



INSTITUTO DE
PREVIDÊNCIA DOS
SERVIDORES PÚBLICOS
DE AQUIDAUANA



ATA Nº. 010 / 2023 - DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA
DOS SERVIDORES PÚBLICO DE AQUIDAUANA – AQUIDAUANA PREV

REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO – MÊS DE SETEMBRO / 2023

Aos vinte dias do mês de outubro de dois mil e vinte e três, às 14:00 horas, na Sala de Reuniões do Instituto de Previdência dos Servidores Públicos de Aquidauana, doravante Aquidauana Prev., sito à Rua Marechal Mallet, nº. 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 009/2023, do Comitê de Investimento, procedeu a leitura da mesma e, não havendo emendas, nem impugnações, foi considerada aprovada a ata nº 009/2023, 2º) Análise do Relatório Analítico de Investimento do mês de setembro de 2023, 3º) Parecer do Comitê de Investimento do mês setembro de 2023. Os trabalhos foram abertos pela senhora Ana Claudia Barcelos. Ato contínuo verificou a existência de quórum e declarou aberta a reunião, dando início à reunião, o senhor Gilson relatou a atual realidade do mercado financeiro e atual posição das carteiras de investimentos apontadas no Relatório Analítico dos Investimentos em setembro de 2023, que após análise, relatou que as diversificações apresentadas nas carteiras no mês, tem no seu enquadramento a estratégia de alocação em Renda Fixa totaliza 59,45% da carteira, Renda Variável totaliza 35,57% da carteira e em Fundos Exterior 4,98% da carteira. O relatório apresentou um saldo de retorno positivo no mês de setembro de 2023 no valor de R\$ 47.059,85 (Quarenta e sete mil, cinquenta e nove reais e oitenta e cinco), onde a carteira de **Renda fixa** apresentou um retorno positivo no valor de R\$ 127.694,25, em **Renda Variável** o retorno foi positivo no valor de R\$ 4.722,40 e **Fundos Exterior** o retorno negativo no valor R\$ -85.356,80. No terceiro trimestre de 2023, tem no seu enquadramento a estratégia de alocação, apresentou um saldo de retorno no valor de R\$ 488.135,99 (Quatrocentos e oitenta e oito mil, cento e trinta e cinco reais e noventa e nove centavos), onde a carteira de **Renda fixa** apresentou um retorno positivo no valor de R\$ 639.006,84, em **Renda Variável** o retorno foi negativo no valor de R\$ -177.783,22 e **Fundos Exterior** o retorno positivo no valor R\$ 26.912,37. No acumulado no ano de 2023 apresentou um saldo de retorno positivo até o mês de setembro de 2023 no valor de R\$ 4.101.559,04, totalizando um saldo até o mês de setembro na carteira (Resolução CMN) em investimento R\$ 48.572.179,31 (Quarenta e oito milhões, quinhentos e setenta e dois mil, cento e setenta e nove reais e trinta e um centavos). O Senhor Gilson informou que no mês foi solicitado análise de fundos de investimento, somente a Análise da Carteira do Instituto “Relatório de Análise de Portfólio, Sugestão e Realocação” no qual o relatório apresentou a recomendação “a exposição em títulos em títulos privados, Ações – SMALL/MID CAPS, IMAB-5 e Ações Dividendos, diminuindo a exposição em CDI, GESTÃO DURETION e Multi Mercado – Moderado.

Sugestão de Realocação Completa

Origem da Aplicação	Resgate (\$)		Aplicação (\$)	Sugestão de Ativo
CDI	500.000,00	→	500.000,00	AÇÕES - SMALL / MID CAPS
CDI	2.000.000,00	→	2.000.000,00	TÍTULOS PRIVADOS
GESTÃO DURATION	2.500.000,00	→	2.500.000,00	IMA-B 5
MULTIMERCADO - MODERADO	500.000,00	→	500.000,00	AÇÕES - DIVIDENDOS

