



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

ATA DA PRIMEIRA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 19 DE JANEIRO DE 2023.

Aos (19) dezanove dias do mês de janeiro de 2023, 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 dando boas-vindas. Logo, 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 fevereiro de 2023; 2 – Aplicações dos repasses que entrarem na conta corrente e 3 – Outros assuntos conforme ata.

Em seguida, a secretária do COI, Vanila apresentou a Planilha de rentabilidade dos fundos de investimentos do Previm referente às aplicações do mês de dezembro/2022. Considerou a pouca rentabilidade dos fundos e o não cumprimento da meta atuarial. Apresentou também as demais informações financeiras contidas no Relatório de Consultoria (anexo) e Carteiras Sugeridas da Caixa Econômica e do Banco do Brasil.

Em relação ao pagamento dos salários dos beneficiários do referente mês de janeiro/23, o valor será resgatado 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 preferencialmente em fundo de ações, observando os cuidados e os limites para essa categoria de investimentos ou no fundo BB IRF M1. As transferências entre os fundos poderão ser realizadas na medida em que o mercado indicar a necessidade



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

da operação, depois de consultarmos Assessoria Financeira e membros deste Comitê.

Rogério se pronuncia no sentido de que a inflação e os juros estão altos em praticamente no mundo todo, com viés de mais alta ainda para 2023. Sendo os fundos atrelados à Selic um ótimo investimento no mercado local (Brasil). O presidente ratifica as palavras de Rogério e encerra a reunião convocando, para o dia 16 de fevereiro de 2023 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

**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO
MUNICÍPIO DE PARANAÍBA**

Informações referentes a Dezembro/2022

1. RENTABILIDADE MÉDIA

| Dezembro/2022 | | | | |
|------------------|---------------|---------------|-------|----------|
| Nome do Fundo | Aplicação | Rentabilidade | Meta | % Meta |
| BB IMA-B | 4.155.546,89 | -0,24% | 1,03% | -22,92% |
| BB IPCA | 1.761.653,42 | 0,95% | 1,03% | 92,43% |
| BB IMA-B 5+ | 3.681.843,75 | -1,19% | 1,03% | -115,10% |
| BB ALOCAÇÃO AT | 0,00 | -0,39% | 1,03% | -37,36% |
| BB RETORNO TOT | 3.574.807,56 | 1,22% | 1,03% | 118,20% |
| BB AÇÕES BOLSA | 2.118.779,62 | -4,58% | 1,03% | -443,59% |
| BB AÇÕES AGRO | 604.932,77 | -2,63% | 1,03% | -254,49% |
| BB TECNOLOGIA | 385.031,27 | -6,29% | 1,03% | -608,50% |
| BB ENERGIA | 441.737,55 | -2,77% | 1,03% | -268,15% |
| BB SMALL CAPS | 502.758,75 | -2,66% | 1,03% | -257,92% |
| BB RETORNO AÇ | 352.826,02 | -2,86% | 1,03% | -277,01% |
| BB CONSUMO | 248.280,06 | -5,27% | 1,03% | -510,05% |
| BB SETOR FINAN | 572.937,62 | 0,13% | 1,03% | 13,01% |
| BB CONSTRUÇÃO | 364.013,04 | -3,73% | 1,03% | -361,43% |
| CAIXA IRF-M | 1.151.949,99 | 1,21% | 1,03% | 116,92% |
| CAIXA IRF-M1 TP | 1.766.545,34 | 0,80% | 1,03% | 76,97% |
| CAIXA IMA-B 5+ | 3.338.731,34 | -1,23% | 1,03% | -119,33% |
| SICREDI IRF-M L | 1.616.067,49 | 1,41% | 1,03% | 136,56% |
| BI - MASSA FALID | 206.401,05 | 0,21% | 1,03% | 20,06% |
| TOTAL / MÉDIA | 26.844.843,53 | -0,72% | 1,03% | -70,03% |

