

Gráfico 1: Distribuição de Recurso por Instituição Financeira – Novembro 2021

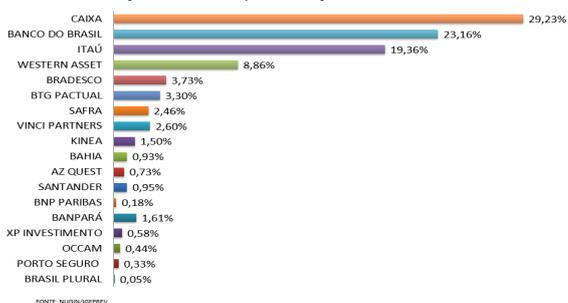


Gráfico 2: Distribuição de Recursos por Estratégia – Novembro 2021

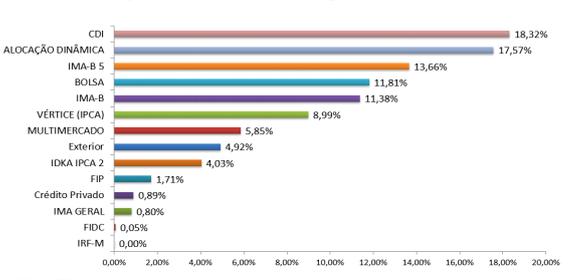
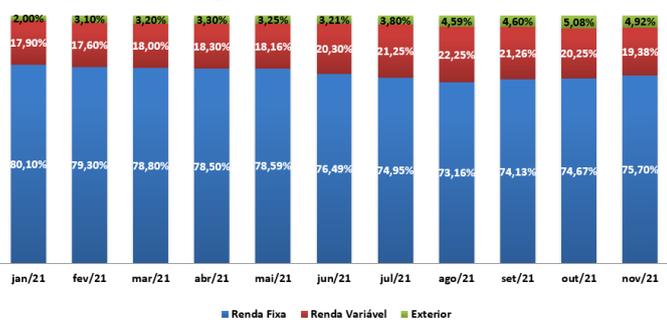


Gráfico 3: Participação por Segmento – somente fundos de Investimentos - Novembro 2021



3. MONITORAMENTO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTO 2021.

Tabela 2: Distribuição e Enquadramento dos Investimentos IGEFREV/PA (FUNREV+FINANPREV+SPSM) – Novembro/2021

Artigo	Tipo de Ativo	Valor (R\$)	Carteira %	Limite Inferior	Estratégia Alvo	Limite Superior	Limite Legal
Renda Fixa							
Art. 7º, I, "b"	Fundos 100% Títulos Públicos	RS 1.506.728.684,35	33,86%	0,00%	40,00%	70,00%	100%
Art. 7º, II	Operações Compromissadas	RS 71.604.037,30	1,61%	0,00%	0,00%	5,00%	5%
Art. 7º, III "a"	Fundos de Renda Fixa Referenciado	RS 375.662.402,20	8,44%	0,00%	2,00%	20,00%	60%
Art. 7º, IV "a"	Fundos de Renda Fixa-Geral	RS 1.371.974.603,62	30,84%	0,00%	26,00%	40,00%	40%
Art. 7º, VI "a"	FIDC Cota Senior	RS 2.256.633,35	0,05%	0,00%	0,03%	1,00%	5%
Art. 7º, VII "b"	Fundos de Crédito Privado	RS 39.739.542,91	0,89%	0,00%	2,00%	5,00%	5%
Total Renda Fixa		RS 3.367.966.903,72	76,70%		70,03%		30%
Renda Variável							
Art. 8º, I "a"	Fundos de Ações - Índices de Ações	RS 15.405.531,89	0,35%	0,00%	0,00%	5,00%	30%
Art. 8º, II "a"	Fundos de Ações - Geral	RS 510.181.991,71	11,47%	0,00%	11,47%	20,00%	20%
Art. 8º, III	Fundos Multimercados	RS 260.443.136,22	5,89%	0,00%	8,00%	10,00%	10%
Art. 8º, IV "a"	Fundos de Participações (FIP)	RS 76.213.630,04	1,71%	0,00%	2,00%	5,00%	5%
Total Renda Variável		RS 862.244.289,86	19,38%		21,47%		10%
Investimento no Exterior							
Art. 9º, II "a"	Fic - Aberto- Investimento no Exterior	RS 63.157.120,93	1,42%	0,00%	7,50%	10,00%	10%
Art. 9º, III "a"	Fundos de Ações - BDR Nível I	RS 155.925.482,74	3,50%	0,00%	1,00%	5,00%	10%
Total Investimento Exterior		RS 219.082.603,67	4,92%		8,50%		10%
Total da Carteira		RS 4.449.292.797,25	100,00%		100,00%		100,00%

Observações: Com a perda do status de Investidor Qualificado no mês de maio/2021, o Igeprev/PA fica impossibilitado de realizar novos aportes em fundos exclusivos para este status de investidor, como é o caso dos fundos classificados no Art. 8º IV "a" e Art. 9º II "a".