Diante do cenário econômico de altas taxas de juros (Selic) e instabilidade atual do cenário econômico, ressaltando ainda a importância da diversificação nos segmentos de ações, foi realizada realocação, resgatada das carteiras em IMA-B e realocados “aplicado” em certas Ações Dividendos e Alocação Ativa Retorno, a fim de buscar melhor estratégia, diante das expectativas da economia na mudanças na taxa de juros no âmbito doméstico e no exterior. A sugestão de realocação do relatório tem como o resgate das carteiras em CDI, Gestão Duretion e MultiMerdado – Moderado e como sugestão em certas IMAB-5, Títulos Privados, Ações Dividendos e Ações – SMALL /MID CAPS. O relatório de análise “Retorno de Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023, apresentou retorno positivo de investimentos até o mês de setembro de 2023, e veio atender o cumprimento da Meta Atuarial no acumulado até o mês de “Investimentos de 7,44% quando ao IPCA + 5,14% a. a é de 8,64%, vindo a cumprir a meta atuarial na Resolução 3.922/2010, conforme Relatório de Análise abaixo;



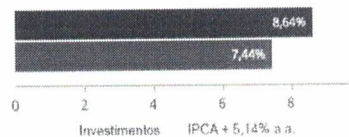
CRÉDITO & MERCADO

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE AQUIDAUANA - AQUIDAUANA PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/09/2023

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	48.375.176,24	786.650,00	1.405.694,80	49.477.060,35	717.637,91	717.637,91	1,45%	1,45%	0,97%	0,97%	140,74%	3,14%
Fevereiro	48.477.969,35	77.200,00	652.903,57	48.252.037,88	-350.207,90	367.010,01	-0,71%	0,74%	1,20%	2,18%	33,68%	2,72%
Março	48.252.037,88	1.941.745,21	974.654,80	49.504.200,96	285.072,47	652.682,48	0,58%	1,32%	1,17%	3,36%	39,01%	2,45%
Abril	49.504.200,96	576.700,00	2.272.014,81	48.345.903,11	536.416,76	1.189.099,24	1,08%	2,42%	0,97%	4,39%	65,11%	2,99%
Mai	48.345.903,11	6.964.200,00	7.520.414,39	48.865.128,66	3.066.040,14	2.255.139,26	2,21%	4,68%	0,67%	5,08%	91,96%	2,47%
Junho	48.865.128,66	366.082,13	974.229,67	49.635.264,99	1.356.263,67	3.613.423,05	2,78%	7,58%	0,34%	5,44%	139,42%	2,55%
Julho	49.635.264,99	278.000,00	447.188,06	50.207.939,38	741.860,45	4.355.283,50	1,49%	9,19%	0,54%	6,01%	152,99%	2,40%
Agosto	50.207.939,38	4.745.425,85	5.863.005,54	48.769.578,38	-300.784,31	4.054.499,19	-0,60%	8,54%	0,60%	6,74%	126,89%	2,55%
Setembro	48.769.578,38	2.604.000,00	3.068.456,92	48.572.179,31	47.059,85	4.101.559,04	0,10%	8,64%	0,60%	7,44%	116,11%	2,60%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



RUA MARECHAM MALLET, n.º 353, Centro, AQUIDAUANA - MS
CEP 79200-000 FONE-FAX (67) 3241-2019 - E-mail atendimento@aquidauanaprev.ms.gov.br
CNPJ 05.030.089/0001-52

Pró-Gestão Nível I




No mês as carteiras de investimentos apresentaram retornos *positivos* na carteira de Fundos de Renda Fixa, Renda Variável e retorno *negativo* no Fundos Exterior, apresentando ainda uma valorização em relação ao mês anterior, conforme relatório de evolução patrimonial e indicadores. No terceiro trimestre as carteiras de investimentos apresentaram retornos *positivos* nas carteiras de Fundos de Renda Fixa e Fundos Exterior e retorno *negativo* no Fundos de Renda Variável.

