

Tabela 5: Carteira de Investimentos - FUNPREV - Investimento no Exterior e TOTAL - Dezembro 2021

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - EXTERIOR	DEZEMBRO		ANO		VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META				
Art. 9º, inciso II, alínea "a" - Fic - Aberto- Investimento no Exterior						R\$ 1.387.987,35	R\$ 64.545.108,28	1,55%
VINCI INTERNACIONAL INVEST. EXTERIOR FIC MULTIMERCAD	1,81%	185,01%	14,52%	108,67%	14,61%	R\$ 161.425,14	R\$ 9.078.785,40	0,22%
WA MACRO OPPORTUNITIES EXTERIOR FI MULTIMERCADO	2,70%	275,50%	8,30%	62,11%	6,44%	R\$ 710.661,08	R\$ 27.074.965,57	0,65%
LM CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH EXTERIOR FI AÇÕES	1,85%	189,15%	23,21%	173,68%	15,06%	R\$ 515.900,54	R\$ 28.391.357,32	0,68%
Art. 9º, inciso II, alínea "a" - Fundos de Ações - BDR Nível I						R\$ 533.847,68	R\$ 157.457.330,42	3,77%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,70%	174,02%	30,51%	228,31%	17,55%	R\$ 1.707.919,96	R\$ 102.015.079,02	2,44%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,32%	-32,36%	13,59%	101,68%	18,52%	R\$ 176.072,28	R\$ 55.442.251,40	1,33%
SUBTOTAL INVESTIMENTO NO EXTERIOR						R\$ 2.919.835,03	R\$ 222.002.438,70	5,92%
TOTAL FUNPREV	0,90%	91,61%	-0,31%	-2,32%	5,08%	R\$ 37.087.511,37	R\$ 4.176.772.202,05	100,00%

