



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

ATA DA DÉCIMA SEGUNDA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 14 DE DEZEMBRO DE 2023.

Aos (14) quatorze dias do mês de dezembro 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 agradeceu a presença de todos e informou 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 janeiro de 2024; 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 novembro/2023, ressaltando que a rentabilidade foi excelente no mês. Em seguida, apresentou as demais informações financeiras contidas no Relatório de Consultoria (anexo).

Em relação ao pagamento dos salários dos beneficiários do referente mês de dezembro/23, o valor será resgatado de um fundo da Caixa Econômica Federal ou transferência de saldo do Banco do Brasil para a conta corrente da Caixa ou ainda, excepcionalmente, do repasse previdenciário do ente federativo neste mês.

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 no fundo BB IRF M1. 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.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

A Secretária Vanilla, considerando a última reunião do Comitê do ano, deseja Feliz Natal e Próspero Ano à todos os membros. Rogério também agradeceu a participação de todos os membros nas reuniões durante o corrente ano e, ao mesmo tempo em que deseja Boas Festa e um Feliz Ano Novo, relembra os companheiros da importância de realizarem a prova para a Nova Certificação, pois em julho de 2024, a exigência será obrigatória para permanência no Comitê. Sem mais assunto, o presidente agradeceu a presença de todos e encerrou a reunião convocando, para o dia 18 de janeiro de 2024 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

Novembro/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	5.404.556,04	2,60%	0,66%	392,10%
BB IRF-M1 TP	2.489.170,66	2,46%	0,66%	371,97%
BB IMA-B 5+	4.929.188,05	3,38%	0,66%	510,02%
BB RETORNO TOTAL	4.898.186,25	1,09%	0,66%	165,12%
BB AÇÕES BOLSA	2.571.470,17	8,63%	0,66%	1303,73%
BB AÇÕES AGRO	808.502,27	9,80%	0,66%	1479,97%
BB TECNOLOGIA	578.240,45	10,53%	0,66%	1590,22%
BB ENERGIA	516.969,58	10,06%	0,66%	1519,92%
BB SMALL CAPS	564.640,44	12,36%	0,66%	1866,07%
BB RETORNO AÇÕES	391.204,64	10,99%	0,66%	1659,25%
BB CONSUMO	276.572,58	16,01%	0,66%	2418,49%
BB SETOR FINANCEIRO	828.559,35	15,96%	0,66%	2410,38%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	505.727,86	14,74%	0,66%	2225,77%
CAIXA IRF-M	235,62	2,47%	0,66%	373,06%
CAIXA IRF-M1 TP	1.810.973,70	0,60%	0,66%	91,08%
CAIXA IMA-B 5+	4.555.854,41	3,37%	0,66%	508,87%
SICREDI IRF-M LP	1.849.836,62	2,61%	0,66%	394,66%
BI - MASSA FALIDA	209.888,91	0,08%	0,66%	11,70%
TOTAL / MÉDIA	33.189.777,60	4,12%	0,66%	622,60%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	16,28%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M1 TP	7,50%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	14,85%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	14,76%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	7,75%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,44%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,74%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,56%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,70%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,18%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,83%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,50%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,52%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	0,00%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	5,46%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	13,73%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,57%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,63%	0%	Não enquadrado

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,91%	0,92%	98,20%
Fevereiro	-0,10%	1,22%	-8,22%
Março	2,04%	1,09%	186,81%
Abril	1,90%	0,99%	190,76%
Mai	3,20%	0,61%	523,45%
Junho	3,35%	0,30%	1115,18%
Julho	1,23%	0,50%	245,07%
Agosto	-0,96%	0,61%	-157,01%
Setembro	-1,11%	0,64%	-172,50%
Outubro	-1,03%	0,62%	-165,95%
Novembro	4,12%	0,66%	622,60%
Dezembro			
Acumulado	14,23%	8,48%	167,83%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 14,23%, enquanto que a meta acumulada no período é de 8,48%, sendo assim o RPPS atingiu 167,83% 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	5.404.556,04	119.672,67	0,36%
BB IRF-M1 TP	2.489.170,66	3.004,47	0,01%
BB IMA-B 5+	4.929.188,05	169.123,54	0,51%
BB RETORNO TOTAL	4.898.186,25	10.098,77	0,03%
BB AÇÕES BOLSA	2.571.470,17	145.070,95	0,44%
BB AÇÕES AGRO	808.502,27	62.780,56	0,19%
BB TECNOLOGIA	578.240,45	43.447,81	0,13%
BB ENERGIA	516.969,58	39.956,56	0,12%
BB SMALL CAPS	564.640,44	61.091,21	0,18%
BB RETORNO AÇÕES	391.204,64	29.353,15	0,09%
BB CONSUMO	276.572,58	29.626,44	0,09%
BB SETOR FINANCEIRO	828.559,35	75.461,51	0,23%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	505.727,86	67.060,20	0,20%
CAIXA IRF-M	235,62	2,93	0,00%
CAIXA IRF-M1 TP	1.810.973,70	2.192,46	0,01%
CAIXA IMA-B 5+	4.555.854,41	154.281,46	0,46%
SICREDI IRF-M LP	1.849.836,62	25.129,29	0,08%
BI - MASSA FALIDA	209.888,91	0,00	0,00%
Carteira	33.189.777,60	821.546,58	2,48%

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	0,02
BB IRF-M1 TP	0,01
BB IMA-B 5+	0,01
BB RETORNO TOTAL	0,02
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	0,03
CAIXA IRF-M1 TP	0,02
CAIXA IMA-B 5+	0,01
SICREDI IRF-M LP	0,03
BI - MASSA FALIDA	-