



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

ATA DA TERCEIRA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 12 DE MARÇO DE 2020.

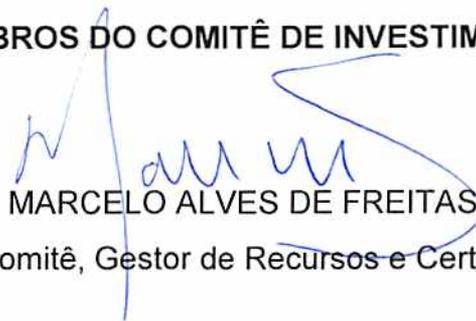
Aos (12) doze dias do mês de março de 2020, na Sala de Reuniões da Sede do PREVIM, com início às 9h, reuniram-se os membros do Comitê de Investimento do Instituto Previdência dos Servidores do Município de Paranaíba – PREVIM conforme RESOLUÇÃO Nº 04 DE 16 DE JANEIRO DE 2018. Estavam presentes os seguintes membros: Marcelo Alves de Freitas, Simone Almeida da Silva, Vanila Garcia Belo, Rogério Luiz de Paulo e Lilian Aparecida de Souza. Iniciando a reunião o presidente 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 abril de 2020; 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 fevereiro/2020. Apresentou também as demais informações financeiras contidas no Relatório de Consultoria (anexo), observando uma rentabilidade negativa nos investimentos diante da propagação do coronavírus na China e o aparecimento de casos mundo afora, aumentando a aversão dos investidores ao risco. Houve uma queda bastante considerável até a presente data nas aplicações de renda variável e nos fundos IMAs.

Os membros do Comitê decidiram que o resgate para pagamento dos beneficiários e despesas administrativas referente ao mês de março será resgatado no início do mês de abril do fundo CAIXA BRASIL IRF M1+. Ficou autorizado também a aplicação dos repasses previdenciários da Câmara, da Prefeitura e da Compensação Previdenciária nos fundos em que o Previm possui e que tenham melhor perspectiva de rentabilidade positiva naquele momento, nos Bancos Caixa Econômica Federal e Banco do Brasil. Decidiu-se manter as

aplicações nos Fundos IMAs, IRFMs e Renda Variável. As próximas compensações previdenciárias (COMPREV) creditadas na conta 24092-3 do Banco do Brasil serão aplicadas no BB AÇÕES SETOR FINANCEIRO. 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. Finalizando, o presidente agradeceu a presença de todos convocando, excepcionalmente, para o dia 16 de abril de 2020, a próxima reunião do comitê. Lavrou-se esta ata que vai assinada por todos os membros do Comitê.

MEMBROS DO COMITÊ DE INVESTIMENTO



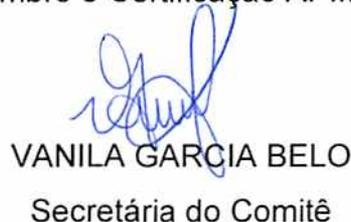
MARCELO ALVES DE FREITAS

Presidente do Comitê, Gestor de Recursos e Certificação ANBIMA



SIMONE ALMEIDA DA SILVA

Membro e Certificação APIMEC



VANILA GARCIA BELO

Secretária do Comitê



ROGERIO LUIZ DE PAULO

Membro e Certificação ANBIMA



LILIAN APARECIDA DE SOUZA

Membro

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Fevereiro/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.283.482,75	0,40%	0,74%	54,59%
BB IPCA TP	1.660.608,03	0,77%	0,74%	104,41%
BB IRF-M1	484.884,15	0,35%	0,74%	47,83%
BB IMA-B 5+	1.467.612,47	0,28%	0,74%	37,45%
BB Alocação Ativa	3.400.195,40	0,46%	0,74%	61,79%
Caixa IRF-M1+	1.960.021,15	0,60%	0,74%	81,29%
Caixa IMA-B 5+	3.841.660,91	0,29%	0,74%	39,49%
Sicredi IRF-M	1.450.032,36	0,81%	0,74%	109,55%
BB Ações Tecnologia	312.539,88	-6,84%	0,74%	-926,82%
BB Ações Energia	468.073,73	-4,09%	0,74%	-554,29%
BB Ações Small Caps	429.130,78	-8,85%	0,74%	-1199,17%
BB Ações Retorno Total	435.614,96	-7,87%	0,74%	-1066,99%
BB Ações Consumo	431.366,58	-9,87%	0,74%	-1337,13%
BB Ações Set Financeiro	95.189,17	-5,32%	0,74%	-720,72%
BB Ações Construção Civil	427.817,20	-10,82%	0,74%	-1466,68%
Caixa Simples LP	877.991,07	-2,91%	0,74%	-393,97%
TOTAL / MÉDIA	20.026.220,59	-0,84%	0,74%	-113,27%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% Pl. do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	11,40%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA TP	8,29%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	2,42%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	7,33%	20%	Art. 7º, I, b
BB Alocação Ativa	16,98%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	9,79%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B 5+	19,18%	20%	Art. 7º, I, b
Sicredi IRF-M	7,24%	20%	Art. 7º, III, a
BB Ações Tecnologia	1,56%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Energia	2,34%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Small Caps	2,14%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Retorno Total	2,18%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Consumo	2,15%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Set Financeiro	0,48%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Construção Civil	2,14%	20%	Art. 8º, II, a
Caixa Simples LP	4,38%	20%	Art. 7º, IV, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,33%	0,70%	-46,59%
Fevereiro	-0,84%	0,74%	-113,27%
Março			
Abril			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-1,16%	1,44%	-80,39%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -1,16%, enquanto que a meta acumulada no período é de 1,44%, sendo assim o RPPS atingiu -80,39% 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	2.283.482,75	51.603,44	0,26%
BB IPCA TP	1.660.608,03	18.807,86	0,09%
BB IRF-M1	484.884,15	480,81	0,00%
BB IMA-B 5+	1.467.612,47	50.289,11	0,25%
BB Alocação Ativa	3.400.195,40	34.753,16	0,17%
Caixa IRF-M1+	1.960.021,15	25.129,78	0,13%
Caixa IMA-B 5+	3.841.660,91	133.680,25	0,67%
Sicredi IRF-M	1.450.032,36	14.359,05	0,07%
BB Ações Tecnologia	312.539,88	30.371,43	0,15%
BB Ações Energia	468.073,73	36.591,41	0,18%
BB Ações Small Caps	429.130,78	43.663,63	0,22%
BB Ações Retorno Total	435.614,96	47.219,82	0,24%
BB Ações Consumo	431.366,58	43.365,61	0,22%
BB Ações Set Financeiro	95.189,17	9.462,01	0,05%
BB Ações Construção Civil	427.817,20	49.038,33	0,24%
Caixa Simples LP	877.991,07	146,70	0,00%
Carteira	20.026.220,59	453.130,96	2,26%

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 TP	0,02
BB IRF-M1	0,05
BB IMA-B 5+	-
BB Alocação Ativa	0,01
Caixa IRF-M1+	0,02
Caixa IMA-B 5+	-
Sicredi IRF-M	0,03
BB Ações Tecnologia	0,03
BB Ações Energia	0,05
BB Ações Small Caps	-
BB Ações Retorno Total	0,01
BB Ações Consumo	-
BB Ações Set Financeiro	0,04
BB Ações Construção Civil	-
Caixa Simples LP	-

Zoi
Mar
Sasilga
[Signature]