



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

ATA DA TERCEIRA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 17 DE MARÇO DE 2022.

Aos (17) dezessete dias do mês de março 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 abril; 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 fevereiro/2022 elaborada pela Assessoria Kansai, cuja meta é 2,39% e a rentabilidade se encontra negativa em -0,75%. 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



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

permitido pela legislação e a política de investimentos, depois de consultarmos Assessoria Financeira e membros deste Comitê.

Todos concordaram que as aplicações do Previm estão diversificadas e que a média da rentabilidade negativa se justifica devido a inflação local e mundial pós-pandemia e a guerra da Ucrânia/Rússia. Mesmo assim, o Brasil tem sido recentemente beneficiado com bilhões de reais em investimento estrangeiro devido aos juros altos em renda fixa e a bolsa (B3) barata, fazendo o dólar cair.

Marcelo encerrou a reunião e convocou para o dia 20 de abril 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

Março/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	3.396.340,04	3,07%	2,04%	150,90%
BB IPCA	1.740.082,23	2,41%	2,04%	118,39%
BB IMA-B 5+	2.747.004,84	3,52%	2,04%	172,89%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.012.874,04	1,34%	2,04%	65,89%
BB AÇÕES BOLSA	2.359.471,01	4,72%	2,04%	231,87%
BB AÇÕES AGRO	497.170,90	7,70%	2,04%	377,97%
BB TECNOLOGIA	309.266,41	3,75%	2,04%	184,13%
BB ENERGIA	477.726,32	8,46%	2,04%	415,47%
BB SMALL CAPS	382.218,22	9,42%	2,04%	462,59%
BB RETORNO AÇÕES	408.254,99	5,51%	2,04%	270,49%
BB CONSUMO	355.681,23	5,46%	2,04%	268,09%
BB SETOR FINANCEIRO	358.381,26	7,36%	2,04%	361,06%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	254.307,47	5,60%	2,04%	274,86%
CAIXA IRF-M	1.320.635,64	0,85%	2,04%	41,87%
CAIXA IRF-M1 TP	1.858.982,54	0,79%	2,04%	38,66%
CAIXA IMA-B 5+	3.300.469,61	3,53%	2,04%	173,28%
SICREDI IRF-M LP	1.506.144,57	1,04%	2,04%	50,97%
TOTAL / MÉDIA	24.285.011,32	3,10%	2,04%	152,23%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,99%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	7,17%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	11,31%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	12,41%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	9,72%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,05%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,27%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,97%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,57%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,68%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	1,46%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	1,48%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,05%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	5,44%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	7,65%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	13,59%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	6,20%	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			
Maio			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	2,33%	4,48%	51,94%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 2,33%, enquanto que a meta acumulada no período é de 4,48%, sendo assim o RPPS atingiu 51,94% 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	3.396.340,04	73.452,84	0,30%
BB IPCA	1.740.082,23	17.002,63	0,07%
BB IMA-B 5+	2.747.004,84	94.285,52	0,39%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.012.874,04	30.797,64	0,13%
BB AÇÕES BOLSA	2.359.471,01	212.793,12	0,88%
BB AÇÕES AGRO	497.170,90	37.095,33	0,15%
BB TECNOLOGIA	309.266,41	37.824,45	0,16%
BB ENERGIA	477.726,32	38.983,84	0,16%
BB SMALL CAPS	382.218,22	52.192,97	0,21%
BB RETORNO AÇÕES	408.254,99	36.219,77	0,15%
BB CONSUMO	355.681,23	45.935,19	0,19%
BB SETOR FINANCEIRO	358.381,26	38.623,97	0,16%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	254.307,47	46.560,67	0,19%
CAIXA IRF-M	1.320.635,64	20.874,05	0,09%
CAIXA IRF-M1 TP	1.858.982,54	5.651,99	0,02%
CAIXA IMA-B 5+	3.300.469,61	112.458,66	0,46%
SICREDI IRF-M LP	1.506.144,57	26.608,96	0,11%
Carteira	24.285.011,32	673.415,01	2,77%

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	0,01
BB IPCA	0,02
BB IMA-B 5+	0,01
BB ALOCAÇÃO ATIVA	0,01
BB AÇÕES BOLSA	-
BB AÇÕES AGRO	-
BB TECNOLOGIA	-
BB ENERGIA	-
BB SMALL CAPS	-
BB RETORNO AÇÕES	-
BB CONSUMO	-