

RELATÓRIO DE FECHAMENTO MENSAL
COMPETÊNCIA: AGOSTO 2020
INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE ITAÚNA

A Gerencia de Investimentos do Instituto Municipal de Previdência dos Servidores Públicos de Itaúna, através deste, vem demonstrar o fechamento do mês Agosto de 2020, apontando sua rentabilidade e demais informações para promoção da transparência pública, com intuito de divulgar os resultados dos investimentos dos recursos deste Instituto.

A Gerência de Investimentos realiza seus trabalhos com apoio de consultoria externa, conforme previsto no § 1º, do artigo 117-A da Lei Municipal nº 4.175/07 e suas alterações. A atual consultoria é a empresa Par Engenharia Financeira Ltda – CNPJ: 20.306.104/0001-36.

Em respeito à transparência das ações realizadas por esta gerência apresentamos o fechamento das rentabilidades do mês Agosto de 2020:

1. A carteira de investimentos do Instituto fechou o mês com 69,53% (sessenta e nove vírgula cinquenta e três por cento) em ativos de renda fixa, 29,44% (trinta vírgula quarenta e quatro por cento) em ativos de renda variável e 1,03% (zero vírgula zero três por cento) em ativos do exterior.
2. Os **ativos de renda fixa** estão distribuídos em consonância a Resolução CMN nº 3922/10 e suas alterações, com os seguintes percentuais: artigo 7º, inciso I, alínea b, o total de R\$ 80.948.672,01 (oitenta milhões novecentos e quarente e oito mil, seiscentos e setenta e dois reais e um centavo) sendo 45,84% (quarenta e cinco vírgula oitenta e quatro por cento) da carteira; artigo 7º, inciso IV, alínea a, o total de R\$ 37.063.332,52 (trinta e sete milhões sessenta e três mil trezentos e trinta e dois reais e cinquenta e dois centavos) sendo 20,99% (vinte vírgula noventa e nove por cento) da carteira; artigo 7º, inciso VII, alínea a, o total de R\$ 4.764.982,22 (quatro milhões setecentos e sessenta e quatro mil novecentos e oitenta e dois reais e vinte e dois centavos) sendo 2,70% (dois vírgula setenta por cento) da carteira;
 - 2.1. A carteira possui atualmente 18 (dezoito) ativos de renda fixa, que estão em conformidade com a legislação aplicável, tendo o seguinte fechamento em agosto/2020: saldo total de R\$ 122.776.986,75 (cento e vinte e dois milhões, setecentos e setenta e seis mil, novecentos e oitenta e seis reais e setenta e cinco centavos), estando este valor distribuído nos seguintes segmentos: R\$ 42.342.908,12 (quarenta e dois milhões, trezentos e quarenta e dois mil, novecentos e oito reais e doze centavos), equivalente a 23,98% (vinte e três vírgula noventa e oito por cento) do total da carteira do Instituto em Gestão de Duration; R\$ 15.796.151,04 (quinze milhões, setecentos e noventa e seis mil, cento e cinquenta e um reais e quatro centavos), equivalente a 8,95% (oito vírgula noventa e cinco por cento) do total da carteira do Instituto em IMA-B; R\$ 30.591.421,57 (trinta milhões, quinhentos e noventa e um mil, quatrocentos e vinte e um reais e cinquenta e sete centavos), equivalente a 17,32% (dezessete vírgula trinta e dois por cento) do total da carteira do Instituto em IMA-B 5; R\$ 10.543.763,21 (dez milhões, quinhentos e quarenta e três mil setecentos e sessenta e três reais e vinte e um centavos), equivalente a 5,97% (cinco vírgula noventa e sete por cento) do total da carteira do Instituto em CDI; R\$ 7.281.939,72 (sete milhões, duzentos e oitenta e um mil, novecentos e trinta e nove reais e setenta e dois centavos), equivalente a 4,12% (quatro vírgula doze por cento) do total da carteira do Instituto em IDKA PRÉ 2A; R\$ 10.287.039,26 (dez milhões,

