

ATA DE REUNIÃO Nº 06/2022 DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DE RIBEIRÃO PIRES – IMPRERP.

Aos dezessete dias do mês de maio de dois mil e vinte e dois, às nove horas e trinta minutos, os servidores membros do Comitê de Investimentos do IMPRERP, nomeados pela Portaria 400/2021; *GLACIANE ARRUDA DE OLIVEIRA CABRAL, NELCI APARECIDA DE OLIVEIRA OGATA, CARLOS HENRIQUE REBELO MAGALHÃES e IVANI DE FARIAS*, a representante da Consultoria Crédito e Mercado *SIMONE LOPES* e o superintendente do instituto *Dr. CLAYTON SOARES DOS SANTOS* **DELIBERAÇÕES: 1) Performance da carteira de investimentos do IMPRERP, fechamento ABRIL de 2022 e Movimentações:**

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	129.088.821,93	7.300.622,35	4.355.546,47	131.097.558,00	-936.339,81	-936.339,81	-0,71%	-0,71%	0,95%	0,95%	-74,43%	3,28%
Fevereiro	131.097.558,00	6.994.395,60	6.553.785,05	131.677.856,99	139.688,44	-796.651,37	0,11%	-0,60%	1,39%	2,35%	-25,68%	3,17%
Março	131.677.856,99	11.195.662,38	10.773.041,52	134.804.770,73	2.704.292,88	1.907.641,51	2,05%	1,43%	2,06%	4,46%	32,11%	3,46%
Abril	134.804.770,73	9.522.587,43	9.466.231,48	133.320.564,91	-1.540.561,77	367.079,74	-1,14%	0,27%	1,44%	5,96%	4,57%	3,39%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

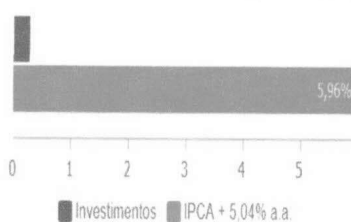


Fig. pag.15 – relatório de performance abril – site:www.imprerp.sp.gov.br

Handwritten signature and initials:
x
E.V.
q l.



O saldo da carteira de investimentos do instituto em abril/2022 foi R\$ 133.320.564,91 (cento e trinta e três milhões, trezentos e vinte mil, quinhentos e sessenta e quatro reais e noventa e um centavos). Há uma diferença de R\$ 12.358,74 (doze mil, trezentos e cinquenta e oito reais e setenta e quatro centavos) referente aos saldos em conta corrente (disponibilidades) que não aparecem no presente relatório da Crédito e Mercado porque este só trata dos investimentos e não das contas correntes. A meta a ser atingida no mês era 1,44 %, o IMPRERP ficou negativo : -1,14% , por conta dos investimentos em renda variável.. 2) **REPASSES:** A Prefeitura Municipal efetuou os repasses pertinentes aos parcelamentos e as contribuições previdenciárias do fundo financeiro (38.587-5) no valor R\$ 851.955,27 (oitocentos e cinquenta e um mil, novecentos e cinquenta e cinco reais e vinte e sete centavos) e do fundo previdenciário (38.586-7) no valor de R\$ 1.374.566,20 (um milhão, trezentos e setenta e quatro mil , quinhentos e sessenta e seis reais e vinte centavos) e R\$ 512.990,87 (quinhentos e doze mil , novecentos e noventa reais e oitenta e sete centavos) referente ao acordo de parcelamento do mês que foram investidos no fundo : BB PERFIL – CNPJ: 13.077.418/0001-49 . 3) **PROPOSIÇÕES DE INVESTIMENTOS /DESINVESTIMENTOS :** Foram resgatados R\$ 2.000.000,00 (dois milhões de reais) do fundo BB PERFIL – CNPJ: 13.077.418/0001-49 (conta 38.586-7 Banco do Brasil) que foram investidos no fundo CAIXA FI BRASIL 2023 TP RF CNPJ: 44.683.378/0001-02.(conta 162-1- Caixa). Foram resgatados R\$ 3.000.000,00 (três milhões de reais) do fundo BB PREV RF RET. TOTAL -CNPJ: 35.292.588/0001-89 , dos quais R\$ 1.649.790,40 (um milhão, seiscentos e quarenta e nove mil, setecentos e noventa reais e quarenta centavos) foram investidos no fundo BB PERFIL – CNPJ: 13.077.418/0001-49 e R\$ 1.271.702,36 (um milhão, duzentos e setenta e um mil, setecentos e dois reais e trinta e seis centavos) foram utilizados para pagar a folha dos aposentados e pensionistas. O Instituto resgatou R\$ 3.000.000,00 (três milhões de reais) do fundo CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO – CNPJ: 08.070.841/0001-87 que foram investidos no fundo SAFRA S&P REAIS – CNPJ: 21.595.829/0001-54 Conforme relatórios abaixo:

2.71.

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Abril/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.057.882,64	2.000.000,00	0,00	5.152.707,48	94.824,84	1,87%	2,22%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	49.622,22	0,00	0,00	50.384,32	762,10	1,54%	1,54%	1,01%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.978.014,31	0,00	0,00	7.084.602,21	106.587,90	1,53%	1,53%	1,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC	12.595.601,72	0,00	0,00	12.782.505,96	186.904,23	1,48%	1,48%	1,13%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND	1.068.547,02	0,00	0,00	1.083.511,78	14.964,76	1,40%	1,40%	1,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	17.694.400,43	0,00	0,00	17.855.597,66	161.197,23	0,91%	0,91%	0,39%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.779,73	0,00	0,00	23.980,61	200,88	0,84%	0,84%	2,26%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI	57.040,22	0,00	0,00	57.498,62	458,40	0,80%	0,80%	2,24%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	463.040,32	0,00	0,00	466.751,43	3.711,11	0,80%	0,80%	2,27%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.189.302,62	0,00	0,00	6.238.824,13	49.521,51	0,80%	0,80%	0,03%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA	800.292,21	0,00	0,00	806.304,95	6.012,74	0,75%	0,75%	2,31%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	89.121,23	0,00	1.000,00	88.781,29	660,06	0,74%	0,75%	0,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE	1.111.773,51	0,00	0,00	1.119.552,23	7.778,72	0,70%	0,70%	0,25%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC	16.450.351,07	4.522.587,43	3.465.231,48	17.636.380,53	120.673,51	0,61%	0,78%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE	14.495.191,60	0,00	3.000.000,00	11.584.663,77	88.472,17	0,61%	0,62%	0,86%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.025.501,05	0,00	0,00	1.030.814,75	5.313,70	0,52%	0,52%	1,14%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P	488.602,15	0,00	0,00	490.961,29	2.359,14	0,48%	0,48%	1,06%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	3.573.160,08	0,00	0,00	3.581.461,65	8.301,57	0,23%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI	842,60	0,00	0,00	842,99	0,39	0,05%	0,05%	3,65%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI	268,48	0,00	0,00	268,21	-0,27	-0,10%	-0,10%	1,47%
Total Renda Fixa	86.213.335,21	6.522.587,43	6.466.231,48	87.136.395,85	866.704,89	1,00%		0,59%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Abril/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.294.564,88	0,00	0,00	2.338.709,16	44.144,28	1,92%	0,00%	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	599.700,11	0,00	0,00	603.375,00	3.674,89	0,61%	0,61%	0,64%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.877.023,80	0,00	3.000.000,00	3.881.123,37	-15.900,43	-0,23%	-0,17%	1,33%
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	3.346.075,69	0,00	0,00	3.329.952,19	-16.123,50	-0,48%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII -	901.161,04	0,00	0,00	887.225,56	-13.935,48	-1,55%	-1,55%	29,82%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	477.232,02	0,00	0,00	462.826,25	-14.405,77	-3,02%	-3,02%	7,12%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,00	3.000.000,00	0,00	2.893.699,95	-106.300,05	-3,54%	-8,65%	12,69%
BB AGRO FIC AÇÕES	7.427.232,73	0,00	0,00	7.149.273,80	-277.958,93	-3,74%	-3,74%	6,02%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	257.339,40	0,00	0,00	243.918,66	-13.420,74	-5,22%	-5,22%	7,40%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.030.381,83	0,00	0,00	2.794.683,40	-235.698,43	-7,78%	-7,78%	7,37%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.936.526,48	0,00	0,00	1.781.134,16	-155.392,32	-8,02%	-8,02%	8,59%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	223.672,43	0,00	0,00	205.346,73	-18.325,70	-8,19%	-8,19%	10,01%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.478.276,85	0,00	0,00	3.188.304,31	-289.972,54	-8,34%	-8,34%	8,52%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	5.195.404,10	0,00	0,00	4.746.231,13	-449.172,97	-8,65%	-8,65%	12,63%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	958.671,11	0,00	0,00	912.184,05	-46.487,06	-8,66%	-8,66%	12,86%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	449.596,94	0,00	0,00	410.507,16	-39.089,78	-8,69%	-8,69%	12,61%
Total Renda Variável	37.492.859,41	3.000.000,00	3.000.000,00	35.808.494,88	-1.684.364,53	-4,16%		8,59%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Abril / 2022

