IMPRERP

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DE RIBEIRÃO PIRES

ATA DE REUNIÃO Nº 10/2022 DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DE RIBEIRÃO PIRES – IMPRERP.

Aos vinte e nove dias do mês de Agosto 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, ALLINY RIBEIRO BOTTARO, ADRIANO OLIVEIRA DA SILVA e ROBERTO APARECIDO ZIGIATTI, 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 julho de 2022 e Movimentações:** O saldo da carteira de investimentos do instituto em Julho/2022 foi de R$ 131.768.158,42 (cento e trinta e um milhões, setecentos e sessenta e oito mil, cento e cinquenta e oito reais e quarenta e dois centavos). A meta a ser atingida no mês era 1,74 %, o IMPRERP ficou em : **0,96%** **2) REPASSES:** A Prefeitura Municipal efetuou os repasses pertinentes aos parcelamentos e as contribuições previdenciárias do fundo financeiro (38.587-5) no valor R$ 806.346,95 (oitocentos e seis mil, trezentos e quarenta e seis reais e noventa e cinco centavos) que foram investidos no fundo BB PERFIL – CNPJ: 13.077.418/0001-49, do fundo previdenciário (38.586-7) no valor de R$ 1.311.980,98 (um milhão, trezentos e onze mil, novecentos e oitenta reais e noventa e oito centavos) que foi investido no fundo BB PERFIL – CNPJ: 13.077.418/0001-49 e R$ 169.751,88 (cento e sessenta e nove mil, setecentos e cinquenta e um reais e oitenta e oito centavos) referentes ao acordo de parcelamento do mês que foram investidos no fundo BB PERFIL – CNPJ: 13.077.418/0001-49. A Câmara Municipal efetuou os repasses pertinentes as contribuições do fundo financeiro (38.587-5) no valor R$ 32.407,32 (trinta e dois mil, quatrocentos e sete reais e trinta e dois centavos) que foram investidos no fundo BB PERFIL – CNPJ: 13.077.418/0001-49. **3) PROPOSIÇÕES DE INVESTIMENTOS/DESINVESTIMENTOS:** Foram resgatados R$ 1.000.000,00 (um milhão de reais) do fundo BB RF IDK2 – CNPJ: 13.322.205/0001-35 (conta corrente: 38.587-5 Banco do Brasil) que foram investidos no fundo BB PERFIL – CNPJ: 13.077.418/0001-49. **4) FATOS RELEVANTES**: A consultora Simone Lopes (Crédito e Mercado) apresentou o Relatório de Investimentos (vide anexo) e avaliou nossa carteira de Julho e nos aconselhou a mantermos a diversificação e que não há o que alterar por conta do cenário econômico. **5) Os FUNDOS ILÍQUIDOS:** AR, CARE 11, W7 e VECTOR continuam com desempenho abaixo da meta. **6) ENCERRAMENTO:** O cenário atual não favorece ao atingimento da meta atuarial, todas as manobras que poderiam ser feitas foram executadas. O que o IMPRERP poderá fazer é manter a diversificação e de acordo com o Relatório de Investimento de Junho aplicar dinheiro novo em IRFM ou DI. Nada mais havendo a tratar o (a) Presidente deu por encerrado os trabalhos, as onze horas e dez 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.

IMPRERP

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DE RIBEIRÃO PIRES

CLAYTON SOARES DOS SANTOS

GLACIANE ARRUDA DE OLIVEIRA CABRAL

ALLINY RIBEIRO BOTTARO

ADRIANO OLIVEIRA DA SILVA

ROBERTO APARECIDO ZIGIATTI

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

CM

Consultoria em Investimentos

PERFORMANCE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO IMPRERP / JAN A JUNHO DE 2022