Assinaturas manuscritas em azul

- duzentos e oitenta e sete mil, trinta e nove reais e vinte e seis centavos), equivalente a 5,83% (cinco vírgula oitenta e três por cento) do total da carteira do Instituto em IDKA IPCA 2A; R\$ 4.764.982,22 (quatro milhões, setecentos e sessenta e quatro mil, novecentos e oitenta e dois reais e vinte e dois centavos), equivalente a 2,70% (dois vírgula setenta por cento) do total da carteira do Instituto em FIDC; R\$ 1.168.781,61 (um milhão, cento e sessenta e oito mil, setecentos e oitenta e um reais e sessenta e um centavos) equivalente a 0,66% (zero vírgula sessenta e seis por cento) do total da carteira do Instituto em IRF-MI;
3. Os **ativos de renda variável** estão distribuídos conforme Resolução CMN nº 3922/10 e suas alterações, com os seguintes percentuais: artigo 8º, inciso II, alínea a, total de R\$ 32.643.251,78 (trinta e dois milhões, seiscentos e quarenta e três mil, duzentos e cinquenta e um reais e setenta e oito centavos) equivalente a 18,49% (dezoito vírgula quarenta e nove por cento) do total da carteira do Instituto; artigo 8º, inciso III, R\$ 13.387.260,26 (treze milhões, trezentos e oitenta e sete mil, duzentos e sessenta reais e vinte e seis centavos) equivalente a 7,58% (sete vírgula cinquenta e oito por cento) do total da carteira do Instituto; artigo 8º, inciso IV, alínea a, total de R\$ 5.946.858,44 (cinco milhões, novecentos e quarenta e seis mil, oitocentos e cinquenta e oito reais e quarenta e quatro centavos) equivalente a 3,37% (três vírgula trinta e sete por cento) do total da carteira do Instituto;
- 3.1. A carteira possui atualmente 14 (quatorze) ativos de renda variável, estando eles em conformidade com a legislação aplicável, tendo o seguinte fechamento em Agosto/2020: saldo total de R\$ 51.977.370,48 (cinquenta e um milhões, novecentos e setenta e sete mil, trezentos e setenta reais e quarenta e oito centavos), estando este valor distribuído nos seguintes segmentos de investimentos: R\$ 24.267.285,74 (vinte e quatro milhões, duzentos e sessenta e sete mil, duzentos e oitenta e cinco reais e setenta e quatro centavos) equivalente a 13,74% (treze vírgula setenta e quatro por cento) do total da carteira do Instituto em Ações Livres; R\$ 8.375.966,04 (oito milhões, trezentos e setenta e cinco mil, novecentos e sessenta e seis reais e quatro centavos) equivalente a 4,74% (quatro vírgula setenta e quatro por cento) do total da carteira do Instituto em Ações - Valor; R\$ 6.383.565,89 (seis milhões, trezentos e oitenta e três mil, quinhentos e sessenta e cinco reais e oitenta e nove centavos), equivalente a 3,62% (três vírgula sessenta e dois por cento) do total da carteira do Instituto em Multimercado Macro; R\$ 1.709.074,86 (um milhão, setecentos e nove mil, setenta e quatro reais e oitenta e seis centavos), equivalente a 0,97% (zero vírgula noventa e sete por cento) do total da carteira do Instituto em Multimercado Exterior; R\$ 5.294.619,51 (cinco milhões, duzentos e noventa e quatro mil, seiscentos e dezenove reais e cinquenta e um centavos), equivalente a 3,00% (três por cento) do total da carteira do Instituto em Multimercado - Outros; R\$ 5.946.858,44 (cinco milhões, novecentos e quarenta e seis mil, oitocentos e cinquenta e oito reais e quarenta e quatro centavos), equivalente a 3,37% (três vírgula trinta e sete por cento) do total da carteira do Instituto em FIP;
4. Os **ativos do exterior** estão distribuídos conforme Resolução CMN nº 3922/10 e suas alterações, com os seguintes percentuais: artigo 9º - A - inciso III, R\$ 1.823.154,45 (um milhão, oitocentos e vinte e três mil, cento e cinquenta e quatro reais e quarenta e cinco centavos) equivalente a 1,03% (um vírgula zero três por cento) do total da carteira do Instituto.
- 4.1 A carteira possui atualmente 1 (um) ativo de investimentos no exterior, estando ele em conformidade com a legislação aplicável, tendo o seguinte fechamento em agosto/2020: saldo total de R\$ 1.823.154,45 (um milhão, oitocentos e vinte e três mil, cento e cinquenta e quatro reais e quarenta e cinco centavos).



estando este valor investido no seguinte segmento: R\$ 1.823.154,45 (um milhão, oitocentos e vinte e três mil, cento e cinquenta e quatro reais e quarenta e cinco centavos) equivalente a 1,03% (um vírgula zero três por cento) do total da carteira do Instituto em Ações Exterior;

5. Considerando o somatório dos ativos de renda fixa, renda variável e exterior, a carteira do Instituto teve um fechamento em 31 de Agosto de 2020 com o saldo total de R\$ 176.577.511,68 (cento e setenta e seis milhões, quinhentos e setenta e sete mil, quinhentos e onze reais e sessenta e oito centavos);
6. O retorno acumulado da carteira do Instituto para o ano de 2020, considerando o fechamento de Agosto, foi de 1,10% (um vírgula dez por cento), sendo a meta atuarial estabelecida para o período de 4,58% (quatro vírgula cinquenta e oito por cento) o que equivale a IPCA + 5,87% (cinco vírgula oitenta e sete por cento), conforme Política de Investimentos. Em resumo, considerando o retorno acumulado do ano até o fechamento do mês de Agosto, o Instituto não cumpriu a meta estabelecida em legislação.

