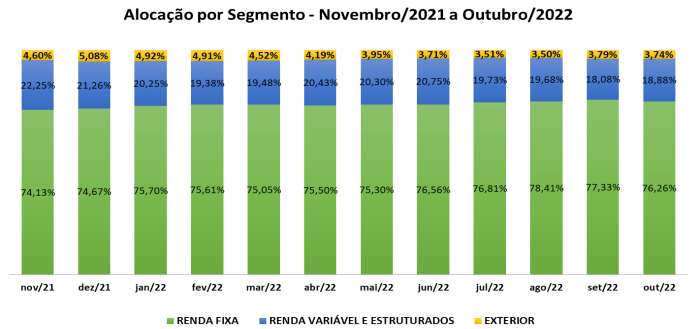


Gráfico 3: Alocação por Segmento – Novembro 2021 a Outubro 2022 (so-
mente Fundos de Investimentos)



2.2. CARTEIRA FUNPREV

2.3. HISTÓRICO DE MOVIMENTAÇÕES 2022

Tabela 2: Historico de Movimentações 2022

MOVIMENTAÇÃO FUNPREV - Acumulado 2022										
INÍZ	SALDO ANTERIOR	APRECAÇÃO	RECEITA APLICADA OUTROS(*)	AMORTIZAÇÃO	LC 125	TAXA DE REGATE	OUTROS(*)	AMORTIZAÇÃO	RENDIMENTO	DISPONIBILIDADE SALDO ATUAL
JANEIRO	4.176.772.020,59	R\$ 1.392.071,59	R\$ 3.882.697,88	R\$ -	R\$ -	R\$ 4.300.000,00	R\$ -	R\$ 10.866.719,39	R\$ 4.184.616.974,73	
FEBREIRO	4.184.070.994,73	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 14.000.000,00	R\$ 15.677.768,89	R\$ 23.197.325,57	R\$ 4.186.059.239,29	
MARÇO	4.196.065.239,29	R\$ -	R\$ 15.677.768,89	R\$ -	R\$ -	R\$ 45.996.401,51	R\$ -	R\$ 94.537.777,88	R\$ 4.230.235.862,64	
ABRIL	4.292.084.786,05	R\$ 3.000.000,00	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 6.000.000,00	R\$ -	R\$ 42.832.521,90	R\$ 4.230.235.862,64	
MAIO	4.206.235.862,64	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 6.000.000,00	R\$ -	R\$ 30.165.767,52	R\$ 4.230.235.862,64	
JUNHO	4.230.235.862,64	R\$ -	R\$ 6.388.503,82	R\$ -	R\$ -	R\$ 6.300.000,00	R\$ 6.392.334,63	R\$ 59.733.884,43	R\$ 4.342.124.754,73	
JULHO	4.342.124.754,73	R\$ -	R\$ 3.810,83	R\$ -	R\$ -	R\$ 4.000.000,00	R\$ -	R\$ 60.881.451,40	R\$ 4.414.235.105,77	
AGOSTO	4.214.328.105,77	R\$ 187.361.159,11	R\$ 76.138.761,40	R\$ -	R\$ 5.800.000,00	R\$ 349.384.534,16	R\$ 76.178.081,40	R\$ 51.663.760,55	R\$ 4.563.336.327,77	
SETEMBRO	4.260.828.974,54	R\$ -	R\$ 254.303.370,31	R\$ 39.500,00	R\$ 40.095.356,96	R\$ 2.400.000,00	R\$ 98.000.020,46	R\$ 5.467.884,62	R\$ 4.907.833,77	
OUTUBRO	4.260.828.112,60	R\$ -	R\$ 189.900.943,70	R\$ -	R\$ 5.677.884,62	R\$ 4.000.000,00	R\$ 201.000.000,00	R\$ 89.578.928,31	R\$ 5.935.855,61	
TOTAL	4.260.828.112,60	R\$ 824.761,47	R\$ 641.363.473,12	R\$ 58.242.764,94	R\$ -	R\$ 78.684.584,62	R\$ 51.695.251,58	R\$ 641.363.473,12	R\$ 4.563.336.327,77	

Observação: A Receita Aplicada (outros): Identifica as receitas aplicadas provenientes de realocação estratégica da própria carteira.
Regate(Outros): Identifica os valores que foram registrados para realocação da carteira.
Obs: (**) A meta é menor em função do aumento proveniente de amortização decorrente de bloqueio judicial no valor de R\$ 3.810,83.
(*) Em agosto o valor do regate para a taxa de administração, foi proveniente do saldo das amortizações dos Fundos Verticais, e portanto não computamos para cálculo do saldo atual do PL.

