



# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

## ATA DA PRIMEIRA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 17 DE JANEIRO DE 2019.

Aos (17) dezessete dias do mês de janeiro de 2019, na Sala de Reuniões da Sede do PREVIM, com início às 9h, reuniram-se os membros do Comitê de Investimento do Instituto Previdência dos Servidores do Município de Paranaíba – PREVIM conforme RESOLUÇÃO Nº 04 DE 16 DE JANEIRO DE 2018. Estavam presentes os seguintes membros: Marcelo Alves de Freitas, Simone Almeida da Silva, Vanila Garcia Belo, Rogério Luiz de Paulo e Lilian Aparecida de Souza. Dando início a reunião, o presidente Marcelo agradece a presença e informa que a partir deste ano não haverá convocação dos membros para a reunião mensal através da assinatura em lista, ou seja, a convocação poderá ser por telefone, e-mail, WhatsApp, etc, respeitando o prazo legal. 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 fevereiro de 2019; 2 – Aplicações dos repasses que entrarem na conta corrente e 3 – Outros assuntos conforme ata. Em seguida, o presidente apresentou a Planilha de rentabilidade dos fundos de investimentos referente às aplicações do mês de Dezembro de 2018, ressaltando que atingimos 96,95% da meta atuarial, ressaltando o bom desempenho diante de um ano com greve de caminhoneiro e eleições, entre outras informações financeiras no Relatório de Consultoria em ANEXO:

Os membros decidiram que o resgate para pagamento dos beneficiários referente ao mês de janeiro de 2019 será do fundo CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP CNPJ 10.577.503/0001-88, da conta 0987-006- 158-5, até o dia 5º dia útil do mês subsequente, prazo legal para pagamento. A Tesoureira informa que neste mês estaremos encerrando a conta corrente da CAIXA 0987-006-159-3, pois não há necessidade de 03 contas neste banco. Fica autorizado também a aplicação dos repasses previdenciários da Câmara, da Prefeitura e da Compensação Previdenciária nos fundos IMAs ou IRFMs, dos Bancos Caixa Econômica e Banco do Brasil, lembrando que o crédito de COMPREV deverá ser creditado em conta específica no



# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

Banco do Brasil. Decidiu-se manter as aplicações nos Fundos IMAs e IRFMs , bem como as migrações entre eles na medida que o mercado indicar a necessidade da operação. O presidente agradece a presença de todos, pedindo que cada membro busque mais conhecimento sobre o mercado financeiro, as legislações que norteiam o RPPS e sobre o Comitê de Investimento neste ano e convoca para o dia 14 de fevereiro de 2019 a próxima reunião. Lavrou-se esta ata que vai assinada por todos os membros do Comitê.

## MEMBROS DO COMITÊ DE INVESTIMENTO

MARCELO ALVES DE FREITAS

Presidente do Comitê, Gestor de Recursos e Certificação ANBIMA

SIMONE ALMEIDA DA SILVA

Membro e Certificação APIMEC

VANILA GARCIA BELO

Secretária e Certificação ANBIMA

ROGÉRIO LUIZ DE PAULO

Membro e Certificação ANBIMA

LILIAN APARECIDA DE SOUZA

Membro



### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Dezembro/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IPCA TP	1.487.902,93	1,91%	0,64%	299,56%
BB IRF-M1	5.060.076,74	0,28%	0,64%	44,49%
BB IMA-B 5+	5.161.815,39	1,89%	0,64%	296,53%
BB IMA-B5	0,00	0,00%	0,64%	0,31%
BB IMA-B	2.211.532,52	1,88%	0,64%	295,39%
Caixa IRF-M1	5.503.364,25	0,51%	0,64%	79,80%
Caixa IRF-M1	679.491,98	0,54%	0,64%	85,08%
Caixa IMA-B 5+	1.435.059,53	1,80%	0,64%	282,49%
Sicredi IRF-M	1.272.339,48	1,50%	0,64%	235,39%
TOTAL / MÉDIA	22.811.582,82	1,18%	0,64%	185,21%

### 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IPCA TP	6,52%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	22,18%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	22,63%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B5	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B	9,69%	20%	Art. 7º, IV, a
Caixa IRF-M1	24,13%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	2,98%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B 5+	6,29%	100%	Art. 7º, I, b
Sicredi IRF-M	5,58%	20%	Art. 7º, III, a

### 3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	1,70%	0,78%	218,42%
Fevereiro	0,55%	0,82%	67,22%
Março	0,62%	0,58%	107,92%
Abril	0,04%	0,71%	5,55%
Maio	-1,88%	0,89%	-211,95%
Junho	-0,11%	1,75%	-6,29%
Julho	1,72%	0,82%	210,10%
Agosto	-0,16%	0,40%	-39,96%
Setembro	-0,10%	0,97%	-10,05%
Outubro	5,36%	0,94%	570,94%
Novembro	0,51%	0,28%	185,49%
Dezembro	1,18%	0,64%	185,21%
Acumulado	9,68%	9,98%	96,95%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 9,68%, enquanto que a meta acumulada no período é de 9,98%, sendo assim o RPPS atingiu 96,95% 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 IPCA TP	1.487.902,93	35.958,91	0,16%
BB IRF-M1	5.060.076,74	10.003,24	0,04%
BB IMA-B 5+	5.161.815,39	220.182,35	0,97%
BB IMA-B5	0,00	0,00	0,00%
BB IMA-B	2.211.532,52	64.413,23	0,28%
Caixa IRF-M1	5.503.364,25	10.702,39	0,05%
Caixa IRF-M1	679.491,98	1.321,41	0,01%
Caixa IMA-B 5+	1.435.059,53	60.854,93	0,27%
Sicredi IRF-M	1.272.339,48	22.690,53	0,10%
Carteira	22.811.582,82	405.890,08	1,78%

##### 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 IPCA TP	0,09
BB IRF-M1	0,05
BB IMA-B 5+	0,05
BB IMA-B5	0,08
BB IMA-B	0,06
Caixa IRF-M1	0,05
Caixa IRF-M1	0,05
Caixa IMA-B 5+	0,05
Sicredi IRF-M	0,07

*Assinaturas manuscritas:*  
 - Assinatura: Jozilva  
 - Assinatura: Jozilva  
 - Assinatura: Jozilva  
 - Assinatura: Jozilva