

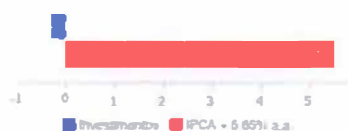
ATA DE REUNIÃO Nº 07/2021 DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DE RIBEIRÃO PIRES – IMPRERP.

Aos quinze dias do mês de junho de dois mil e vinte e um, às nove horas e trinta minutos, por meio de meet (videoconferência), os servidores membros do Comitê de Investimentos do IMPRERP, nomeados pela Portaria 400/2021; *GLACIANE ARRUDA DE OLIVEIRA CABRAL, NELCI APARECIDA DE OLIVEIRA OGATA, IVANI DE FARIAS, CARLOS HENRIQUE REBELO MAGALHÃES, e SIMONE LOPES representante da Consultoria Crédito e Mercado.* **DELIBERAÇÕES: 1-) Performance da carteira de investimentos do IMPRERP, fechamento MAIO de 2021 e Movimentações:**

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janero	119.403.365,85	2.689.866,45	1.564.401,13	119.804.218,06	-834.523,11	-834.523,11	-0,78%	-0,78%	0,09%	0,09%	-112,68%	2,94%
Fevereiro	119.804.218,06	2.909.516,66	2.284.382,57	119.488.471,90	-1.730.880,25	-2.565.403,36	-1,44%	-2,20%	1,20%	1,89%	-112,80%	3,17%
Março	119.488.471,90	2.121.073,55	979.624,81	119.710.185,78	89.285,14	-2.595.118,22	0,06%	-2,15%	1,44%	3,42%	-62,79%	3,60%
Abril	119.710.185,78	24.240.249,53	23.081.840,44	121.584.889,37	690.259,52	-1.900.858,69	0,57%	-1,59%	0,75%	4,19%	-37,96%	2,19%
Mai	121.584.889,37	4.632.235,15	3.292.710,16	124.524.630,52	1.600.246,16	-309.812,63	1,30%	-0,31%	1,29%	5,54%	5,81%	2,62%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



O saldo da carteira de investimentos do instituto em maio/2021 foi R\$ 124.524.630,52 (cento e vinte e quatro milhões, quinhentos e vinte e quatro mil, seiscentos e trinta reais e cinquenta e dois centavos). **A meta a ser atingida no mês era 1,29% e chegamos a 1,30%.** As realocações feitas trouxeram um efeito positivo para a carteira, porém, como ultrapassamos 0,22% o limite permitido para investir em ações (30%) deveremos corrigir **2)REPASSES:** A Prefeitura Municipal fez os repasses pertinentes as contribuições previdenciárias do fundo financeiro (38.587-5) e do servidor do fundo previdenciário (38.586-7) do mês que foram



investidas de acordo com a política de investimentos: As contribuições previdenciárias da prefeitura que estão pendentes somam: R\$ 7.458.032,56 (sete milhões, quatrocentos e cinquenta e oito mil, trinta e dois reais e cinquenta e seis centavos) correspondem a Parte Patronal do Fundo Previdenciário (CC: 38.586-7 Banco do Brasil) abrangem o período de março a novembro de 2020 suspensos pela lei 6531/2020 e o mês de dezembro incluindo 13º (que não pertencem ao período abrangido pela lei por terem vencimento em 01/2021), porém sendo objeto de cobrança por parte deste instituto, bem como poderão fazer parte do acordo de parcelamento. Temos um Processo Judicial Nº 1003578-93.2020.826.0505 referente ao ressarcimento da taxa administrativa (4098-3 Banco do Brasil) no valor R\$ 1.439.000,00 (um milhão, quatrocentos e trinta e nove mil reais, e também está pendente a integralização de parte da taxa administrativa 2021 no valor de R\$ 872.812,11 (oitocentos e setenta e dois mil, oitocentos e doze reais e onze centavos) referente ao fundo Financeiro o qual necessita de aporte, este valor vem sendo cobrado via ofício, mas não foi repassado ainda. 3) **PROPOSIÇÕES DE INVESTIMENTOS /DESINVESTIMENTOS** foram feitos resgates de diversos fundos de Renda Fixa, conforme tabela abaixo, com o objetivo de pagar a folha dos aposentados e pensionistas e também **investir em ações conforme aprovação do comitê: BB AÇÕES ESG – CNPJ: 22.632.237/0001/28 (R\$ 250.000,00); BB AÇÕES BOLSA AMERICANA – CNPJ: 36.178.569/0001-99 (R\$ 250.000,00) e CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRES- CNPJ: 30.068.169/0001-44 (R\$ 500.000,00) conforme a tabela de Renda variável**



Avenida Fortuna, 135 - Centro - Ribeirão Pires/SP - CEP 09400-320 - tel/fax: 4824-3492 / 4825-2325