4. CARTEIRA FUNPREV

4.1. COMPOSIÇÃO POR FUNDOS DE INVESTIMENTO

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

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	NOVEMBRO	ANO	VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	%
TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses		CARTEIRA
Art. 7º, I, "b" - 100% Títulos Públicos	2,47%	206,28%	3,48%	28,37%	2,77%	36,19%
BB IMA-B 5 FIC REF PREVIDENCIÁRIO LP	1,74%	145,31%	6,01%	49,04%	1,66%	0,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS (PCPA) FI REF PREVIDENCIÁRIO	1,74%	144,96%	5,97%	48,67%	1,66%	0,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS (PCPA) FI REF PREVIDENCIÁRIO	2,00%	171,37%	4,64%	46,46%	2,23%	1,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS (PCPA) FI REF PREVIDENCIÁRIO	1,74%	144,74%	5,95%	48,51%	1,65%	0,83%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI REF	2,55%	212,94%	-1,14%	-9,32%	4,36%	1,09%
BRASECO INSTITUCIONAL IMA-B FIC REF	3,44%	286,93%	-1,82%	-14,32%	5,85%	1,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC REF	0,91%	75,56%	-0,93%	-7,56%	2,36%	0,57%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI REF	2,71%	225,85%	-3,01%	-24,52%	5,18%	1,08%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI REF	2,71%	225,64%	-3,10%	-25,27%	5,18%	1,08%
CAIXA BRASIL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI REF	2,71%	225,81%	-3,03%	-24,68%	5,18%	1,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI REF LP	2,47%	205,83%	3,52%	28,69%	2,76%	0,45%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI REF LP	2,42%	201,52%	3,91%	31,92%	2,72%	0,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC REF	2,49%	207,99%	3,55%	28,95%	2,75%	0,45%
SAFRA IMA FIC REF	3,21%	267,63%	-5,05%	-41,17%	6,62%	1,36%
Art. 7º, III, "a" - Fundos de Renda Fixa Referenciado	3,40%	283,77%	-1,71%	-13,97%	5,86%	0,99%
CAIXA NOVO BRASIL FIC REF REFERENCIADO IMA-B LP	2,89%	240,82%	2,89%	23,52%	3,86%	0,62%
XP INFILTAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO PCPA LP	2,89%	240,82%	2,89%	23,52%	3,86%	0,62%
Art. 7º, IV, "a" - Fundos de Renda Fixa Geral	3,66%	305,46%	-6,56%	-53,51%	6,64%	1,36%
BRASECO NIULO FI RENDA FIXA	1,64%	137,20%	3,46%	28,19%	1,08%	0,49%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3,47%	289,35%	3,64%	29,66%	7,13%	1,36%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO RENDA FIXA	0,57%	47,30%	0,60%	49,38%	3,58%	0,58%
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	0,45%	37,45%	3,47%	27,85%	1,46%	0,28%
ITAÚ INSTITUCIONAL LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,63%	52,59%	0,99%	8,11%	3,45%	0,28%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DE PREVIDENCIÁRIO	0,68%	56,60%	0,74%	6,02%	1,29%	0,28%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	0,35%	29,75%	0,35%	28,95%	1,46%	0,28%
Art. 7º, VII, "b" - FIDC Cota Senior	-0,35%	-28,83%	27,10%	220,94%	21,64%	0,05%
BBF MASTER FIDC LP						
SUBTOTAL RENDA FIXA						73,85%

