



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

ATA DA TERCEIRA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 09 DE JULHO DE 2020.

Aos (09) nove dias do mês de julho de 2020, na Sala de Reuniões da Sede do PREVIM, com início às 9h, reuniram-se os membros do Comitê de Investimento do Instituto 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 inicia cumprimentando os membros 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 agosto de 2020; 2 – Aplicações dos repasses que entrarem na conta corrente e 3 – Outros assuntos conforme ata.

A secretária Vanila informa que houve um erro na ata anterior em que foi redigido no início daquela, o mês de maio, e o correto seria junho. Em seguida, o presidente apresentou a Planilha de rentabilidade dos fundos de investimentos referente às aplicações do mês de junho/2020. Apresentou também as demais informações financeiras contidas no Relatório de Consultoria (anexo) e Carteiras Sugeridas da Caixa Econômica e do Banco do Brasil. Relata também que a recuperação dos ativos desde a queda provocada pela pandemia do COVID-19, em especial, tem sido satisfatória, mas ainda poderá haver volatilidade pelas incertezas sobre vacinas e projeções muito menores do PIB mundial e do Brasil para 2020.

Os membros do Comitê decidiram que o resgate para pagamento dos beneficiários e despesas administrativas referente ao mês de julho será resgatado no início do mês de agosto, de um fundo da CAIXA Econômica Federal.

Ficou autorizado também que a aplicação dos repasses previdenciários da Câmara e da Prefeitura serão em fundos que o Previm já possui e que tenham melhor perspectiva de rentabilidade positiva no momento, nos Bancos Caixa



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

Econômica Federal ou Banco do Brasil. As compensações previdenciárias (COMPREV) creditadas na conta 24092-3 do Banco do Brasil serão aplicadas no BB AÇÕES SETOR FINANCEIRO. 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.

Finalizando, o presidente pediu que reforcem os estudos sobre CPA10/CGRPPS pois em breve as provas estarão liberadas e os membros precisam estar certificados e agradeceu a presença de todos convocando, para o dia 13 de agosto a próxima reunião. Lavrou-se esta ata que vai assinada por todos os membros do Comitê


MEMBROS DO COMITÊ DE INVESTIMENTO


MARCELO ALVES DE FREITAS – CPF: 420.970.101-72

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


SIMONE ALMEIDA DA SILVA – CPF: 962.739.761-04

Membro, Proponente das APRs e Certificação APIMEC


VANILA GARCIA BELO – CPF: 034.308.601-80

Secretária do Comitê


ROGERIO LUIZ DE PAULO- CPF: 596.115.291-04

Membro, Liquidador das APRs e Certificação ANBIMA


ROBSON JESUS DA SILVA - CPF: 712.961.401-30

Membro

2. RENTABILIDADE MÉDIA **4. GERENCIAMENTO DE RISCO**

Junho/2020				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.224.287,29	2,03%	0,75%	271,56%
BB IPCA TP	1.660.501,12	1,14%	0,75%	152,86%
BB IRF-M1	0,00	0,03%	0,75%	4,39%
BB IMA-B 5+	1.408.514,52	2,80%	0,75%	374,33%
BB Alocacao Ativa	3.427.350,97	0,95%	0,75%	126,83%
Caixa IRF-M1-	0,00	0,47%	0,75%	63,16%
Caixa IMA-B 5+	3.623.695,15	2,83%	0,75%	377,96%
Sicredi IRF-M	1.493.289,21	0,96%	0,75%	128,07%
BB Ações Tecnologia	292.734,75	7,64%	0,75%	###
BB Ações Energia	418.642,18	4,08%	0,75%	545,17%
BB Ações Small Caps	351.471,02	13,39%	0,75%	###
BB Ações Retorno Total	380.440,53	6,53%	0,75%	872,54%
BB Ações Consumo	415.715,36	9,92%	0,75%	###
BB Ações Set Financeiro	136.375,48	10,97%	0,75%	###
BB Ações Construção Civil	322.945,15	18,35%	0,75%	###
Caixa IRF-M	447.703,27	0,58%	0,75%	77,13%
Caixa IRF-M1	1.252.126,90	0,14%	0,75%	18,69%
TOTAL / MÉDIA	17.855.792,90	2,63%	0,75%	351,83%

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	2.224.287,29	199.575,26	1,12%
BB IPCA TP	1.660.501,12	71.929,90	0,40%
BB IRF-M1	0,00	0,00	0,00%
BB IMA-B 5+	1.408.514,52	194.691,08	1,09%
BB Alocacao Ativa	3.427.350,97	150.814,53	0,84%
Caixa IRF-M1+	0,00	0,00	0,00%
Caixa IMA-B 5+	3.623.695,15	503.488,17	2,82%
Sicredi IRF-M	1.493.289,21	11.632,35	0,07%
BB Ações Tecnologia	292.734,75	72.774,09	0,41%
BB Ações Energia	418.642,18	107.952,47	0,60%
BB Ações Small Caps	351.471,02	117.917,16	0,66%
BB Ações Retorno Total	380.440,53	106.223,99	0,59%
BB Ações Consumo	415.715,36	134.377,38	0,75%
BB Ações Set Financeiro	136.375,48	43.885,57	0,25%
BB Ações Construção Civil	322.945,15	136.413,05	0,76%
Caixa IRF-M	447.703,27	19.069,62	0,11%
Caixa IRF-M1	1.252.126,90	4.596,48	0,03%
Carteira	17.855.792,90	1.708.693,35	9,57%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	12,46%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA TP	9,30%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	0,00%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	7,89%	20%	Art. 7º, I, b
BB Alocacao Ativa	19,19%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1-	0,00%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B 5+	20,29%	20%	Art. 7º, I, b
Sicredi IRF-M	8,36%	20%	Art. 7º, III, a
BB Ações Tecnologia	1,64%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Energia	2,34%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Small Caps	1,97%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Retorno Total	2,13%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Consumo	2,33%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Set Financeiro	0,76%	20%	Art. 8º, II, a
BB Ações Construção Civil	1,81%	20%	Art. 8º, II, a
Caixa IRF-M	2,51%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1	7,01%	20%	Art. 7º, I, 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.

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	-0,33%	0,70%	-46,59%
Fevereiro	-0,84%	0,74%	-113,27%
Março	-8,32%	0,56%	-1493,85%
Abril	2,13%	0,18%	1215,91%
Maior	1,74%	0,10%	1655,39%
Junho	2,63%	0,75%	351,83%
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	-3,38%	3,07%	-109,97%

Fundo	Sharpe
BB IMA-B	0,04
BB IPCA TP	0,04
BB IRF-M1	0,06
BB IMA-B 5+	0,03
BB Alocacao Ativa	0,04
Caixa IRF-M1+	0,03
Caixa IMA-B 5+	0,03
Sicredi IRF-M	0,08
BB Ações Tecnologia	-
BB Ações Energia	-
BB Ações Small Caps	0,03
BB Ações Retorno Total	-
BB Ações Consumo	-
BB Ações Set Financeiro	0,02
BB Ações Construção Civil	0,03
Caixa IRF-M	0,03
Caixa IRF-M1	0,07

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de -3,38%, enquanto que a meta acumulada no período é de 3,07%, sendo assim o RPPS atingiu -109,97% da meta atuarial

Maw

B