



# 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 13/12/2018, 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 dezembro de 2018; 3 – Aplicações dos repasses que entrarem na conta corrente e 4 – Outros assuntos conforme ata.

Paranaíba, 06 de dezembro 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 DÉCIMA SEGUNDA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 13 DE DEZEMBRO DE 2018.

Aos (13) treze dias do mês de dezembro 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 janeiro de 2019; 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 novembro de 2018, entre outras informações financeiras (ANEXO) constando como saldo final das aplicações.

Foi aprovado que o resgate para pagamento dos beneficiários referente ao mês de dezembro e o 13º salário virá do fundo CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF, CNPJ: 10.740.670/0001-06 e transferido para Conta Movimento da Caixa Econômica Federal 0987 006 158.5, até o dia 5º dia útil do mês subsequente e até dia 20 de dezembro para pagamento do 13º salário, prazo legal para os pagamentos. 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. O Presidente agradece a presença de todos, desejando Feliz Natal e Próspero Ano Novo, reconhecendo o compromisso de todos os membros do comitê durante o ano que termina e convoca para o dia 17 de janeiro de 2019 a próxima reunião. Lavrou-se esta ata que vai assinada por todos os membros do Comitê.



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

## 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

ROGERIO LUIZ DE PAULO

Membro e Certificação ANBIMA

LILIAN APARECIDA DE SOUZA

Membro

### 1. RENTABILIDADE MÉDIA

Novembro/2018				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IPCA TP	1.460.021,47	0,13%	0,28%	46,76%
BB IRF-M1	10.033.719,06	0,49%	0,28%	179,02%
BB IMA-B5	2.145.282,26	0,03%	0,28%	12,26%
Caixa IRF-M1	6.016.745,23	0,52%	0,28%	190,05%
Caixa IMA-B 5+	1.409.673,87	1,24%	0,28%	448,73%
Sicredi IRF-M	1.253.529,41	1,02%	0,28%	369,32%
Caixa IRF-M1	675.826,64	0,49%	0,28%	179,00%
Caixa IRF-M1	0,00	0,03%	0,28%	9,40%
TOTAL / MÉDIA	22.994.797,94	0,51%	0,28%	185,49%

### 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IPCA TP	6,35%	100%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	43,63%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B5	9,33%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	26,17%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B 5+	6,13%	100%	Art. 7º, I, b
Sicredi IRF-M	5,45%	20%	Art. 7º, III, a
Caixa IRF-M1	2,94%	100%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	0,00%	100%	Art. 7º, I, b

### 3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	1,70%	0,78%	218,42%
Fevereiro	0,55%	0,82%	67,22%
Março	0,62%	0,58%	107,92%
Abril	0,04%	0,71%	5,55%
Maior	-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	-0,10%	0,97%	-10,05%
Outubro	5,36%	0,94%	570,94%
Novembro	0,51%	0,28%	185,49%
Dezembro			
Acumulado	8,40%	9,28%	90,45%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 8,4%, enquanto que a meta acumulada no período é de 9,28%, sendo assim o RPPS atingiu 90,45% 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	1.460.021,47	36.401,45	0,16%
BB IRF-M1	10.033.719,06	20.851,13	0,09%
BB IMA-B5	2.145.282,26	31.355,18	0,14%
Caixa IRF-M1	6.016.745,23	12.323,00	0,05%
Caixa IMA-B 5+	1.409.673,87	61.529,25	0,27%
Sicredi IRF-M	1.253.529,41	22.786,69	0,10%
Caixa IRF-M1	675.826,64	1.384,17	0,01%
Caixa IRF-M1	0,00	0,00	0,00%
Carteira	22.994.797,94	177.024,13	0,77%

##### 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 IPCA TP	-
BB IRF-M1	0,02
BB IMA-B5	-
Caixa IRF-M1	0,03
Caixa IMA-B 5+	0,02
Sicredi IRF-M	0,03
Caixa IRF-M1	0,03
Caixa IRF-M1	0,03