

**PREFEITURA MUNICIPAL DE AQUIDAUANA
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE AQUIDAUANA
AQUIDAUANAPREV**

ATA N.º. 010/2020

REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO – MÊS DE OUTUBRO DE 2020

Ao quatorze dias do mês de outubro do ano de dois mil e vinte, às oito horas, na Sala de Reuniões do Instituto de Previdência dos Servidores Públicos de Aquidauana, doravante Aquidauanaprev, sito à Rua Marechal Mallet, 353, Centro, da Cidade de Aquidauana, Estado de Mato Grosso do Sul, reuniram-se os Membros do Comitê de Investimento, convocados pelo Presidente, Gilson S. Menezes, para realização da Reunião Ordinária, com os Membros do Comitê de Investimento, com a seguinte pauta: 1º) aprovação da ata nº 009/2020, do comitê de Investimento, procedeu a leitura da mesma e, não havendo emendas, nem impugnações, foi considerada aprovada a ata nº 009/2020, 2º) Relatório das Aplicações Financeiras do mês de setembro de 2020, 3º) Análise do Relatório de Portfólio, e aplicações financeiras nos fundos de investimentos disponíveis no mercado financeiro. Os trabalhos foram abertos pelo Presidente, Senhor Gilson S. Menezes, que cumprimentou e agradeceu a presença de seus pares e ao Senhor Sergio da Assessoria & Crédito Mercado no qual participou via Web, comunicando, que a senhora Ana Claudia Barcelos, iria secretariar o encontro. Ato contínuo verificou a existência de quorum e declarou aberta a reunião, dando início à reunião passou a palavra ao Senhor Sergio responsável pela gestão dos recursos de investimento do instituto pela assessoria no qual iniciou o comentário sobre a atual situação econômica, e o que tem causado no cenário econômico no mercado interno e externo e com destaques o mercado financeiro quanto as expectativas das eleições americanas, aceleração no desenvolvimento das vacinas contra corona-vírus e o retorno da contaminação do vírus em acessão na Europa e o Brexit, diante disso, apresentou ao comitê o Relatório das Aplicações Financeiras com data base de 30.09.2020 das carteiras de ativos consolidado até o mês de setembro do Instituto, detalhando o resumo a composição das carteiras e no detalhamento dos ativos, conforme Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco, no qual o senhor Sergio demonstrou o Retorno de Investimento e Benchmark's de ativos do Instituto até o mês de setembro de 2020. Relatou que com tudo as turbulências ocorridas no mercado financeiro os retornos obtidos nas aplicações no período foram dentro do esperado devido ao momento financeiro vem passando, que as carteiras estão bem diversificadas e sugere fazer algumas mudanças na composição das carteiras dos fundos que não tem perspectiva de bater meta, para aqueles diminuir o retorno negativos, a fim de buscar o cumprimento de meta no exercício. Como demonstra o quadro à abaixo.



PREFEITURA MUNICIPAL DE AQUIDAUANA
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE AQUIDAUANA
AQUIDAUANAPREV

Ativos Renda Fixa	Saldo Ativo	Ações	Resgates	Debit. Fiscal	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Delimit.	Var. %/12
BB FIM TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.016.634,55	0,00	51.200,00	1.752.696,29	-11.703,28	-0,64%	0,00%	1,33%
CADIA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	1.342.677,10	901.243,00	941.040,25	1.039.688,90	-3.210,25	-0,31%	-0,19%	0,14%
BB IMA-B RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.551.756,65	0,00	0,00	1.527.442,30	-24.314,35	-1,57%	-1,50%	4,15%
CADIA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	6.905.997,59	100.000,00	0,00	6.739.439,07	-166.529,46	-1,54%	-0,50%	4,14%
CADIA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	1.417.609,00	0,00	0,00	1.419.693,06	1.030,05	0,12%	0,18%	0,12%
CADIA BRASIL IMA-B S TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	2.111.296,73	1.100.000,00	0,00	4.203.336,11	-7.999,62	-0,19%	-0,19%	1,65%
BB IDCA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.730.937,97	0,00	0,00	4.736.404,91	5.466,94	0,11%	0,11%	1,25%
CADIA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	6.991,04	0,00	0,00	6.822,67	-168,37	-2,98%	-0,50%	2,50%
CADIA BRASIL IDCA PCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	1.051.642,07	0,00	0,00	1.602.239,65	617,59	0,04%	0,04%	1,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS PCA IN RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	610.036,51	0,00	0,00	619.229,95	1.194,04	0,19%	0,19%	1,16%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO ORÇANICA RENDA FIXA	217.847,69	0,00	0,00	217.343,46	-499,41	-0,22%	-0,20%	0,49%
CADIA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	6.828.974,65	0,00	100.000,00	9.484.484,29	-42.610,98	-0,49%	-0,50%	1,88%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RENDA FIXA PREVIDEN	3.149.552,04	0,00	0,00	3.119.916,07	-27.636,24	-0,88%	0,50%	2,35%
Total Renda Fixa	35.135.094,20	2.161.240,00	1.092.340,35	35.986.692,34	-215.201,59	-0,59%		2,11%

