



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

ATA DA SEGUNDA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 18 DE JUNHO DE 2020.

Aos (18) dezoito dias do mês de maio de 2020, 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 013 DE 11 DE MAIO DE 2020 (ANEXO) para o triênio 2020 - 2023. 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 Diretor Executivo do Instituto 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 2020; 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 maio/2020. Apresentou também as demais informações financeiras contidas no Relatório de Consultoria (anexo) e Carteiras Sugeridas da Caixa Econômica e do Banco do Brasil. Informa ainda que a recuperação dos ativos desde a queda acentuada em março tem sido satisfatória e com a queda da taxa Selic (2,25%) fará com que os ativos de Renda Fixa tenham pouca rentabilidade.

Os membros do Comitê decidiram que o resgate para pagamento dos beneficiários e despesas administrativas referente ao mês de junho será resgatado no início do mês de julho, de um fundo que tenha recuperado ou superado significativamente sua rentabilidade.

Ficou autorizado também que a aplicação dos repasses previdenciários da Câmara e da Prefeitura serão em 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 próximas compensações



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

previdenciárias (COMPREV) creditadas na conta 24092-3 do Banco do Brasil serão aplicadas no BB AÇÕES SETOR FINANCEIRO. As transferências entre os fundos poderão ser realizadas na medida em que o mercado indicar a necessidade da operação, depois de consultarmos Assessoria Financeira e membros deste Comitê.

Rogério reforça o pedido de que todos os membros devem estudar e se manter atualizados sobre o mercado financeiro e político, pois há meses tem sido muito volátil devido a pandemia do coronavírus e das incertezas políticas. Desta forma, acredita que as decisões do Comitê possam ser tomadas mais assertivamente. Finalizando, o presidente agradeceu a presença de todos convocando, para o dia 09 de julho 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 – 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



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

Rogério Luiz de Paulo:

ROGERIO LUIZ DE PAULO - CPF: 596.115.291-04

Membro, Liquidador das APRs e Certificação ANBIMA

Robson Jesus da Silva:

ROBSON JESUS DA SILVA - CPF: 712.961.401-30

Membro

Uquid

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Maio/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.180.003,58	1,54%	0,10%	1471,25%
BB IPCA TP	1.641.729,56	2,46%	0,10%	2341,83%
BB IRF-M1	515.496,41	0,39%	0,10%	370,54%
BB IMA-B 5+	1.370.149,67	1,00%	0,10%	950,96%
BB Alocacao Ativa	3.395.141,54	1,07%	0,10%	1022,01%
Caixa IRF-M1+	612.088,99	2,01%	0,10%	1920,62%
Caixa IMA-B 5+	3.524.061,40	1,00%	0,10%	953,30%
Sicredi IRF-M	1.479.119,22	1,39%	0,10%	1322,82%
BB Ações Tecnologia	271.945,22	-1,19%	0,10%	-1130,12%
BB Ações Energia	402.238,87	8,17%	0,10%	7790,05%
BB Ações Small Caps	309.966,35	4,96%	0,10%	4731,80%
BB Ações Retorno Total	357.131,45	6,89%	0,10%	6570,50%
BB Ações Consumo	378.203,46	7,75%	0,10%	7388,45%
BB Ações Construção Civi	272.877,37	0,92%	0,10%	873,14%
Caixa IRF-M	295.135,21	1,40%	0,10%	1330,22%
Caixa IRF-M1	250.379,05	0,15%	0,10%	144,53%
BB Ações Set Financeiro	109.550,09	5,00%	0,10%	4766,20%
TOTAL / MÉDIA	17.365.217,44	1,74%	0,10%	1655,39%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	12,55%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA TP	9,45%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	2,97%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	7,89%	20%	Art. 7º, I, b
BB Alocacao Ativa	19,55%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	3,52%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B 5+	20,29%	20%	Art. 7º, I, b
Sicredi IRF-M	8,52%	20%	Art. 7º, III, a
BB Ações Tecnologia	1,57%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Energia	2,32%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Small Caps	1,78%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Retorno Total	2,06%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Consumo	2,18%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Construção Civi	1,57%	20%	Art. 8º, II, a
Caixa IRF-M	1,70%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	1,44%	20%	Art. 7º, I, b
BB Ações Set Financeiro	0,63%	20%	Art. 8º, II, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,33%	0,70%	-46,59%
Fevereiro	-0,84%	0,74%	-113,27%
Março	-8,32%	0,56%	-1493,85%
Abril	2,13%	0,18%	1215,91%
Maio	1,74%	0,10%	1655,39%
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-5,85%	2,29%	-255,07%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -5,85%, enquanto que a meta acumulada no período é de 2,29%, sendo assim o RPPS atingiu -255,07% 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	2.180.003,58	193.955,50	1,12%
BB IPCA TP	1.641.729,56	70.786,03	0,41%
BB IRF-M1	515.496,41	1.912,52	0,01%
BB IMA-B 5+	1.370.149,67	187.433,28	1,08%
BB Alocacao Ativa	3.395.141,54	148.551,94	0,86%
Caixa IRF-M1+	612.088,99	38.683,56	0,22%
Caixa IMA-B 5+	3.524.061,40	484.673,66	2,79%
Sicredi IRF-M	1.479.119,22	71.820,67	0,41%
BB Ações Tecnologia	271.945,22	67.643,07	0,39%
BB Ações Energia	402.238,87	102.499,63	0,59%
BB Ações Small Caps	309.966,35	101.868,29	0,59%
BB Ações Retorno Total	357.131,45	99.733,23	0,57%
BB Ações Consumo	378.203,46	121.577,98	0,70%
BB Ações Construção Civil	272.877,37	112.241,87	0,65%
Caixa IRF-M	295.135,21	12.506,26	0,07%
Caixa IRF-M1	250.379,05	920,68	0,01%
BB Ações Set Financeiro	109.550,09	34.213,32	0,20%
Carteira	17.365.217,44	1.689.988,15	9,73%

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	0,02
BB IPCA TP	0,08
BB IRF-M1	0,05
BB IMA-B 5+	0,00
BB Alocacao Ativa	0,03
Caixa IRF-M1+	0,04
Caixa IMA-B 5+	0,00
Sicredi IRF-M	0,03
BB Ações Tecnologia	-
BB Ações Energia	0,00
BB Ações Small Caps	-
BB Ações Retorno Total	-
BB Ações Consumo	-
BB Ações Construção Civil	-
Caixa IRF-M	0,04
Caixa IRF-M1	0,05
BB Ações Set Financeiro	-

Man
ss Silva
Vap