



# RELATÓRIO GERENCIAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

## **RELATÓRIO GERENCIAL DA CARTEIRA INVESTIMENTOS**

Este documento contempla o Relatório Semestral de Diligências, que demonstra a verificação dos lastros relativos aos títulos públicos e demais papéis incluídos nas carteiras de ativos dos fundos de investimentos aplicados pelo RPPS, utilização do ALM, além da análise da situação patrimonial, fiscal, comercial e jurídica das instituições investidas, tendo como suporte as informações prestadas pelas administradoras e gestoras dos fundos de investimentos e demais informações disponíveis na internet de conhecimento público, ou outros meios disponíveis no mercado acessíveis pelos RPPS.

Além disso, este presente documento contempla também o Relatório de Acompanhamento da Implementação das Estratégias, que demonstra o acompanhamento da implementação das estratégias de carteiras específicas para os compromissos do plano com seus segurados e beneficiários.

## Sumário

|   |   |
|---|---|
| APLICAÇÕES FINANCEIRAS .....                                | 3 |
| ESTRATÉGIAS NA MOVIMENTAÇÃO FINANCEIRA .....                | 3 |
| FUNDOS DE INVESTIMENTOS .....                               | 3 |
| FUNDOS CREDENCIADOS DO BANCO DO BRASIL S/A.....             | 4 |
| FUNDOS CREDENCIADOS DA XP INVESTIMENTOS .....               | 5 |
| XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA.....                             | 5 |
| INDIE CAPITAL INVESTIMENTOS LTDA.....                       | 5 |
| XP INVESTIMENTOS CCTVM.....                                 | 5 |
| INTRAG DISTR DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.....     | 5 |
| FUNDOS CREDENCIADOS DO BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S/A .... | 6 |
| POLÍTICA DE INVESTIMENTOS.....                              | 6 |
| RENTABILIDADE FINANCEIRA .....                              | 6 |
| LASTROS DOS PAPÉIS COM INVESTIMENTO DO FUNDO.....           | 7 |

## 1. APLICAÇÕES FINANCEIRAS

A Gerência de Assistência e Controle Contábil e Financeira – GECCF, através do Setor de Investimentos Financeiros, procura de forma responsável desempenhar diariamente a movimentação nos Fundos Credenciados do FUMPRES, em busca de boas rentabilidades no mercado financeiro.

## 2. ESTRATÉGIAS NA MOVIMENTAÇÃO FINANCEIRA

O Setor de Investimentos financeiros, extrai os extratos bancários junto aos Sites das Instituições Financeiras, busca as informações sobre os saldos das contas, taxas de aplicações diárias, mensal, anual e dos últimos 12 meses, que através de planilha analisa a forma de distribuição das aplicações financeiras nos Fundos Credenciados.

As informações adquiridas por meio do Site UOL Economia, oferece o acompanhamento do comportamento diário do Mercado Financeiro BOVESPA e do DÓLAR, consolidando os principais indicadores nos investimentos. Na análise desses índices com a BOVESPA em alta e o DÓLAR em queda, buscamos decisões objetivando boas rentabilidades, quando acontece na realização de prejuízo, o índice BOVESPA está em queda e o DÓLAR com tendência de fechamento em alta.

Utilizamos também, a estratégia para enquadramento dos limites de investimentos em atenção à Resolução nº 3922/2010, obedecendo a participação de 20% para cada Fundo e as Alíneas “A” 40% e “B” 100% principalmente no último dia de cada mês.

O histórico de cada Fundo Credenciado, também serve como parâmetro na análise e decisão de alterações na alocação dos recursos.

## 3. FUNDOS DE INVESTIMENTOS

O Credenciamento dos Fundos de Investimentos, tem como o objetivo diversificar as aplicações em ativos que estejam enquadrados na Resolução nº 3.992/2010.

O FUMPRES tem conhecimento dos aspectos que caracterizam cada Fundo de Investimento, em relação ao conteúdo do seu Regulamento e de fatos relevantes que possam contribuir para seu desempenho, além de sua compatibilidade ao perfil da carteira e à Política de investimentos do RPPS.

