

ATA DE REUNIÃO Nº 10/2021 DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DE RIBEIRÃO PIRES – IMPRERP.

Aos vinte e um dias do mês de setembro 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**, **SIMONE LOPES** representante da Consultoria Crédito e Mercado e o superintendente do instituto **Dr. CLAYTON SOARES DOS SANTOS** 1) **DELIBERAÇÕES: Performance da carteira de investimentos do IMPRERP, fechamento AGOSTO de 2021 e Movimentações:**

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DE RIBEIRÃO PIRES
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2021

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
Janeiro	119.403.365,85	2.609.066,45	1.554.491,13	119.604.219,06	-934.523,11	-934.523,11	-0,78%	-0,78%	0,69%	0,69%	-112,65%	2,94%
Fevereiro	119.604.219,06	2.909.516,66	2.204.302,57	119.498.471,90	-1.730.880,25	-2.665.403,36	-1,44%	-2,26%	1,26%	1,95%	-112,80%	3,17%
Março	118.498.471,90	2.121.973,55	979.534,84	119.710.195,75	69.295,14	-2.596.118,22	0,06%	-2,15%	1,44%	3,42%	-62,79%	3,60%
Abril	119.710.195,75	24.240.249,53	23.051.845,44	121.504.059,37	686.259,53	-1.909.858,69	0,57%	-1,59%	0,75%	4,19%	-37,96%	2,19%
Maio	121.504.059,37	4.632.235,15	3.292.710,16	124.524.610,52	1.600.246,16	-309.612,53	1,30%	-0,31%	1,29%	5,54%	-5,61%	2,62%
Junho	124.524.610,52	7.198.454,90	7.085.554,97	124.720.305,66	32.855,21	-226.757,32	0,07%	-0,24%	0,99%	6,59%	-3,71%	2,39%
Julho	124.720.305,66	23.726.500,32	22.973.045,35	124.704.487,64	-688.632,99	-915.390,31	-0,55%	-0,79%	1,45%	8,13%	-9,74%	2,70%
Agosto	124.704.487,64	8.675.043,93	8.196.424,79	124.249.107,39	-1.023.919,39	-1.939.309,70	-0,82%	-1,60%	1,36%	9,59%	-16,71%	2,83%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



O saldo da carteira de investimentos do instituto em agosto/2021 foi R\$ 124.249.187,39 (cento e vinte e quatro milhões, duzentos e quarenta e nove mil, cento e oitenta e sete reais e trinta e nove centavos). A meta a ser atingida no mês era 1,36%, não foi atingida e obtivemos retorno negativo de 0,82%. Apesar de termos efetuado todas as realocações sugeridas pela consultoria Crédito e Mercado, não alcançamos um desempenho satisfatório. Ante a Pandemia, nenhum índice da nossa carteira, exceto o IBOVESPA, tem dado resultados suficientes para bater a Meta Atuarial. Após o parecer favorável da Crédito e Mercado, conforme ata anterior, o comitê decidiu investir nos fundos: SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP – CNPJ: 24.633.818/0001-00 (o qual está em fase de credenciamento): CAIXA IDKA 2- CNPJ: 14.386.926/0001-71 e CAIXA BRASIL IMA-B 5 – CNPJ: 11.060.913/0001-10 que tem apresentado um bom desempenho em comparação com os demais renda fixa.

[Handwritten signature]

2) REPASSES: A Prefeitura Municipal efetuou 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, bem como os resgates e aplicações do mês. As contribuições previdenciárias da prefeitura que estavam pendentes R\$ 7.458.032,56 (sete milhões, quatrocentos e cinquenta e oito mil, trinta e dois reais e cinquenta e seis centavos) farão parte do acordo de parcelamento, aprovado pela lei 6.626 de 30/06/2021. Com relação a lei 6.626 de 30/06/21 esclarecemos que a mesma será alterada em seu artigo 2º onde os valores referentes a multa e juros passarão para zero e 0,5% respectivamente. 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). **3) PROPOSIÇÕES DE INVESTIMENTOS / DESINVESTIMENTOS** foram efetuados 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 a tabela de Renda Fixa e Renda Variável .**REALOCAÇÕES:** Resgatamos R\$ 2.000.000,00 (dois milhões de reais) do fundo SMALL CAPS - CNPJ: 5.100.221/0001-55 e aplicamos no AGRO AÇÕES – CNPJ: 40.054.357/0001-77. Solicitamos a **Caixa, via ofício** , que investisse: R\$ 1.000.000,00 (um milhão de reais) no fundo Caixa Brasil IMA-B 5 TP RF LP – CNPJ: 11.060.913/0001-10 da conta corrente 162-1, porém a CEF se equivocou e aplicou indevidamente no fundo Caixa Brasil IMA-B 5+ TP RF LP – CNPJ: 10.577.503/0001-88. O estorno foi feito rapidamente , Solicitamos à entidade que faça o ressarcimento pelo prejuízo. Resgatamos : R\$ 2.700.000,00 (dois milhões e setecentos mil reais) do fundo BB PREVID RF IDKA 2 e aplicamos no fundo AÇÕES BOLSA AMERICANA- CNPJ: 36.178.569/0001-99. Conforme quadro abaixo:

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

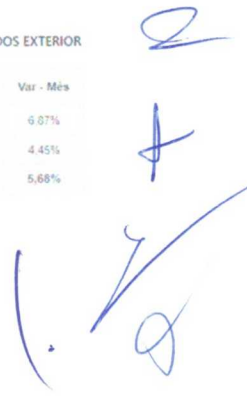
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	271.534,48	2.700.000,00	0,00	2.997.200,34	25.665,86	0,90%	3,26%	3,05%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	3.378.501,27	0,00	0,00	3.373.693,13	-4.808,14	-0,14%	-	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	2.613.262,40	0,00	0,00	2.603.794,14	-4.468,26	-0,17%	-0,17%	1,65%
VECTOR QUELUS LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.219.003,31	0,00	0,00	2.195.452,94	-20.550,47	-0,93%	-0,93%	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.692.742,72	0,00	0,00	6.601.445,83	-91.296,89	-1,36%	-1,36%	1,74%
BB AGRO FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.971.442,01	-28.557,99	-1,43%	-3,44%	8,63%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3.287.549,28	0,00	0,00	3.235.106,94	-52.442,34	-1,60%	-1,60%	8,44%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.458.585,62	0,00	0,00	4.377.875,78	-80.709,84	-1,81%	-1,81%	7,17%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.020.459,95	0,00	0,00	4.917.054,47	-103.375,48	-2,06%	-2,06%	7,26%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.356.082,95	0,00	0,00	3.282.714,66	-93.368,29	-2,78%	-1,74%	8,49%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	479.452,98	0,00	0,00	465.289,82	-14.163,16	-2,95%	-2,95%	9,85%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	3.117.618,12	0,00	2.000.000,00	972.368,72	-145.449,40	-4,67%	-4,90%	12,38%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII -	894.193,30	0,00	0,00	847.741,70	-46.451,60	-5,19%	-5,19%	11,20%
Total Renda Variável	35.789.186,38	4.700.000,00	2.000.000,00	37.829.210,38	-659.976,00	-1,71%		5,97%

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

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	2.885.352,74	31.654,09	0,00	3.002.490,49	85.483,66	2,93%	3,00%	6,07%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍV	2.879.705,00	0,00	0,00	2.936.830,92	57.125,12	1,98%	1,98%	4,45%
Total Exterior	5.765.058,54	31.654,09	0,00	5.939.321,41	142.608,78	2,46%		5,68%



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

CRÉDITO E MERCADO
Consultoria em Investimentos

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DE RIBEIRÃO PIRES
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2021