Fonte: Nugin/gesprev

4.2. MOVIMENTAÇÕES DA CARTEIRA

Tabela 6: Movimentações FUNPREV – Ano 2021

MÊS	FUNDO DE INVESTIMENTO	APLICAÇÃO	RESGATE	DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO
JAN	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	451.904,36		Arrecadação Previdenciária
	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF		145.000.000,00	Enquadramento art. 14º Res. 3.922/2010
	ITAÚ INSTITUCIONAL FOF GENESIS FIC AÇÕES	35.137.210,36		Atendimento da LC 125/2019
FEV	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	1.627.203,71		Arrecadação Previdenciária
	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I; IPCA IV; IPCA VI; IPCA VII		7.016.436,59	Amortização
	CAIXA BRASIL 2024 I, 2024 IV, 2024 V		2.968.109,31	Amortização
	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	9.984.545,90		Recurso de amortização
	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO		20.000.000,00	Realocação/estratégia
	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO		22.655.448,98	Realocação/estratégia
	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA LP		254.701.209,08	Realocação/estratégia
	CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA LP		27.794.400,29	Realocação/estratégia
	BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO		9.881.291,64	Realocação/estratégia
	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FISA	200.000.000,00		Realocação/estratégia
	XP INFLAÇÃO FI RENDA FISA REFERENCIADO IPCA LP	25.000.000,00		Realocação/estratégia
	WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FISA	25.000.000,00		Realocação/estratégia
MAR	WA MACRO OPPORTUNITIES EXTERIOR FI MULTIMERCADO	25.000.000,00		Realocação/estratégia
	LM CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH EXTERIOR FI AÇÕES	20.000.000,00		Realocação/estratégia
	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	20.032.349,99		Realocação/estratégia
	VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	20.000.000,00		Realocação/estratégia
	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES		35.000.000,00	Fundo desenquadrado
	AZ QUEST SMALL MID CAPS	35.000.000,00		Recurso de Fundo Desenquadrado
	VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	2.670.209,41		Arrecadação Previdenciária
	VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO	1.961.228,23		Arrecadação Previdenciária
	LM CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH EXTERIOR FI AÇÕES	1.501.903,48		Arrecadação Previdenciária
	BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA		176.538,18	Amortização
	LM CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH EXTERIOR FI AÇÕES		176.538,18	Recurso de amortização
	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO		1.969.770,00	Taxa de Administração
ABR	BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICIF		3.077.599,58	Amortização
	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.077.599,58		Recurso de amortização
	LM CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH EXTERIOR FI AÇÕES	14.800.000,00		Arrecadação Previdenciária
MAI	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO		23.305.328,25	Atendimento da LC 125/2021
	SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	2.000.000,00		Arrecadação Previdenciária
	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO		50.000.000,00	Realocação/estratégia
JUN	BAHIA AM VALUATION FIC AÇÕES	32.000.000,00		Realocação/estratégia
	SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	18.000.000,00		Realocação/estratégia
	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES		100.000.000,00	Enquadramento art. 14º Res. 3.922/2010
JUL	BAHIA AM VALUATION FIC AÇÕES	25.000.000,00		Recurso de Fundo Desenquadrado
	VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	30.000.000,00		Recurso de Fundo Desenquadrado
	OCCAM FIC AÇÕES	25.000.000,00		Recurso de Fundo Desenquadrado
AGO	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	20.000.000,00		Recurso de Fundo Desenquadrado
	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO		400.000,00	Taxa de Administração
	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO		48.433.004,41	Atendimento da LC 125/2021
	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO		3.754.831,00	8ª chamada de capital KINEA
	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INST. I FIP MULTISTRATÉGIA	3.754.831,00		8ª chamada de capital KINEA
	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO		800.000,00	Taxa de Administração
	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO		8.486.655,01	Atendimento da LC 125/2021
	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO		80.000.000,00	Realocação/estratégia
	BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	30.000.000,00		Realocação/estratégia
	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	30.000.000,00		Realocação/estratégia
	WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	20.000.000,00		Realocação/estratégia
	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO		2.500.000,00	Taxa de Administração
SET	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I; IPCA IV; IPCA VI; IPCA VII		7.261.786,34	Amortização
	CAIXA BRASIL 2024 I, 2024 IV, 2024 V		3.119.027,60	Amortização
	BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	10.380.813,94		Recurso de amortização
	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF		80.000.000,00	Desenquadramento art. 14, Res. 3922/2010
	ITAÚ PRIVATE S&P500 BRL FIC	30.000.000,00		Recurso de Fundo Desenquadrado
	SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	20.000.000,00		Recurso de Fundo Desenquadrado
	WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	30.000.000,00		Recurso de Fundo Desenquadrado
	ITAÚ PRIVATE S&P500 BRL FIC	3.300.000,00		Arrecadação previdenciária
	BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA		196.153,53	Amortização
	ITAÚ PRIVATE S&P500 BRL FIC	196.153,53		Recurso de amortização
	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF		2.400.000,00	Taxa de Administração
	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO		319.656.527,21	Realocação/estratégia
OUT	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FISA PREVIDENCIÁRIO		266.117.205,96	Realocação/estratégia
	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF		80.000.000,00	Realocação/estratégia
	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FIC RENDA FISA		18.402.277,96	Realocação/estratégia
NOV	BB PERFIL FIC REFERENCIADO PREVIDENCIÁRIO LP	505.773.733,17		Realocação/estratégia
	WESTERN ASSET ATIVO RENDA FISA	80.000.000,00		Realocação/estratégia
	ITAÚ INSTITUCIONAL LEGEND FIC RENDA FISA LP	98.402.277,96		Realocação/estratégia
DEZ	ITAÚ INSTITUCIONAL LEGEND FIC RENDA FISA LP	2.918.066,66		Arrecadação previdenciária
	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA LP		12.000.000,00	Taxa de Administração
	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA LP		3.702.161,00	9ª Chamada de Capital do fundo Kineia
TOTAL FUNPREV		R\$1.453.704.695,28	R\$ 1.640.775.761,92	Arrecadação Previdenciária

Fonte: Nugin/gesprev

4.3. EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FUNPREV

Gráfico 4: Evolução do Patrimônio Líquido - FUNPREV - Janeiro a Dezembro 2021.

