



## **INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS**

### **ATA DA SÉTIMA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 21 DE JULHO DE 2022.**

Aos (21) vinte e um dias do mês de julho 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 Alves de Freitas, Vanila Garcia Belo, Rogério Luiz de Paulo e Robson Jesus da Silva. O Presidente avisa sobre a ausência da servidora Simone e agradece a presença de todos, informando 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 agosto; 2 – Aplicações dos repasses que entrarem na conta corrente e 3 – Outros assuntos conforme ata.

Assim, o presidente apresentou a Planilha de rentabilidade dos fundos de investimentos do PREVIM referente às aplicações do mês de junho/2022 elaborada pela Assessoria Kansai e os membros observaram e discutiram as demais informações financeiras contidas no Relatório de Consultoria (anexo).

Ficou decidido que para o pagamento da folha salarial dos beneficiários do mês de julho, 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.



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

O presidente e os demais membros lamentam que o prefeito encaminhou e a Câmara municipal aprovou a lei sobre o parcelamento especial da dívida previdenciária. A parcela mensal repassada ao Previm passava de R\$ 500.000,00 (quinhentos mil), no entanto, ficará em torno de R\$ 110.000,00 (cento e dez mil). Marcelo agradece a todos pela presença e convoca para o dia 18 de agosto de 2022 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

**SIMONE ALMEIDA DA SILVA** Membro e Proponente das APRs - faltou

**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

**1: RENTABILIDADE MÉDIA**

| Junho/2022           |                      |               |              |                 |
|----------------------|----------------------|---------------|--------------|-----------------|
| Nome do Fundo        | Aplicação            | Rentabilidade | Meta         | % Meta          |
| BB IMA-B TP          | 3.591.867,27         | -0,40%        | 1,08%        | -36,48%         |
| BB IPCA              | 1.743.800,41         | 0,33%         | 1,08%        | 30,23%          |
| BB IMA-B 5+          | 3.349.136,66         | -1,09%        | 1,08%        | -100,88%        |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA    | 3.365.982,27         | 0,33%         | 1,08%        | 30,41%          |
| BB AÇÕES BOLSA       | 2.008.995,49         | -7,44%        | 1,08%        | -687,09%        |
| BB AÇÕES AGRO        | 521.591,02           | -12,11%       | 1,08%        | -1117,43%       |
| BB TECNOLOGIA        | 245.314,83           | -8,65%        | 1,08%        | -798,04%        |
| BB ENERGIA           | 440.386,50           | -5,11%        | 1,08%        | -471,40%        |
| BB SMALL CAPS        | 286.253,73           | -16,51%       | 1,08%        | -1524,03%       |
| BB RETORNO AÇÕES     | 341.531,90           | -11,84%       | 1,08%        | -1092,53%       |
| BB CONSUMO           | 252.816,41           | -14,47%       | 1,08%        | -1335,85%       |
| BB SETOR FINANCEIRO  | 309.505,16           | -12,43%       | 1,08%        | -1147,56%       |
| BB CONSTRUÇÃO CIVIL  | 199.458,10           | -12,08%       | 1,08%        | -1115,05%       |
| CAIXA IRF-M          | 1.330.688,16         | 0,34%         | 1,08%        | 31,77%          |
| CAIXA IRF-M1 TP      | 1.233.535,05         | 0,92%         | 1,08%        | 85,28%          |
| CAIXA IMA-B 5+       | 3.302.772,77         | -1,10%        | 1,08%        | -101,52%        |
| SICREDI IRF-M LP     | 1.518.816,53         | 0,32%         | 1,08%        | 29,52%          |
| BI - MASSA FALIDA    | 204.161,91           | 0,15%         | 1,08%        | 13,70%          |
| <b>TOTAL / MÉDIA</b> | <b>24.246.614,17</b> | <b>-2,16%</b> | <b>1,08%</b> | <b>-199,60%</b> |