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.005.190,46	5.190,46	0,52%	0,13%	1,29%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.412.796,45	0,00	0,00	5.439.366,95	26.568,50	0,49%	0,49%	0,06%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	91.493,84	0,00	1.000,00	90.859,20	-635,36	-0,40%	0,40%	0,02%
CDB - BANCO RENNER	352.827,00	0,00	0,00	354.149,50	1.322,50	0,37%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENC	1.068.177,52	0,00	0,00	1.071.750,15	3.572,63	0,33%	0,33%	0,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC	4.942.699,10	2.943.389,84	2.105.424,79	5.726.626,95	25.962,80	0,33%	0,45%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND	990.064,69	0,00	0,00	1.000.024,20	1.939,51	0,19%	0,19%	1,13%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC	15.367.433,59	0,00	3.000.000,00	12.388.087,24	-20.653,65	-0,13%	0,18%	1,09%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	8.790.175,64	0,00	0,00	8.799.281,81	9.106,17	0,10%	0,10%	1,31%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P	177.781,32	0,00	0,00	177.107,74	-673,58	-0,38%	-0,30%	1,43%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	999.904,19	0,00	0,00	995.495,40	-4.408,71	-0,45%	-0,45%	1,38%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE	19.320.808,13	0,00	0,00	19.232.922,66	-87.885,47	-0,45%	-0,45%	1,34%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI	265,32	0,00	0,00	263,61	-1,71	-0,64%	-0,65%	1,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI	1.500.968,07	0,00	1.000.000,00	495.454,79	-15.411,28	-1,03%	-2,36%	5,58%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.181,19	0,00	0,00	22.922,93	-258,26	-1,11%	-1,11%	3,42%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA	780.951,30	0,00	0,00	772.214,80	-8.736,50	-1,12%	-1,12%	3,43%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI	610.412,07	0,00	0,00	603.514,61	-6.897,46	-1,13%	-1,13%	3,42%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	451.703,51	0,00	0,00	446.567,09	-5.136,42	-1,14%	-1,14%	3,46%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	19.274.206,31	0,00	0,00	18.994.812,53	-279.393,78	-1,45%	-1,45%	1,87%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	3.068.361,48	0,00	0,00	2.874.042,90	-192.318,58	-6,27%	-	-

Página 16 de 20

Credito & Mercado - Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua São João de Panenspiacaba, 238 - 19º Andar - Jd. 1901 - Santos - SP
CEP: 11090-250 - Telefone: (13) 3878-8410

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Fixa	83.230.242,72	3.943.389,84	6.186.424,79	80.480.655,60	-506.552,17	-0,61%	-	1,29%

4

-

7

4) DESENQUADRAMENTO: Após o envio do DAIR, constou o desenquadramento passivo do AR CAPITAL BANK . A consultoria respondeu: Quanto ao AR CAPITAL 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 ilíquido, inexistem medidas a serem tomadas para o enquadramento no curto prazo, se enquadrando no critério de exceção do artigo 21, § 1º. **5) Os FUNDOS ILÍQUIDOS: AR, W7, CARE11 e VECTOR continuam com desempenho abaixo da meta atuarial: conforme os gráficos abaixo;**

AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR

24.445.360/0001-65

Histórico do Ativo na Carteira do RPPS



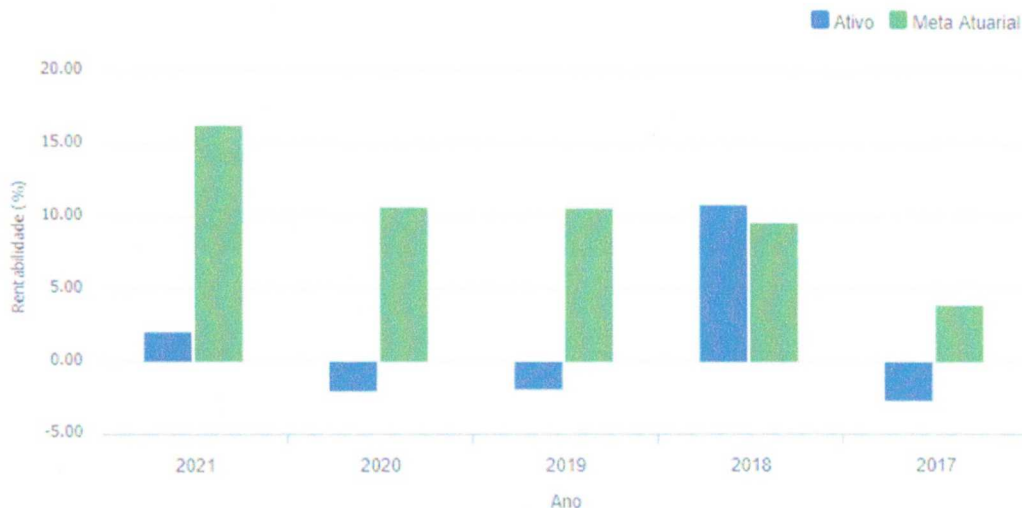
2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)
Jan	5.065.572,50	0,00	0,00	5.017.878,20	-47.694,30	-0,94%	0,69%
Fev	5.017.878,20	0,00	0,00	4.795.156,68	-222.719,52	-4,44%	1,26%
Mar	4.795.156,68	0,00	0,00	4.025.393,26	-769.765,42	-16,05%	1,44%
Abr	4.025.393,26	0,00	0,00	3.073.215,90	-952.177,36	-23,65%	0,75%
Mai	3.073.215,90	0,00	0,00	2.913.293,68	-159.922,22	-5,20%	1,29%
Jun	2.913.293,68	0,00	0,00	2.887.177,75	-26.115,93	-0,90%	0,99%
Jul	2.887.177,75	0,00	0,00	3.066.361,48	179.183,73	6,21%	1,45%
Ago	3.066.361,48	0,00	0,00	2.874.042,90	-192.318,58	-6,27%	1,36%

