

1.2. CARTEIRA FUNPREV
1.2.1. HISTÓRICO DE MOVIMENTAÇÕES 2022
Tabela 2: Histórico de Movimentações 2022

MÊS	SALDO ANTERIOR	ADRECAÇÃO	RECEITA AMORTIZAÇÃO	RESGATE LC 125	TAXA DE ADM	AMORTIZAÇÃO	RENDIMENTO	SALDO ATUAL
JANEIRO	4.174.772.002,05	R\$ 3.392.077,53		R\$ -	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\$ -	R\$ 15.671.768,89		R\$ 23.197.325,57	R\$ 4.196.059.239,29
MARÇO	4.196.059.239,29	R\$ -	R\$ 15.671.768,89	R\$ -	R\$ 14.000.000,00		R\$ 94.353.777,88	R\$ 4.292.084.786,05
ABRIL	4.292.084.786,05	R\$ 3.000.000,00		R\$ 45.996.401,51			R\$ 42.852.521,90	R\$ 4.206.235.862,64
TOTAL	4.292.084.786,05	R\$ 8.254.761,47	R\$ 15.671.768,89	R\$ 45.996.401,51	R\$ 18.300.000,00	R\$ 15.671.768,89	R\$ 85.505.300,63	R\$ 4.206.235.862,64

Fonte: NUGIN/IGEPREV

1.2.2. MOVIMENTAÇÕES DA CARTEIRA abril
Tabela 3: Movimentações FUNPREV – Abril de 2022

MOVIMENTAÇÕES - FUNPREV - ABRIL 2022				
DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	FUNDO DE INVESTIMENTO	DESCRIÇÃO
19/04/2022		R\$ 45.996.401,51	CAIXA BRASIL-IMA-B S TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIA LP	RESGATE PARA ATENDIMENTO DA LIC
20/04/2022	R\$ 3.000.000,00		SANTANDER RF CRÉDITO PRIVADO CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	ARRECAÇÃO PREVIDENCIÁRIA ABRIL 2022
TOTAL	R\$ 3.000.000,00	R\$ 45.996.401,51		

Fonte: NUGIN/IGEPREV

1.2.3. COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR FUNDOS DE INVESTIMENTO
Tabela 4: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Fixa – Abril 2022

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA									
	ABRIL	ANO	VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA			
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses				
Art. 7º, II, "b" - FI 100% Títulos Públicos					24.723.628,85	1.955.406.774,03	46,49%		
BB-IMA-B S FIC RENDA FIA PREVIDENCIÁRIO LP	1,53%	116,67%	5,32%	99,95%	2,67%	3.331.921,85	221.463.721,78	5,27%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIA PREVIDENCIÁRIO	2,05%	156,66%	6,18%	115,95%	1,55%	716.998,37	35.674.180,81	0,85%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIA PREVIDENCIÁRIO	2,05%	156,37%	6,16%	115,65%	1,55%	2.057.965,18	102.582.817,07	2,44%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIA PREVIDENCIÁRIO	1,78%	116,01%	5,77%	108,37%	1,85%	1.728.760,52	98.814.300,59	2,35%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIA PREVIDENCIÁRIO	2,05%	156,27%	6,16%	115,56%	1,55%	941.457,88	46.957.583,14	1,12%	
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIA	1,52%	116,17%	2,57%	48,24%	4,43%	114.421,68	7.637.430,24	0,18%	
BRASESCO INSTITUCIONAL-IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIA	0,84%	63,98%	3,63%	68,22%	5,51%	399.566,69	48.101.192,13	1,14%	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIA	0,91%	69,58%	3,25%	60,95%	2,03%	2.132.906,19	247.338.010,12	5,88%	
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIA	1,25%	95,29%	2,38%	44,61%	4,82%	468.430,08	38.014.285,44	0,90%	
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIA	1,25%	95,19%	2,14%	40,11%	4,93%	387.380,00	31.472.100,00	0,75%	
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIA	1,25%	95,29%	2,14%	40,10%	4,94%	650.190,00	52.766.790,00	1,25%	
CAIXA BRASIL-IMA-B S TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIA LP	1,54%	117,20%	5,35%	100,46%	2,68%	2.701.378,24	147.847.112,15	3,51%	
CAIXA BRASIL-IPCA IDCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIA LP	1,40%	106,97%	5,28%	99,04%	2,68%	2.474.542,29	179.167.376,16	4,26%	
ITAÚ INSTITUCIONAL-IMA-B S FIC RENDA FIA I	1,54%	117,52%	5,37%	100,71%	2,63%	3.419.167,68	225.640.834,96	5,36%	
SAPRA IMA FIC RENDA FIA	0,64%	49,05%	3,05%	57,21%	6,06%	234.838,37	36.800.579,98	0,87%	
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO RENDA FIA	0,42%	30,38%	2,53%	47,51%	6,41%	166.324,90	18.405.090,98	0,44%	
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIA	0,06%	4,55%	1,00%	20,73%	2,74%	14.647,60	24.611.870,14	0,59%	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIA	0,78%	59,29%	3,43%	64,43%	1,16%	2.033.480,32	264.004.320,79	6,28%	
ITAÚ INSTITUCIONAL LEGADO FIC RENDA FIA LP	0,62%	47,24%	3,11%	58,40%	1,66%	658.351,99	107.109.184,54	2,55%	
Art. 7º, III, "b" - FI Renda Fria					8.444.428,47	1.048.286,24	26,12%		
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIA REFERENCIADO IMA-B LP	0,75%	57,39%	3,54%	66,52%	5,57%	2.569.280,61	344.539.337,57	8,19%	
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIA REFERENCIADO IPCA LP	1,10%	84,16%	4,64%	87,01%	3,66%	295.562,51	27.119.353,54	0,64%	
BRASESCO H NILO FI RENDA FIA	0,62%	47,19%	3,31%	62,22%	6,21%	456.035,37	74.271.248,53	1,77%	
BB PERFIL FIC RENDA FIA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,78%	59,74%	3,37%	63,24%	0,18%	4.128.178,74	532.103.184,05	12,65%	
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIA	0,72%	55,31%	2,88%	54,12%	1,02%	601.081,84	83.600.658,61	1,99%	
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINAMICO RF FIC	0,91%	69,64%	3,78%	70,89%	0,79%	1.079.043,02	119.426.966,72	2,84%	
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIA	0,82%	62,92%	1,80%	33,75%	0,21%	13.747,48	1.682.546,23	0,04%	
Art. 7º, V, "b" - FIDC Cota Senior					10.815,31	2.216.498,90	0,65%		
BBIF MASTER FIDC LP	-0,49%	-37,09%	-1,48%	-27,71%	14,41%	2.216.498,90	2.216.498,90	0,65%	
Art. 7º, V, "b" -					160.121,01	18.967.439,29	0,45%		
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RF CP LP	0,96%	73,16%	1,83%	34,38%	0,31%	160.121,01	18.967.439,29	0,45%	
TOTAL RENDA FIA					34.026.066,12	1.159.334.068,47	75,11%		