2.4. MOVIMENTAÇÕES DA CARTEIRA OUTUBRO

Tabela 3: Movimentações FUNPREV – Outubro de 2022

MOVIMENTAÇÕES - FUNPREV - OUTUBRO 2022				
DATA	APLICAÇÃO	REGATE	ATIVO	DESCRIÇÃO
13/10/2022		4.000.000,00	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIC REFERENCIADO IMA-B LP	Taxa de Administração
19/10/2022		5.617.884,62	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIC REFERENCIADO IMA-B LP	Atendimento da Lei Complementar 125/2019
19/10/2022		100.000.000,00	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIC REFERENCIADO IMA-B LP	Realocação Estratégica
21/10/2022	99.901.930,28		NTN-B 15/05/2045	Realocação Estratégica
27/10/2022		101.000.000,00	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIC LP	Realocação Estratégica
31/10/2022	99.999.013,42		NTN-B 15/05/2045	Realocação Estratégica
TOTAL		R\$ 199.900.943,70	R\$ 210.617.884,62	
FONTE: Nugin/geprev				

Fonte: Nugin/igeprev

2.5. COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR FUNDOS DE INVESTIMENTO

Tabela 4: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Fixa – Outubro 2022

FUNDO DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA										
Art. 7º, inciso I, alínea "b" - 100% Títulos Públicos	OUTUBRO		ANO		VOL	TAXA	TAXA	RENDIMENTO R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META						
NTN 2025 25.08.22 - 5,882	0,55%	0,5878%	0,68%	9,23%	-	0,00%	0,00%	1.422.273,70	239.059.022,07	6,02%
NTN 2025 26.08.22 - 5,970	0,55%	0,6278%	0,70%	9,83%	-	0,00%	0,00%	608.330,72	12.889.705,28	0,49%
NTN 2025 01.09.2022 - 5,570	0,56%	0,6609%	0,69%	9,99%	-	0,00%	0,00%	442.102,40	79.539.197,23	1,26%
NTN 2020 15.09.2022 - 5,930	0,56%	0,6638%	0,69%	9,99%	-	0,00%	0,00%	415.043,39	25.074.331,53	1,29%
NTN 2020 27.09.2022 - 5,640	0,55%	0,6555%	0,69%	6,70%	-	0,00%	0,00%	552.926,40	101.208.098,67	2,35%
NTN 2021 21.10.2022 - 5,840	0,59%	0,6411%	0,29%	6,10%	-	0,00%	0,00%	188.815,38	100.100.846,56	2,39%
NTN 2025 11.10.2022 - 5,910	0,56%	0,6000%	0,00%	6,00%	-	0,00%	0,00%	99.999.013,42	1.999.999.013,42	2,32%
Art. 7º, inciso II, alínea "b" - 100% Títulos Públicos	24,76%	24,76%	24,76%	24,76%	1,00%	0,00%	0,00%	24.764.412,84	1.999.999.013,42	16,76%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIC REFERENCIADO LP	1,89%	235,51%	8,92%	121,98%	2,45%	0,20%	0,00%	4.248.205,06	229.029.991,62	5,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIC PREVIDENCIÁRIO	1,88%	238,83%	9,03%	131,71%	1,06%	0,20%	0,00%	608.330,72	12.889.705,28	0,49%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIC	1,67%	199,51%	-17,77%	-55,01%	30,70%	0,15%	0,00%	63.959,04	3.889.190,16	0,04%
BRASESCO INSTITUCIONAL ALOCADO DINÂMICA FIC RENDA FIC	1,30%	143,42%	2,23%	97,24%	5,09%	0,20%	0,00%	706.477,17	49.733.807,13	3,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIC	0,99%	137,64%	9,36%	127,92%	1,59%	0,40%	0,00%	2.557.649,93	261.971.306,12	6,09%
