

CARTEIRA FUNPREV - NOVEMBRO 2024

RENDA FIXA

ATIVOS	RENDIMENTO	PL	% CARTEIRA
Art. 7º, I, "a" - Títulos Públicos emitidos pelo Tesouro Nacional	R\$ 14.480.782,44	R\$ 1.674.989.577,69	38,59%
NTN-B 2035 28.11.2022_6,21	R\$ 869.964,36	R\$ 99.146.732,19	2,28%
NTN-B 2040 28.12.2022_6,27	R\$ 1.136.467,50	R\$ 131.282.005,06	3,02%
NTN-B 2040_11.04.2023_6,1910	R\$ 361.920,27	R\$ 42.076.111,56	0,97%
NTN-B 2045 21.10.2022_5,84	R\$ 919.110,76	R\$ 108.084.674,52	2,49%
NTN-B 2045 30.01.2023_6,452	R\$ 396.059,54	R\$ 44.240.816,75	1,02%
NTN-B 2045 31.10.2022_5,851	R\$ 918.192,07	R\$ 107.881.562,71	2,49%
NTN-B 2045_16.03.2023_6,44	R\$ 776.371,31	R\$ 86.805.351,94	2,00%
NTN-B 2050 10.02.2023_6,452	R\$ 386.803,57	R\$ 44.034.464,67	1,01%
NTN-B 2050 15.09.2022_5,933	R\$ 702.299,83	R\$ 83.414.691,95	1,92%
NTN-B 2050 16.03.2023_6,4461	R\$ 191.612,93	R\$ 21.821.908,47	0,50%
NTN-B 2050 27.09.2022_5,846	R\$ 939.454,60	R\$ 112.401.687,30	2,59%
NTN-B 2050 28.12.2022_6,312	R\$ 1.140.358,44	R\$ 131.275.642,82	3,02%
NTN-B 2055 01.09.2022_5,973	R\$ 738.740,17	R\$ 85.891.064,76	1,98%
NTN-B 2055 10.02.2023_6,377	R\$ 391.703,50	R\$ 44.024.129,22	1,01%
NTN-B 2055 11.04.2023_6,21	R\$ 689.153,38	R\$ 78.558.371,88	1,81%
NTN-B 2055 12.04.2023_6,155	R\$ 64.033,39	R\$ 7.330.705,74	0,17%
NTN-B 2055 14.04.2023_6,0675	R\$ 367.331,85	R\$ 42.369.074,88	0,98%
NTN-B 2055 25.08.2022_5,882	R\$ 2.386.972,77	R\$ 279.742.320,19	6,45%
NTN-B 2055 26.08.2022_5,882	R\$ 53.809,09	R\$ 6.306.179,93	0,15%
NTN-B 2055 28.11.2022_6,212	R\$ 870.035,73	R\$ 99.132.505,84	2,28%
NTN-F 27.02.2023_13,36	R\$ 180.387,39	R\$ 19.169.575,32	0,44%
Art. 7º, I, "b" - Fundos de Investimentos 100% Títulos Públicos	R\$ 3.167.453,33	R\$ 427.713.008,37	9,85%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	R\$ 0,03	R\$ 8,41	0,00%
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	R\$ 1.477.412,76	R\$ 137.231.668,53	3,16%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	R\$ 1.688.625,66	R\$ 290.257.073,33	6,69%
ITAU INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	R\$ 1.414,89	R\$ 224.258,10	0,01%
Art. 7º, II - Operações Compromissadas	R\$ -	R\$ -	0,00%
Operações Compromissadas - LFT	R\$ -	R\$ -	0,00%
ATIVOS	RENDIMENTO	PL	% CARTEIRA
Art. 7º, II - Operações Compromissadas	R\$ -	R\$ -	0,00%
Operações Compromissadas - LFT	R\$ -	R\$ -	0,00%
Art. 7º, III, "a" - Fundos de Renda Fixa Geral	R\$ 8.835.412,11	R\$ 1.108.689.895,67	25,55%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	R\$ 18,22	R\$ 2.325,19	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	R\$ 5.639.090,72	R\$ 705.149.714,34	16,25%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	R\$ 1.546.966,45	R\$ 201.936.277,42	4,65%
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	R\$ 1.649.336,72	R\$ 201.601.578,71	4,65%
Art. 7º, IV - Ativos Financeiros de RF de emissão de Instituições Financeiras	R\$ 547.153,64	R\$ 51.139.239,53	1,18%
LFSN BTG Pactual - VENC. DEZ/2032 - IPCA+8,4%	R\$ 547.153,64	R\$ 51.139.239,53	1,18%
Art. 7º, V, "a" - FIDC Cota Senior	-R\$ 11.299,58	R\$ 2.401.744,09	0,06%
BBIF MASTER FIDC LP	-R\$ 11.299,58	R\$ 2.401.744,09	0,06%
Art. 7º, inciso V, alínea "b"	R\$ 300.234,02	R\$ 49.671.253,95	1,14%
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	R\$ 98.366,00	R\$ 19.706.281,03	0,45%
BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	R\$ 141.250,15	R\$ 17.904.355,05	0,41%
ITAU HIGH GRADE RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	R\$ 60.617,87	R\$ 12.060.617,87	0,28%
SUBTOTAL RENDA FIXA	R\$ 27.319.735,96	R\$ 3.314.604.719,30	76,37%