#### 4. FUNDOS CREDENCIADOS DO BANCO DO BRASIL S/A

Apresentamos os Fundos Credenciados junto ao Banco do Brasil S/A em 09/05/2019 Ata 005/2019 em Reunião do Comitê de Investimentos do Fundo Municipal de Previdência do Servidor - FUMPRES, com movimentação diária no exercício de 2020 na conta de receita 930.194-1:

| FUNDO                                 | CNPJ               |
|---------------------------------------|--------------------|
| BB RF DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO      | 07.214.377/0001-92 |
| BB PREVID RENDA FIXA FLUXO            | 13.077.415/0001-05 |
| BB PREVID RF PERFIL FI                | 13.077.418/0001-49 |
| BB PREVID SP AUTOMÁTICO               | 04.061.762/0001-59 |
| BB PREVID RF IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS | 11.328.882/0001-35 |
| BB PREVID RF IDKA 2                   | 13.322.205/0001-35 |
| BB PREVID RENDA FIXA IMA-B5 LP FIC    | 03.543.447/0001-03 |
| BB PREVID RF IMA GERAL EX-C FI        | 14.964.240/0001-10 |
| BB PREVID RF IRF-M                    | 07.111.384/0001-69 |
| BB PREVID IMA-B TP                    | 07.442.078/0001-05 |
| BB PREVID RF IMAB 5+                  | 13.327.340/0001-73 |
| BB PREVID RF ALOCAÇÃO                 | 25.078.994/0001-90 |
| BB MULTIMERCADO FI LP                 | 10.418.362/0001-50 |
| BB MULTIMERCADO ALOCAÇÃO FI           | 35.292.597/0001-70 |
| BB RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL    | 35.292.588/0001-89 |

Associação da Conta Corrente 930.256-5 com a finalidade de poupança para redução do Déficit Atuarial:

| <b>FUNDO</b>                     | <b>CNPJ</b>        |
|----------------------------------|--------------------|
| BB RF DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO | 07.214.377/0001-92 |

## 5. FUNDOS CREDENCIADOS DA XP INVESTIMENTOS

Em Reunião do Comitê de Investimentos do Fundo Municipal de Previdência do Servidor – FUMPRES, realizada em 10/08/2020 Ata 008/2020, após análise, os membros concluíram pelo deferimento do credenciamento dos fundos da XP Investimentos:

### 5.1 XP GESTÃO DE RECURSOS LTDA – CNPJ: 07.625.200/0001-89

| <b>INVESTIMENTO</b>          | <b>CNPJ</b>        |
|------------------------------|--------------------|
| XP INVESTOR FIA              | 07.152.170/0001-30 |
| XP DIVIDENDOS FIA            | 16.575.255/0001-12 |
| XP INVESTOR 30 FIC FIA       | 26.718.169/0001-75 |
| XP DIVIDENDOS 30 FIC FIA     | 26.773.140/0001-96 |
| XP AÇÕES FIA                 | 28.122.142/0001-40 |
| XP INFLAÇÃO FIRF REF IPCA LP | 14.146.491/0001-98 |

### 5.2 INDIE CAPITAL INVESTIMENTOS LTDA - CNPJ: 14.359.791/0001-55

### 5.3 XP INVESTIMENTOS CCTVM - CNPJ: 02.332.886/0001-04

| <b>INVESTIMENTO</b>                  | <b>CNPJ</b>        |
|--------------------------------------|--------------------|
| ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA       | 26.673.556/0001-32 |
| BAHIA AM VALUATION FIC AÇÕES         | 09.635.172/0001-06 |
| NEO FUTURE II FIC AÇÕES              | 29.994.491/0001-15 |
| NEO NATIVAS B FIC AÇÕES              | 26.218.614/0001-38 |
| NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 06.301.947/0001-19 |