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO IMPRERP BASE JUNHO 2022

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.042.667,07	0,78%	439	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	16.395.437,00	12,30%	1.077	0,17%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	7.161.825,95	5,37%	820	0,10%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	57.845,54	0,04%	597	0,00%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	497.307,57	0,37%	101	0,29%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.140.243,43	0,86%	1.068	0,02%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	270,66	0,00%	453	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2024	5.023.102,88	3,77%	161	0,33%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	463 dias	41.862.458,69	31,40%	218	1,21%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	2.008.240,95	1,51%	179	0,09%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.070.974,51	0,80%	868	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.264.072,44	0,95%	1.073	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	50.938,94	0,04%	1.024	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	843,19	0,00%	272	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	9.440,71	0,01%	798	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	7.534.515,92	5,65%	547	0,20%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	24.104,22	0,02%	228	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.827.451,76	1,37%	974	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	306.319,66	0,23%	948	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	90.652,91	0,07%	588	0,00%

CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	10.518,50	0,01%	262	0,00%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não pos...	Não há	3.584.824,62	2,69%	8	18,19%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	4.423.679,46	3,32%	33.893	0,28%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.926.367,99	2,20%	2.100	0,30%
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	6.383.976,82	4,79%	7.149	0,00%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	218.064,14	0,16%	4.019	0,08%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.610.972,48	1,21%	25.804	0,12%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	167.514,43	0,13%	13.635	0,05%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.540.496,46	1,91%	1.588	0,39%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	426.827,04	0,32%	177	0,00%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	2.575.752,36	1,93%	34.606	0,48%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	7.346.200,77	5,51%	17.281	0,95%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	9.736,89	0,01%	100	0,01%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.865.508,63	2,90%	9.808	0,16%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	382.253,82	0,29%	12.074	0,02%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	2.696.080,18	2,02%	150	0,28%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	848.995,34	0,64%	5.324	0,39%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	3.321.220,61	2,49%	28	2,46%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	966.193,28	0,72%		0,65%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	1.632.797,17	1,22%		2,57%
Total para cálculo dos limites da Resolução			**133.306.694,99**			
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			**1.045,52**			
PL Total			**133.307.740,51**			

RETORNOS

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno ($)	Retorno Acum ($)	Retorno Mês (%)	Retorno Acum (%)	Meta Mês(%)	Meta Acum (%)	(%) da META
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%
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%
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%
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%
Maio	133.320.564,91	44.920.830,83	44.425.004,92	135.199.970,30	1.383.579,48	1.750.659,22	1,03%	1,31%	0,90%	6,91%	18,94%
Junho	135.199.970,30	7.990.321,70	7.109.367,03	133.306.694,99	-2.774.229,98	-1.023.570,76	-2,04%	-0,76%	1,08%	**8,07%**	-9,37%

META DE RENTABILIDADE DETERMINADA NA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2022 (IPCA +5,04%)

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO IMPRERP

Sub-segmento	Valor	%	Característica
GESTÃO DURATION	8.605.490,43	6,46%	GESTÃO DURATION - R$ 8.605.490,43 - 6,4554%
IMA-B 5+	843,19	0,00%	LONGUÍSSIMO PRAZO - R$ 843,19 - 0,0006%
IMA-GERAL	1.539.974,64	1,16%	LONGO PRAZO - R$ 5.226.708,23 - 3,9208%
IMA-B	101.908,97	0,08%	
FIDC	3.584.824,62	2,69%	
IRF-M	270,66	0,00%	MÉDIO PRAZO - R$ 31.903.888,82 - 23,9325%
IDKA IPCA 2A	17.659.509,44	13,25%	
IMA-B 5	14.244.108,72	10,69%	
IRF-M 1	1.140.243,43	0,86%	CURTO PRAZO - R$ 45.228.171,97 - 33,9276%
CDI	44.086.883,02	33,07%	
DISP. FINANCEIRA	1.045,52	0,00%	
AÇÕES - LIVRES	4.578.295,98	3,43%	AÇÕES - R$ 14.274.219,36 - 10,7077%
AÇÕES - SETORIAIS	6.383.976,82	4,79%	
AÇÕES - DIVIDENDOS	218.064,14	0,16%	
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	167.514,43	0,13%	
AÇÕES - VALOR	2.926.367,99	2,20%	
MULTIMERCADO - MACRO	3.865.508,63	2,90%	MULTIMERCADO - R$ 3.875.245,52 - 2,9070%
MULTIMERCADO - MODERADO	9.736,89	0,01%	
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.598.990,45	1,95%	FUNDO IMOBILIÁRIO - R$ 2.598.990,45 - 1,9496%
FIP	3.321.220,61	2,49%	FIP - R$ 3.321.220,61 - 2,4914%
AÇÕES - EXTERIOR	14.345.632,59	10,76%	EXTERIOR - R$ 18.272.961,93 - 13,7074%
MULTIMERCADO - EXTERIOR	3.927.329,34	2,95%	

