



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

ATA DA QUARTA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 13 DE AGOSTO DE 2020.

Aos (13) treze dias do mês de agosto 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. 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 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 setembro de 2020; 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 referente às aplicações do mês de julho/2020, observando que foram bastante satisfatórias. 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 o resgate para pagamento dos beneficiários e despesas administrativas referente ao mês de agosto será resgatado no início do mês de setembro, de um fundo da CAIXA Econômica Federal.

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 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.

Robson Jesus da Silva

aw
[Signature]



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

Finalizando, o presidente reportou que o mercado financeiro, apesar da curva ascendente de recuperação, ainda sofrerá volatilidade e incertezas, motivados por questões políticas locais e globais, bem como relações comerciais entre os países e blocos comerciais e alertou mais uma vez os membros do comitê sobre as certificações que a legislação exige e que as provas já podem ser realizadas em alguns lugares. A agradeceu a presença de todos convocando, para o dia 17 de setembro 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 – CPF: 420.970.101-72

Presidente do Comitê, Gestor de Recursos, Autorizador das APRs e
Certificação ANBIMA


SIMONE ALMEIDA DA SILVA – CPF: 962.739.761-04

Membro, Proponente das APRs e Certificação APIMEC


VANILA GARCIA BELO – CPF: 034.308.601-80

Secretária do Comitê


ROGERIO LUIZ DE PAULO- CPF: 596.115.291-04

Membro, Liquidador das APRs e Certificação ANBIMA


ROBSON JESUS DA SILVA - CPF: 712.961.401-30

Membro

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Julho/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.321.841,19	4,39%	0,85%	516,89%
BB IPCA TP	1.679.093,31	1,12%	0,85%	131,96%
BB IMA-B 5+	1.511.026,73	7,28%	0,85%	857,75%
BB Alocacao Ativa	3.487.938,61	1,77%	0,85%	208,34%
Caixa IMA-B 5+	3.887.927,58	7,29%	0,85%	859,37%
Sicredi IRF-M	1.513.151,22	1,33%	0,85%	156,76%
BB Ações Tecnologia	318.513,46	8,81%	0,85%	1037,84%
BB Ações Energia	450.995,70	7,73%	0,85%	910,80%
BB Ações Small Caps	387.093,69	10,14%	0,85%	1194,49%
BB Ações Retorno Total	410.233,40	7,83%	0,85%	922,93%
BB Ações Consumo	446.441,84	7,39%	0,85%	871,09%
BB Ações Set Financeiro	162.538,42	8,56%	0,85%	1008,95%
BB Ações Construção Civil	345.770,00	7,07%	0,85%	832,96%
Caixa IRF-M	1.310.965,74	1,02%	0,85%	120,45%
Caixa IRF-M1	32.312,25	0,01%	0,85%	1,74%
Caixa Prático	0,00	0,00%	0,85%	0,05%
TOTAL / MÉDIA	18.265.843,14	4,29%	0,85%	506,05%

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	2.321.841,19	204.580,77	1,12%
BB IPCA TP	1.679.093,31	71.539,09	0,39%
BB IMA-B 5+	1.511.026,73	205.882,47	1,13%
BB Alocacao Ativa	3.487.938,61	151.099,11	0,83%
Caixa IMA-B 5+	3.887.927,58	531.712,67	2,91%
Sicredi IRF-M	1.513.151,22	11.668,54	0,06%
BB Ações Tecnologia	318.513,46	72.092,51	0,39%
BB Ações Energia	450.995,70	107.450,83	0,59%
BB Ações Small Caps	387.093,69	119.007,46	0,65%
BB Ações Retorno Total	410.233,40	100.782,76	0,55%
BB Ações Consumo	446.441,84	135.669,34	0,74%
BB Ações Set Financeiro	162.538,42	50.598,81	0,28%
BB Ações Construção Civil	345.770,00	140.254,91	0,77%
Caixa IRF-M	1.310.965,74	55.345,16	0,30%
Caixa IRF-M1	32.312,25	118,81	0,00%
Caixa Prático	0,00	0,00	0,00%
Carteira	18.265.843,14	1.800.537,89	9,86%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	12,71%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA TP	9,19%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	8,27%	20%	Art. 7º, I, b
BB Alocacao Ativa	19,10%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B 5+	21,29%	20%	Art. 7º, I, b
Sicredi IRF-M	8,28%	20%	Art. 7º, III, a
BB Ações Tecnologia	1,74%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Energia	2,47%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Small Caps	2,12%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Retorno Total	2,25%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Consumo	2,44%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Set Financeiro	0,89%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Construção Civil	1,89%	20%	Art. 8º, II, a
Caixa IRF-M	7,18%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	0,18%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa Prático	0,00%	20%	Art. 7º, IV, a

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.

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,33%	0,70%	-46,59%
Fevereiro	-0,84%	0,74%	-113,27%
Março	-8,32%	0,56%	-1493,85%
Abril	2,13%	0,18%	1215,91%
Mai	1,74%	0,10%	1655,39%
Junho	2,63%	0,75%	351,83%
Julho	4,29%	0,85%	506,05%
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,77%	3,94%	19,62%

Fundo	Sharpe
BB IMA-B	0,10
BB IPCA TP	0,05
BB IMA-B 5+	0,10
BB Alocacao Ativa	0,08
Caixa IMA-B 5+	0,10
Sicredi IRF-M	0,03
BB Ações Tecnologia	0,02
BB Ações Energia	0,00
BB Ações Small Caps	0,02
BB Ações Retorno Total	-
BB Ações Consumo	0,00
BB Ações Set Financeiro	-
BB Ações Construção Civil	-
Caixa IRF-M	0,05
Caixa IRF-M1	0,02
Caixa Prático	-

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,77%, enquanto que a meta acumulada no período é de 3,94%, sendo assim o RPPS atingiu 19,62% da meta atuarial.

Mar

[Handwritten signature]

Sassiva *Zoni*