



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

CONVOCAÇÃO

O Presidente do Comitê de Investimento do PREVIM – Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Paranaíba, Marcelo Alves de Freitas, com base no Item VIII da Resolução nº 030/2012, **CONVOCA**, para o dia 20/09/2018, às 9h, na Sala de Reuniões da sede do PREVIM, sito a Rua Otto Lemos Fleury, nº 225 – Santa Mônica, nesta cidade, os membros do Comitê de Investimento para discutir a seguinte pauta: 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 outubro de 2018; 3 – Aplicações dos repasses que entrarem na conta corrente e 4 – Outros assuntos conforme ata.

Paranaíba, 13 de setembro de 2018.

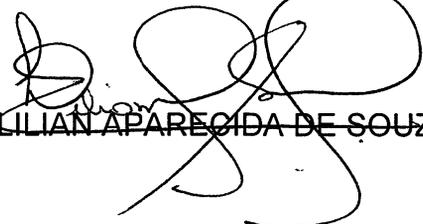
MEMBROS DO COMITÊ DE INVESTIMENTO


MARCELO ALVES DE FREITAS


SIMONE ALMEIDA DA SILVA


VANILA GARCIA BELO


ROGERIO LUIZ DE PAULO


LILIAN APARECIDA DE SOUZA



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

ATA DA NONA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 20 DE SETEMBRO DE 2018.

Aos (20) vinte dias do mês de setembro de 2018, 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 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 outubro de 2018; 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 agosto de 2018, entre outras informações financeiras (ANEXO) constando como saldo final aplicados, os seguintes Fundos:

| | |
|---|-------------------|
| • BB PREV RF TP IPCA, CNPJ: 15.486.093/0001-83, | R\$ 1.421.537,46 |
| • BB PREV RF IRF-M1 TP, CNPJ: 11.328.882/0001-35, | R\$ 5.473.091,22 |
| • BB PREVID RF IMAB 5+, CNPJ 13.327.340/0001-73 | R\$ 5.722.760,19 |
| • BB PREVID RF IMA B 5, CNPJ 03.543.477/0001-03 | R\$ 35.746,44 |
| • BB PREVID RF IRF-M1 TP, CNPJ: 11.328.882/0001-35, | R\$ 1.385.413,58 |
| • BB PREVID RF IMAB 5+, CNPJ 13.327.340/0001-73 | R\$ 603.681,46 |
| • CAIXA BRASIL IMA-B5+ TP RF CNPJ: 10.577.503/0001-88 | R\$ 681.123,55 |
| • CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF, CNPJ: 10.740.670/0001-06, | R\$ 3.304.339,12 |
| • CAIXA BRASIL IMA-B5+ TP RF CNPJ: 10.577.503/0001-88 | R\$ 2.581.218,44 |
| • SICREDI INST RF IRF-M LP, CNPJ: 13.081.159/0001-20, | R\$ 1.181.074,47 |
| • TOTAL | R\$ 22.389.985,93 |



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

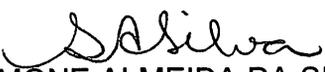
Os membros decidiram que o resgate para pagamento dos beneficiários referente ao mês de setembro será do fundo CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF, CNPJ: 10.740.670/0001-06, no valor de 950.000,00 (Novecentos e Cinquenta Mil Reais) e transferido para Conta Movimento da Caixa Econômica Federal 0987 006 158.5, até o dia 5º dia útil do mês subsequente, prazo legal para pagamento. 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 do COMPREV deverá ser creditado em conta específica no Banco do Brasil. Sobre os fundos IMAs Marcelo lamenta que os fundos até a presente data não vem tendo rentabilidade positiva mas que sair será pior, e que já há indícios de que o Mercado Financeiro já admite a vitória de Bolsonaro, que defende as reformas, entre elas, a da Previdência. Decidiu-se manter as aplicações nos Fundos IMAs até a recuperação de rentabilidade. Agradece a presença de todos e convoca para o dia 18 de outubro de 2018 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