### 5.4 INTRAG DISTR DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA. - CNPJ: 62.418.140/0001-31

## 6. FUNDOS CREDENCIADOS DO BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S/A

Em Reunião realizada em 18/11/2020 pelo Comitê de Investimentos do Fundo Municipal de Previdência do Servidor – FUMPRES, Ata 011/2020, após análise, os membros concluíram pelo deferimento do credenciamento dos fundos do Banco do Nordeste do Brasil S/A:

| FUNDO                                  | CNPJ               |
|--|--------------------|
| BNB IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RF     | 08.266.261/0001-60 |
| BNB SELEÇÃO FI AÇÕES                   | 63.375.216/0001-51 |
| BNB INSTITUCIONAL FIC FI RF REFER. DI  | 21.307.581/0001-89 |
| BNB PLUS FIC FI RF LONGO PRAZO         | 06.124.241/0001-29 |
| BNB FI MULTIMERCADO LONGO PRAZO        | 06.124.248/0001-40 |
| BNB ESPECIAL FIC FI RF REFERENCIADO DI | 03.772.995/0001-55 |
| BNB SP FUNDO DE INVESTIMENTO RF CP     | 08.266.344/0001-59 |
| BNB SOBERANO FUNDO INVESTIMENTO RF     | 30.568.193/0001-42 |

## 7. POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

Todos estes ativos estão de acordo com a política de investimentos do FUMPRES para o ano de 2020 e, também, preenchem os requisitos de liquidez, baixo risco de crédito e rentabilidade exigidos nos editais de credenciamentos.

## 8. RENTABILIDADE FINANCEIRA

No que tange ao resultado no desempenho das Aplicações Financeiras do FUMPRES, cumpre-nos destacar que foi previsto para o exercício de 2020 um Rendimento de Aplicações no montante de R\$ 2.441.000,00 (dois milhões, quatrocentos e quarenta e um mil reais), tendo se realizado o valor de R\$ 1.941.008,67 (Um milhão, novecentos e quarenta e um mil, oito reais e sessenta e sete centavos), conforme demonstrativo de Execução da Receita de 31/12/2020.

## 9. LASTROS DOS PAPÉIS COM INVESTIMENTO DO FUNDO

No que tange aos Lastro dos papéis com aplicação do Fundo Municipal de Previdência do Servidor – FUMPRES, no exercício 2020, podemos destacar:

| FUNDO                                 | CNPJ               |
|---------------------------------------|--------------------|
| BB RF DIFERENCIADO SETOR PÚBLICO      | 07.214.377/0001-92 |
| BB PREVID RENDA FIXA FLUXO            | 13.077.415/0001-05 |
| BB PREVID RF PERFIL FI                | 13.077.418/0001-49 |
| BB PREVID SP AUTOMÁTICO               | 04.061.762/0001-59 |
| BB PREVID RF IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS | 11.328.882/0001-35 |
| BB PREVID RF IDKA 2                   | 13.322.205/0001-35 |
| BB PREVID RENDA FIXA IMA-B5 LP FIC    | 03.543.447/0001-03 |
| BB PREVID RF IMA GERAL EX-C FI        | 14.964.240/0001-10 |
| BB PREVID RF IRF-M                    | 07.111.384/0001-69 |
| BB PREVID IMA-B TP                    | 07.442.078/0001-05 |
| BB PREVID RF IMAB 5+                  | 13.327.340/0001-73 |

Todos os fundos de investimentos relacionados acima, tem sua carteira formada majoritariamente por Ativos de Renda Fixa e tem seu lastro atrelado a esses produtos.

O acompanhamento das aplicações em fundos de investimentos do FUMPRES, se enquadram na metodologia ALM, tendo em vista que é feito um acompanhamento diário dos saldos aplicados em cada ATIVO, além da automação do processo que se encontra em curso com a implantação do SISPREVWEB.

Quanto aos lastros de cada Fundo, anexamos Relatório de Auditoria Independente, fornecida pela Instituição Banco do Brasil e elaborada pela empresa KPMG, com o Demonstrativo da Composição e diversificação da carteira; Demonstrações das evoluções do Patrimônio líquido; Notas explicativas às demonstrações contábeis.



Os Relatórios anexados, demonstram de forma clara e inequívoca a garantia dos recursos aplicados em tais produtos, tendo vista a composição de suas carteiras além do Banco do Brasil se tratar de instituição financeira brasileira, constituída na forma de sociedade de economia mista, com participação do Governo Federal do Brasil em 50% das ações. Podemos ainda acrescentar ainda, ser o Banco do Brasil o maior banco da América Latina, com a maior rede de agências do Brasil no Exterior.

Por fim, ressaltamos que no semestre de 2020, este RPPS aplicou apenas nos fundos credenciados do Banco do Brasil, mesmo tendo fundos de outras instituições credenciados.

APROVADO EM 5º REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO 13/05/2021