



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

### **ATA DA DÉCIMA PRIMEIRA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 16 DE NOVEMBRO DE 2023.**

Aos (16) dezesseis dias do mês de novembro de 2023, 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, Lilian Aparecida de Souza, Vanila Garcia Belo, Rogério Luiz de Paulo e Robson Jesus da Silva. O presidente agradeceu a presença de todos e informou 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 dezembro de 2023; 2 – Aplicações dos repasses que entrarem na conta corrente e 3 – Outros assuntos conforme ata.

Em seguida, a secretária do COI, Vanila apresentou a Planilha de rentabilidade dos fundos de investimentos do Previm referente às aplicações do mês de outubro/2023. Em seguida, apresentou as demais informações financeiras contidas no Relatório de Consultoria (anexo).

Em relação ao pagamento dos salários dos beneficiários do referente mês de novembro/23, o valor será resgatado de um fundo da Caixa Econômica Federal ou transferência de saldo do Banco do Brasil para a conta corrente da Caixa.

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 já existentes na carteira, observando os cuidados e os limites para essa categoria de investimentos ou no fundo BB IRF M1. 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.



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

O presidente Marcelo informa que o Conselho deliberativo do Previm autorizou este comitê de investimento a encerrar a conta bancária no Sicredi. Sem mais assunto, o presidente agradece a presença de todos e encerra a reunião convocando, para o dia 14 de dezembro de 2023 a próxima reunião. Lavrou-se esta ata que vai assinada por todos os membros do Comitê:

**MARCELO ALVES DE FREITAS**

Presidente do Comitê, Gestor de Recursos, Autorizador das APRs e  
Certificação ANBIMA

**LILIAN APARECIDA DE SOUSA**

Membro

**VANILA GARCIA BELO**

Secretária do Comitê e Certificação ANBIMA

**ROGERIO LUIZ DE PAULO**

Membro, Liquidador das APRs e Certificação ANBIMA

**ROBSON JESUS DA SILVA**

Membro e Proponente das APRs

## 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Outubro/ 2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	5.267.790,93	-0,68%	0,62%	-109,06%
BB IRF-M	2.429.336,56	0,35%	0,62%	56,80%
BB IMA-B 5+	4.768.164,97	-0,99%	0,62%	-158,86%
BB RETORNO TOTAL	4.845.212,37	0,85%	0,62%	136,79%
BB AÇÕES BOLSA	2.367.125,78	-1,76%	0,62%	-282,88%
BB AÇÕES AGRO	736.343,85	-6,36%	0,62%	-1022,75%
BB TECNOLOGIA	523.154,69	-1,85%	0,62%	-298,20%
BB ENERGIA	454.251,58	-5,82%	0,62%	-935,31%
BB SMALL CAPS	502.545,49	-8,55%	0,62%	-1375,36%
BB RETORNO AÇÕES	352.479,04	-3,33%	0,62%	-535,99%
BB CONSUMO	238.396,15	-8,89%	0,62%	-1428,80%
BB SETOR FINANCEIRO	714.520,44	-3,04%	0,62%	-489,16%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	440.768,30	-6,12%	0,62%	-983,50%
CAIXA IRF-M	229,94	0,35%	0,62%	56,13%
CAIXA IRF-M1 TP	1.700.117,59	0,33%	0,62%	52,46%
CAIXA IMA-B 5+	4.407.351,85	-0,96%	0,62%	-154,67%
SICREDI IRF-M LP	1.816.667,16	0,99%	0,62%	159,22%
BI - MASSA FALIDA	209.726,37	0,11%	0,62%	16,98%
TOTAL / MÉDIA	31.774.183,06	-0,99%	0,62%	-158,97%

## 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	16,58%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M	7,65%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	15,01%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	15,25%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	7,45%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,32%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,65%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,43%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,58%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,11%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,75%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,25%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,39%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	5,35%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	13,87%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,72%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,66%	0%	Não enquadrado

## 3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,91%	0,92%	98,20%
Fevereiro	-0,10%	1,22%	-8,22%
Março	2,04%	1,09%	186,81%
Abril	1,90%	0,99%	190,76%
Mai	3,20%	0,61%	523,45%
Junho	3,35%	0,30%	###
Julho	1,23%	0,50%	245,07%
Agosto	-0,96%	0,61%	-157,01%
Setembro	-1,11%	0,64%	-172,50%
Outubro	-0,99%	0,62%	-158,97%
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	9,76%	7,77%	125,63%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 9,76%, enquanto que a meta acumulada no período é de 7,77%, sendo assim o RPPS atingiu 125,63% 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	5.267.790,93	117.455,46	0,37%
BB IRF-M	2.429.336,56	29.302,35	0,09%
BB IMA-B 5+	4.768.164,97	162.904,59	0,51%
BB RETORNO TOTAL	4.845.212,37	21.250,38	0,07%
BB AÇÕES BOLSA	2.367.125,78	133.304,41	0,42%
BB AÇÕES AGRO	736.343,85	53.997,00	0,17%
BB TECNOLOGIA	523.154,69	40.124,54	0,13%
BB ENERGIA	454.251,58	33.587,59	0,11%
BB SMALL CAPS	502.545,49	51.943,93	0,16%
BB RETORNO AÇÕES	352.479,04	26.266,78	0,08%
BB CONSUMO	238.396,15	23.324,98	0,07%
BB SETOR FINANCEIRO	714.520,44	61.769,60	0,19%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	440.768,30	56.973,23	0,18%
CAIXA IRF-M	229,94	2,78	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	1.700.117,59	2.267,57	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	4.407.351,85	148.263,58	0,47%
SICREDI IRF-M LP	1.816.667,16	23.805,40	0,07%
BI - MASSA FALIDA	209.726,37	0,00	0,00%
Carteira	31.774.183,06	752.547,50	2,37%

#### 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	-
BB IRF-M	-
BB IMA-B 5+	-
BB RETORNO TOTAL	-
BB AÇÕES BOLSA	-
BB AÇÕES AGRO	-
BB TECNOLOGIA	-
BB ENERGIA	-
BB SMALL CAPS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB CONSUMO	-
BB SETOR FINANCEIRO	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	-
CAIXA IRF-M	-
CAIXA IRF-M1 TP	-
CAIXA IMA-B 5+	-
SICREDI IRF-M LP	-
BI - MASSA FALIDA	-