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

Rogério Luiz de Paulo

ROGERIO LUIZ DE PAULO

Membro e Certificação ANBIMA

Lilian Aparecida de Souza

LILIAN APARECIDA DE SOUZA

Membro

1. RENTABILIDADE MÉDIA

| Agosto/2018 | | | | |
|----------------|---------------|---------------|-------|----------|
| Nome do Fundo | Aplicação | Rentabilidade | Meta | % Meta |
| BB IPCA TP | 1.421.537,46 | -0,40% | 0,40% | -100,81% |
| BB IRF-M1 | 5.473.091,22 | 0,40% | 0,40% | 99,75% |
| BB IMA-B 5+ | 5.722.760,19 | -0,56% | 0,40% | -141,75% |
| BB IMA-B5 | 35.746,44 | -0,35% | 0,40% | -88,21% |
| BB IRF-M1 | 1.385.413,58 | 0,40% | 0,40% | 99,75% |
| BB IMA-B 5+ | 603.681,46 | -0,56% | 0,40% | -141,65% |
| BB IMA-B 5+ | 681.123,55 | -0,51% | 0,40% | -128,18% |
| Caixa IRF-M1 | 3.304.339,12 | 0,32% | 0,40% | 81,70% |
| Caixa IMA-B 5+ | 2.581.218,44 | -0,78% | 0,40% | -195,93% |
| Sicredi IRF-M | 1.181.074,47 | -1,00% | 0,40% | -251,89% |
| TOTAL / MÉDIA | 22.389.985,93 | -0,16% | 0,40% | -39,96% |

2. ENQUADRAMENTO

| Nome do Fundo | % PL do RPPS | % Resolução | Enquadramento |
|----------------|--------------|-------------|-----------------|
| BB IPCA TP | 6,35% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB IRF-M1 | 24,44% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB IMA-B 5+ | 25,56% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB IMA-B5 | 0,16% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB IRF-M1 | 6,19% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB IMA-B 5+ | 2,70% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB IMA-B 5+ | 3,04% | 100% | Art. 7º, I, b |
| Caixa IRF-M1 | 14,76% | 100% | Art. 7º, I, b |
| Caixa IMA-B 5+ | 11,53% | 100% | Art. 7º, I, b |
| Sicredi IRF-M | 5,28% | 20% | Art. 7º, III, a |

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

| | Rentabilidade | Meta | % Meta |
|-----------|---------------|-------|----------|
| Janeiro | 1,70% | 0,87% | 195,68% |
| Fevereiro | 0,55% | 0,82% | 67,22% |
| Março | 0,62% | 0,58% | 107,92% |
| Abril | 0,04% | 0,71% | 5,55% |
| Mai | -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 | | | |
| Outubro | | | |
| Novembro | | | |
| Dezembro | | | |
| Acumulado | 2,46% | 7,03% | 34,97% |

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,46%, enquanto que a meta acumulada no período é de 7,03%, sendo assim o RPPS atingiu 34,97% 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 Asset.

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 | 1.421.537,46 | 42.962,07 | 0,19% |
| BB IRF-M1 | 5.473.091,22 | 20.274,74 | 0,09% |
| BB IMA-B 5+ | 5.722.760,19 | 231.783,64 | 1,04% |
| BB IMA-B5 | 35.746,44 | 665,60 | 0,00% |
| BB IRF-M1 | 1.385.413,58 | 5.132,18 | 0,02% |
| BB IMA-B 5+ | 603.681,46 | 24.450,35 | 0,11% |
| BB IMA-B 5+ | 681.123,55 | 27.586,91 | 0,12% |
| Caixa IRF-M1 | 3.304.339,12 | 12.169,08 | 0,05% |
| Caixa IMA-B 5+ | 2.581.218,44 | 104.125,35 | 0,47% |
| Sicredi IRF-M | 1.181.074,47 | 23.622,69 | 0,11% |
| Carteira | 22.389.985,93 | 448.200,60 | 2,00% |

4.2.2 INDICE 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 | - |
| BB IRF-M1 | - |
| BB IMA-B 5+ | - |
| BB IMA-B5 | - |
| BB IRF-M1 | - |
| BB IMA-B 5+ | - |
| BB IMA-B 5+ | - |
| Caixa IRF-M1 | - |
| Caixa IMA-B 5+ | - |
| Sicredi IRF-M | - |