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	8.145.734,21	0,00	0,00	7.631.818,94	-513.915,27	-6,31%	-6,31%	10,99%
BB AÇÕES BOLSA GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NI	2.952.841,90	0,00	0,00	2.743.855,24	-208.986,66	-7,08%	-7,08%	10,41%
Total Exterior	11.098.576,11	0,00	0,00	10.375.674,18	-722.901,93	-6,51%		10,84%

Handwritten signature and initials.

4) FATOS RELEVANTES : O banco do Brasil fez a reunião mensal para apresentar suas sugestões de investimento e explicar o cenário interno e externo. Apresentou as seguintes sugestões de investimentos:

Fundos Vértice

BB RF IPCA (15/05/23) – CNPJ: 15.486.093/0001-83

BB RF Vértice XXI (15/08/24) – CNPJ: 44.345.590/0001-60

Títulos Públicos Federais

06/Mai/2022

Papel IPCA		NTN-B - Taxa (% a.a.)/252					Intervalo Indicativo			
Código SELIC	Data Base/Emissão	Data de Vencimento	Tx. Compra	Tx. Venda	Tx. Indicativas	PU	Mínimo (D0)	Máximo (D0)	Mínimo (D+1)	Máximo (D+1)
760199	15/07/2000	15/08/2022	4,0400	3,9971	4,0180	4.009,106678	3,0993	5,0337	2,8716	4,8189
760100	15/07/2000	15/03/2023	5,0760	5,0320	5,0556	3.999,748823	4,7153	5,5381	4,6899	5,5157
760199	15/07/2000	15/05/2023	5,0713	5,0444	5,0560	4.084,772633	4,7468	5,4427	4,7257	5,4236
760199	15/07/2000	15/08/2024	5,4897	5,4528	5,4700	4.032,684379	5,1514	5,7348	5,2060	5,7894

As taxas acima refletem o fechamento do dia 06/05/22, não representando garantia de retorno, apenas referência para a taxa dos papéis em questão.

Sugestões de Alocação – Renda Fixa

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS

FUNDO DE INVESTIMENTO

CONDIÇÕES COMERCIAIS			
Aplicação Inicial	R\$ 10.000,00	Taxa de Administração	0,2% a.a.
Aplicação Adicional	R\$ 0,01	Taxa de Performance	Não há
Resgate Mínimo	R\$ 0,01	Taxa de Ingresso	Não há
Saldo Mínimo	R\$ 0,01	Taxa de Saída	Não há
Cota de Aplicação	D+0	Carência	Não há
Cota de Resgate	D+1	Tipo de Cota	Fechamento
Crédito do Resgate	D+1	Horário Limite	15:00h

DADOS DE FECHAMENTO DO MÊS

Cota Fech.	Qtd. Cotas	PL Médio 12 m	PL Fechamento
3.141091867	2847904916.34	R\$ 9.540.309.770.77	R\$ 8.945.530.970.72
V@R (95% de confiança) (*)		-0,2320%	5
Volatilidade no ano (*)		2,65%	4
Volatilidade nos últimos 12 m (*)		2,60%	3
% de retornos positivos no ano		62,90%	2
% de retornos positivos nos últimos 12 m		62,70%	1
Índice de Sharpe nos últimos 12 m (*)		0,91	

