



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

### **ATA DA QUINTA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 19 DE MAIO DE 2022.**

Aos (19) dezoito dias do mês de maio 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 junho; 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 abril/2022 elaborada pela Assessoria Kansai, observando a dificuldade da rentabilidade de atingir a meta, mesmo estando bastante diversificado, com 17 fundos. 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.

Questões doméstica e globais tem deixado o mercado financeiro estressado e receoso quanto ao curto prazo. Manter o patrimônio e aproveitar oportunidade nos parece a melhor alternativa no momento.

Os membros do comitê foram convocados para o dia 15 de junho 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

ABRIL/2022				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	3.374.884,22	0,84%	1,47%	56,98%
BB IPCA	1.778.862,72	2,23%	1,47%	151,10%
BB IMA-B 5+	3.250.081,94	0,09%	1,47%	6,43%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.028.485,43	0,52%	1,47%	35,13%
BB AÇÕES BOLSA	2.155.480,99	-8,65%	1,47%	-586,16%
BB AÇÕES AGRO	478.564,63	-3,74%	1,47%	-253,73%
BB TECNOLOGIA	274.095,19	-11,37%	1,47%	-771,04%
BB ENERGIA	466.178,19	-2,42%	1,47%	-163,89%
BB SMALL CAPS	350.902,71	-8,19%	1,47%	-555,48%
BB RETORNO AÇÕES	376.383,76	-7,81%	1,47%	-529,28%
BB CONSUMO	305.130,98	-14,21%	1,47%	-963,57%
BB SETOR FINANCEIRO	324.119,98	-11,91%	1,47%	-807,38%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	237.394,83	-6,65%	1,47%	-450,89%
CAIXA IRF-M	1.318.360,15	-0,17%	1,47%	-11,68%
CAIXA IRF-M1 TP	1.901.663,58	0,67%	1,47%	45,51%
CAIXA IMA-B 5+	3.301.979,85	0,05%	1,47%	3,10%
SICREDI IRF-M LP	1.504.400,61	-0,12%	1,47%	-7,85%
TOTAL / MÉDIA	24.426.969,76	-1,40%	1,47%	-95,12%

### 2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	13,82%	20%	Art. 7º, III, a
BB IPCA	7,28%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	13,31%	100%	Art. 7º, I, b
BB ALOCAÇÃO ATIVA	12,40%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	8,82%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	1,96%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,12%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,91%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,44%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,54%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	1,25%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	1,33%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	0,97%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	5,40%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	7,79%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	13,52%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	6,16%	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			
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	0,89%	6,02%	14,78%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 0,89%, enquanto que a meta acumulada no período é de 6,02%, sendo assim o RPPS atingiu 14,78% 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	3.374.884,22	73.034,32	0,30%
BB IPCA	1.778.862,72	16.858,72	0,07%
BB IMA-B 5+	3.250.081,94	112.564,48	0,46%
BB ALOCAÇÃO ATIVA	3.028.485,43	31.190,17	0,13%
BB AÇÕES BOLSA	2.155.480,99	216.867,13	0,89%
BB AÇÕES AGRO	478.564,63	31.975,40	0,13%
BB TECNOLOGIA	274.095,19	35.129,36	0,14%
BB ENERGIA	466.178,19	35.382,52	0,14%
BB SMALL CAPS	350.902,71	44.508,74	0,18%
BB RETORNO AÇÕES	376.383,76	30.913,09	0,13%
BB CONSUMO	305.130,98	36.651,58	0,15%
BB SETOR FINANCEIRO	324.119,98	33.418,60	0,14%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	237.394,83	40.446,83	0,17%
CAIXA IRF-M	1.318.360,15	20.176,53	0,08%
CAIXA IRF-M1 TP	1.901.663,58	5.590,78	0,02%
CAIXA IMA-B 5+	3.301.979,85	114.290,68	0,47%
SICREDI IRF-M LP	1.504.400,61	25.263,61	0,10%
Carteira	24.426.969,76	681.527,57	2,79%

##### 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	0,02
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	-