



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

ATA DA PRIMEIRA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 20 DE JANEIRO DE 2022.

Aos (20) vinte dias do mês de janeiro de 2022, 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 cumprimenta, dá boas vindas na 1º reunião do ano e agradece a presença de todos, informando 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 2022; 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 do PREVIM referente às aplicações do mês de dezembro/2021 elaborada pela Assessoria Kansai cuja média final das rentabilidades dos fundos foi negativa de -4.13%, causando um prejuízo bastante significativo ao patrimônio do Instituto. 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 da folha salarial dos beneficiários do mês de janeiro 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 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, atentando para o percentual máximo para esse segmento.

Man
Robson Jesus
B

2022



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 legislação e a política de investimentos, depois de consultarmos Assessoria Financeira e membros deste Comitê.

Houve uma discussão entre os membros do comitê no sentido de que as perspectivas para a economia diante da inflação que atinge vários países no planeta não são muito otimistas para esse ano. No entanto, há economistas dizendo que o pior já passou e que pode haver uma boa retomada econômica no Brasil, mesmo em ano de eleições e inflação alta. O presidente encerrou a reunião e convocou para o dia 17 de fevereiro de 2022 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

SIMONE ALMEIDA DA SILVA
Membro e Proponente das APRs

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

RENTABILIDADE MÉDIA

Dezembro/2021				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	3.002.187,72	0,21%	1,22%	17,21%
BB IPCA	1.674.448,35	0,55%	1,22%	45,39%
BB IMA-B 5+	2.036.245,09	-0,33%	1,22%	-26,75%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.505.837,63	0,91%	1,22%	74,91%
BB AÇÕES BOLSA	2.226.040,19	4,74%	1,22%	388,71%
BB TECNOLOGIA	344.331,75	-0,13%	1,22%	-10,42%
BB ENERGIA	431.287,22	0,09%	1,22%	6,99%
BB SMALL CAPS	354.432,22	3,55%	1,22%	290,68%
BB RETORNO AÇÕES	392.664,42	1,50%	1,22%	123,21%
BB CONSUMO	338.531,59	-0,04%	1,22%	-3,24%
BB SETOR FINANCEIRO	265.397,08	-4,15%	1,22%	-340,20%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	234.849,89	6,28%	1,22%	514,89%
CAIXA IRF-M	1.302.700,92	0,58%	1,22%	47,36%
CAIXA IRF-M1 TP	2.468.737,13	0,85%	1,22%	69,54%
CAIXA IMA-B 5+	3.239.690,39	-0,34%	1,22%	-28,01%
SICREDI IRF-M LP	1.482.577,98	2,15%	1,22%	176,46%
TOTAL / MÉDIA	22.299.959,57	0,91%	1,22%	74,83%

ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,46%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA	7,51%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	9,13%	20%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	11,24%	20%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	9,98%	20%	Art. 8º, II, a
BB TECNOLOGIA	1,54%	20%	Art. 8º, II, a
BB ENERGIA	1,93%	20%	Art. 8º, II, a
BB SMALL CAPS	1,59%	20%	Art. 8º, II, a
BB RETORNO AÇÕES	1,76%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSUMO	1,52%	20%	Art. 8º, II, a
BB SETOR FINANCEIRO	1,19%	20%	Art. 8º, II, a
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,05%	20%	Art. 8º, II, a
CAIXA IRF-M	5,84%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	11,07%	20%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	14,53%	20%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	6,65%	20%	Art. 7º, III, a

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%
Mai	1,30%	1,32%	98,30%
Junho	0,16%	1,02%	15,98%
Julho	-0,92%	1,45%	-63,05%
Agosto	-1,14%	1,36%	-83,92%
Setembro	-1,36%	1,65%	-82,03%
Outubro	-2,68%	1,74%	-153,80%
Novembro	1,81%	1,44%	125,30%
Dezembro	0,91%	1,22%	74,83%
Acumulado	-4,13%	16,66%	-24,79%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -4,13%, enquanto que a meta acumulada no período é de 16,66%, sendo assim o RPPS atingiu -24,79% 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	3.002.187,72	92.588,90	0,42%
BB IPCA	1.674.448,35	19.137,03	0,09%
BB IMA-B 5+	2.036.245,09	101.743,26	0,46%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	2.505.837,63	35.171,16	0,16%
BB AÇÕES BOLSA	2.226.040,19	143.507,21	0,64%
BB TECNOLOGIA	344.331,75	34.248,21	0,15%
BB ENERGIA	431.287,22	40.892,96	0,18%
BB SMALL CAPS	354.432,22	51.572,23	0,23%
BB RETORNO AÇÕES	392.664,42	42.107,68	0,19%
BB CONSUMO	338.531,59	42.355,96	0,19%
BB SETOR FINANCEIRO	265.397,08	36.902,92	0,17%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	234.849,89	43.970,10	0,20%
CAIXA IRF-M	1.302.700,92	26.114,23	0,12%
CAIXA IRF-M1 TP	2.468.737,13	10.502,44	0,05%
CAIXA IMA-B 5+	3.239.690,39	159.627,71	0,72%
SICREDI IRF-M LP	1.482.577,98	30.948,56	0,14%
Carteira	22.299.959,57	669.880,42	3,00%

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

Assis

205 -