



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

ATA DA SEXTA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 17 DE JUNHO DE 2021.

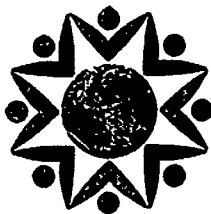
Aos (17) dezoito dias do mês de junho de 2021, na Sala de Reuniões da Sede do PREVIM, com início às 9h, reuniram-se os membros do Comitê de Investimento do Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Paranaíba – PREVIM. Estavam presentes na reunião os seguintes membros: Marcelo Alves de Freitas, Simone Almeida da Silva, Vanila Garcia Belo, Rogério Luiz de Paulo e Robson Jesus da Silva. O presidente Marcelo inicia cumprimentando os membros e informa que na pauta da ordem do dia serão discutidos os seguintes assuntos: analisar os incisos 1, 2, 3 e 4 do item VIII, c do Regimento Interno do Comitê de Investimento e, em especial: 1 - Elaboração da Política Financeira para o mês de julho de 2021; 2 – Aplicações dos repasses que entrarem na conta corrente e 3 – Outros assuntos conforme ata.

Em seguida, o presidente Marcelo apresentou a Planilha de rentabilidade dos fundos de investimentos do PREVIM referente às aplicações do mês de maio/2021, cuja rentabilidade foi positiva de 1,30%. Apresentou também as demais informações financeiras contidas no Relatório de Consultoria (anexo) e Carteiras Sugeridas da Caixa Econômica e do Banco do Brasil.

Os membros do Comitê decidiram que para o pagamento do mês de junho aos beneficiários será resgatado de um fundo da Caixa Econômica Federal.

Ficou autorizado também que a aplicação dos repasses previdenciários da Câmara e da Prefeitura serão nos fundos que o PREVIM já possui e que tenham melhor perspectiva de rentabilidade positiva no momento, nos Bancos Caixa Econômica Federal ou Banco do Brasil.

As compensações previdenciárias (COMPREV) creditadas na conta 24092-3 do Banco do Brasil serão aplicadas preferencialmente em fundo de ações com exposição americana ou europeia, atentando para o percentual máximo para esse segmento.

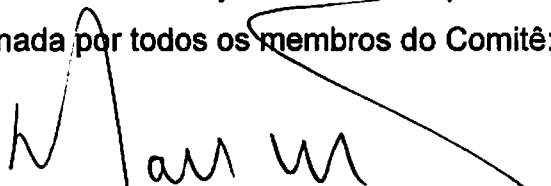


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

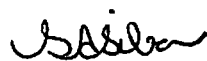
As migrações entre os fundos poderão ser realizadas na medida em que o mercado indicar a necessidade da operação ou quando atingir o limite permitido pela norma, depois de consultarmos Assessoria Financeira e membros deste Comitê.

Todos os membros concordaram sobre a necessidade de obterem a certificação exigida pela Secretaria da Previdência para que possam integrar este Comitê.

Sem mais assunto a ser tratado, o presidente agradeceu a presença de todos convocando, para o dia 15 de julho de 2021 a próxima reunião. Lavrou-se esta ata que vai assinada por todos os membros do Comitê:



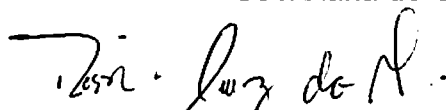
MARCELO ALVES DE FREITAS – CPF:420.970.101-72
Presidente do Comitê, Gestor de Recursos, Autorizador das APRs e
Certificação ANBIMA



SIMONE ALMEIDA DA SILVA – CPF: 962.739.761-04
Membro, Proponente das APRs e Certificação APIMEC

VANILA GARCIA BELO – CPF: 034.308.601-80

Secretária do Comitê



ROGERIO LUIZ DE PAULO- CPF: 596.115.291-04
Membro, Liquidador das APRs e Certificação ANBIMA

