



RELATÓRIO DE FECHAMENTO MENSAL
COMPETÊNCIA: OUTUBRO 2020
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 demonstrar o fechamento do mês Outubro 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 Outubro de 2020:

1. A carteira de investimentos do Instituto fechou o mês com 69,19% (sessenta e nove vírgula dezenove por cento) em ativos de renda fixa, 29,81% (vinte e nove vírgula oitenta e um por cento) em ativos de renda variável e 1,00% (um 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\$ 80.696.326,92 (oitenta milhões seiscentos e noventa seis mil, trezentos e vinte e seis reais e noventa e dois centavos) sendo 45,87% (quarenta e cinco vírgula oitenta e sete por cento) da carteira; artigo 7º, inciso IV, alínea a, o total de R\$ 36.279.203,99 (trinta e seis milhões duzentos e setenta e nove reais, duzentos e três reais e noventa e nove centavos) sendo 20,62% (vinte vírgula sessenta e dois por cento) da carteira; artigo 7º, inciso VII, alínea a, o total de R\$ 4.761.596,80 (quatro milhões setecentos e sessenta e um mil, quinhentos e noventa e seis reais e oitenta centavos) sendo 2,71% (dois vírgula setenta e um 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 outubro/2020: saldo total de R\$ 121.737.127,71 (cento e vinte e um milhões, setecentos e trinta e sete mil, cento e vinte e sete reais e setenta e um centavos), estando este valor distribuído nos seguintes segmentos: R\$ 41.772.580,00 (quarenta e um milhões, setecentos e setenta e dois mil, quinhentos e oitenta reais), equivalente a 23,74% (vinte e três vírgula setenta e quatro por cento) do total da carteira do Instituto em Gestão de Duration; R\$ 15.585.990,59 (quinze milhões, quinhentos e oitenta e cinco mil, novecentos e noventa reais e cinquenta e nove centavos), equivalente a 8,86% (oito vírgula oitenta e seis por cento) do total da carteira do Instituto em IMA-B; R\$ 27.949.388,49 (vinte e sete milhões, novecentos e quarenta e nove mil, trezentos e oitenta e oito reais e quarenta e nove centavos), equivalente a 15,89% (quinze vírgula oitenta e nove por cento) do total da carteira do Instituto em IMA-B 5; R\$ 10.233.372,75 (dez milhões, duzentos e trinta e três mil, trezentos e setenta e dois reais e setenta e cinco centavos), equivalente a 5,82% (cinco vírgula oitenta e dois por cento) do total da carteira do Instituto em CDI; R\$ 7.188.112,71 (sete milhões, cento e oitenta e oito mil, cento e doze reais e setenta e um centavos), equivalente a 4,09% (quatro vírgula zero nove por cento) do total da carteira do Instituto em IDKA PRÉ 2A; R\$ 13.925.515,52 (treze milhões, novecentos e vinte e cinco mil, quinhentos e quinze reais e cinquenta e dois centavos), equivalente a 11,43% (onze vírgula quatro por cento) do total da carteira do Instituto em IDKA PRÉ 2A.

M. Souza
[Handwritten signatures]



- mil, quinhentos e quinze reais e cinquenta e dois centavos), equivalente a 7,92% (sete vírgula noventa e dois por cento) do total da carteira do Instituto em IDKA IPCA 2A; R\$ 4.761.596,80 (quatro milhões, setecentos e sessenta e um mil, quinhentos e noventa e seis reais e oitenta centavos), equivalente a 2,71% (dois vírgula setenta e um por cento) do total da carteira do Instituto em FIDC; R\$ 320.570,85 (trezentos e vinte mil, quinhentos e setenta reais e oitenta e cinco centavos) equivalente a 0,18% (zero vírgula dezoito 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\$ 31.236.346,35 (trinta e um milhões, duzentos e trinta e seis mil, trezentos e quarenta e seis reais e trinta e cinco centavos) equivalente a 17,94% (dezessete vírgula noventa e quatro por cento) do total da carteira do Instituto; artigo 8º, inciso III, R\$ 13.236.088,74 (treze milhões, duzentos e trinta e seis mil e oitenta e oito reais e setenta e quatro centavos) equivalente a 7,60% (sete vírgula sessenta por cento) do total da carteira do Instituto; artigo 8º, inciso IV, alínea a, total de R\$ 5.941.706,88 (cinco milhões, novecentos e quarenta e um mil, setecentos e seis reais e oitenta e oito centavos) equivalente a 3,41% (três vírgula quarenta e um por cento) do total da carteira do Instituto;
- 3.1. A carteira possui atualmente 15 (quinze) ativos de renda variável, estando eles em conformidade com a legislação aplicável, tendo o seguinte fechamento em Outubro/2020: saldo total de R\$ 50.414.141,97 (cinquenta milhões, quatrocentos e quatorze mil, cento e quarenta e um reais e noventa e sete centavos), estando este valor distribuído nos seguintes segmentos de investimentos: R\$ 22.859.795,21 (vinte e dois milhões, oitocentos e cinquenta e nove mil, setecentos e noventa e cinco reais e vinte e um centavos) equivalente a 12,99% (doze vírgula noventa e nove por cento) do total da carteira do Instituto em Ações Livres; R\$ 8.095.716,80 (oito milhões, noventa e cinco mil, setecentos e dezesseis reais e oitenta centavos) equivalente a 4,60% (quatro vírgula sessenta por cento) do total da carteira do Instituto em Ações - Valor; R\$ 6.304.061,65 (seis milhões, trezentos e quatro mil, sessenta e um reais e sessenta e cinco centavos), equivalente a 3,58% (três vírgula cinquenta e oito por cento) do total da carteira do Instituto em Multimercado Macro; R\$ 1.589.765,14 (um milhão, quinhentos e oitenta e nove mil, setecentos e sessenta e cinco reais e quatorze centavos), equivalente a 0,90% (zero vírgula noventa por cento) do total da carteira do Instituto em Multimercado Exterior; R\$ 5.262.168,32 (cinco milhões, duzentos e sessenta e dois mil, cento e sessenta e oito reais e trinta e dois centavos), equivalente a 2,99% (dois vírgula noventa e nove por cento) do total da carteira do Instituto em Multimercado - Outros; R\$ 5.935.060,37 (cinco milhões, novecentos e trinta e cinco mil, sessenta reais e trinta e sete centavos), equivalente a 3,37% (três vírgula trinta e sete por cento) do total da carteira do Instituto em FIP; R\$ 2.399.426,85 (dois milhões, trezentos e noventa e nove mil, quatrocentos e vinte e seis reais e oitenta e cinco centavos), equivalente a 1,36% (um vírgula trinta e seis por cento) do total da carteira do Instituto em Ações - SMALL / MID CAPS;
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\$ 1.751.568,02 (um milhão, setecentos e cinquenta e um mil, quinhentos e sessenta e oito reais e dois centavos) equivalente a 1,00% (um por cento) do total da carteira do Instituto.

