0,55%	-36,47%	0,33%	3,05%	0,84%	R\$ 175.025,18	R\$ 56.093,934	11,86%
BRASILEIRO PREMIUM FIC RF REFERENCIADO DI	-0,58%	-38,66%	0,44%	31,44%	0,91%	R\$ 113.518,03	R\$ 103.759,787	6,58%
BB PERIFIC FIC PREVIDENCIÁRIO	-0,49%	-32,60%	0,34%	28,76%	0,11%	R\$ 8.561,61	R\$ 1.755,7125	0,59%
WESTERN INVESTIMENTOS FIC RF	-0,22%	-14,88%	0,22%	1,48%	0,03%	R\$ 203.987,94	R\$ 189.420,924	2,88%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	0,52%	34,70%	0,92%	26,73%	2,12%	R\$ 162.601,47	R\$ 78.884,473	5,98%
PORTO SEGURO CLASSICO FIC RF LP	0,03%	2,33%	0,98%	8,86%	1,11%	R\$ 5.130,12	R\$ 14.668,655	4,40%
Art. 7º, inciso VIII, alínea "b" - Fundos de Crédito Privado								
BCT ATUAL YIELD FIC RF REF. DI CREDITO PRIVADO	0,52%	34,76%	3,50%	31,99%	0,10%	R\$ 204.776,31	R\$ 34.492,056	13,20%
TOTAL REND.FINPREV	0,12%	7,53%	17,6%	16,06%	1,67%	R\$ 5.678,120	R\$ 2.990,473	100,00%