



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE PARANAÍBA - MS

ATA DA OITAVA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO PREVIM, REALIZADA EM 15 DE AGOSTO DE 2019.

Aos (15) dias do mês de agosto de 2019, 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, 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 setembro 2019; 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 julho, informando que a rentabilidade do PL do Previm está superando da meta atuarial até o momento, com ótimo superávit. Apresentou também as demais informações financeiras contidas no Relatório de Consultoria em ANEXO.

Os membros do Comitê decidiram que o resgate para pagamento dos beneficiários referente ao mês de agosto de 2019 será do fundo CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ ou do CAIXA BRASIL IMA B 5+. Ficou autorizado também a aplicação dos repasses previdenciários da Câmara, da Prefeitura e da Compensação Previdenciária nos fundos em que o Previm já possui e que tenha melhor perspectiva de rentabilidade positiva naquele momento, nos Bancos Caixa Econômica Federal e Banco do Brasil. Decidiu-se manter as aplicações nos Fundos IMAs e IRFMs bem como as migrações entre eles na medida que o mercado indicar a necessidade da operação. Finalizando, o presidente agradeceu a presença de todos convocando para o dia 19 de setembro de 2019

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

Julho/2019				
Nome do Fundo	Aplicação	Rentabilidade	Meta	% Meta
BB IMA-B	2.154.957,38	1,25%	0,68%	184,00%
BB IPCA TP	1.601.138,49	1,08%	0,68%	159,49%
BB IRF-M1	4.097.763,55	0,70%	0,68%	103,17%
BB IMA-B 5+	1.286.951,68	1,49%	0,68%	220,11%
BB Alocacao Ativa	4.222.463,59	1,02%	0,68%	150,09%
BB IMA-B 5+	2.687.032,73	1,49%	0,68%	220,11%
Caixa IRF-M1+	3.985.849,68	1,27%	0,68%	187,14%
Caixa IMA-B 5+	848.772,77	0,45%	0,68%	65,88%
Sicredi IRF-M	1.377.436,71	1,15%	0,68%	170,13%
TOTAL / MÉDIA	22.262.366,58	1,10%	0,68%	162,88%

2. ENQUADRAMENTO

Nome do Fundo	% PL do RPPS	% Resolução	Enquadramento
BB IMA-B	9,68%	20%	Art. 7º, IV, a
BB IPCA TP	7,19%	20%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M1	18,41%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	5,78%	20%	Art. 7º, I, b
BB Alocacao Ativa	18,97%	20%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B 5+	12,07%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IRF-M1+	17,90%	20%	Art. 7º, I, b
Caixa IMA-B 5+	3,81%	20%	Art. 7º, I, b
Sicredi IRF-M	6,19%	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%
Maio	2,34%	0,62%	378,91%
Junho	2,71%	0,50%	546,41%
Julho	1,10%	0,68%	162,88%
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			
Acumulado	11,96%	5,96%	200,54%

No acumulado do ano a rentabilidade da carteira é de 11,96%, enquanto que a meta acumulada no período é de 5,96%, sendo assim o RPPS atingiu 200,54% 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	2.154.957,38	52.714,29	0,24%
BB IPCA TP	1.601.138,49	23.812,95	0,11%
BB IRF-M1	4.097.763,55	4.981,80	0,02%
BB IMA-B 5+	1.286.951,68	46.475,99	0,21%
BB Alocacao Ativa	4.222.463,59	51.656,50	0,23%
BB IMA-B 5+	2.687.032,73	97.037,45	0,44%
Caixa IRF-M1+	3.985.849,68	60.031,44	0,27%
Caixa IMA-B 5+	848.772,77	30.397,54	0,14%
Sicredi IRF-M	1.377.436,71	15.667,76	0,07%
Carteira	22.262.366,58	366.277,73	1,65%

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	0,04
BB IPCA TP	0,04
BB IRF-M1	0,06
BB IMA-B 5+	0,04
BB Alocacao Ativa	0,04
BB IMA-B 5+	0,04
Caixa IRF-M1+	0,05
Caixa IMA-B 5+	0,04
Sicredi IRF-M	0,05


