



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

ATA DA DÉCIMA PRIMEIRA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 17 DE NOVEMBRO DE 2022.

Aos (17) dezessete dias do mês de novembro 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, Lilian Aparecida de Souza, 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 dezembro de 2022; 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 outubro/2022. Apresentou também as demais informações financeiras contidas no Relatório de Consultoria (anexo) e Carteiras Sugeridas da Caixa Econômica e do Banco do Brasil.

Para o pagamento dos salários dos beneficiários do referente mês será resgatado de um fundo da Caixa Econômica Federal 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 preferencialmente em fundo de ações, observando as precauções e os limites para essa categoria de investimentos. 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.

[Handwritten signatures in blue ink]



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

Vanila ressalta que até o momento não houve tanta volatilidade no mercado financeiro após a eleição em 2º turno em 30 de outubro. O setor de commodities que sofreu um pouco mais, devido a promessa de intervenção nas estatais brasileira. Sem mais assunto a ser tratado, o presidente agradeceu a presença de todos convocando, para o dia 15 de dezembro 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


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/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	4.197.263,75	1,20%	1,00%	119,69%
BB IPCA	1.783.263,82	2,24%	1,00%	223,58%
BB IMA-B 5+	3.773.218,35	0,70%	1,00%	70,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.497.801,35	1,01%	1,00%	101,09%
BB AÇÕES BOLSA	2.102.057,00	7,70%	1,00%	767,67%
BB AÇÕES AGRO	602.445,84	8,23%	1,00%	820,54%
BB TECNOLOGIA	371.314,00	3,18%	1,00%	316,78%
BB ENERGIA	467.394,13	6,60%	1,00%	657,63%
BB SMALL CAPS	558.177,45	6,75%	1,00%	672,56%
BB RETORNO AÇÕES	399.695,60	6,17%	1,00%	615,04%
BB CONSUMO	306.933,80	5,91%	1,00%	589,62%
BB SETOR FINANCEIRO	608.917,10	6,60%	1,00%	657,75%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	429.142,64	1,99%	1,00%	198,45%
CAIXA IRF-M	276.511,91	0,94%	1,00%	93,38%
CAIXA IRF-M1 TP	1.799.772,31	0,65%	1,00%	64,83%
CAIXA IMA-B 5+	3.421.335,98	0,64%	1,00%	64,01%
SICREDI IRF-M LP	1.605.830,95	0,88%	1,00%	88,06%
BI - MASSA FALIDA	205.664,33	0,15%	1,00%	14,89%
TOTAL / MÉDIA	26.406.740,31	2,13%	1,00%	211,98%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	15,89%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	6,75%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	14,29%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	13,25%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	7,96%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,28%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,41%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,77%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	2,11%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,51%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	1,16%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,31%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,63%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	1,05%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	6,82%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	12,96%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	6,08%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,78%	0%	Não enquadrado

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,51%	0,95%	-53,89%
Fevereiro	-0,23%	1,42%	-16,36%
Março	3,08%	2,04%	150,97%
Abril	-1,39%	1,47%	-94,32%
Maio	0,76%	0,88%	85,89%
Junho	-2,16%	1,08%	-199,60%
Julho	0,92%	-0,27%	-337,82%
Agosto	1,69%	0,05%	3450,13%
Setembro	0,51%	0,12%	423,38%
Outubro	2,13%	1,00%	211,98%
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	4,77%	9,08%	52,54%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 4,77%, enquanto que a meta acumulada no período é de 9,08%, sendo assim o RPPS atingiu 52,54% 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	4.197.263,75	102.717,11	0,39%
BB IPCA	1.783.263,82	13.727,71	0,05%
BB IMA-B 5+	3.773.218,35	145.619,40	0,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.497.801,35	34.912,25	0,13%
BB AÇÕES BOLSA	2.102.057,00	240.540,41	0,91%
BB AÇÕES AGRO	602.445,84	48.359,80	0,18%
BB TECNOLOGIA	371.314,00	43.625,06	0,17%
BB ENERGIA	467.394,13	41.183,79	0,16%
BB SMALL CAPS	558.177,45	73.387,15	0,28%
BB RETORNO AÇÕES	399.695,60	42.535,40	0,16%
BB CONSUMO	306.933,80	39.663,71	0,15%
BB SETOR FINANCEIRO	608.917,10	71.619,71	0,27%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	429.142,64	62.446,70	0,24%
CAIXA IRF-M	276.511,91	4.064,39	0,02%
CAIXA IRF-M1 TP	1.799.772,31	2.805,02	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	3.421.335,98	132.423,14	0,50%
SICREDI IRF-M LP	1.605.830,95	23.940,23	0,09%
BI - MASSA FALIDA	205.664,33	0,00	0,00%
Carteira	26.406.740,31	819.897,51	3,10%

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	0,00
BB IPCA	0,04
BB IMA-B 5+	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA	-
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	-

Man
B
2022