MOVIMENTAÇÃO FUNPREV

MOVIMENTAÇÕES - FUNPREV					
DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	AMORTIZAÇÃO/ PAGAMENTO DE CUPOM	ATIVO	DESCRIÇÃO
08/11/2024	R\$ 6.000.000,00			ITAU HIGH GRADE RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Arrecadação previdenciária
13/11/2024	R\$ 5.000.000,00			ITAU HIGH GRADE RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Arrecadação previdenciária
14/11/2024				ITAU HIGH GRADE RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Arrecadação previdenciária
14/11/2024				ITAU INSTITUCIONAL MA-B 5 FIC RF I	Realocação estratégica
18/11/2024				BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	Realocação estratégica
18/11/2024				R\$ 3.111.555,99	Pgto Juros NTN-B - NOV/2045
18/11/2024				R\$ 3.109.623,51	Pgto Juros NTN-B - NOV/2045
18/11/2024				R\$ 1.364.590,97	Pgto Juros NTN-B - NOV/2045
18/11/2024				R\$ 2.673.912,91	Pgto Juros NTN-B - NOV/2045
18/11/2024				R\$ 2.956.184,32	Pgto Juros NTN-B - NOV/2035
18/11/2024				R\$ 8.063.866,87	Pgto Juros NTN-B - NOV/2055
18/11/2024				R\$ 181.782,27	Pgto Juros NTN-B - NOV/2055
18/11/2024				R\$ 2.506.817,51	Pgto Juros NTN-B - NOV/2055
18/11/2024				R\$ 2.987.877,05	Pgto Juros NTN-B - NOV/2055
18/11/2024				R\$ 1.356.216,87	Pgto Juros NTN-B - NOV/2055
18/11/2024				R\$ 2.365.746,22	Pgto Juros NTN-B - NOV/2055
18/11/2024				R\$ 219.272,45	Pgto Juros NTN-B - NOV/2055
18/11/2024				R\$ 1.252.506,93	Pgto Juros NTN-B - NOV/2055
18/11/2024	R\$ 210.000,00			BTGP INFRAESTRUTURA FEEDER FIP MULTI	2ª Chamada de Capital do FIP BTGP INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP MULTI
19/11/2024	R\$ 2.864.632,33			BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	Saldo remanescente do pagamento de cupom que foi utilizado para atendimento da LC 125/19 e chamada de Capital do FIP Infra III Feeder
27/11/2024	RS 7.968.236,26			BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	Arrecadação Previdenciária
TOTAL	R\$ 23.197.235,94	R\$ 154.365,35	R\$ 32.149.953,87		