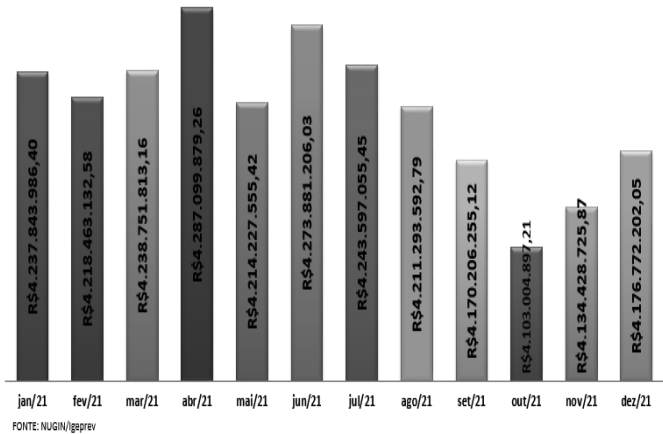


Gráfico 5: Evolução do Rendimento - FUNPREV - Janeiro a Dezembro 2021

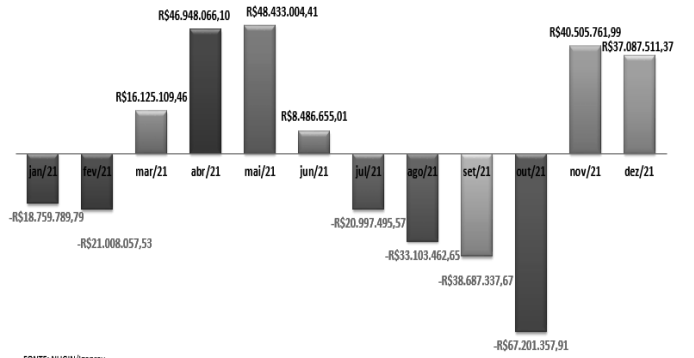
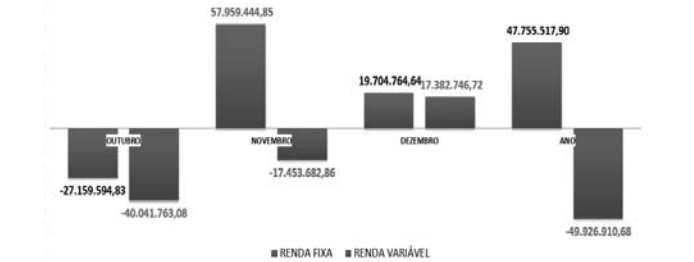


Gráfico 6: Evolução do Rendimento FUNPREV por Segmento - Outubro a Dezembro 2021 e acumulado no ano



5.1.COMPOSIÇÃO POR FUNDOS DE INVESTIMENTOS

Tabela 7: Carteira de Investimentos – FINANPREV – Dezembro 2021

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDIXA		DEZEMBRO		ANO		VOL		Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
Art. 7º, inciso I, alínea "a" - FI 100% Títulos Públicos		TIR	TIR/META	TIR	TIR/META					
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	0,72%	73,56%	4,66%	34,89%	2,76%	R\$ 75.824,21	R\$ 10.611.189,59	3,17%		
Art. 7º, inciso II, OPERAÇÕES COMPROMISSADAS						R\$ 313.561,94	R\$ 83.256.261,77	24,88%		
Art. 7º, inciso II, alínea "a" - Fundos de Renda Fixa Geral						R\$ 1.713.058,62	R\$ 200.978.353,86	66,07%		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RF	0,86%	87,58%	4,53%	33,90%	1,10%	R\$ 42.618,84	R\$ 4.993.925,00	1,49%		
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FISA	0,79%	80,40%	0,79%	5,89%	0,21%	R\$ 92.607,89	R\$ 367.780,74	10,87%		
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL AVANÇADO FIC R	0,74%	75,15%	1,24%	9,25%	0,33%	R\$ 73.762,55	R\$ 1.011.189,59	7,84%		
SANTANDER ATIVO FIC RF	0,77%	78,86%	2,47%	18,51%	1,12%	R\$ 277.647,78	R\$ 36.261.183,02	36,26%		
BRASECO PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	0,81%	82,81%	1,94%	36,98%	0,16%	R\$ 160.577,91	R\$ 19.980.155,46	5,97%		
BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO	0,80%	81,65%	4,62%	34,60%	0,15%	R\$ 14.147,05	R\$ 1.785.015,26	0,53%		
WESTERN ASSET ATIVO FI RF	0,83%	84,62%	2,52%	18,84%	1,22%	R\$ 770.283,54	R\$ 12.650.155,46	12,65%		
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	0,78%	79,41%	4,34%	32,47%	0,15%	R\$ 139.816,29	R\$ 18.134.538,01	5,42%		
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RF LP	0,96%	97,94%	2,69%	20,13%	1,16%	R\$ 141.592,78	R\$ 14.916.989,35	4,46%		
Art. 7º, inciso VII, alínea "a" - Fundos de Crédito Privado						R\$ 319.475,85	R\$ 39.739.542,91	11,88%		
BTG PACTUAL YIELD FI RF DE CRÉDITO PRIVADO	0,80%	82,16%	4,98%	37,30%	0,13%	R\$ 319.475,85	R\$ 39.739.542,91	11,88%		
TOTAL FINANPREV	0,86%	87,52%	3,51%	26,26%	0,85%	R\$ 2.421.917,62	R\$ 334.585.348,14	100,00%		