Março 2022

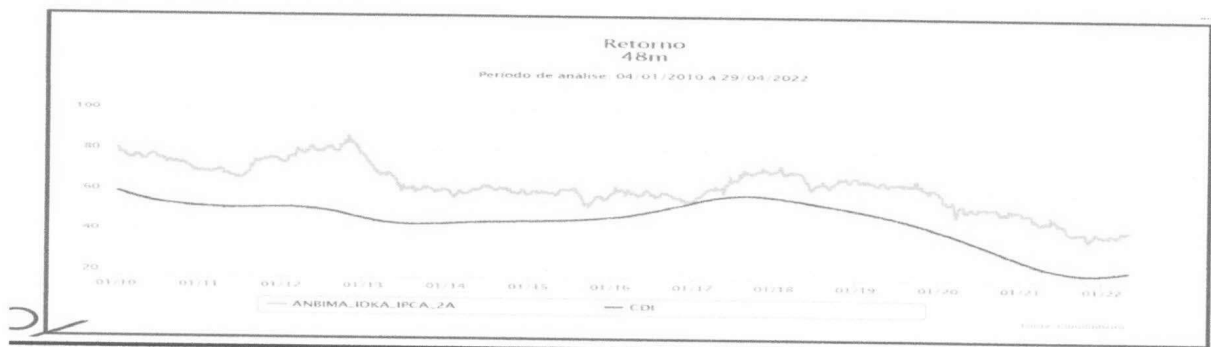
RENTABILIDADE

A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS

Ano	Taxa Nominal	IDKA IPCA 2A	Acumulada 5 anos
2017	12,40%	13,61%	Fundo IDKA IPCA 2A
2018	9,22%	9,75%	54,17%
2019	11,20%	11,82%	58,99%
2020	7,92%	8,62%	Fundo IDKA IPCA 2A
2021	4,65%	4,97%	3,82%
			3,88%
Mês	Fundo	IDKA IPCA 2A	%IDKA IPCA 2A
mar/22	2,62%	2,54%	103,19%
fev/22	1,16%	1,26%	92,08%
jan/22	0,01%	0,05%	18,55%
dez/21	0,71%	0,83%	85,18%
nov/21	2,43%	2,51%	96,80%
out/21	-1,25%	-1,47%	-
set/21	1,03%	1,10%	94,17%
ago/21	0,18%	0,26%	67,58%
jul/21	0,08%	-0,18%	-
jun/21	-0,09%	-0,32%	-
mai/21	0,67%	0,88%	76,66%
abr/21	0,84%	1,35%	62,25%
últimos 12 meses	8,64%		9,10%

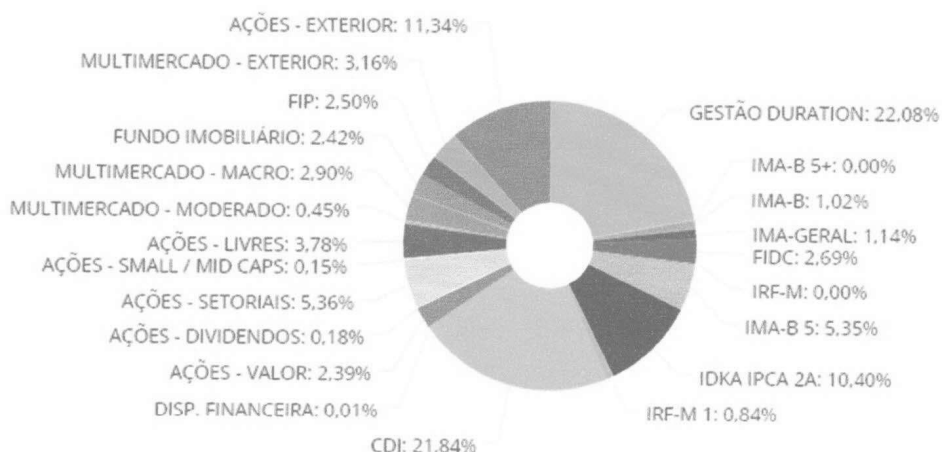
CNPJ: 13.322.205/0001-35
Artigo 7º, Inciso I, 'b'

Handwritten notes and signatures at the bottom right of the page.



obs: a figura acima mostra o gráfico de desempenho do IDKA 2 no período de 2010 a 2022