MOVIMENTAÇÕES - FUNPREV

DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	AMORTIZAÇÃO/ PAGAMENTO DE CUPOM	ATIVO	DESCRIÇÃO
08/11/2024	R\$ 6.000.000,00			ITAU HIGH GRADE RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Arrecadação previdenciária
13/11/2024	R\$ 5.000.000,00			ITAU HIGH GRADE RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Arrecadação previdenciária
14/11/2024	R\$ 1.000.000,00			ITAU HIGH GRADE RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Arrecadação Previdenciária
14/11/2024		R\$ 154.365,35		ITAU INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RF I	Realocação estratégica
18/11/2024			R\$ 3.111.555,99	BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	Realocação estratégica
18/11/2024			RS 3.109.623,51	NTN-B 2045 21.10.2022_5,84	Pgto Juros NTN-B - NOV/2045
18/11/2024			RS 1.364.590,97	NTN-B 2045 31.10.2022_5,8510	Pgto Juros NTN-B - NOV/2045
18/11/2024			RS 2.673.912,91	NTN-B 2045 16.03.2023_6,44	Pgto Juros NTN-B - NOV/2045
18/11/2024			RS 2.956.184,32	NTN-B 2035 28.11.2022_6,21	Pgto Juros NTN-B - NOV/2035
18/11/2024			RS 8.063.866,87	NTN-B 2055 25.08.2022_5,8820	Pgto Juros NTN-B - NOV/2055
18/11/2024			RS 181.782,27	NTN-B 2055 26.08.2022_5,88820	Pgto Juros NTN-B - NOV/2055
18/11/2024			RS 2.506.817,51	NTN-B 2055 01.09.2022_5,9730	Pgto Juros NTN-B - NOV/2055
18/11/2024			RS 2.987.877,05	NTN-B 2055 28.11.2022_6,2120	Pgto Juros NTN-B - NOV/2055
18/11/2024			RS 1.356.216,87	NTN-B 2055 10.02.2023_6,3770	Pgto Juros NTN-B - NOV/2055
18/11/2024			RS 2.365.746,22	NTN-B 2055 11.04.2023_6,2056	Pgto Juros NTN-B - NOV/2055
18/11/2024			RS 219.272,45	NTN-B 2055 12.04.2023_6,1550	Pgto Juros NTN-B - NOV/2055
18/11/2024			RS 1.252.506,93	NTN-B 2055 14.04.2023_6,0675	Pgto Juros NTN-B - NOV/2055
18/11/2024	R\$ 210.000,00			BTGP INFRAESTR III FEEDER FIP MULTI	2º Chamada de Capital do FIP BTGP INFRAESTR III FEEDER FIP MULTI
19/11/2024	RS 2.864.632,33			BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	Saldo remanescente do pagamento de cupom que foi utilizado para
27/11/2024	RS 7.968.238,26			BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	Arrecadação Previdenciária
TOTAL	R\$ 23.197.235,94	R\$ 154.365,35	R\$ 32.149.953,87		

NO QUADRO ACIMA REPETIDO REDIMENCIONEI A ULTIMA COLUNA E HOUVE PERDA NA DESCRIÇÃO DA PENULTIMA LINHA

CARTEIRA FINANPREV - JULHO 2024

CARTEIRA FINANPREV - JULHO 2024

ATIVOS - RENDA FIXA	RENDIMENTO	PL	% CARTEIRA
Art. 7º, II - Operações Compromissadas	R\$ 782.644,27	R\$ 73.509.838,49	13,58%
Operações Compromissadas - LFT	R\$ 782.644,27	R\$ 73.509.838,49	13,58%
Art. 7º, III, "a" - Fundos de Renda Fixa Geral	R\$ 4.426.807,41	R\$ 467.792.261,19	86,41%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	R\$ 1.498.144,82	R\$ 151.993.931,15	28,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	R\$ 103.102,78	R\$ 10.988.651,90	2,03%
PORTO SEGURO CLÁSSICO FIC RENDA FIXA LP	R\$ 1.491,01	R\$ 125.901,02	0,02%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	R\$ 2.824.068,80	R\$ 304.683.777,12	56,28%
Art. 7º, inciso V, alínea "b" - Fundos de Crédito Privado	R\$ 641,51	R\$ 69.605,74	0,01%
BTG PACTUAL YIELD FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	R\$ 641,51	R\$ 69.605,74	0,01%
TOTAL FINANPREV	R\$ 5.210.093,20	R\$ 541.371.705,42	100%

MOVIMENTAÇÕES - FINANPREV

DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	ATIVO	DESCRIÇÃO
04/07/2024	17.897.156,55	-	OPERAÇÃO COMPROMISSADA -LFT	-
09/07/2024	587.100,53	-	OPERAÇÃO COMPROMISSADA -LFT	-
10/07/2024	37.988.276,19	-	OPERAÇÃO COMPROMISSADA -LFT	-
11/07/2024	30.990.707,92	-	OPERAÇÃO COMPROMISSADA -LFT	-
19/07/2024		169.761.041,30	OPERAÇÃO COMPROMISSADA -LFT	Pagamento da Folha FINANPREV
23/07/2024	492.062,29		OPERAÇÃO COMPROMISSADA -LFT	
29/07/2024	35.987.558,73		OPERAÇÃO COMPROMISSADA -LFT	
30/07/2024	36.986.262,71	-	OPERAÇÃO COMPROMISSADA -LFT	-
TOTAL	160.929.124,92	169.761.041,30		

CARTEIRA SPSM - JULHO 2024

ATIVOS - RENDA FIXA	RENDIMENTO	PL
Art. 7º, II - Operações Compromissadas	R\$ 130.252,15	R\$ 11.584.480,98
Operações Compromissadas - LFT	R\$ 129.137,89	R\$ 11.584.480,98
TOTAL	R\$ 129.137,89	R\$ 11.584.480,98

MOVIMENTAÇÕES - SPSM

DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	ATIVO	DESCRIÇÃO
04/07/2024	R\$ 27.993.309,47		OPERAÇÃO COMPROMISSADA -LFT	-
19/07/2024		R\$ 28.114.469,83	OPERAÇÃO COMPROMISSADA -LFT	Pagamento da Folha SPSM
29/07/2024	R\$ 11.575.387,98		OPERAÇÃO COMPROMISSADA -LFT	
TOTAL	R\$ 39.568.697,45	R\$ 28.114.469,83		