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

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL	NOVEMBRO	ANO	VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	%
TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses		CARTEIRA
Art. 8º, inciso I, alínea "a" - FI Ações - Índices de Ações	-2,06%	-171,89%	-18,18%	-148,20%	19,94%	0,41%
ITAÚ FOF RPI IBOVESA ATIVO FIC AÇÕES	-2,97%	-247,54%	-19,23%	-156,81%	23,46%	0,12%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESA FI AÇÕES	-1,54%	-128,19%	-14,56%	-118,71%	20,46%	0,5%
Art. 8º, inciso II, alínea "a" - Fundos de Ações - Geral						12,34%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-4,24%	-353,90%	-18,28%	-149,09%	18,56%	0,03%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-2,73%	-227,40%	-19,06%	-155,38%	19,60%	0,08%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-2,97%	-247,54%	-19,23%	-156,81%	23,46%	0,12%
BRASECO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-3,17%	-264,14%	-13,22%	-107,76%	21,89%	0,43%
BRASECO VALUATION IBOVESA FI AÇÕES	-2,02%	-168,75%	-19,88%	-162,11%	20,23%	0,08%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-6,71%	-559,35%	-13,22%	-255,34%	23,30%	2,18%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,00%	83,43%	-9,81%	-79,99%	18,99%	0,06%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-1,44%	-120,45%	-9,39%	-76,54%	17,84%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	-2,69%	-224,71%	-11,61%	-176,20%	20,67%	0,70%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	-2,76%	-230,44%	-17,42%	-142,01%	22,08%	1,76%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,51%	293,03%	-13,93%	-105,42%	20,17%	1,23%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	-0,64%	-53,26%	-8,91%	-72,67%	18,45%	0,50%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-3,98%	-332,09%	-10,70%	-87,28%	18,86%	0,76%
SAFRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC AÇÕES	-5,68%	-474,08%	-26,83%	-218,37%	22,51%	0,35%
BAHIA AM VALUATION FIC AÇÕES	-2,09%	-174,54%	-26,96%	-211,62%	20,72%	1,00%
OCCAM FIC AÇÕES	-2,67%	-222,70%	-11,36%	-174,20%	19,89%	0,48%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-1,49%	-124,32%	-13,20%	-107,63%	19,37%	0,8%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-7,24%	-603,96%	-13,28%	-271,39%	23,04%	0,82%
Art. 8º, inciso III - Fundos Multimercados						6,30%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-0,51%	-42,52%	25,32%	206,41%	12,60%	0,15%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-0,50%	-42,04%	25,55%	208,35%	12,70%	1,20%
VINCI VALOREM FI PB FI MULTIMERCADO	1,37%	113,97%	3,75%	30,57%	1,85%	0,85%
BRASECO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,99%	82,23%	-0,21%	-1,70%	2,16%	0,17%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,31%	26,02%	0,01%	0,07%	3,54%	2,61%
ITAÚ PRIVATE S&P 500 FIC MULTIMERCADO	-0,51%	-42,46%	9,22%	42,58%	12,73%	0,85%
Art. 8º, inciso IV, alínea "a" - Fundos de Participações (FIP)						1,84%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FIP	-0,09%	-7,35%	-13,29%	-108,37%	29,77%	0,3%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INST. I. MULTI. FIP	-0,10%	-8,15%	24,16%	197,00%	33,50%	1,62%
SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL						20,89%

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

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - EXTERIOR	NOVEMBRO	ANO	VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	%
TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses		CARTEIRA
Art. 9º, inciso I, alínea "a" - Fic - Aberto- Investimento no Exterior						1,53%
VINCI INTERNATIONAL INVEST. EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	-1,39%	-115,85%	12,49%	101,80%	14,95%	0,22%
WM MACRO OPPORTUNITIES EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	-1,16%	-96,62%	5,46%	44,50%	6,43%	0,64%
LM CLEARBRI DE US LARGE CAP GROWTH EXTERIOR FIC AÇÕES	0,55%	45,72%	20,97%	170,98%	13,80%	0,67%
Art. 9º, inciso III, alínea "a" - Fundos de Ações - BDR Nível I						3,77%
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,89%	-74,40%	28,32%	230,94%	17,20%	1,43%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,31%	-25,77%	13,25%	113,78%	17,93%	2,3%
SUBTOTAL INVESTIMENTO NO EXTERIOR						5,30%
TOTAL FUNPREV	0,99%	82,19%	-1,20%	-9,75%		100,00%

4.2. MOVIMENTAÇÕES DA CARTEIRA

Tabela 6: Movimentações FUNPREV – Novembro 2021

DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	FUNDO DE INVESTIMENTO	DESCRIÇÃO
01/11/2021	RS 1.576.500,94		ITAÚ INSTITUCIONAL LEGEND FIC RENDA FIXA LP	Arrecadação Previdenciária
10/11/2021	RS 1.341.565,72		ITAÚ INSTITUCIONAL LEGEND FIC RENDA FIXA LP	Arrecadação Previdenciária
12/11/2021		RS 12.000.000,00	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Taxa de Administração
TOTAL	RS 2.918.066,66	RS 12.000.000,00		

4.3. EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FUNPREV

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