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Apl./Resgates	Despesas	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Invest	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI	502.141,91	0,00	0,00	500.127,80	6.905,99	1,38%	1,00%	1,00%
BB IMA B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.001.251,16	0,00	0,00	1.017.875,23	16.624,05	1,65%	1,05%	2,21%
CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	447.037,94	0,00	0,00	451.688,44	4.650,50	1,04%	1,04%	2,30%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA	3.728.619,87	0,00	1.000.000,00	2.761.001,27	32.389,40	0,87%	1,00%	3,30%
CÓPIA - BANCO RENNER	344.349,00	0,00	0,00	347.214,00	2.865,00	0,83%	-	-
BB IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI	894.720,16	0,00	200.000,00	610.889,00	5.748,82	0,94%	1,05%	2,40%
BB IMA B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.744.836,67	0,00	0,00	6.804.163,45	59.326,78	0,88%	0,89%	1,01%
BB IMA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC	15.404.730,44	0,00	0,00	15.568.908,40	163.352,00	0,87%	0,67%	0,65%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RENDA FIXA PRE	10.416.237,70	0,00	0,00	10.531.880,37	115.642,68	0,80%	0,80%	1,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.895.493,40	0,00	0,00	4.014.704,73	19.210,33	0,49%	0,48%	1,97%
BB IMA GERAL EX C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P	170.721,17	0,00	0,00	177.181,76	6.460,59	0,40%	0,40%	3,61%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	79.767,81	18.851,56	1.880,00	92.642,96	3.431,41	0,29%	0,29%	6,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.358.079,08	0,00	0,00	5.372.829,00	14.749,92	0,24%	0,24%	0,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	19.379.201,41	0,00	0,00	19.425.457,47	46.256,05	0,24%	0,24%	1,16%
BB IMA 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE	1.062.618,22	0,00	0,00	1.064.508,30	1.890,08	0,18%	0,18%	0,14%
BB PERFFI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC	3.622.211,00	3.465.401,47	2.001.710,16	4.026.906,29	10.689,58	0,18%	0,20%	0,04%
BB IMA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI	265,77	0,00	0,00	266,19	0,42	0,00%	0,10%	1,99%
AR BANK MÉRBUAROS FIC RENDA SÊNIOR	3.073.215,00	0,00	0,00	3.113.293,85	158.892,22	5,20%	-	-
Total Renda Fixa	66.145.202,63	3.805.523,03	3.282.710,16	66.633.168,76	276.568,28	0,32%		1,00%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Maio/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Invest	Var - Mês
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	3.057.226,88	0,00	0,00	3.289.216,22	231.989,37	7,28%	7,20%	6,82%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3.205.108,44	0,00	0,00	3.430.733,18	225.624,74	7,04%	7,04%	6,27%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4.780.010,97	127.112,12	0,00	5.205.646,35	388.525,26	5,60%	5,91%	6,90%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	6.352.408,75	0,00	0,00	6.820.833,83	347.624,08	5,60%	5,60%	6,76%
BRABLIAN (BRAMEFAR) AND DEATH CARE (SERVICIOS FI	870.987,50	0,00	0,00	917.419,10	46.431,60	5,33%	5,33%	50,63%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.302.249,22	0,00	0,00	3.468.164,03	165.914,81	5,03%	5,02%	7,35%
III AÇÕES BOLSA AMERICANA FIC AÇÕES	0,00	250.000,00	0,00	250.232,02	232,02	0,09%	0,31%	6,74%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	507.267,13	7.267,13	1,45%	0,30%	7,57%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.633.257,34	0,00	0,00	6.728.577,96	95.320,62	1,44%	1,44%	1,00%
VECTOR BUELZ LAJES CORPORATIVAS III - VLS11	2.204.159,08	0,00	0,00	2.232.711,54	28.552,46	1,30%	14,450%	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	3.575.946,41	0,00	0,00	3.612.800,40	36.853,99	1,03%	1,01%	1,00%
W7 MULTISTRATEGIA FII	3.435.263,10	0,00	0,00	3.396.918,85	-38.344,25	-1,11%	-	-
Total Renda Variável	35.438.886,76	877.112,12	0,00	37.638.021,53	1.316.282,97	3,63%		6,86%

CRÉDITO E MERCADO

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DE RIBEIRÃO PIRES - CONSOLIDADO
Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - Base 31/05/2021

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Maio / 2021)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Apl./Resgates	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Invest	Var - Mês
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	350.000,00	0,00	355.438,93	5.438,93	2,10%	-2,79%	5,91%
Total Exterior	0,00	350.000,00	0,00	355.438,93	5.438,93	2,10%		6,33%



4) DESENQUADRAMENTO: Todos os meses , quando é feito o DAIR, aparece o desequadramento passivo do AR CAPITAL BANK e agora, do fundo VECTOR

RPPS: INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DE RIBEIRÃO PIRES

ASSUNTO: Parecer Técnico referente notificação denominada MPS-CADPREV Desequadramento Patrimônio Líquido do Fundo - Art. 14.