**2: ENQUADRAMENTO**

| Nome do Fundo       | Base do RPPS | % Resolução | Enquadramento   |
|---------------------|--------------|-------------|-----------------|
| BB IMA-B TP         | 14,81%       | 100%        | Art. 7º, I, b   |
| BB IPCA             | 7,19%        | 100%        | Art. 7º, I, b   |
| BB IMA-B 5+         | 13,81%       | 100%        | Art. 7º, I, b   |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA   | 13,88%       | 100%        | Art. 7º, I, b   |
| BB AÇÕES BOLSA      | 8,29%        | 20%         | Art. 8º, I      |
| BB AÇÕES AGRO       | 2,15%        | 20%         | Art. 8º, I      |
| BB TECNOLOGIA       | 1,01%        | 20%         | Art. 8º, I      |
| BB ENERGIA          | 1,82%        | 20%         | Art. 8º, I      |
| BB SMALL CAPS       | 1,18%        | 20%         | Art. 8º, I      |
| BB RETORNO AÇÕES    | 1,41%        | 20%         | Art. 8º, I      |
| BB CONSUMO          | 1,04%        | 20%         | Art. 8º, I      |
| BB SETOR FINANCEIRO | 1,28%        | 20%         | Art. 8º, I      |
| BB CONSTRUÇÃO CIVIL | 0,82%        | 20%         | Art. 8º, I      |
| CAIXA IRF-M         | 5,49%        | 100%        | Art. 7º, I, b   |
| CAIXA IRF-M1 TP     | 5,09%        | 100%        | Art. 7º, I, b   |
| CAIXA IMA-B 5+      | 13,62%       | 100%        | Art. 7º, I, b   |
| SICREDI IRF-M LP    | 6,26%        | 20%         | Art. 7º, III, a |
| BI - MASSA FALIDA   | 0,84%        | 0%          | 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%  |
| Maio      | 0,76%         | 0,88% | 85,89%   |
| Junho     | -2,16%        | 1,08% | -199,60% |
| Julho     |               |       |          |
| Agosto    |               |       |          |
| Setembro  |               |       |          |
| Outubro   |               |       |          |
| Novembro  |               |       |          |
| Dezembro  |               |       |          |
| Acumulado | -0,54%        | 8,11% | -6,68%   |

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -0,54%, enquanto que a meta acumulada no período é de 8,11%, sendo assim o RPPS atingiu -6,68% 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 TP         | 3.591.867,27         | 77.760,16         | 0,32%        |
| BB IPCA             | 1.743.800,41         | 19.393,44         | 0,08%        |
| BB IMA-B 5+         | 3.349.136,66         | 117.821,11        | 0,49%        |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA   | 3.365.982,27         | 36.727,22         | 0,15%        |
| BB AÇÕES BOLSA      | 2.008.995,49         | 277.996,65        | 1,15%        |
| BB AÇÕES AGRO       | 521.591,02           | 68.457,52         | 0,28%        |
| BB TECNOLOGIA       | 245.314,83           | 38.349,02         | 0,16%        |
| BB ENERGIA          | 440.386,50           | 39.018,19         | 0,16%        |
| BB SMALL CAPS       | 286.253,73           | 52.604,91         | 0,22%        |
| BB RETORNO AÇÕES    | 341.531,90           | 44.737,91         | 0,18%        |
| BB CONSUMO          | 252.816,41           | 42.726,18         | 0,18%        |
| BB SETOR FINANCEIRO | 309.505,16           | 45.040,67         | 0,19%        |
| BB CONSTRUÇÃO CIVIL | 199.458,10           | 34.173,59         | 0,14%        |
| CAIXA IRF-M         | 1.330.688,16         | 20.986,84         | 0,09%        |
| CAIXA IRF-M1 TP     | 1.233.535,05         | 9.229,32          | 0,04%        |
| CAIXA IMA-B 5+      | 3.302.772,77         | 116.740,00        | 0,48%        |
| SICREDI IRF-M LP    | 1.518.816,53         | 24.927,70         | 0,10%        |
| BI - MASSA FALIDA   | 204.161,91           | 0,00              | 0,00%        |
| <b>Carteira</b>     | <b>24.246.614,17</b> | <b>805.893,16</b> | <b>3,32%</b> |

**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 TP         | -      |
| BB IPCA             | -      |
| BB IMA-B 5+         | -      |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA   | -      |
| 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         | -      |
| CAIXA IRF-M1 TP     | -      |
| CAIXA IMA-B 5+      | -      |
| SICREDI IRF-M LP    | -      |
| BI - MASSA FALIDA   | -      |