BANCO CENTRAL DO BRASIL | Focus Relatório de Mercado

Expectativas de Mercado

22 de julho de 2022

▲ Aumento ▼ Diminuição = Estabilidade

Mediana - Agregado	2022							2023							2024					2025					
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **
IPCA (variação %)	8,27	7,54	7,30	▼	(4)	134	7,18	99	4,91	5,20	5,30	▲	(16)	133	5,30	99	3,25	3,30	3,30	=	(2)	99	3,00	3,00	3,00	=	(54)	91
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	1,50	1,75	1,93	▲	(4)	95	1,98	57	0,50	0,50	0,49	▼	(1)	91	0,47	54	1,80	1,80	1,70	▼	(1)	69	2,00	2,00	2,00	=	(37)	66
Câmbio (R$/US$)	5,10	5,13	5,20	▲	(1)	113	5,25	75	5,10	5,10	5,20	▲	(1)	110	5,20	73	5,08	5,05	5,10	▲	(1)	83	5,15	5,14	5,15	▲	(1)	78
Selic (% a.a)	13,75	13,75	13,75	=	(5)	130	13,75	84	10,25	10,75	10,75	=	(1)	127	10,75	81	7,75	8,00	8,00	=	(2)	105	7,50	7,50	7,50	=	(7)	96
IGP-M (variação %)	12,41	11,88	11,59	▼	(4)	74	11,49	51	4,58	4,75	4,77	▲	(5)	70	4,88	50	4,00	4,00	4,00	=	(39)	58	4,00	4,00	3,90	▼	(1)	55
IPCA Administrados (variação %)	3,81	1,74	0,01	▼	(9)	77	-0,55	61	5,53	6,50	7,06	▲	(11)	70	7,07	55	3,50	3,50	3,80	▲	(1)	46	3,02	3,50	3,50	=	(1)	42
Conta corrente (US$ bilhões)	-18,00	-18,00	-18,00	=	(5)	25	-18,00	13	-30,90	-30,60	-30,00	▲	(2)	21	-27,20	12	-40,00	-40,00	-39,70	▲	(1)	15	-39,25	-40,39	-40,00	▲	(1)	13
Balança comercial (US$ bilhões)	70,00	68,18	68,50	▲	(1)	25	71,60	13	60,00	60,00	60,00	=	(1)	21	60,00	12	58,75	51,80	52,40	▲	(1)	16	49,75	48,75	51,30	▲	(1)	13
Investimento direto no país (US$ bilhões)	60,00	57,20	57,85	▲	(1)	26	60,00	13	62,75	60,50	60,75	▲	(1)	22	60,75	12	70,00	70,00	70,00	=	(1)	17	75,00	70,91	71,82	▲	(1)	15
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	59,00	59,23	59,00	▼	(1)	19	58,80	10	62,00	63,50	63,60	▲	(2)	17	63,25	10	63,00	63,00	64,10	▲	(1)	14	64,55	66,20	65,15	▼	(1)	12
Resultado primário (% do PIB)	0,10	0,10	0,22	▲	(1)	26	0,30	15	-0,10	-0,20	-0,30	▼	(1)	25	-0,20	15	0,00	0,00	0,00	=	(4)	19	0,00	0,40	0,00	▼	(1)	17
Resultado nominal (% do PIB)	-6,70	-6,70	-6,80	▼	(1)	21	-6,80	11	-7,60	-7,60	-7,70	▼	(1)	19	-7,70	11	-5,70	-5,70	-5,70	=	(4)	15	-4,85	-4,50	-4,80	▼	(1)	13

* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias *** respondentes nos últimos 5 dias úteis

2022 2023 2024 2025