



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

ATA DA SEXTA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 15 DE JUNHO DE 2022.

Aos (15) quinze dias do mês de junho 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, Simone Almeida da Silva, Vanila Garcia Belo, Rogério Luiz de Paulo e Robson Jesus da Silva. O Presidente 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 julho; 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 maio/2022 elaborada pela Assessoria Kansai. Os membros 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 fevereiro, o valor será resgatado de um fundo da Caixa Econômica Federal.

As aplicações dos parcelamentos e repasses previdenciários da Câmara e da Prefeitura serão 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, 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**

Inflação persistente, eleição, guerra e outros fatores globais tem mantido o mercado financeiro bastante volátil e estressado.

O presidente agrade a todos e convoca para o dia 21 de julho 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

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

Maio/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	3.406.117,44	0,93%	0,88%	104,86%
BB IPCA	1.738.107,77	0,52%	0,88%	59,37%
BB IMA-B 5+	3.286.144,04	1,11%	0,88%	125,73%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.354.928,48	0,79%	0,88%	90,02%
BB AÇÕES BOLSA	2.170.562,99	0,70%	0,88%	79,28%
BB AÇÕES AGRO	493.429,76	3,11%	0,88%	351,96%
BB TECNOLOGIA	268.530,84	-5,33%	0,88%	-603,95%
BB ENERGIA	464.087,10	-0,45%	0,88%	-50,83%
BB SMALL CAPS	342.862,28	-2,29%	0,88%	-259,64%
BB RETORNO AÇÕES	387.382,17	2,92%	0,88%	331,11%
BB CONSUMO	295.594,81	-3,13%	0,88%	-354,13%
BB SETOR FINANCEIRO	343.891,86	6,10%	0,88%	691,21%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	226.862,83	-4,44%	0,88%	-502,70%
CAIXA IRF-M	1.326.123,61	0,59%	0,88%	66,73%
CAIXA IRF-M1 TP	1.866.292,65	0,77%	0,88%	87,17%
CAIXA IMA-B 5+	3.339.501,96	1,14%	0,88%	128,76%
SICREDI IRF-M LP	1.513.975,42	0,64%	0,88%	72,12%
TOTAL / MÉDIA	24.824.396,01	0,76%	0,88%	86,44%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,72%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	7,00%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	13,24%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	13,51%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	8,74%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	1,99%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,08%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,87%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,38%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,56%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	1,19%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	1,39%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	0,91%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	5,34%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	7,52%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	13,45%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	6,10%	20%	Art. 7º, III, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,52%	0,95%	-54,43%
Fevereiro	-0,24%	1,42%	-16,50%
Março	3,10%	2,04%	152,23%
Abril	-1,40%	1,47%	-95,12%
Maio	0,76%	0,88%	86,44%
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	1,66%	6,95%	23,86%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 1,66%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,95%, sendo assim o RPPS atingiu 23,86% 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	3.406.117,44	75.046,12	0,30%
BB IPCA	1.738.107,77	17.029,26	0,07%
BB IMA-B 5+	3.286.144,04	115.216,21	0,46%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.354.928,48	35.187,56	0,14%
BB AÇÕES BOLSA	2.170.562,99	249.307,97	1,00%
BB AÇÕES AGRO	493.429,76	34.345,09	0,14%
BB TECNOLOGIA	268.530,84	35.948,20	0,14%
BB ENERGIA	464.087,10	36.365,30	0,15%
BB SMALL CAPS	342.862,28	42.444,01	0,17%
BB RETORNO AÇÕES	387.382,17	32.638,82	0,13%
BB CONSUMO	295.594,81	36.096,99	0,15%
BB SETOR FINANCEIRO	343.891,86	35.982,26	0,14%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	226.862,83	35.191,63	0,14%
CAIXA IRF-M	1.326.123,61	20.171,97	0,08%
CAIXA IRF-M1 TP	1.866.292,65	5.335,01	0,02%
CAIXA IMA-B 5+	3.339.501,96	117.464,35	0,47%
SICREDI IRF-M LP	1.513.975,42	24.574,84	0,10%
Carteira	24.824.396,01	719.399,09	2,90%

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+	0,00
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+	0,00
SICREDI IRF-M LP	-