[Handwritten signature and initials]

FUNDO W7:

Histórico do Ativo na Carteira do RPPS

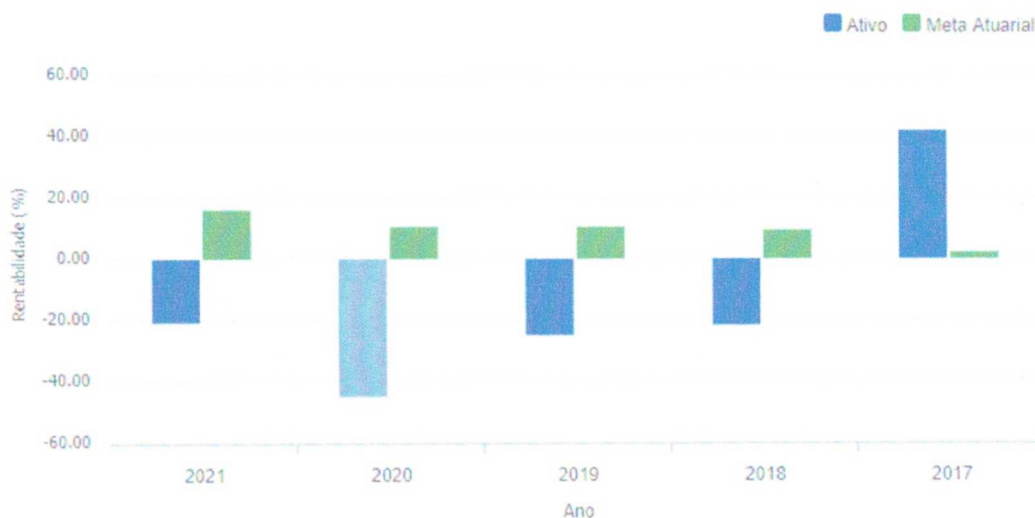


2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)
Jan	3.290.669,42	0,00	0,00	3.448.020,10	157.350,68	4,78%	0,69%
Fev	3.448.020,10	0,00	0,00	3.444.446,38	-3.573,72	-0,10%	1,26%
Mar	3.444.446,38	0,00	0,00	3.427.379,78	-17.066,60	-0,50%	1,44%
Abr	3.427.379,78	0,00	0,00	3.435.285,10	7.905,32	0,23%	0,75%
Mai	3.435.285,10	0,00	0,00	3.386.918,65	-48.366,45	-1,41%	1,29%
Jun	3.386.918,65	0,00	0,00	3.382.819,99	-4.098,66	-0,12%	0,99%
Jul	3.382.819,99	0,00	0,00	3.378.501,27	-4.318,72	-0,13%	1,45%
Ago	3.378.501,27	0,00	0,00	3.373.693,13	-4.808,14	-0,14%	1,36%

[Handwritten signature]

Histórico do Ativo na Carteira do RPPS



2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)
Jan	812.903,00	0,00	0,00	801.290,10	-11.612,90	-1,43%	0,69%
Fev	801.290,10	0,00	0,00	766.451,40	-34.838,70	-4,35%	1,26%
Mar	766.451,40	0,00	0,00	627.096,60	-139.354,80	-18,18%	1,44%
Abr	627.096,60	0,00	0,00	670.967,50	243.870,90	38,89%	0,75%
Mai	670.967,50	0,00	0,00	917.419,10	46.451,60	5,33%	1,29%
Jun	917.419,10	0,00	0,00	940.644,90	23.225,80	2,53%	0,99%
Jul	940.644,90	0,00	0,00	894.193,30	-46.451,60	-4,94%	1,45%
Ago	894.193,30	0,00	0,00	847.741,70	-46.451,60	-5,19%	1,36%