O BB sugeriu que o Instituto invista no fundo **BB XXI FI RF PREV- CNPJ: 44.345.590/0001-60**, pois se trata de um fundo vértice com vencimento em 2024, cujo rendimento ajudará a bater a meta atuarial e também por oferecer menor risco. Também ressaltou o bom desempenho do fundo **IDKA 2 – CNPJ: 13.322.205/0001-35** sugerindo realocações de fundos de menor rendimento como o **BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP – CNPJ: 13.077.418/0001-49** e o **BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO- CNPJ: 25.078.994/0001-90** para o IDKA 2 e o **BB XXI**. Em reunião com a consultora da Crédito e Mercado, a sr.^a Simone Lopes, foi questionado, pelo comitê, o bom desempenho dos fundos IDKA e IMA-B 5 em comparação ao desempenho inferior dos fundos de gestão ativa ou gestão duration, a consultora explicou que o motivo é que os fundos de gestão ativa têm um patrimônio muito elevado sendo mais moroso o processo de se desfazer dos títulos da carteira e trocar pelos IDKA E IMA-B 5, mas que os gestores deste seguimento (gestão duration) estão tomando esta providência. A consultoria também justificou que a queda dos ativos de renda variável ocorreu por conta do aumento da taxa de juros, da desvalorização do dólar e do COVID na China. Apesar da queda dos fundos de renda variável a recomendação da consultoria é de que o IMPRERP permaneça nos mesmos para não assumir o prejuízo. A carteira do instituto está bem diversificada e a recomendação é de que seja mantida a diversificação.



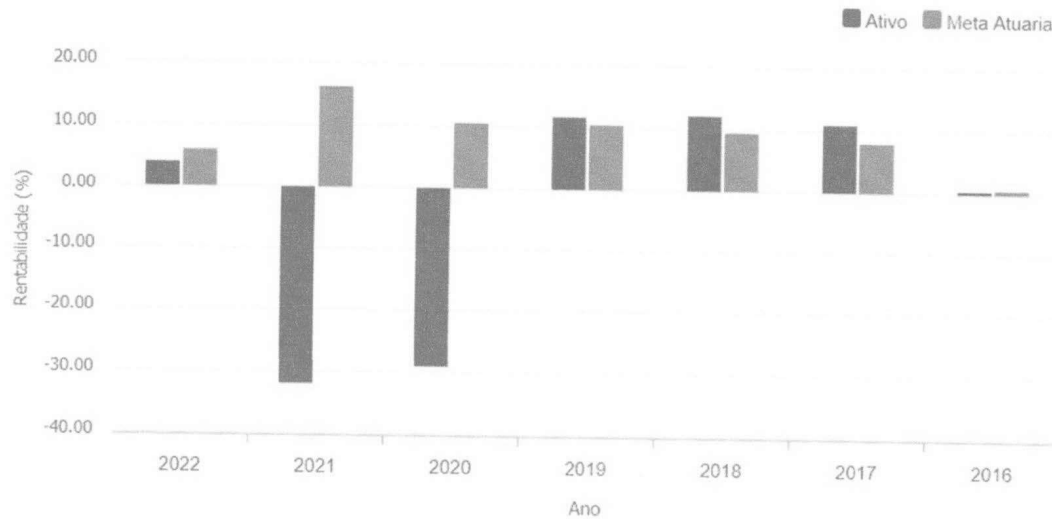
Handwritten signature and initials.

5) Os FUNDOS ILÍQUIDOS : AR, CARE 11 ,W7 e VECTOR continuam com desempenho abaixo da meta. Seguem abaixo os gráficos de desempenho dos fundos ilíquidos:

AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR

24.445.360/0001-65

Histórico do Ativo na Carteira do RPPS

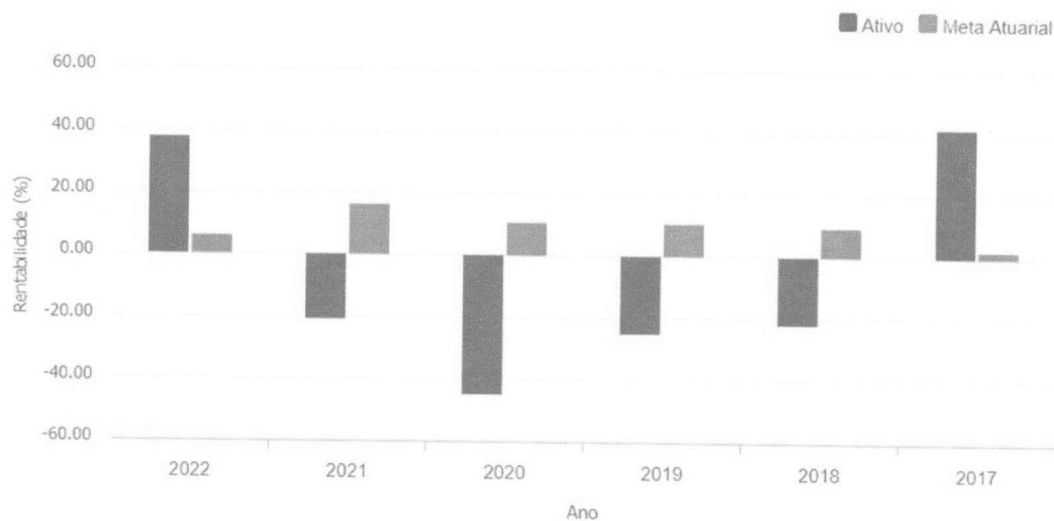


2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)
Jan	3.445.912,09	0,00	0,00	3.517.839,26	71.927,17	2,09%	0,95%
Fev	3.517.839,26	0,00	0,00	3.582.708,06	64.868,80	1,84%	1,39%
Mar	3.582.708,06	0,00	0,00	3.573.160,08	-9.547,98	-0,27%	2,06%
Abr	3.573.160,08	0,00	0,00	3.581.461,65	8.301,57	0,23%	1,44%
Acumulado no Ano					135.549,56	3,93%	5,97%

Handwritten signature and initials.

Histórico do Ativo na Carteira do RPPS

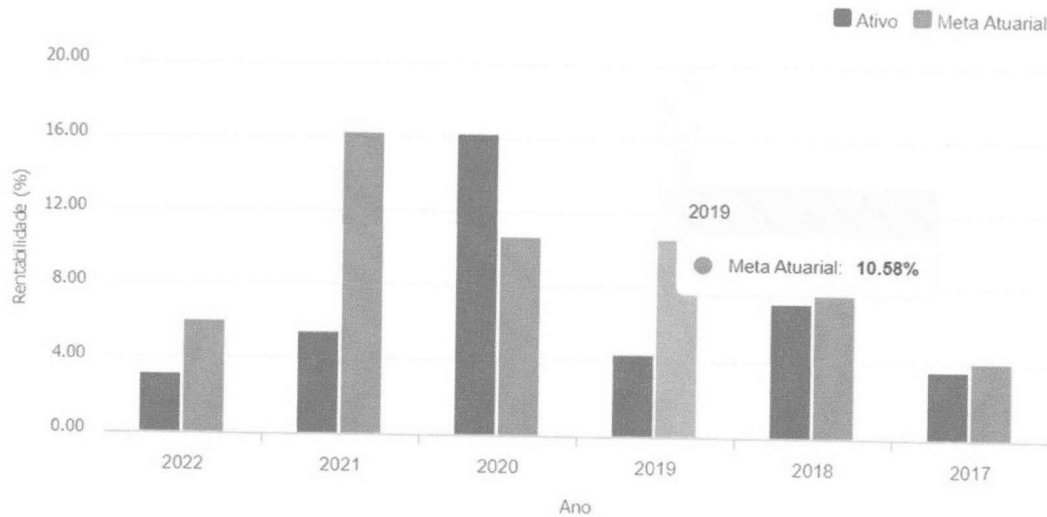


2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)
Jan	643.354,66	0,00	0,00	483.096,64	-160.258,02	-24,91%	0,95%
Fev	483.096,64	0,00	0,00	620.128,86	137.032,22	28,37%	1,39%
Mar	620.128,86	0,00	0,00	901.161,04	281.032,18	45,32%	2,06%
Abr	901.161,04	0,00	0,00	887.225,56	-13.935,48	-1,55%	1,44%
Acumulado no Ano					243.870,90	37,91%	5,97%

Handwritten signature and initials.

