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

A Gerência de Investimentos do Instituto Municipal de Previdência dos Servidores Públicos de Itaúna, através deste, vem retificar o fechamento do mês dezembro 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 dezembro de 2020:

1. A carteira de investimentos do Instituto fechou o mês com 66,58% (sessenta e seis vírgula cinquenta e oito por cento) em ativos de renda fixa, 32,47% (trinta e dois vírgula quarenta e sete por cento) em ativos de renda variável e 0,96% (zero vírgula noventa e seis 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$ 80.244.852,95 (oitenta milhões, duzentos e quarenta e quatro mil, oitocentos e cinquenta e dois reais e noventa e cinco centavos) sendo 42,58% (quarenta e dois vírgula cinquenta e oito por cento) da carteira; artigo 7º, inciso IV, alínea a, o total de R$ 40.295.437,02 (quarenta milhões, duzentos e noventa e cinco mil, quatrocentos e trinta e sete reais e dois centavos) sendo 21,38% (vinte e um virgula trinta e oito por cento) da carteira; artigo 7º, inciso VII, alínea a, o total de R$ 4.936.354,08 (quatro milhões novecentos e trinta e seis mil, trezentos e cinquenta e quatro reais e oito centavos) sendo 2,62% (dois vírgula sessenta e dois 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 dezembro/2020: saldo total de R$ 125.476.644,05 (cento e vinte e cinco milhões, quatrocentos e setenta e seis mil, seiscentos e quarenta e quatro reais e cinco centavos), estando este valor distribuído nos seguintes segmentos: R$ 42.933.983,41 (quarenta e dois milhões, novecentos e trinta e três mil, novecentos e oitenta e três reais e quarenta e um centavos), equivalente a 22,78% (vinte e dois vírgula setenta e oito por cento) do total da carteira do Instituto em Gestão de Duration; R$ 13.294.682,34 (treze milhões, duzentos e noventa e quatro mil, seiscentos e oitenta e dois reais e trinta e quatro centavos), equivalente a 7,05% (sete vírgula zero cinco por cento) do total da carteira do Instituto em IMA-B; R$ 26.666.657,33 (vinte e seis milhões, seiscentos e sessenta e seis mil, seiscentos e cinquenta e sete reais e trinta e três centavos), equivalente a 15,74% (quinze vírgula setenta e quatro por cento) do total da carteira do Instituto em IMA-B 5; R$ 13.426.559,29 (treze milhões, quatrocentos e vinte e seis mil, quinhentos e cinquenta e nove reais e vinte e nove centavos), equivalente a 7,12% (sete vírgula doze por cento) do total da carteira do Instituto em CDI; R$ 4.348.765,37 (quatro milhões, trezentos e quarenta e oito mil, setecentos e sessenta e cinco reais e trinta e sete centavos), equivalente a 2,31% (dois vírgula trinta e um por cento) do total da carteira do Instituto em IDKA PRÉ 2A; R$ 16.547.465,44 (dezesseis milhões,

quinhentos e quarenta e sete mil, quatrocentos e sessenta e cinco reais e quarenta e quatro centavos), equivalente a 8,78% (oito vírgula setenta e oito por cento) do total da carteira do Instituto em IDKA IPCA 2A; R$ 4.936.354,08 (quatro milhões, novecentos e trinta e seis mil, trezentos e cinquenta e quatro reais e oito centavos), equivalente a 2,62% (dois vírgula sessenta e dois por cento) do total da carteira do Instituto em FIDC; R$ 322.176,79 (trezentos e vinte e dois mil, cento e setenta e seis reais e setenta e nove centavos) equivalente a 0,17% (zero vírgula dezessete por cento) do total da carteira do Instituto em IRF-M1;