A

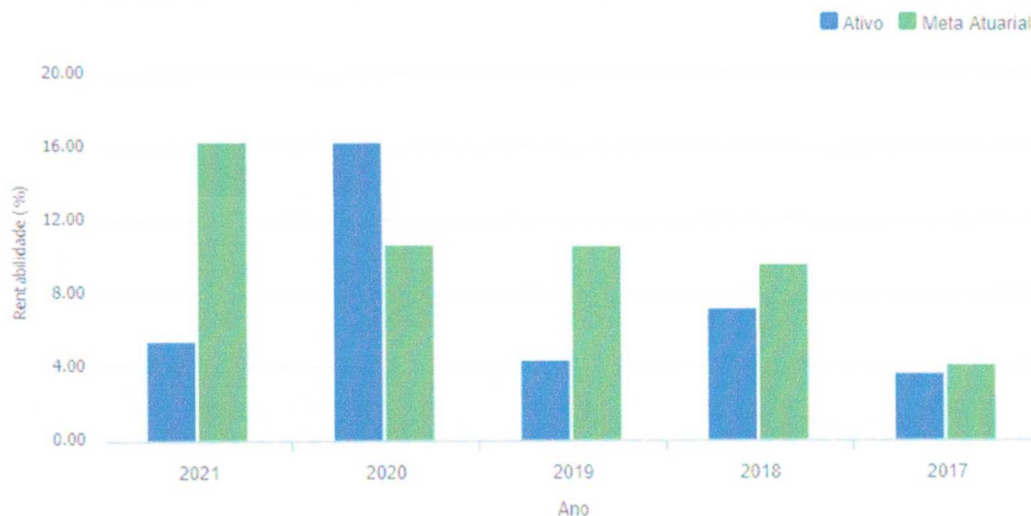
✓

g

VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11

13.842.683/0001-76

Histórico do Ativo na Carteira do RPPS

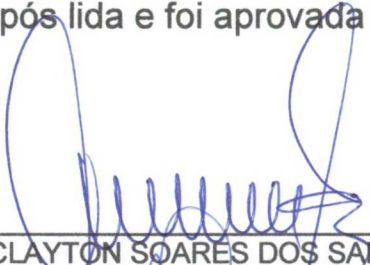


2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)
Jan	2.152.994,73	0,00	0,00	2.119.707,69	-33.287,04	-1,55%	0,69%
Fev	2.119.707,69	0,00	0,00	2.112.075,97	-7.631,72	-0,36%	1,26%
Mar	2.112.075,97	0,00	0,00	2.129.529,03	17.453,06	0,83%	1,44%
Abr	2.129.529,03	0,00	0,00	2.204.156,03	74.627,00	3,50%	0,75%
Mai	2.204.156,03	0,00	0,00	2.232.711,54	28.555,51	1,30%	1,29%
Jun	2.232.711,54	0,00	0,00	2.269.249,79	36.538,25	1,64%	0,99%
Jul	2.269.249,79	0,00	0,00	2.219.003,31	-50.246,48	-2,21%	1,45%
Ago	2.219.003,31	0,00	0,00	2.198.452,84	-20.550,47	-0,93%	1,36%



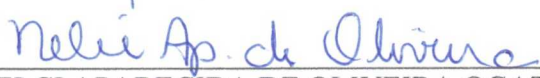
6) ENCERRAMENTO: Nada mais havendo a tratar o (a) Presidente deu por encerrado os trabalhos, as dez horas e trinta minutos, lavrou-se a presente ata a que se refere esta reunião do Comitê de Investimentos após lida e foi aprovada por unanimidade dos membros presentes.



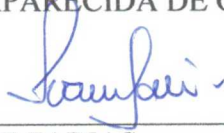
CLAYTON SOARES DOS SANTOS



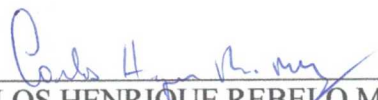
GLACIANE ARRUDA DE OLIVEIRA CABRAL



NELCI APARECIDA DE OLIVEIRA OGATA



IVANI DE FARIAS



CARLOS HENRIQUE REBELO MAGALHÃES