ROBSON JESUS DA SILVA - CPF: 712.961.401-30

Membro

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Maio/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.293.104,74	1,05%	1,32%	79,86%
BB IPCA	1.675.812,63	0,88%	1,32%	66,46%
BB IMA-B 5+	1.419.170,04	1,35%	1,32%	102,47%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.495.943,54	0,48%	1,32%	36,40%
BB TECNOLOGIA	398.720,87	-0,51%	1,32%	-38,91%
BB ENERGIA	483.637,52	4,84%	1,32%	366,10%
BB SMALL CAPS	480.505,47	7,20%	1,32%	545,50%
BB RETORNO AÇÕES	511.553,50	2,60%	1,32%	196,49%
BB CONSUMO	475.947,80	6,38%	1,32%	482,89%
BB SETOR FINANCEIRO	287.897,18	6,59%	1,32%	499,32%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	330.643,20	7,02%	1,32%	531,28%
CAIXA IRF-M	2.898.456,42	0,09%	1,32%	7,07%
CAIXA IRF-M1 TP	1.553.524,44	0,15%	1,32%	11,43%
CAIXA IMA-B 5+	3.365.145,25	1,39%	1,32%	105,33%
SICREDI IRF-M LP	1.482.396,61	0,21%	1,32%	15,55%
TOTAL / MÉDIA	20.152.459,21	1,30%	1,32%	98,30%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	11,38%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA	8,32%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	7,04%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	12,39%	20%	Art. 7º, I, b
BB TECNOLOGIA	1,98%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	2,40%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAPS	2,38%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO AÇÕES	2,54%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	2,36%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	1,43%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,64%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	14,38%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	7,71%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	16,70%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	7,36%	20%	Art. 7º, III, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-1,28%	0,74%	-174,08%
Fevereiro	-1,88%	1,35%	-138,88%
Março	0,04%	1,42%	3,15%
Abril	0,93%	0,80%	116,04%
Maio	1,30%	1,32%	98,30%
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,93%	5,76%	-16,09%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,93%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,76%, sendo assim o RPPS atingiu -16,09% da meta atuarial.

4. GERENCIAMENTO DE RISCO

4.1 RISCO DE CRÉDITO

Caso o RPPS detenha fundos com Crédito Privado, a análise do crédito será feita a parte através da análise de avaliação de risco cedida por empresas com sede no país e fornecidas pelo RPPS para a Kansai

4.2 RISCO DE MERCADO

4.2.1 VaR - VALUE AT RISK

O VaR representa o valor monetário das perdas no valor presente a que uma carteira está sujeita, a um determinado nível de confiança e dentro de um horizonte de tempo.

Fundo	Aplicação	VaR	VaR %
BB IMA-B	2.293.104,74	60.128,98	0,30%
BB IPCA	1.675.812,63	23.167,10	0,1%
BB IMA-B 5+	1.419.170,04	56.222,43	0,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.495.943,54	34.025,57	0,17%
BB TECNOLOGIA	398.720,87	35.669,15	0,18%
BB ENERGIA	483.637,52	48.780,20	0,24%
BB SMALL CAPS	480.505,47	54.544,78	0,27%
BB RETORNO AÇÕES	511.553,50	51.205,40	0,25%
BB CONSUMO	475.947,80	52.510,81	0,26%
BB SETOR FINANCEIRO	287.897,18	34.973,45	0,17%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	330.643,20	52.915,93	0,26%
CAIXA IRF-M	2.898.456,42	43.280,87	0,21%
CAIXA IRF-M1 TP	1.553.524,44	2.523,75	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	3.365.145,25	133.752,20	0,66%
SICREDI IRF-M LP	1.482.396,61	23.739,30	0,12%
Carteira	20.152.459,21	545.695,65	2,71%

4.2.2 ÍNDICE SHARPE

O Índice Sharpe é um indicador de performance que ajusta o retorno ao risco, ou seja, ele avalia se um determinado fundo de investimento apresenta uma rentabilidade ponderada ao risco que o investidor está exposto.