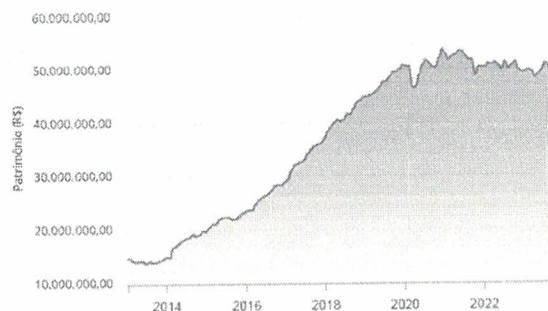


**CRÉDITO
& MERCADO**

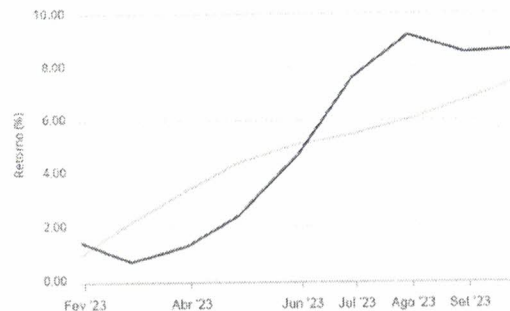
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE AQUIDAUANA - AQUIDAUANA PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/09/2023

Evolução do Patrimônio



Comparativo




Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
 IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
 IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

Diante do cenário apresentado e das recomendações sugeridas pela assessoria da Crédito Mercado e das carteiras sugeridas das Instituições Banco do Brasil, Caixa Econômica Federal e Banco Santander Brasil, o comitê decidiu manter as estratégias e buscar novas exposição em Títulos Públicos, Títulos Privados e Ações Dividendos, procurando um melhor momento e oportunidades do mercado, buscando junto as instituições financeiras sugestões para melhores fundos, diante da solicitação e aprovação das análise dos fundos, no foi solicitado análise dos fundos BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP e DAYCOVAL CLASSIC FI RANDA FIXA CREDITO PRIVADO. O comitê ratificou sobre a aplicações e resgates ocorrido no mês de setembro de 2023 e devidamente autorizado pelo Conselho de Administração 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” com conclusão da análise do portfólio das carteiras. Em seguida, o senhor Gilson apresentou fez apresentação do Parecer do Comitê de Investimento, competência do mês de setembro de 2023, no qual os membros do comitê após apresentação e avaliação, deliberarão pela aprovação. Finalizado todos os conteúdos pautados e nada mais tendo a tratar, foi declarada e encerrada a presente reunião a 15:35 horas, e eu Ana Claudia Barcelos, na qualidade de Gestora de Recursos lavrei a presente ata, onde lida e achada exata, vai assinada pelos membros presentes.

COMITÊ DE INVESTIMENTO:




GILSON SEBASTIÃO MENEZES
Membro do Comitê de Investimento
CPF: 437.348.041-91
Certificação: CGRPPS – 3155
Validade: 18.03.2026



ANA CLAUDIA BARCELOS
Membro do Comitê de Investimento
CPF: 489.783.371-04
Certificação: APIMEC
Validade: 31.01.2027

ELIZABETH ORTIZ
Membro do Comitê de Investimento
CPF: 250.463.061-15
Certificação da ANBIMA – CPA - 10
Validade: 13.03.2024




FRANCISCO TAVARES DA CÂMARA
Membro do Comitê de Investimento
CPF: 273.328.101-15
Certificação: CGEPPS – 6472
Validade: 30/03/2026



**INSTITUTO DE
PREVIDÊNCIA DOS
SERVIDORES PÚBLICOS
DE AQUIDAUANA**




ADRIANA COSTA MARQUES
Membro do Comitê de Investimento
CPF: 908.424.211-49
Certificação: CGRPPS – 5002
Validade: 25/07/2025

RUA MARECHAM MALLET, nº. 353, Centro, AQUIDAUANA - MS
CEP 79200-000 FONE-FAX (67) 3241-2019 - E-mail atendimento@aquidauanaprev.ms.gov.br
CNPJ 05.030.089/0001-52