CAIXA BRASIL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIC	1,29%	239,93%	2,23%	30,29%	1,02%	0,20%	0,00%	188.815,38	100.100.846,56	2,39%
CAIXA BRASIL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIC	1,29%	239,93%	2,23%	30,29%	1,02%	0,20%	0,00%	188.815,38	100.100.846,56	2,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIC	1,88%	237,77%	9,05%	123,68%	2,41%	0,20%	0,00%	2.111.302,50	42.876.218,95	1,00%
CAIXA BRASIL IPCA 24 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIC LP	1,88%	238,83%	9,03%	131,71%	1,06%	0,20%	0,00%	608.330,72	12.889.705,28	0,49%
ITAU INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIC	1,00%	238,48%	9,03%	123,68%	2,41%	0,18%	0,00%	4.346.973,13	233.362.320,32	5,42%
ITAU IMA-B FIC RENDA FIC	1,00%	238,48%	9,03%	123,68%	2,41%	0,18%	0,00%	4.346.973,13	233.362.320,32	5,42%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO RENDA FIC	1,00%	129,73%	6,02%	82,28%	5,88%	0,10%	0,00%	424.921,72	40.745.553,13	0,95%
WESTERN ASSET ATIVO RENDA FIC	1,00%	82,49%	7,01%	95,81%	2,49%	0,80%	0,00%	100.968,19	26.094.038,42	0,61%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIC	0,88%	104,93%	9,36%	127,91%	1,80%	0,40%	0,00%	2.433.278,72	278.123.568,96	6,49%
Art. 7º, inciso II, alínea "b" - 100% Títulos Públicos	0,96%	114,28%	9,03%	122,12%	1,41%	0,10%	0,00%	8.541.564,48	817.230.138,08	20,00%
Art. 7º, inciso II, alínea "b" - 100% Títulos Públicos	1,40%	150,03%	7,84%	99,21%	5,21%	0,20%	0,00%	489.204,11	31.116.533,16	0,77%
PP IMPLANTAÇÃO FIC RENDA FIC REFERENCIADO IMA-B LP	1,34%	150,59%	8,02%	106,59%	3,61%	0,10%	0,00%	970.131,18	57.035.639,08	0,80%
BB PERFIL FIC RENDA FIC REFERENCIADO DE PREVIDENCIÁRIO LP	1,04%	133,93%	10,21%	139,59%	0,11%	0,20%	0,00%	5.834.426,26	567.321.376,39	13,10%
WESTERN ASSET ATIVO FIC RENDA FIC	0,96%	134,67%	10,00%	137,48%	0,94%	0,40%	0,00%	509.632,17	53.516.140,99	1,24%
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC	1,00%	139,13%	10,00%	136,09%	0,71%	0,10%	0,00%	1.119.974,10	113.493.943,48	3,10%
BB INSTITUCIONAL FIC RENDA FIC	1,04%	124,30%	6,61%	91,17%	0,11%	0,20%	0,00%	18.507,54	1.795.110,03	0,04%
Art. 7º, inciso II, alínea "b" - 100% Títulos Públicos	-0,40%	-40,48%	-1,60%	-76,59%	1,51%	0,25%	0,00%	7.245,66	2.222.664,01	0,06%
BB MASTER FIC LP	-0,40%	-40,48%	-1,60%	-76,59%	1,51%	0,25%	0,00%	7.245,66	2.222.664,01	0,06%
Art. 7º, inciso II, alínea "b" - 100% Títulos Públicos	1,11%	133,93%	9,03%	123,11%	0,18%	0,30%	0,00%	222.202,28	20.360.798,21	0,49%
NTN 2025 25.08.22 - 5,882	0,55%	0,5878%	0,68%	9,23%	-	0,00%	0,00%	1.422.273,70	239.059.022,07	6,02%
TOTAL INVESTIMENTOS	24,76%	24,76%	24,76%	24,76%	1,00%	0,00%	0,00%	24.764.412,84	1.999.999.013,42	16,76%

Considerando que Títulos Públicos estão mercadorias no caixa, no seja, estão precificadas de acordo com a taxa acordada na negociação. Logo, a remuneração informada dentro dessa nota não está incorporada à volatilidade de mercado.