Tabela 5: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Variável – Abril 2022

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL									
	ABRIL	ANO	VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA			
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses				
Art. 8º, inciso I - FI Ações					- 53.027.017,71	535.151.949,35	12,72%		
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-9,53%	-728,28%	1,85%	34,82%	19,19%	- 1.459.202,13	13.844.621,90	0,33%	
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-9,99%	-762,70%	2,88%	54,05%	19,20%	- 242.282,77	2.184.022,77	0,05%	
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-7,72%	-589,44%	2,97%	55,74%	17,00%	- 105.072,09	3.987.289,44	0,93%	
BWP PARABAS ACTION FIC AÇÕES	-6,42%	-480,31%	8,71%	163,53%	18,99%	- 241.896,37	3.154.008,10	0,08%	
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-6,28%	-403,39%	3,89%	73,11%	24,77%	- 290.752,62	5.214.560,03	0,12%	
BRASESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-9,42%	-719,21%	1,26%	23,60%	23,07%	- 1.945.261,05	17.413.478,82	0,44%	
BRASESCO SMALL VALUATION IBOVESPA FI AÇÕES	-7,60%	-580,87%	5,87%	110,28%	19,58%	- 191.811,98	3.545.589,14	0,08%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-10,96%	-837,12%	-2,16%	-40,52%	24,29%	- 10.802.376,45	87.759.655,65	2,09%	
ITAU DIVIDENDOS FI AÇÕES	-6,77%	-515,00%	7,66%	143,82%	16,97%	- 194.340,38	2.676.387,92	0,06%	
ITAÚ DINAMIS FIC AÇÕES	-6,31%	-482,31%	-1,01%	-18,95%	17,76%	- 2.529.513,56	37.528.657,86	0,89%	
ITAU INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	-10,56%	-806,83%	-0,92%	-17,19%	21,10%	- 3.428.095,50	29.024.649,72	0,89%	
VINCO INSTITUCIONAL PRIVATE EQUITY FI AÇÕES	-10,24%	-782,33%	-0,29%	-5,50%	21,64%	- 3.318.337,31	72.984.555,49	1,73%	
VINCO MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-9,29%	-709,66%	0,70%	13,08%	20,67%	- 5.240.569,64	51.163.623,14	1,22%	
VINCO SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	-7,15%	-545,84%	1,33%	24,95%	17,25%	- 1.652.494,09	21.470.877,37	0,51%	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-5,92%	-452,10%	-0,02%	-0,31%	16,73%	- 2.011.465,07	31.971.420,04	0,76%	
SAPRA EQUITY PORTFOLIO PB FIC AÇÕES	-8,64%	-660,08%	0,33%	6,26%	24,44%	- 1.391.342,21	14.708.234,15	0,35%	
BAHIA AM VALUATION FIC AÇÕES	-9,16%	-699,42%	0,54%	10,17%	21,36%	- 4.209.803,69	41.763.019,15	0,99%	
OCCAM FIC AÇÕES	-8,70%	-664,28%	2,07%	38,78%	18,15%	- 1.978.041,54	20.765.880,26	0,49%	
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-8,02%	-612,30%	2,55%	47,93%	18,15%	- 3.470.674,28	39.781.480,71	0,95%	
CAIXA AÇÕES UBER FIC AÇÕES	-8,36%	-638,34%	-0,03%	-0,59%	28,53%	- 9.114.651,95	35.128.224,67	0,84%	
TOTAL RENDA VARIÁVEL					53.027.017,71	535.151.949,35	12,72%		