Ativos Renda Variável	Saldo Ativo	Ações	Resgates	Debit. Fiscal	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Delimit.	Var. %/12
BB FIM MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	770.144,91	0,00	0,00	784.218,07	-13.629,64	-1,77%	-1,77%	0,26%
CADIA VALOR RESS. FIC. AÇÕES	4.528.735,65	0,00	1.100.000,00	3.436.038,14	-123.698,51	-2,67%	-2,50%	10,44%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FUNDOS	790.692,70	0,00	0,00	749.650,32	-41.042,38	-4,58%	-4,50%	6,90%
ITAU MOMENTO 30 FIC. AÇÕES	1.249.237,42	0,00	0,00	1.199.023,64	-49.916,76	-4,00%	-4,00%	11,90%
CADIA RY 10 FIM MULTIMERCADO LP	1.494.349,69	0,00	0,00	1.453.653,07	-40.696,61	-2,65%	-2,50%	3,86%
CADIA ALOCAÇÃO MAIOR FIC MULTIMERCADO LP	560.972,37	0,00	0,00	556.972,05	-4.000,32	-0,91%	-0,91%	1,98%

As recomendações sugeridas pelas Instituições Financeiras no qual o Instituto tem vínculos nas carteiras sugeridas e da empresa de assessoria no qual relata em de adotar cautela nos investimentos e acompanhamento diário dos mercados e estratégias, mas sugere uma exposição maior em Renda Variável (Ações – Dividendos, Small/MD CAPS, Ações – Índice Ativo, Multimercado “Conservador”), em Renda Fixa fazer realocação para os fundos IMAB5 e na Gestão Duration em busca de melhores retornos. As mudanças poderão ocorrer de recursos necessários para despesa ou de realocação que seja resgatado dos investimentos menos voláteis como Ações Livres e Ações Valor IMA-B, IRF-M, IRF-M 1+ E Multimercado Alocação, e que os demais recursos ficassem em “quarentena” esperando um melhor momento para realocar ou até mesmo a implementação de uma nova carteira sugerida, segue abaixo o quadro de sugestão de realocação completa.



PREFEITURA MUNICIPAL DE AQUIDAUANA
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE AQUIDAUANA
AQUIDAUANAPREV

CRÉDITO E MERCADO
Consultoria em Investimentos

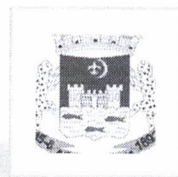
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE AQUIDAUANA - AQUIDAUANA PREV
Relatório de Análise de Portfólio, Sugestão e Realocação - Base: 30/09/2020

RECOMENDAÇÕES GERAIS

Sugestão de Realocação Completa

Origem da Aplicação	Resgate (\$)		Aplicação (\$)	Sugestão de Ativo
AÇÕES - LIVRES	1.500.000,00	→	1.500.000,00	AÇÕES - DIVIDENDOS
AÇÕES - VALOR	1.500.000,00	→	1.500.000,00	AÇÕES - SMALL / MID CAPS
IMA-B	1.400.000,00	→	1.400.000,00	IMA-B 5
IRF-M	650.000,00	→	650.000,00	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO
IRF-M	1.103.606,29	→	1.103.606,29	GESTÃO DURATION
IRF-M 1+	6.922,97	→	6.922,97	GESTÃO DURATION
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.463.653,07	→	1.463.653,07	MULTIMERCADO - CONSERVADOR