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

FUNDO DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL											
Art. 8º, Inciso I - FICs	OUTUBRO		ANO		VOL	Taxa	Adm	Tfornam	Rendimentos R\$	PL (R\$)	% CARTEIRA
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META							
30.01.2023											
30.01.2023	30.01.2023	30.01.2023	30.01.2023	30.01.2023	30.01.2023	30.01.2023	30.01.2023	30.01.2023	30.01.2023	30.01.2023	30.01.2023
ITAU DIF FUNDOS AÇÕES FIC RENDA FIC	6,12%	730,75%	12,79%	174,91%	19,93%	1,50%	0,00%		84.769,59	15.315.579,99	0,36%
CAIXA BRASIL INDEX BOLSA ATIVO FIC RENDA FIC	5,36%	639,74%	14,70%	146,70%	20,12%	0,50%	0,00%		119.620,79	2.350.700,64	0,05%
CAIXA QUEST AÇÕES FIC RENDA FIC	6,11%	728,51%	9,36%	126,65%	18,85%	2,00%	0,00%		84.750,34	1.472.849,21	0,03%
BRASESCO VALUATION INDEX BOLSA ATIVO FIC RENDA FIC	6,73%	803,62%	14,57%	210,17%	19,13%	2,00%	0,00%		235.950,87	3.738.948,97	0,99%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIC RENDA FIC	7,80%	930,67%	1,72%	23,48%	25,79%	2,00%	0,00%		369.388,87	5.105.292,27	0,12%
BRASESCO MID SMALL CAPS FIC RENDA FIC	8,43%	1003,93%	5,44%	74,31%	25,18%	1,50%	0,00%		1.553.012,29	19.485.653,14	0,45%
BRASESCO VALUATION INDEX BOLSA ATIVO FIC RENDA FIC	6,73%	803,62%	14,57%	210,17%	19,13%	2,00%	0,00%		235.950,87	3.738.948,97	0,99%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC RENDA FIC	7,78%	928,69%	9,95%	95,55%	24,46%	3,00%	0,00%		6.929.752,94	95.964.521,04	2,23%
ITAU DIVIDENDOS FIC RENDA FIC	4,69%	559,02%	11,11%	151,83%	17,81%	1,50%	0,00%		123.611,55	2.762.025,59	0,09%
ITAU DUNAMIS FIC RENDA FIC	10,60%	1.246,50%	12,97%	176,64%	19,13%	1,50%	0,00%		4.102.077,77	42.369.847,79	1,00%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	7,28%	868,43%	8,46%	115,63%	21,46%	0,80%	10,00%		2.155.432,84	11.779.591,91	0,24%
ITAU INSTITUCIONAL FUNDOS FIC RENDA FIC	6,95%	828,80%	7,34%	100,28%	21,09%	2,00%	0,00%		5.096.656,33	78.471.458,01	1,82%
VINCO MOSAICO INSTITUCIONAL FIC RENDA FIC	8,15%	995,82%	10,11%	138,26%	1,96%	1,97%	2,00%		4.309.634,66	55.948.243,31	1,20%
VINCO SELECTION EQUITIES FIC RENDA FIC	5,54%	661,39%	11,30%	154,49%	17,61%	0,97%	2,00%		1.238.593,27	23.583.798,16	0,55%
CAIXA QUEST SMALL MID CAPS FIC RENDA FIC	8,89%	1061,05%	3,12%	42,64%	18,79%	2,00%	0,00%		2.692.749,40	32.974.121,14	0,77%
SAPFA EQUITY PORTFOLIO RF FIC RENDA FIC	4,22%	503,13%	3,73%	51,00%	24,80%	2,00%	0,00%		615.248,81	15.206.223,85	0,35%
CAIXA ANA VALUATION FIC RENDA FIC	8,13%	970,20%	9,74%	113,11%	21,21%	1,90%	2,00%		3.426.973,63	45.582.405,96	1,06%
OCCAM FIC RENDA FIC	6,75%	805,11%	13,34%	182,30%	19,56%	2,00%	0,00%		1.457.530,31	23.058.644,11	0,54%
BB QUANTITATIVO FIC RENDA FIC	4,36%	520,35%	6,11%	81,48%	20,19%	1,00%	0,00%		1.719.945,16	41.159.911,09	0,96%
SAPFA AÇÕES LIVRE FIC RENDA FIC	4,79%	571,52%	4,53%	61,88%	29,85%	2,00%	0,00%		1.638.247,72	38.834.292,19	0,86%
30.01.2023											
TOTAL RENDA VARIÁVEL									30.01.2023	577.973.812,64	13,49%