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$ 41.439.019,70 (quarenta e um milhões, quatrocentos e trinta e nove mil, dezenove reais e setenta centavos) equivalente a 21,99 (vinte e um vírgula noventa e nove por cento) do total da carteira do Instituto; artigo 8º, inciso III, R$ 13.692.579,28 (treze milhões, seiscentos e noventa e dois mil quinhentos e setenta e nove reais e vinte e oito centavos) equivalente a 7,26% (sete vírgula vinte e seis por cento) do total da carteira do Instituto; artigo 8º, inciso IV, alínea a, total de R$ 6.064.861,19 (seis milhões, sessenta e quatro mil oitocentos e sessenta e um reais e dezenove centavos) equivalente a 3,22 (três vírgula vinte e dois por cento) do total da carteira do Instituto;
   3.1. A carteira possui atualmente 17 (dezessete) ativos de renda variável, estando eles em conformidade com a legislação aplicável, tendo o seguinte fechamento em dezembro/2020: saldo total de R$ 61.196.460,17 (sessenta e um milhões, cento e noventa e seis mil, quatrocentos e sessenta reais e dezesete centavos), estando este valor distribuído nos seguintes segmentos de investimentos: R$ 25.294.382,71 (vinte e cinco milhões, duzentos e noventa e quatro mil, trezentos e oitenta e dois reais e setenta e um centavos) equivalente a 13,42% (treze vírgula quarenta e dois por cento) do total da carteira do Instituto em Ações Livres; R$ 10.083.286,96 (dez milhões, oitenta e três mil, duzentos e oitenta e seis reais e noventa e seis centavos) equivalente a 5,35% (cinco vírgula trinta e cinco por cento) do total da carteira do Instituto em Ações - Valor; R$ 2.945.605,56 (dois milhões, novecentos e quarenta e cinco mil seiscentos e cinco reais e cinquenta e seis centavos), equivalente a 1,56% (um virgula cinquenta e seis por cento) do total da carteira do Instituto em Ações – SMALL / MID CAPS; R$ 6.593.327,39 (seis milhões, quinhentos e noventa e três mil, trezentos e vinte e sete reais e trinta e nove centavos), equivalente a 3,50% (três vírgula cinquenta por cento) do total da carteira do Instituto em Multimercado Macro; R$ 1.811.977,97 (um milhão, oitocentos e onze mil, novecentos e setenta e sete reais e noventa e sete centavos), equivalente a 0,96% (zero vírgula noventa e seis por cento) do total da carteira do Instituto em Multimercado Exterior; R$ 5.287.273,92 (cinco milhões, duzentos e oitenta e sete mil, duzentos e setenta e três reais e noventa e dois centavos), equivalente a 2,81% (dois virgula oitenta e um por cento) do total da carteira do Instituto em Multimercado Conservador; R$ 6.064.861,19 (seis milhões, sessenta e quatro mil oitocentos e sessenta e um reais e dezenove centavos) equivalente a 3,22 (três vírgula vinte e dois por cento) do total da carteira do Instituto em FIP; R$ 3.115.744,47 (três milhões cento e quinze mil setecentos e quarenta e quatro reais e quarenta e sete centavos), equivalente a 1,65% (um vírgula sessenta e cinco por cento) do total da carteira do Instituto em Ações Dividendos;
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$ 1.800.588,26 (um milhão, oitocentos mil, quinhentos e

oitenta e oito reais e vinte e seis centavos) equivalente a 0,96% (zero virgula noventa e seis 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 dezembro/2020: saldo total de R$ 1.800.588,26 (um milhão, oitocentos mil, quinhentos e oitenta e oito reais e vinte e seis centavos), estando este valor investido no seguinte segmento: R$ 1.800.588,26 (um milhão, oitocentos mil, quinhentos e oitenta e oito reais e vinte e seis centavos) equivalente a 0,96% (zero virgula noventa e seis 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 dezembro de 2020 com o saldo total de R$ 188.473.692,48 (cento e oitenta e oito milhões, quatrocentos e setenta e três mil, seiscentos e noventa e dois reais e quarenta e oito centavos);
6. O retorno acumulado da carteira do Instituto para o ano de 2020, considerando o fechamento de dezembro, foi de 5,61% (cinco vírgula sessenta e um por cento), sendo a meta atuarial estabelecida para o período de 10,63% (dez vírgula sessenta e três 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 dezembro, o Instituto não cumpriu a meta estabelecida em legislação.

   Observação: A disparidade apresentada entre o retorno acumulado e a meta atuarial, é proveniente da volatilidade apresentada pelo mercado no decorrer do ano devido à pandemia que atravessamos. Destaca-se que durante os meses de fevereiro e março ocorreu o maior período de volatilidade devido o anuncio da pandemia Covid 19. A partir de abril o mercado iniciou uma recuperação, mas em agosto voltar a apresentar uma volatilidade enorme prejudicando a rentabilidade do Instituto.

   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.

   A retificação relatório de fechamento mensal de dezembro anteriormente aprovado se dá pelo fato do Fundo W7 MULTIESTRATÉGIA FIP ter sofrido um novo recálculo do valor das Cotas, o que gerou um novo valor de retorno acumulado.

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

Itaúna – MG, 23 de fevereiro de 2021.

Helton José Tavares da Cunha
Gerente de Investimentos
Membros do Comitê de Investimentos

Comitê de Investimentos

Availton Ferreira Dutra
Membro do Comitê de Investimentos

Kelly Cristina Mendes
Presidente do Comitê de Investimentos

Marco Aurélio Alves Pinto
Secretário do Comitê de Investimentos

Helton José Tavares da Cunha
Membro do Comitê de Investimentos

Cláudia Carvalho Santos Silveira
Membro do Comitê de Investimentos

Ratificado pelo Comitê de Investimentos em Ata do dia 23 / 02 /2021.

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 Bechtlufft 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 24 / 02 /2021.

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 24 / 02 /2021.