Diante do que foi apresentado pelo o Senhor Sergio em relação ao detalhamento dos ativos em ampliar e realocação de aplicações em renda fixa e variável, o senhor Gilson apresentou uma nova carteiras para solicitação de análise junto à assessoria, sendo a carteira ITAU PRIVATE S&P500 – BRL FIC MULTIMERCADO – CNPJ 26.269.692/0001.61, para posterior deliberação ao Conselho Administrativos e realização de futuras movimentação financeiras, relatou ainda aos membros uma posição em relação sugestões sugerias, no qual os membros deliberam que efetuasse as realocações seguindo as sugestões apresentadas pela Instituições Financeiras e pela Assessoria. No qual Ana Claudia Barcelos, deu sequencia a reunião, explanando sobre o Relatório Analítico de Investimentos do mês de setembro no ano de 2020. O relatório apresentou um saldo consolidado de investimentos no final do mês de setembro, 3º Trimestre 2020 o acumulando do total na Carteira de R\$ 50.486.913,73 (Cinquenta milhões, quatrocentos e oitenta e seis mil, novecentos e treze reais e setenta e três centavos) e retorno no mês no valor de R\$ -732.506,53 (Setecentos e trinta e dois mil, quinhentos e seis reais e cinquenta e três centavos), e no acumulado R\$ -227.731,09 (Duzentos e vinte e sete reais, setecentos e trinta e um reais e nove centavos) sendo em Renda Fixa e Renda Variável, vindo apresentar um resultado negativo com a instabilidade no mercado financeiro impacto ainda pela crise que ocasionou uma mudança radical de perspectivas desde que a epidemia do conronavirus e agora de momento o seu retorno em alguns países , eleições americana e instabilidade política, apesar de nos últimos dias vem apresentando melhoras no mercado financeiro, com pequenos sinais de recuperação, a de demorar mais um bom período para recuperação do mercado financeiro, no entanto, não veio atender o cumprimento da Meta Atuarial no mês e no trimestre acumulado de “Investimentos -0,41%” quando ao



PREFEITURA MUNICIPAL DE AQUIDAUANA
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE AQUIDAUANA
AQUIDAUANAPREV

IPCA+5,52%.a.a - 5,49% (meta atuarial) não cumprindo a meta atuarial na Resolução 3.922/2010, conforme Relatório de Análise abaixo;

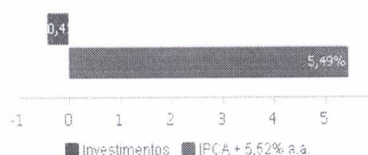
CRÉDITO E MERCADO
Consultoria em Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE AQUIDAUANA - AQUIDAUANA PREV
 Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2020

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020:

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum.	Retorno Mês	Retorno Acum.	Meta Mês	Meta Acum.	Gap Acum.	VaR
Janeiro	50.846.450,96	4.184.948,07	4.637.432,38	50.595.062,56	201.195,69	201.195,69	0,40%	0,40%	0,68%	0,68%	58,09%	2,16%
Fevereiro	50.595.082,56	915.565,20	233.689,36	50.672.362,91	-804.876,69	-403.480,70	-1,16%	-0,79%	0,84%	1,32%	-59,67%	3,35%
Março	50.672.362,91	1.016.000,00	1.714.779,20	48.536.900,51	-3.435.794,00	-3.840.284,70	-6,78%	-7,52%	0,54%	1,87%	-402,28%	13,15%
Abril	48.536.800,81	1.897.100,00	2.702.194,62	46.701.925,19	970.219,19	-2.870.065,51	2,08%	-5,59%	0,12%	1,99%	-281,30%	6,95%
Mai	46.701.925,19	2.053.741,72	1.021.591,32	48.623.662,41	1.164.876,63	-1.685.165,68	2,43%	-3,25%	0,05%	2,03%	-159,85%	4,04%
Junho	48.923.982,41	757.009,73	224.000,00	50.742.032,50	1.285.041,46	-400.127,22	2,60%	-0,73%	0,71%	2,76%	-26,53%	3,28%
Julho	50.742.032,50	13.199.439,42	13.619.690,16	51.794.995,07	1.474.502,21	1.074.374,99	2,91%	2,15%	0,85%	3,63%	59,23%	3,29%
Agosto	51.794.995,07	6.733.370,84	6.708.246,75	51.250.520,51	-669.596,55	504.775,44	-1,10%	1,03%	0,89%	4,35%	23,58%	2,90%
Setembro	51.250.520,51	2.161.240,00	2.192.340,35	50.489.913,73	-722.506,53	-227.731,09	-1,43%	-0,41%	1,09%	5,49%	-7,54%	3,58%