Tabela 6: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Investimento no Exterior, Estruturado e Total FUNPREV – Abril 2022

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR									
	ABRIL	ANO	VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA			
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses				
Art. 9º, inciso II - FI Investimento no Exterior					- 3.899.466	51.750.054,26	1,23%		
VINCO INTERNACIONAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	0,48%	36,64%	-16,39%	-307,63%	14,20%	36.236,77	7.590.930,93	0,18%	
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC	-3,02%	-230,66%	-19,30%	-362,23%	11,40%	- 680.393,70	21.850.284,33	0,52%	
LEGG MASON CLEARBIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTIMENTO NO EX	-12,73%	-972,62%	-21,42%	-402,15%	21,64%	- 3.255.308,96	22.308.839,00	0,53%	
Art. 9º, inciso III - FI Ações BDR Nivel I					- 9.919.169	113.932.799,23	2,71%		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-6,82%	-520,89%	-25,10%	-471,13%	19,06%	- 5.592.366,75	76.411.231,24	1,82%	
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-10,34%	-789,71%	-32,32%	-606,75%	22,04%	- 4.326.802,32	37.521.567,99	0,89%	
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					(13.818.694,96)	165.682.853,48	3,94%		

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - ESTRUTURADOS									
	ABRIL	ANO	VOL	Rendimento R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA			
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses				
Art. 10º, inciso I - FI ou FIC Multimercado					- 8.290.796,44	261.442.366,78	6,22%		
SAPRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-8,65%	-660,78%	-11,39%	-213,78%	16,42%	- 2.244.072,53	23.695.331,86	0,56%	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-8,78%	-670,41%	-11,46%	-215,07%	16,59%	- 4.464.216,97	46.397.154,11	1,10%	
VINCO VALOREM FI MULTIMERCADO	1,79%	136,73%	6,10%	114,52%	1,87%	658.085,68	37.419.803,33	0,89%	
BRASESCO MAIOR INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,72%	55,07%	3,07%	57,63%	1,87%	52.313,68	7.307.834,05	0,17%	
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,17%	-12,74%	3,90%	73,15%	3,31%	- 190.078,18	113.747.539,02	2,70%	
ITAÚ PRIVATE S&P500 BRL FIC MULTIMERCADO	-8,62%	-658,73%	-11,47%	-215,24%	16,59%	- 3.103.628,02	32.874.713,41	0,78%	
Art. 10º, inciso II - FI Participações					- 742.138,90	84.624.626,56	2,01%		
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFP	-0,06%	-4,96%	1,47%	27,58%	1,78%	- 6.172,75	90.000.125,47	0,23%	
ONEA PRIVATE EQUITY II FEEDER INSTITUCIONAL II MULTISTRATÉGIA FIP	-0,97%	-74,10%	6,14%	115,26%		735.966,15	75.124.499,09	1,78%	
TOTAL ESTRUTURADOS					10.032.935,35	346.065.991,34	8,23%		
TOTAL FUNPREV	-1,01%	-76,86%	1,56%	29,35%	5,03%	- 42.852.521,90	4.206.235.862,64	100,00%	

1.2.4. FUNDO ESTRESSADO

O IGEPREV possui apenas 01(um) fundo estressado na carteira FUNPREV – FIDC BBIF MASTER.

abr/22

FIDC BBIF MASTER	Valor
APLICAÇÃO	12.000.000,00
Quant. Cotas	107,16
VALOR REAL(EXTRATO)	2.216.499,90
VALOR ATUALIZADO (IPCA + 8,5%)	54.144.000,00
RETORNO NO MÊS (%)	-0,49%
RETORNO NO MÊS (\$)	- 10.815,31
PATRIMÔNIO DO FUNDO	28.919.390,29
VARIAÇÃO(atualizado - Valor Real)	- 51.927.500,10

1.2.5. EVOLUÇÃO DA CARTEIRA FUNPREV

Gráfico 4: Evolução do Patrimônio Líquido – FUNPREV – Maio 2021 a Abril 2022.