Observação: A disparidade apresentada entre o retorno acumulado e a meta atuarial, é em grande parte proporcionada pela alta volatilidade e desvalorização da renda variável ocorrida principalmente nos meses de fevereiro e março devido a decretação da pandemia do Covid19 pela OMS – Organização Mundial de Saúde. Ocorre que em fevereiro o Instituto estava com posicionamento em renda variável com o 29,06% de sua carteira, tendo um recuo para 24,89% em março, devido à desvalorização dos ativos de renda variável. Essa desvalorização trouxe a rentabilidade acumulada à patamares muito baixos em relação a meta atuarial.

Cumprir informar que nos meses de abril a julho o Instituto apresentou rentabilidade mensal superior a meta, o que proporcionou uma melhora na diminuição da disparidade acumulada para o ano.

Vale ressaltar também que o mercado financeiro ainda se recupera da crise provocada pelo Covid19, sendo este um dos principais motivos da alta volatilidade apresentada pelo mercado global.

7. No mês de Agosto o Instituto realizou uma alteração da carteira de investimentos, onde foi realizado o resgate de R\$ do Fundo FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES, sendo realizado aporte de R\$ 2.500.000,00 (dois milhões e quinhentos mil reais) no Fundo FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES, e aporte de R\$ 429.527,13 (quatrocentos e vinte e nove mil, quinhentos e vinte e sete reais e treze centavos) no Fundo CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP. A alteração realizada teve como intuito buscar um maior retorno em relação ao risco assumido entre os fundos de renda variável, uma vez que o Fundo FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES não apresentou resultado esperado nos últimos períodos analisados, bem como o Administrador e Gestor do fundo não estão na lista exaustiva publicada pela Secretaria de Previdência em relação as instituições aptas para receber aporte dos RPPS. A alocação no Fundo CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP teve como intuito a redução dos ativos de renda variável, visando enquadramento conforme Resolução 3.922/10, bem como posicionar o valor em investimento de renda fixa no período de instabilidade do mercado.

Sem mais, este é o relatório que será apresentado aos três órgãos colegiados, sendo: Comitê de Investimentos, Conselho Administrativo e Conselho Fiscal para apreciação e consideração pertinentes com posterior ratificação.

Itaúna – MG, 11 de setembro de 2020.

[Handwritten signatures and initials in blue ink]



Availton Ferreira Dutra
Gerente de Investimentos
Membros do Comitê de Investimentos

Comitê de Investimentos

Cláudia Carvalho dos Santos Silveira
Membro do Comitê de Investimentos

Kelly Cristina Mendes
Presidente do Comitê de Investimentos

Marco Aurélio Alves Pinto
Secretário do Comitê de Investimentos

Sandro Ferreira Pinto
Membro do Comitê de Investimentos

Ratificado pelo Comitê de Investimentos em Ata do dia 11/09 /2020.

Conselho Administrativo

Ângela Geralda Teixeira Ferreira
Secretária do Conselho Administrativo

Elaine Marra de Sousa Boaventura
Membro do Conselho Administrativo

Gisele de Oliveira Peixoto
Membro do Conselho Administrativo

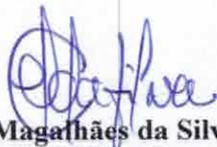
Júlia Márcia Bechtluft Souza
Membro do Conselho Administrativo

Leandro Nogueira de Souza
Membro do Conselho Administrativo

Leonel Araújo Camargos
Presidente do Conselho Administrativo

Ratificado pelo Conselho Administrativo em Ata do dia 22 / 09 /2020.

Conselho Fiscal



Elde Magalhães da Silva
Presidente do Conselho Fiscal



Joel Honório Antunes
Membro do Conselho Fiscal



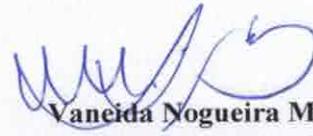
Maria Aparecida da Silva Soares
Membro do Conselho Fiscal



Roberto Morávia de Carvalho
Membro do Conselho Fiscal



Natália de Andrade Monteiro
Secretária do Conselho Fiscal



Vaneida Nogueira Mileib
Membro do Conselho Fiscal

Ratificado pelo Conselho Fiscal em Ata do dia 30 / 09 /2020.