



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

ATA DA PRIMEIRA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 23 DE JANEIRO DE 2020.

Aos (23) vinte e três dias do mês de janeiro 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 conforme RESOLUÇÃO Nº 04 DE 16 DE JANEIRO DE 2018. Estavam presentes os seguintes membros: Marcelo Alves de Freitas, Simone Almeida da Silva, Vanila Garcia Belo, Rogério Luiz de Paulo e Lilian Aparecida de Souza. Dando início a reunião, Marcelo apresentou o Decreto Municipal nº 569, de 09 de janeiro de 2020 em que o mandato dos Conselheiros e Diretoria Executiva foram renovados até 30 de abril de 2020 e a Resolução do Previm Nº 003, de 23 de janeiro de 2020 nomeando os membros do Comitê de Investimento. Assim, Marcelo A. de Freitas é nomeado Presidente do Comitê e Vanila Garcia Belo, Secretária. O presidente 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 fevereiro de 2020; 2 – Aplicações dos repasses que entrarem na conta corrente e 3 – Outros assuntos conforme ata.

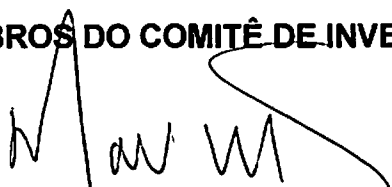
Em seguida, o presidente apresentou a Planilha de rentabilidade dos fundos de investimentos referente às aplicações do mês de dezembro. Apresentou também as demais informações financeiras contidas no Relatório de Consultoria (anexo), confirmando uma ótima rentabilidade da carteira no ano de 2019.

Os membros do Comitê decidiram que o resgate para pagamento dos beneficiários e despesas administrativas referente ao mês de janeiro será resgatado no início do mês de fevereiro do fundo CAIXA BRASIL IRF M1+. Ficou autorizado também a aplicação dos repasses previdenciários da Câmara, da Prefeitura e da Compensação Previdenciária nos fundos em que o Previm

Assinatura

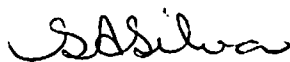
possui e que tenha melhor perspectiva de rentabilidade positiva naquele momento, nos Bancos Caixa Econômica Federal e Banco do Brasil e que não haverá investimentos no Banco Sicredi, por enquanto. Decidiu-se manter as aplicações nos Fundos IMAs e IRFMs e migrar toda aplicação da conta 24092-3 do Banco do Brasil, no limite de até 03 (três) milhões de reais, divididos em fundos de ações do próprio Banco do Brasil, cujos fundos, previamente analisados, são os seguintes: BB AÇÕES TECNOLOGIA, BB AÇÕES ENERGIA, BB AÇÕES SMALL CAPS, BB AÇÕES RETORNO TOTAL, BB AÇÕES CONSUMO, BB AÇÕES CONSTRUÇÃO CIVIL E BB AÇÕES SETOR FINANCEIRO. As próximas compensações previdenciárias (COMPREV) creditadas na referida conta, poderão ser aplicadas no BB AÇÕES SETOR FINANCEIRO. O presidente ressalta que as aplicações em renda variável também foram autorizadas pelo Conselho Administrativo através da Ata da Reunião Extraordinária 01/2020-PREVIM e constam na Política Anual de Investimentos para 2020. As transferências entre os fundos poderão ser realizadas na medida em que o mercado indicar a necessidade da operação. Finalizando, o presidente agradeceu a presença de todos convocando para o dia 13 de fevereiro de 2020 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

Presidente do Comitê, Gestor de Recursos e Certificação ANBIMA



SIMONE ALMEIDA DA SILVA

Membro e Certificação APIMEC



VANILA GARCIA BELO

Secretária do Comitê




ROGERIO LUIZ DE PAULO

Membro e Certificação ANBIMA


LILIAN APARECIDA DE SOUZA
Membro



1. RENTABILIDADE MÉDIA

Dezembro/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.268.351,76	2,01%	1,64%	122,44%
BB IPCA TP	1.636.996,08	1,45%	1,64%	88,41%
BB IRF-M1	481.161,09	0,33%	1,64%	20,26%
BB IMA-B 5+	1.432.952,31	2,72%	1,64%	165,69%
BB Alocacao Ativa	3.368.396,13	0,96%	1,64%	58,38%
BB IMA-B 5+	2.941.778,31	2,70%	1,64%	164,32%
Caixa IRF-M1+	2.207.899,98	0,45%	1,64%	27,51%
Caixa IMA-B 5+	2.439.372,88	2,56%	1,64%	155,64%
Sicredi IRF-M	1.424.154,00	0,63%	1,64%	38,43%
TOTAL / MÉDIA	18.201.062,54	1,50%	1,64%	91,32%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	12,46%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA TP	8,99%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	2,64%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	7,87%	20%	Art. 7º, I, b
BB Alocacao Ativa	18,51%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	16,16%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	12,13%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B 5+	13,40%	20%	Art. 7º, I, b
Sicredi IRF-M	7,82%	20%	Art. 7º, III, a

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	4,44%	0,81%	549,50%
Fevereiro	-0,49%	0,92%	-53,43%
Março	0,40%	1,24%	32,14%
Abril	0,96%	1,06%	90,77%
Mai	2,34%	0,62%	378,91%
Junho	2,71%	0,50%	546,41%
Julho	1,10%	0,68%	162,88%
Agosto	-0,21%	0,60%	-34,43%
Setembro	2,32%	0,45%	519,25%
Outubro	2,68%	0,59%	456,96%
Novembro	-1,90%	1,00%	-189,77%
Dezembro	1,50%	1,64%	91,32%
Acumulado	16,89%	10,56%	159,87%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 16,89%, enquanto que a meta acumulada no período é de 10,56%, sendo assim o RPPS atingiu 159,87% 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	2.268.351,76	52.336,99	0,29%
BB IPCA TP	1.636.996,08	19.763,90	0,11%
BB IRF-M1	481.161,09	576,47	0,00%
BB IMA-B 5+	1.432.952,31	49.069,29	0,27%
BB Alocacao Ativa	3.368.396,13	35.408,97	0,19%
BB IMA-B 5+	2.941.778,31	100.736,75	0,55%
Caixa IRF-M1+	2.207.899,98	1.269,44	0,01%
Caixa IMA-B 5+	2.439.372,88	23.022,26	0,13%
Sicredi IRF-M	1.424.154,00	7.582,63	0,04%
Carteira	18.201.062,54	280.660,74	1,54%

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	0,03
BB IPCA TP	0,05
BB IRF-M1	0,02
BB IMA-B 5+	0,03
BB Alocacao Ativa	0,03
BB IMA-B 5+	0,03
Caixa IRF-M1+	0,01
Caixa IMA-B 5+	0,03
Sicredi IRF-M	0,01

Handwritten signatures and initials:
Mau
SABIANA
J. J.