



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

### **ATA DA OITAVA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 15 DE DEZEMBRO DE 2020.**

Aos (15) quinze dias do mês de dezembro de 2020, 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 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 janeiro 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 novembro/2020, ressaltando a boa rentabilidade positiva. 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 o pagamento do 13º salário dos beneficiários, que será pago amanhã (16), utilizará o saldo da conta corrente da Caixa, cujo valor repassado pela prefeitura recentemente e complementar o valor resgatando de um fundo do mesmo banco. Para o pagamento do mês de dezembro e despesas administrativas referente ao mês de dezembro será resgatado de um fundo da Caixa Econômica ou Banco Brasil.

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 no BB AÇÕES SETOR FINANCEIRO preferencialmente ou em outro fundo de



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

ações. 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.


Marcelo cumprimenta a todos os membros do comitê que participaram de todas as reuniões neste ano e pelo empenho dedicado às questões de investimentos do instituto e deseja Feliz Natal a todos e um próximo ano novo cheio de realizações com muita saúde, mantendo os cuidados contra o coronavírus. Rogerio ressalta a importância dos demais membros de realizarem as provas de certificações no próximo ano. Sem mais assunto a ser tratado, o presidente agradeceu a presença de todos convocando, para o dia 20 de janeiro 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

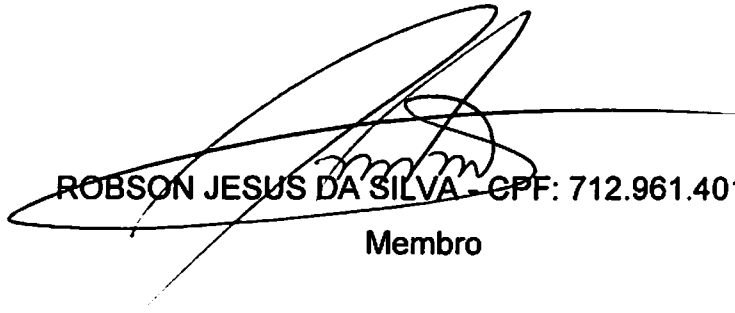
Secretária do Comitê

  
ROGERIO LUIZ DE PAULO- CPF: 596.115.291-04

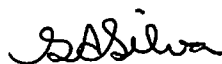
Membro, Liquidador das APRs e Certificação ANBIMA



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

  
ROBSON JESUS DA SILVA - CPF: 712.961.401-30  
Membro





**RENTABILIDADE MÉDIA** **4. GERENCIAMENTO DE RISCO**

Novembro/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.292.326,11	1,95%	1,38%	141,12%
BB IPCA TP	1.658.834,96	1,30%	1,38%	94,24%
BB IMA-B 5+	1.455.092,15	2,49%	1,38%	180,59%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.457.399,49	0,65%	1,38%	61,40%
CAIXA IMA-B 5+	3.283.708,49	2,57%	1,38%	185,75%
SICREDI IRF-M	1.483.313,25	0,41%	1,38%	29,69%
BB NÍVEL I	340.206,58	5,50%	1,38%	398,21%
BB ENERGIA	452.422,85	11,11%	1,38%	804,25%
BB SMALL CAP	413.584,30	17,23%	1,38%	1247,35%
BB RETORNO TOTAL	418.176,91	11,70%	1,38%	847,17%
BB CONSUMO	443.689,30	8,66%	1,38%	626,88%
BB SETOR FINANCEIRO	219.233,95	15,39%	1,38%	1114,70%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	330.804,97	15,26%	1,38%	1177,09%
CAIXA IRF-M	1.016.831,94	0,33%	1,38%	23,93%
CAIXA IRF-M1 TP	935.925,84	0,10%	1,38%	7,28%
TOTAL / MÉDIA	17.201.551,10	2,89%	1,38%	209,49%

**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	2.292.326,11	66.793,68	0,39%
BB IPCA TP	1.658.834,96	22.176,25	0,13%
BB IMA-B 5+	1.455.092,15	66.309,01	0,39%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.457.399,49	36.653,54	0,21%
CAIXA IMA-B 5+	3.283.708,49	150.461,78	0,97%
SICREDI IRF-M	1.483.313,25	5.957,42	0,03%
BB NÍVEL I	340.206,58	33.663,55	0,20%
BB ENERGIA	452.422,85	41.513,74	0,24%
BB SMALL CAP	413.584,30	47.294,20	0,27%
BB RETORNO TOTAL	418.176,91	44.401,41	0,26%
BB CONSUMO	443.689,30	49.219,49	0,29%
BB SETOR FINANCEIRO	219.233,95	29.670,34	0,17%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	330.804,97	57.694,18	0,34%
CAIXA IRF-M	1.016.831,94	14.656,62	0,09%
CAIXA IRF-M1 TP	935.925,84	1.506,37	0,01%
Carteira	17.201.551,10	555.805,07	3,23%

**ENQUADRAMENTO**

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,33%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA TP	9,64%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	8,44%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	14,29%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	19,09%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M	8,62%	20%	Art. 7º, III, a
BB NÍVEL I	1,98%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	2,63%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAP	2,40%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO TOTAL	2,43%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	2,58%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	1,27%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,92%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	5,91%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	5,44%	20%	Art. 7º, I, b

**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.

**COMPARATIVO COM A META ATUARIAL**

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,33%	0,70%	-45,59%
Fevereiro	-0,84%	0,74%	-113,27%
Março	-8,32%	0,56%	-1493,85%
Abril	2,13%	0,18%	1215,91%
Mai	1,74%	0,10%	1655,39%
Junho	2,63%	0,75%	351,83%
Julho	4,29%	0,85%	506,05%
Agosto	-1,72%	0,73%	-235,96%
Setembro	-1,98%	1,13%	-174,92%
Outubro	-0,20%	1,35%	-14,91%
Novembro	2,89%	1,38%	209,49%
Dezembro			
Acumulado	-0,31%	8,60%	-3,49%

Fundo	Sharpe
BB IMA-B	0,04
BB IPCA TP	0,06
BB IMA-B 5+	0,03
BB ALOCAÇÃO ATIVA	0,03
CAIXA IMA-B 5+	0,03
SICREDI IRF-M	0,01
BB NÍVEL I	-
BB ENERGIA	-
BB SMALL CAP	0,01
BB RETORNO TOTAL	-
BB CONSUMO	-
BB SETOR FINANCEIRO	0,01
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	0,00
CAIXA IRF-M	0,00
CAIXA IRF-M1 TP	0,03

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,31%, enquanto que a meta acumulada no período é de 8,6%, sendo assim o RPPS atingiu -3,49% da meta atuarial!

*Silva*

*2020*

*Mov*  
*2020*