PL por Instituição Financeira

Data Base: 31/07/2024

Gestoras	Valor Aplicado	%
Tesouro Nacional	R\$ 1.667.848.812,05	34,36%
BB Asset Management	R\$ 759.073.214,00	15,59%
Itaú	R\$ 696.935.785,78	14,28%
Bradesco	R\$ 226.331.847,60	5,27%
Santander	R\$ 323.925.173,13	6,66%
BTG Pactual	R\$ 267.574.219,49	5,47%
Caixa Econômica Asset	R\$ 220.937.770,63	4,55%
Safra Asset Management	R\$ 133.162.816,15	2,71%
Vinci Partners	R\$ 111.106.852,96	2,24%
Kinea Investimentos	R\$ 115.914.386,29	2,40%
Western Asset	R\$ 70.295.515,96	1,43%
Bahia Asset	R\$ 44.519.042,59	0,88%
XP Asset Management	R\$ 42.751.295,51	0,89%
AZ Quest Investimentos	R\$ 35.141.342,35	0,69%
Occam Brasil	R\$ 23.203.970,08	0,47%
Pátria Investimentos	R\$ 15.240.642,30	0,30%
BNP Paribas Asset	R\$ 3.740.339,75	0,08%
Genial Banco	R\$ 2.452.670,82	0,05%
Porto Seguro Investimentos	R\$ 125.901,02	0,003%
Banpará (LFT)	R\$ 85.094.319,47	1,69%
TOTAL	R\$ 4.845.375.917,93	100,00%
Disponibilidade Financeira	R\$ 147.059.075,16	
TOTAL GERAL	R\$ 4.992.434.993,09	

Distribuição e Enquadramento dos Investimentos IGEPPREV/PA (FUNPREV+FINANPREV+SPSM)

Data base 31/07/2024

Artigo	Tipo de Ativo	Valor (R\$)	Carteira %	Política de Investimentos 2024			Limite Legal
				Limite Inferior	Estratégia Alvo	Limite Superior	
Renda Fixa		3.812.536.024,72	78,68%		85,00%		100,00%
Art. 7º, I, "a"	Títulos Públicos de Emissão do TN (SELIC)	1.667.848.812,05	34,42%	0,00%	40,00%	65,00%	100,00%
Art. 7º, I, "b"	Fundos RF 100% Títulos Públicos	589.283.964,70	12,16%	0,00%	14,95%	55,00%	100,00%
Art. 7º, I, "c"	FI Índices RF (ETF) 100% Tít. Públicos (negociados em bolsa)	-	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	100,00%
Art. 7º, II	Operações Compromissadas	85.094.319,47	1,76%	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%
Art. 7º, III "a"	Fundos de Renda Fixa conforme CVM	1.399.438.078,56	28,88%	0,00%	25,00%	40,00%	
Art. 7º, III "b"	ETF - Renda Fixa CVM	-	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	70,00%
Art. 7º, IV	Ativos Privados de Instituições Financeiras (Lista Exaustiva BACEN)	49.107.177,37	1,01%	0,00%	2,50%	5,00%	20,00%
Art. 7º, V "a"	FIDC Cota Senior	2.452.670,82	0,05%	0,00%	0,05%	1,00%	10,00%
Art. 7º, V "b"	Fundos de Crédito Privado	19.311.001,74	0,40%	0,00%	2,50%	5,00%	10,00%
Art. 7º, V "c"	Debêntures Incentivadas	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%
Renda Variável		598.484.636,11	12,35%		6,00%		40,00%
Art. 8º	Fundos de Ações CVM	468.966.430,92	9,68%	0,00%	3,00%	10,00%	40,00%
Art. 8º, III	Fundos de Ações - BDR Nível I	129.518.205,19	2,67%	0,00%	2,00%	10,00%	10,00%
Exterior		134.152.029,47	2,77%		6,00%		10,00%
Art. 9º, II	Fic - Aberto- Investimento no Exterior	134.152.029,47	2,77%	0,00%	4,00%	10,00%	10,00%
Estruturados		300.203.227,64	6,20%		3,00%		20,00%
Art. 10º, I	Fundos Multimercados	155.795.967,39	3,22%	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%
Art. 10º, II	Fundos de Participações (FIP)	144.407.260,25	2,98%	0,00%	3,00%	5,00%	5,00%
Total da Carteira		R\$ 4.845.375.917,93	100,00%		100%		
Disponibilidade Financeira		R\$ 147.059.075,16					
Total Geral		R\$ 4.992.434.993,09					

Fonte: NUGIN