Fonte: Nugin/gesprev

OBSERVAÇÃO: Não foi calculado a Taxa de Retorno e Volatilidade das operações comprometidas em virtude de sua aplicação ser de curtíssimo prazo(1 mês). Não consideramos valores referentes ao SP5M

5.2. MOVIMENTAÇÕES NA CARTEIRA

Tabela 8: Movimentações FINANPREV – Fundos de Investimentos – Ano 2021

MÊS	FUNDO DE INVESTIMENTO	APLICAÇÃO	RESGATE	DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO
JAN	WESTERN ASSET ATIVO RENDA FISA	R\$ 7.012.778,77		Saldo Poderes
FEV	PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FISA	R\$ 6.685.914,67		Saldo Poderes
	PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FISA	R\$ 7.796.825,20		Saldo Poderes
MAR	WESTERN ASSET ATIVO RENDA FISA		R\$ 661.364,13	Sollicitação Poderes
	WESTERN ASSET ATIVO RENDA FISA	R\$ 5.364.543,35		Saldo Poderes
MAI	WESTERN ASSET ATIVO RENDA FISA	R\$ 15.571.443,13		Saldo Poderes
JUN	SANTANDER ATIVO FIC RENDA FISA	R\$ 6.389.048,04		Saldo Poderes
	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FISA LP		R\$ 11.212.304,36	Realocação/estratégia
JUL	BRASECO IN NULO FI RF		R\$ 889.242,84	Realocação/estratégia
	SANTANDER ATIVO FIC RENDA FISA	R\$ 12.101.547,20		Realocação/estratégia
	SANTANDER ATIVO FIC RENDA FISA	R\$ 7.905.401,33		Saldo Poderes
	SANTANDER ATIVO FIC RENDA FISA	R\$ 7.040.664,46		Saldo Poderes
SET	WESTERN ASSET ATIVO RENDA FISA		R\$ 449.114,84	Sollicitação Poderes
	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF LP		R\$ 3.599.050,30	Sollicitação Poderes
OUT	SANTANDER ATIVO FIC RENDA FISA	R\$ 2.080.853,82		Saldo Poderes
NOV	SANTANDER CRESCIMENTO INST. ADV. FIC RF	R\$ 6.119.108,85		Saldo Poderes
	BB INSTITUCIONAL FI RF	R\$ 6.280.172,45		Saldo Poderes
DEZ	WESTERN ASSET ATIVO RENDA FISA		R\$ 50.000.000,00	Enquadramento art. 14º Res. 3.922/2010
	SANTANDER CRESCIMENTO INST. ADV. FIC RF	R\$ 20.000.000,00		Recurso de Fundo Desenquadrado
	BB INSTITUCIONAL FI RF	R\$ 30.000.000,00		Recurso de Fundo Desenquadrado
TOTAL FINANPREV		R\$ 140.348.301,27	R\$ 66.811.076,47	

Fonte: Nugin/gesprev

Observação: Não houve movimentação na carteira FINANPREV (fundos de investimentos) nos meses de abril e agosto de 2021

5.3. EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FINANPREV

Gráfico 7: Evolução do Patrimônio Líquido – FINANPREV (Fundos + LFT) – Janeiro a Dezemb 2021