Investimentos x Meta Atuarial



O Comitê de Investimento deliberou e ratificou sobre a aplicação e resgate ocorrido, nos dias 01/09/2020, conforme Autorização de Resgate - APR: N° 137/2020, no valor R\$ 91.100,00 (Noventa e um mil, cem reais), no dia 02/09/2020, conforme Autorização de Resgate - APR: 0138/2020 no valor R\$ 3.000,00 (Três mil reais), no dia 03/09/2020, conforme Autorização de Resgate - APR: N° 139/2020 no valor R\$ 100.000,00 (Cem mil reais), no dia 03/09/2020, conforme Autorização de Aplicação - APR: N° 140/2020, no valor R\$ 100.000,00 (Cem mil reais), no dia 09/09/2020, conforme Autorização de Resgate - APR: N° 141/2020, no valor R\$ 24.300,00 (Vinte e quatro mil, trezentos reais), no dia 09/09/2020, conforme Autorização de Resgate - APR: N° 142/2020, no valor R\$ 203.900,00 (Noventa e seis mil reais), no dia 09/09/2020, conforme Autorização de Aplicação - APR: 143/2020, no valor R\$ 268.800,00 (Duzentos e sessenta e oito mil, oitocentos reais), no dia 10/09/2020, conforme Autorização de Aplicação - APR: N° 144/2020, no valor R\$ 233.700,00 (Duzentos e trinta e três mil, setecentos reais), no dia 11/09/2020, conforme Autorização de Resgate - APR: N°

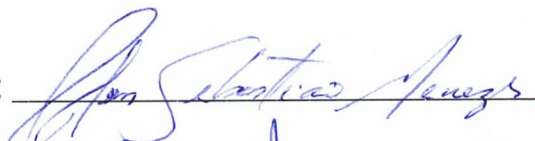


PREFEITURA MUNICIPAL DE AQUIDAUANA
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE AQUIDAUANA
AQUIDAUANAPREV

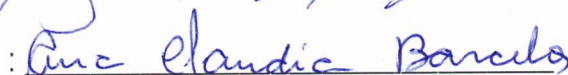
145/2020 no valor R\$ 105.098,52 (Cento e cinco mil, noventa e oito reais e cinquenta e dois centavos), no dia 22/09/2020, conforme Autorização de Resgate – APR: Nº 146/2020 no valor R\$ 12.000,00 (Doze mil reais), no dia 28/09/2020, conforme Autorização de Aplicação – APR: Nº 147/2020 no valor R\$ 17.000,00 (Dezessete mil reais), no dia 29/09/2020, conforme Autorização de Resgate – APR: Nº 148/2020 no valor R\$ 12.000,00 (Doze mil reais), no dia 29/09/2020, conforme Autorização de Resgate – APR: Nº 149/2020 no valor R\$ 744.841,33 (Setecentos e quarenta e quatro mil, oitocentos e quarenta e três reais e trinta e três centavos) e dentro da análise dos Fundos de Investimentos disponíveis no mercado que se enquadram na Política de Investimentos do Instituto, bem como comportamento da carteira de Investimentos quanto ao cumprimento da meta atuarial, e revendo o histórico do rendimento e volatilidade dos últimos 12 meses, e as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez e transparência, por estar dentro das expectativas de superar a meta Atuarial do Instituto, ficando a ser estudadas até a próxima reunião novas medidas quanto a investimento de acordo com o momento econômico “mercado financeiro”. Nada mais a serem tratados, neste momento, os trabalhos foram encerrados e coleta de assinaturas colhidas, após leitura desta ata e por estar em conforme. (Aquidauana - MS, 14 de outubro de 2020).

COMITÊ DE INVESTIMENTO:

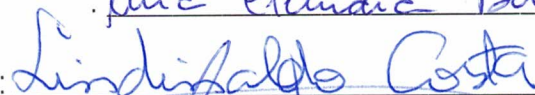
GILSON SEBASTIÃO MENEZES :



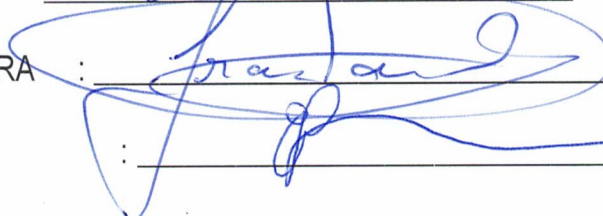
ANA CLAUDIA BARCELOS

: 

LINDINALDO JOÃO DA COSTA :



FRANCISCO TAVARES CÂMARA :



ELIZABETH ORTIZ

: 