Senhores,

Em atendimento a solicitação e em complemento a linha de defesa do Regime Próprio de Previdência Social, emitimos este Parecer Técnico no intuito de orientar quanto ao(s) referido(s) apontamento(s) da notificação, perante os critérios:

Critério Analisado:	Desequadramento - % Patrimônio Líquido do Fundo - Art. 14
Descrição do Critério Analisado:	Por meio do Demonstrativo das Aplicações e Investimentos dos Recursos - DAIR, os entes federativos informam os dados analíticos das aplicações dos recursos do Regime Próprio de Previdência Social - RPPS por eles instituídos, em atendimento ao art. 9º, parágrafo único, da Lei nº 9.717, de 1998 e art. 22 da Portaria MPS nº 402, de 2008, possibilitando verificar se estão em conformidade com as normas do Conselho Monetário Nacional.
Segmento:	Renda Fixa.
Tipo de Ativo:	FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, VII, a.
Identificação do Ativo:	24.445.360/0001-65 - AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 13.842.683/0001-76 - VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FI

Art. 14. O total das aplicações dos recursos da regime próprio de previdência social em um mesmo fundo de investimento deverá representar, no máximo, 15% (quinze por cento) do patrimônio líquido do fundo, observado o disposto no art. 12. (Redação dada pela Resolução nº 4.604, de 19/10/2017.)

Art. 14. O total das aplicações dos recursos da regime próprio de previdência social em um mesmo fundo de investimento deverá representar, no máximo, 15% (quinze por cento) do patrimônio líquido do fundo, observado o disposto no art. 12. (Redação dada pela Resolução nº 4.604, de 19/10/2017.)

§ 1º O limite de que trata o caput será de até 5% (cinco por cento) do patrimônio líquido dos fundos de investimento de que tratam os incisos VII do art. 7º, III e IV do art. 8º.

Notamos que no seu histórico de investimento consta que a primeira aplicação do **AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR** foi realizada em 2016 e o fundo **VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII** teve a primeira aplicação em junho de 2017, sendo assim ocorreu antes da alteração da Resolução CMN nº 4.604/17, que permitia o percentual de 25% para os Patrimônios Líquidos do Fundo.

Desta forma, é importante ressaltar que se trata de um fundo de investimento líquido, é certo de que a aplicação inicial foi feita dentro dos limites legais vigentes à época, sem alternativa para enquadramento do curto prazo.

Deste modo, o legislador prevendo possíveis problemas com a alteração da resolução, criou o artigo 21, parágrafo primeiro:

“Art. 21. Os regimes próprios de previdência social que, em decorrência da entrada em vigor desta Resolução ou de suas alterações, passem a apresentar aplicações em desacordo com a estabelecida, poderão mantê-las em carteira por até 180 dias. (Redação dada pela Resolução nº 4.604, de 19/10/2017);

§ 1º As aplicações que apresentem prazos para vencimento, resgate, carência ou para conversão de cotas de fundos de investimento previstas em seu regulamento então vigente poderão ser mantidas em carteira até o respectivo data, caso superior ao prazo previsto no caput. (Incluído pela Resolução nº 4.604, de 19/10/2017).”

A consultoria orienta pela notificação à Secretaria de Previdência, junto a todas as informações apresentadas neste parecer, destacando não haver qualquer irregularidade uma vez que as aplicações se deram sob os requisitos da Resolução CMN nº 3.922/2010, que permitia a concentração de até 25% do patrimônio líquido de fundos, por se tratar de um fundo líquido, inexistem medidas a serem tomadas para o enquadramento no curto prazo, se enquadrando no critério de exceção do artigo 21, § 1º.

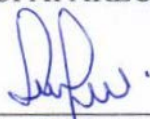
5) ENCERRAMENTO: Nada mais havendo a tratar o (a) Presidente deu por encerrado os trabalhos, as dez horas e trinta minutos, lavrou-se a presente ata a que se refere esta reunião do Comitê de Investimentos após lida e foi aprovada por unanimidade dos membros presentes.



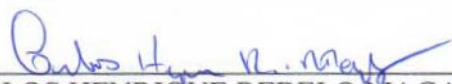
GLACIANE ARRUDA DE OLIVEIRA CABRAL



NELCI APARECIDA DE OLIVEIRA OGATA



IVANI DE FARIAS



CARLOS HENRIQUE REBELO MAGALHÃES