2. ENQUADRAMENTO

| Nome do Fundo | % PL do RPPS | % Resolução | Enquadramento |
|------------------|--------------|-------------|-----------------|
| BB IMA-B | 15,48% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB IPCA | 6,56% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB IMA-B 5+ | 13,72% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB ALOCAÇÃO AT | 0,00% | 100% | Art. 7º, I, b |
| BB RETORNO TOT | 13,32% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BB AÇÕES BOLSA | 7,89% | 20% | Art. 8º, I |
| BB AÇÕES AGRO | 2,25% | 20% | Art. 8º, I |
| BB TECNOLOGIA | 1,43% | 20% | Art. 8º, I |
| BB ENERGIA | 1,65% | 20% | Art. 8º, I |
| BB SMALL CAPS | 1,87% | 20% | Art. 8º, I |
| BB RETORNO AÇ | 1,31% | 20% | Art. 8º, I |
| BB CONSUMO | 0,92% | 20% | Art. 8º, I |
| BB SETOR FINAN | 2,13% | 20% | Art. 8º, I |
| BB CONSTRUÇÃO | 1,36% | 20% | Art. 8º, I |
| CAIXA IRF-M | 4,29% | 100% | Art. 7º, I, b |
| CAIXA IRF-M1 TP | 6,58% | 100% | Art. 7º, I, b |
| CAIXA IMA-B 5+ | 12,44% | 100% | Art. 7º, I, b |
| SICREDI IRF-M L | 6,02% | 20% | Art. 7º, III, a |
| BI - MASSA FALID | 0,77% | - | - |

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% |
| Mai | 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 | -1,22% | 0,82% | -148,85% |
| Dezembro | -0,72% | 1,03% | -70,03% |
| Acumulado | 2,74% | 11,11% | 24,65% |

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,74%, enquanto que a meta acumulada no período é de 11,11%, sendo assim o RPPS atingiu 24,65% 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 | 4.155.546,89 | 117.170,23 | 0,44% |
| BB IPCA | 1.761.653,42 | 12.737,93 | 0,05% |
| BB IMA-B 5+ | 3.681.843,75 | 159.641,99 | 0,59% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA | | 0,00 | |
| BB RETORNO TOTAL | 3.574.807,56 | 50.251,40 | 0,19% |
| BB AÇÕES BOLSA | 2.118.779,62 | 231.028,53 | 0,86% |
| BB AÇÕES AGRO | 604.932,77 | 53.398,52 | 0,20% |
| BB TECNOLOGIA | 385.031,27 | 39.351,13 | 0,15% |
| BB ENERGIA | 441.737,55 | 47.155,97 | 0,18% |
| BB SMALL CAPS | 502.758,75 | 73.011,48 | 0,27% |
| BB RETORNO AÇÕES | 352.826,02 | 43.055,49 | 0,16% |
| BB CONSUMO | 248.280,06 | 37.624,41 | 0,14% |
| BB SETOR FINANCEIRO | 572.937,62 | 80.201,75 | 0,30% |
| BB CONSTRUÇÃO CIVIL | 364.013,04 | 66.387,77 | 0,25% |
| CAIXA IRF-M | 1.151.949,99 | 22.002,55 | 0,08% |
| CAIXA IRF-M1 TP | 1.766.545,34 | 2.021,96 | 0,01% |
| CAIXA IMA-B 5+ | 3.338.731,34 | 144.497,20 | 0,54% |
| SICREDI IRF-M LP | 1.616.067,49 | 31.032,62 | 0,12% |
| BI - MASSA FALIDA | 206.401,05 | 0,00 | 0,00% |
| Carteira | 26.844.843,53 | 878.509,44 | 3,27% |

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 | - |
| BB IMA-B 5+ | - |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA | - |
| BB RETORNO TOTAL | - |
| 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 | 0,00 |
| CAIXA IRF-M1 TP | 0,01 |
| CAIXA IMA-B 5+ | - |
| SICREDI IRF-M LP | 0,00 |
| BI - MASSA FALIDA | - |