[Handwritten signatures and initials in blue ink]



- 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 outubro/2020: saldo total de R\$ 1.751.568,02 (um milhão, setecentos e cinquenta e um mil, quinhentos e sessenta e oito reais e dois centavos), estando este valor investido no seguinte segmento: R\$ 1.751.568,02 (um milhão, setecentos e cinquenta e um mil, quinhentos e sessenta e oito reais e dois centavos) equivalente a 1,00% (um 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 outubro de 2020 com o saldo total de R\$ 175.935.690,07 (cento e setenta e cinco milhões, novecentos e trinta e cinco mil, seiscentos e noventa reais e sete centavos);
6. O retorno acumulado da carteira do Instituto para o ano de 2020, considerando o fechamento de outubro, foi de - 0,76% (zero vírgula setenta e seis por cento - negativo), sendo a meta atuarial estabelecida para o período de 7,17% (sete vírgula dezessete 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 outubro, 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.

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 considerações pertinentes, com posterior ratificação.

Itaúna – MG, 17 de novembro de 2020.

Availton Ferreira Dutra
Gerente de Investimentos

Membros do Comitê de Investimentos

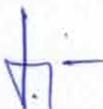
M. Souza
H.
[Handwritten signatures]

Comitê de Investimentos


Availton Ferreira Dutra
Membro do Comitê de Investimentos


Kelly Cristina Mendes
Presidente do Comitê de Investimentos

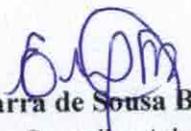

Marco Aurélio Alves Pinto
Secretário do Comitê de Investimentos


Sandro Ferreira Pinto
Membro do Comitê de Investimentos

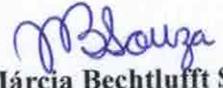
Ratificado pelo Comitê de Investimentos em Ata do dia 17 / 11 /2020.

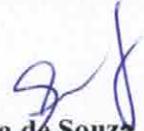
Conselho Administrativo

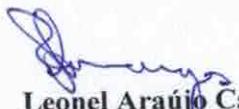

Ângela Geralda Teixeira Ferreira
Secretária do Conselho Administrativo


Elaine Marra de Sousa Boaventura
Membro do Conselho Administrativo


Giselê 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 27 / 11 /2020.









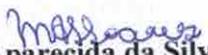




Conselho Fiscal

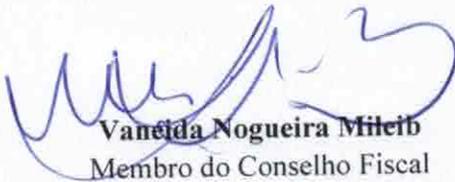

Elde Magalhães da Silva
Presidente do Conselho Fiscal


Joel Honorio Antunes
Membro do Conselho Fiscal


Maria Aparecida da Silva Soares
Membro do Conselho Fiscal


Roberto Moravia de Carvalho
Membro do Conselho Fiscal


Natália de Andrade Monteiro
Secretária do Conselho Fiscal


Vanêida Nogueira Milcib
Membro do Conselho Fiscal

Ratificado pelo Conselho Fiscal em Ata do dia 25 / 11 /2020.