Histórico do Ativo na Carteira do RPPS



2022							
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)
Jan	2.268.542,77	0,00	0,00	2.220.314,00	-48.228,77	-2,13%	0,95%
Fev	2.220.314,00	0,00	0,00	2.249.497,31	29.183,31	1,31%	1,39%
Mar	2.249.497,31	0,00	0,00	2.294.564,88	45.067,57	2,00%	2,06%
Abr	2.294.564,88	0,00	0,00	2.338.709,16	44.144,28	1,92%	1,44%
Acumulado no Ano					70.166,39	3,08%	5,97%

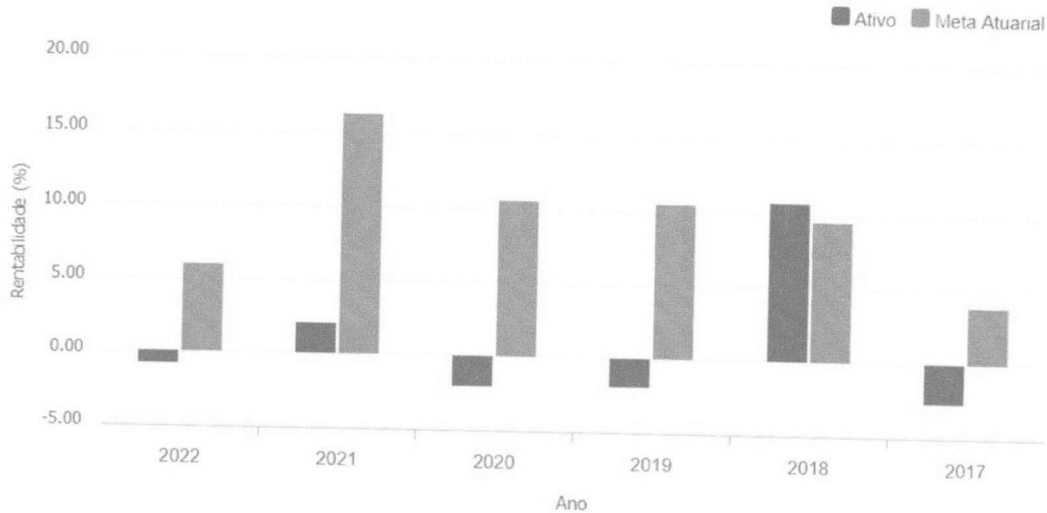
↓

E. V.
Q

W7 FIP MULTISTRATÉGIA

15.711.367/0001-90

Histórico do Ativo na Carteira do RPPS

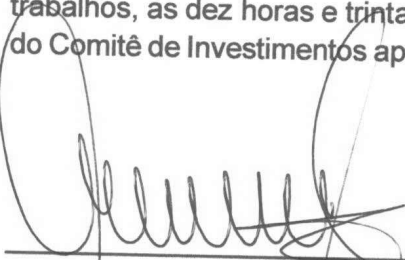


2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)
Jan	3.358.062,12	0,00	0,00	3.353.986,93	-4.075,19	-0,12%	0,95%
Fev	3.353.986,93	0,00	0,00	3.350.317,35	-3.669,58	-0,11%	1,39%
Mar	3.350.317,35	0,00	0,00	3.346.075,69	-4.241,66	-0,13%	2,06%
Abr	3.346.075,69	0,00	0,00	3.329.952,19	-16.123,50	-0,48%	1,44%
Acumulado no Ano					-28.109,93	-0,84%	5,97%

Handwritten signature and initials.

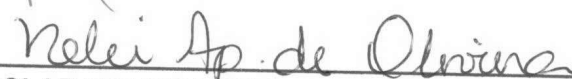
6) ENCERRAMENTO: Nada mais havendo a tratar o (a) Presidente deu por encerrado os trabalhos, as dez horas e trinta minutos, lavrou-se a presente ata a que se refere esta reunião do Comitê de Investimentos após lida e foi aprovada por unanimidade dos membros presentes.



CLAYTON SOARES DOS SANTOS



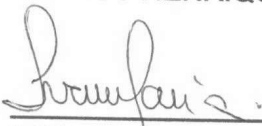
GLACIANE ARRUDA DE OLIVEIRA CABRAL



NELCI APARECIDA DE OLIVEIRA OGATA



CARLOS HENRIQUE REBELO MAGALHÃES



IVANI DE FARIAS