



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

ATA DA OITAVA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 17 DE AGOSTO DE 2023.

Aos (17) dezessete dias do mês de agosto de 2023, 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, Lilian Aparecida de Souza, Vanila Garcia Belo, Rogério Luiz de Paulo e Robson Jesus da Silva. O presidente agrade a presença de todos e logo 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 setembro de 2023; 2 – Aplicações dos repasses que entrarem na conta corrente e 3 – Outros assuntos conforme ata.

Em seguida, a secretária do COI, Vanila apresentou a Planilha de rentabilidade dos fundos de investimentos do Previm referente às aplicações do mês de julho/2023, ressaltando a excelente rentabilidade até o momento e que a meta da política de investimento foi alcançada. Em seguida, apresentou as demais informações financeiras contidas no Relatório de Consultoria (anexo).

Em relação ao pagamento dos salários dos beneficiários do referente mês de agosto/23, o valor será resgatado de um fundo da Caixa Econômica Federal.

Ficou autorizado também que a aplicação dos repasses previdenciários da Câmara e da Prefeitura serão nos fundos que o Previm já possui e que tenham melhor perspectiva de rentabilidade positiva no momento, 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 já existentes na carteira, observando os cuidados e os limites para essa categoria de investimentos ou no fundo BB IRF M1. 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.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

Sem mais assunto, o presidente agradece a presença de todos e encerra a reunião convocando, para o dia 14 de setembro de 2023 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

LILIAN APARECIDA DE SOUSA

Membro

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 e Proponente das APRs

1. RENTABILIDADE MÉDIA

Julho/2023				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	5.380.350,95	0,78%	0,50%	156,31%
BB IRF-M	2.400.025,31	0,76%	0,50%	151,66%
BB IMA-B 5+	4.975.857,19	0,73%	0,50%	144,75%
BB RETORNO TOTAL	4.713.529,35	0,76%	0,50%	151,39%
BB AÇÕES BOLSA	2.546.542,97	3,28%	0,50%	654,81%
BB AÇÕES AGRO	795.195,60	3,98%	0,50%	792,95%
BB TECNOLOGIA	525.583,42	2,44%	0,50%	485,60%
BB ENERGIA	511.083,35	-0,79%	0,50%	-157,54%
BB SMALL CAPS	597.781,64	3,62%	0,50%	721,27%
BB RETORNO AÇÕES	378.953,30	4,53%	0,50%	903,50%
BB CONSUMO	304.540,80	2,16%	0,50%	431,26%
BB SETOR FINANCEIRO	786.990,50	1,29%	0,50%	256,99%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	526.600,30	5,04%	0,50%	1005,74%
CAIXA IRF-M	180.200,68	0,88%	0,50%	175,95%
CAIXA IRF-M1 TP	983.558,31	0,92%	0,50%	183,51%
CAIXA IMA-B 5+	4.714.122,66	0,74%	0,50%	147,08%
SICREDI IRF-M LP	1.782.858,68	0,95%	0,50%	188,86%
BI - MASSA FALIDA	208.817,62	0,16%	0,50%	31,52%
TOTAL / MÉDIA	32.312.592,63	1,23%	0,50%	245,07%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	16,65%	20%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M	7,43%	100%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	15,40%	100%	Art. 7º, I, b
BB RETORNO TOTAL	14,59%	100%	Art. 7º, I, b
BB AÇÕES BOLSA	7,88%	20%	Art. 8º, I
BB AÇÕES AGRO	2,46%	20%	Art. 8º, I
BB TECNOLOGIA	1,63%	20%	Art. 8º, I
BB ENERGIA	1,58%	20%	Art. 8º, I
BB SMALL CAPS	1,85%	20%	Art. 8º, I
BB RETORNO AÇÕES	1,17%	20%	Art. 8º, I
BB CONSUMO	0,94%	20%	Art. 8º, I
BB SETOR FINANCEIRO	2,44%	20%	Art. 8º, I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	1,63%	20%	Art. 8º, I
CAIXA IRF-M	0,56%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IRF-M1 TP	3,04%	100%	Art. 7º, I, b
CAIXA IMA-B 5+	14,59%	100%	Art. 7º, I, b
SICREDI IRF-M LP	5,52%	20%	Art. 7º, III, a
BI - MASSA FALIDA	0,65%	0%	Não enquadrado

3. COMPARATIVO COM A META ATUARIAL

	Rentabilidade	Meta	% Meta
Janeiro	0,91%	0,92%	98,20%
Fevereiro	-0,10%	1,22%	-8,22%
Março	2,04%	1,09%	186,81%
Abril	1,90%	0,99%	190,76%
Mai	3,20%	0,61%	523,45%
Junho	3,35%	0,30%	###
Julho	1,23%	0,50%	245,07%
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	13,18%	5,77%	228,49%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 13,18%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,77%, sendo assim o RPPS atingiu 228,49% 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	5.380.350,95	91.974,43	0,28%
BB IRF-M	2.400.025,31	25.391,90	0,08%
BB IMA-B 5+	4.975.857,19	128.469,36	0,40%
BB RETORNO TOTAL	4.713.529,35	36.882,95	0,11%
BB AÇÕES BOLSA	2.546.542,97	142.475,93	0,44%
BB AÇÕES AGRO	795.195,60	59.993,59	0,19%
BB TECNOLOGIA	525.583,42	42.368,67	0,13%
BB ENERGIA	511.083,35	37.243,56	0,12%
BB SMALL CAPS	597.781,64	67.518,34	0,21%
BB RETORNO AÇÕES	378.953,30	32.513,12	0,10%
BB CONSUMO	304.540,80	35.344,59	0,11%
BB SETOR FINANCEIRO	786.990,50	77.418,64	0,24%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL	526.600,30	67.018,35	0,21%
CAIXA IRF-M	180.200,68	1.911,89	0,01%
CAIXA IRF-M1 TP	983.558,31	1.557,61	0,00%
CAIXA IMA-B 5+	4.714.122,66	118.741,69	0,37%
SICREDI IRF-M LP	1.782.858,68	18.893,98	0,06%
BI - MASSA FALIDA	208.817,62	0,00	0,00%
Carteira	32.312.592,63	675.452,99	2,09%

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	-
BB IRF-M	-
BB IMA-B 5+	-
BB RETORNO TOTAL	-
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	-
BI - MASSA FALIDA	-