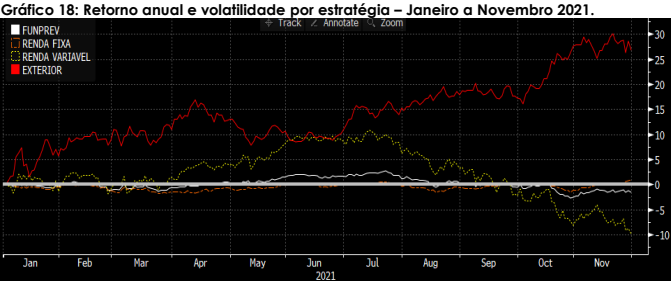


9.3. VOLATILIDADE POR ESTRATÉGIA

Conforme pode ser observado no **Gráfico 18**, a carteira FUNPREV acompanha o comportamento da estratégia Renda Fixa, dado o peso desta na carteira agregada. É possível notar que, apesar da volatilidade, os investimentos no Exterior contribuíram com a performance da carteira. Com isto, destaca-se a importância da diversificação em classes de ativos, estratégias, geografias e moedas para o cumprimento da meta atuarial.



Fonte: Bloomberg/NUGIN

10. GERENCIAMENTO DE RISCO

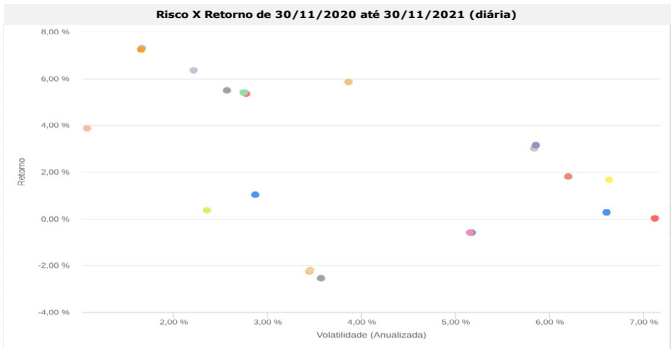
10.1. AVALIAÇÃO DE RISCO E RETORNO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS

O estudo técnico de análise de risco e retorno dos Fundos de Investimentos devidamente credenciados é apresentado através do "Relatório Mensal de Avaliação de Fundos de Investimentos".

Este relatório serve como suporte para a tomada de decisão da Diretoria Executiva do IGEPREV – DIREX em relação às recomendações de movimentação financeira dos fundos de investimentos proposta pela área técnica do IGEPREV.

10.2. RISCO X RETORNO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS DA CARTEIRA FUNPREV

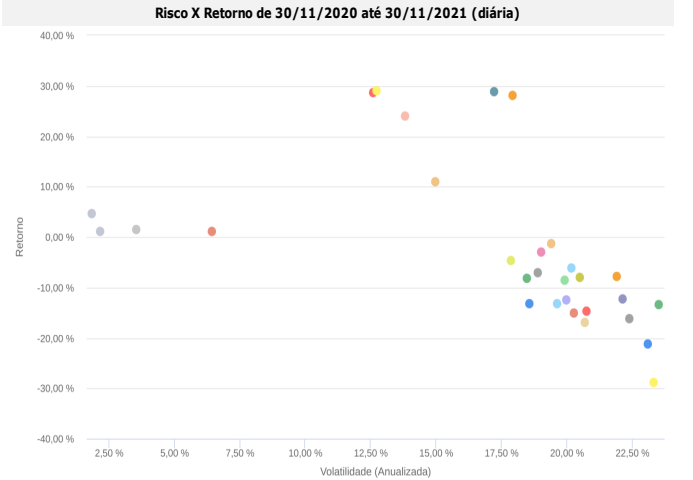
Gráfico 19: Risco x Retorno dos Fundos de Investimentos – Carteira FUNPREV: Renda Fixa 30/11/2020 a 30/11/2021 (diária).



Ativo	Retorno	Volatilidade
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03 %	2,87 %
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5,49 %	2,57 %
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5,34 %	2,77 %
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,28 %	3,45 %
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7,31 %	1,67 %
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7,26 %	1,66 %
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6,36 %	2,21 %
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7,23 %	1,66 %
BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	1,80 %	6,20 %
BRADERCO H NILO FI RENDA FIXA	1,67 %	6,63 %
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3,00 %	5,84 %
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,81 %	5,18 %
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,58 %	5,17 %
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,58 %	5,16 %
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,36 %	2,36 %
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,39 %	2,75 %
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,18 %	3,45 %
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3,13 %	5,85 %
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3,86 %	1,08 %
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	5,42 %	2,75 %
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,26 %	6,61 %
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	-2,55 %	3,57 %
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	0,02 %	7,12 %
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	5,84 %	3,86 %

Fonte: QuantumAxis

Gráfico 20: Risco x Retorno dos Fundos de Investimentos – Carteira FUNPREV: Renda Variável - 30/11/2020 a 30/11/2021 (diária)



Ativo	Retorno	Volatilidade
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-13,24 %	18,59 %
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-7,15 %	18,89 %
BAHIA AM VALUATION FIC AÇÕES	-14,64 %	20,75 %
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-1,38 %	19,41 %
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-13,26 %	19,64 %
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIC AÇÕES	-13,48 %	23,51 %
BRADERCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1,09 %	2,16 %
BRADERCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-7,77 %	21,92 %
BRADERCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	-15,09 %	20,26 %
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-28,82 %	23,34 %
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,48 %	3,55 %
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-8,07 %	20,50 %
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28,81 %	17,23 %
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,95 %	19,02 %
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-4,62 %	17,85 %
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-12,51 %	19,97 %
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	-16,91 %	20,71 %
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-12,33 %	22,12 %
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,03 %	13,82 %
OCCAM FIC AÇÕES	-8,61 %	19,93 %
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-21,20 %	23,08 %
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	-16,10 %	22,40 %
SAFRA S&P REALIS PB FI MULTIMERCADO	28,57 %	12,62 %
VINCI INTERNACIONAL INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	10,98 %	14,97 %
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-6,08 %	20,18 %
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	-8,20 %	18,48 %
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	4,58 %	1,86 %
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28,03 %	17,94 %
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIN	1,09 %	6,43 %
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	28,96 %	12,72 %

Fonte: QuantumAxis

Protocolo: 746170

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 a transparência pública deve ser assegurada por procedimentos executados em conformidade com os princípios básicos da Administração Pública;

Considerando ser a publicidade um dos princípios fundamentais regentes da Administração Pública, compreendendo a transparência, a acessibilidade, a integralidade e a integridade das informações referentes à gestão administrativa e financeira da coisa pública;

Considerando que são princípios da governança pública a capacidade de resposta, a integridade, a confiabilidade, a melhoria regulatória, a prestação de contas e responsabilidade, e a transparência;

RESOLVE:

- I- Visando assegurar a transparência das suas ações, bem como demonstrar o árduo trabalho que vem sendo desenvolvido nesta Autarquia, torna público o **Relatório do Nucleo de Gestão de Investimento de 2021**