



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

ATA DA DÉCIMA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 20 DE OUTUBRO DE 2022.

Aos (20) vinte dias do mês de outubro 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, Vanila, Rogério, Robson e Lilian.

O presidente agradece a presença de todos 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 novembro; 2 -- Aplicações dos repasses que entrarem na conta corrente e 3 – Outros assuntos conforme ata.

Em seguida, a Secretária Vanila apresentou a Planilha de rentabilidade dos fundos de investimentos do PREVIM referente às aplicações do mês de setembro/2022 elaborada pela Assessoria Kansai e acredita que, observando a rentabilidade atual contida no Relatório de Consultoria (anexo), não conseguiremos atingir a meta atuarial até o final do ano.

Ficou decidido que para o pagamento da folha salarial dos beneficiários do mês de outubro, o valor será resgatado de um fundo da Caixa Econômica Federal.

As aplicações dos parcelamentos e repasses previdenciários da Câmara e da Prefeitura deverão ser aplicados em fundos dos 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, atentando para o percentual máximo para esse segmento.

As migrações entre os fundos poderão ser realizadas na medida em que o mercado indicar a necessidade da operação ou quando atingir o limite permitido pela legislação e a política de investimentos, depois de consultarmos Assessoria Financeira e membros deste Comitê.

Handwritten signatures and initials in blue ink, including a large 'B' in the upper right corner.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

Faltando 10 dias para a eleição do 2º turno, o mercado financeiro local demonstra já ter precificado os ativos que compõe nossos fundos de investimento, pois há pouca volatilidade até o momento.

Rogério considerou que mesmo o Brasil demonstrando bons números em relação a economia, com inflação em queda, os Estados Unidos, a União Europeia e vários outros países ricos tem aumentado juros com a inflação crescente. Soma-se a isso a projeção de um crescimento baixo da China que, todos esses fatores prejudicam muito a relação comercial com o Brasil.

O presidente encerra a reunião agradecendo a presença de todos e convoca a todos para a próxima reunião em 17 de novembro de 2022.

Lavrou-se esta ata que vai assinada por todos os membros do Comitê.

MARCELO ALVES DE FREITAS

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

LILIAN APARECIDA DE SOUSA

Membro

VANILA GARCIA BELO

Secretária e Certificação ANBIMA

ROGERIO LUIZ DE PAULO

Membro, Liquidador das APRs e Certificação ANBIMA

ROBSON JESUS DA SILVA

Proponente da APRs

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Setembro/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	3.647.473,90	1,45%	0,12%	1215,55%
BB IPCA	1.744.150,37	0,08%	0,12%	70,04%
BB IMA-B 5+	3.446.804,67	2,36%	0,12%	1974,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.462.689,78	1,24%	0,12%	1036,65%
BB AÇÕES BOLSA	1.951.773,12	-8,03%	0,12%	-6726,18%
BB AÇÕES AGRO	556.633,59	-3,39%	0,12%	-2839,64%
BB TECNOLOGIA	346.158,87	-2,65%	0,12%	-2218,40%
BB ENERGIA	438.471,93	-4,35%	0,12%	-3641,86%
BB SMALL CAPS	522.902,91	-1,95%	0,12%	-1634,92%
BB RETORNO AÇÕES	376.471,05	-2,86%	0,12%	-2395,32%
BB CONSUMO	289.795,27	-1,21%	0,12%	-1009,32%
BB SETOR FINANCEIRO	571.230,59	2,76%	0,12%	2309,66%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	420.767,29	10,98%	0,12%	9197,99%
CAIXA IRF-M	1.561.882,28	1,22%	0,12%	1019,53%
CAIXA IRF-M1 TP	2.558.137,58	1,09%	0,12%	910,80%
CAIXA IMA-B 5+	3.399.510,31	2,37%	0,12%	1988,44%
SICREDI IRF-M LP	1.591.771,75	1,45%	0,12%	1216,16%
BI - MASSA FALIDA	205.357,53	0,18%	0,12%	151,16%
TOTAL / MÉDIA	27.091.982,79	0,51%	0,12%	423,38%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,46%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	6,44%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	12,72%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	12,78%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	7,20%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,05%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,28%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,62%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,93%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,39%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	1,07%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,11%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,55%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	5,77%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	9,44%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	12,55%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,88%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,76%	-	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%
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			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,59%	8,00%	32,38%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,59%, enquanto que a meta acumulada no período é de 8%, sendo assim o RPPS atingiu 32,38% 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	3.647.473,90	91.460,94	0,34%
BB IPCA	1.744.150,37	15.998,45	0,06%
BB IMA-B 5+	3.446.804,67	137.174,19	0,51%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.462.689,78	35.905,94	0,13%
BB AÇÕES BOLSA	1.951.773,12	219.505,50	0,81%
BB AÇÕES AGRO	556.633,59	42.945,34	0,16%
BB TECNOLOGIA	346.158,87	40.580,20	0,15%
BB ENERGIA	438.471,93	32.430,51	0,12%
BB SMALL CAPS	522.902,91	64.183,04	0,24%
BB RETORNO AÇÕES	376.471,05	33.809,15	0,12%
BB CONSUMO	289.795,27	33.123,60	0,12%
BB SETOR FINANCEIRO	571.230,59	56.179,93	0,21%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	420.767,29	56.920,91	0,21%
CAIXA IRF-M	1.561.882,28	23.707,78	0,09%
CAIXA IRF-M1 TP	2.558.137,58	4.254,15	0,02%
CAIXA IMA-B 5+	3.399.510,31	135.738,30	0,50%
SICREDI IRF-M LP	1.591.771,75	24.626,05	0,09%
BI - MASSA FALIDA	205.357,53	0,00	0,00%
Carteira	27.091.982,79	757.500,11	2,80%

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

Maw
B
2022
[Signature]