Fundo	Sharpe
BB IMA-B	0,01
BB IPCA	0,01
BB IMA-B 5+	0,01
BB ALOCAÇÃO ATIVA	0,01
BB TECNOLOGIA	-
BB ENERGIA	-
BB SMALL CAPS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB CONSUMO	-
BB SETOR FINANCEIRO	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	-
CAIXA IRF-M	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B 5+	0,01
SICREDI IRF-M LP	0,00

Assinatura
Maio 2021

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Maio/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.293.104,74	1,05%	1,32%	79,86%
BB IPCA	1.675.812,63	0,88%	1,32%	66,46%
BB IMA-B 5+	1.419.170,04	1,35%	1,32%	102,47%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.495.943,54	0,48%	1,32%	36,40%
BB TECNOLOGIA	398.720,87	-0,51%	1,32%	-38,91%
BB ENERGIA	483.637,52	4,84%	1,32%	366,10%
BB SMALL CAPS	480.505,47	7,20%	1,32%	545,50%
BB RETORNO AÇÕES	511.553,50	2,60%	1,32%	196,49%
BB CONSUMO	475.947,80	6,38%	1,32%	482,89%
BB SETOR FINANCEIRO	287.897,18	6,59%	1,32%	499,32%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	330.643,20	7,02%	1,32%	531,28%
CAIXA IRF-M	2.898.456,42	0,09%	1,32%	7,07%
CAIXA IRF-M1 TP	1.553.524,44	0,15%	1,32%	11,43%
CAIXA IMA-B 5+	3.365.145,25	1,39%	1,32%	105,33%
SICREDI IRF-M LP	1.482.396,61	0,21%	1,32%	15,55%
TOTAL / MÉDIA	20.152.459,21	1,30%	1,32%	98,30%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	11,38%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA	8,32%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	7,04%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	12,39%	20%	Art. 7º, I, b
BB TECNOLOGIA	1,98%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	2,40%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAPS	2,38%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO AÇÕES	2,54%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	2,36%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	1,43%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,64%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	14,38%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	7,71%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	16,70%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	7,36%	20%	Art. 7º, III, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-1,28%	0,74%	-174,08%
Fevereiro	-1,88%	1,35%	-138,88%
Março	0,04%	1,42%	3,15%
Abril	0,93%	0,80%	116,04%
Maio	1,30%	1,32%	98,30%
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-0,93%	5,76%	-16,09%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,93%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,76%, sendo assim o RPPS atingiu -16,09% da meta atuarial.

4. GERENCIAMENTO DE RISCO

4.1 RISCO DE CRÉDITO

Caso o RPPS detenha fundos com Crédito Privado, a análise do crédito será feita a parte através da análise de avaliação de risco cedida por empresas com sede no país e fornecidas pelo RPPS para a Kansai

4.2 RISCO DE MERCADO

4.2.1 VaR - VALUE AT RISK

O VaR representa o valor monetário das perdas no valor presente a que uma carteira está sujeita, a um determinado nível de confiança e dentro de um horizonte de tempo.

Fundo	Aplicação	VaR	VaR %
BB IMA-B	2.293.104,74	60.128,98	0,30%
BB IPCA	1.675.812,63	23.167,10	0,11%
BB IMA-B 5+	1.419.170,04	56.222,43	0,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.495.943,54	34.025,57	0,17%
BB TECNOLOGIA	398.720,87	35.669,15	0,18%
BB ENERGIA	483.637,52	48.780,20	0,24%
BB SMALL CAPS	480.505,47	54.544,78	0,27%
BB RETORNO AÇÕES	511.553,50	51.205,40	0,25%
BB CONSUMO	475.947,80	52.510,81	0,26%
BB SETOR FINANCEIRO	287.897,18	34.973,45	0,17%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	330.643,20	52.915,93	0,26%
CAIXA IRF-M	2.898.456,42	43.280,87	0,21%
CAIXA IRF-M1 TP	1.553.524,44	2.523,75	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	3.365.145,25	133.752,20	0,66%
SICREDI IRF-M LP	1.482.396,61	23.739,30	0,12%
Carteira	20.152.459,21	545.695,65	2,71%

4.2.2 ÍNDICE SHARPE

O Índice Sharpe é um indicador de performance que ajusta o retorno ao risco, ou seja, ele avalia se um determinado fundo de investimento apresenta uma rentabilidade ponderada ao risco que o investidor está exposto.

Fundo	Sharpe
BB IMA-B	0,01
BB IPCA	0,01
BB IMA-B 5+	0,01
BB ALOCAÇÃO ATIVA	0,01
BB TECNOLOGIA	-
BB ENERGIA	-
BB SMALL CAPS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB CONSUMO	-
BB SETOR FINANCEIRO	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	-
CAIXA IRF-M	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B 5+	0,01
SICREDI IRF-M LP	0,00