

Relatório Trimestral de Investimentos – TIBAGIPREV

3º Trimestre-2021 (Posição no dia 30/09/2021)

1 - Carteira de Investimentos

FUNDO	RESGATE	SALDO	%	ART. RES. 3.922
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	9.846.781,21	9,14	Artigo. 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE	D+1	20.578.189,30	19,09	Artigo. 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	20.448.038,70	18,97	Artigo. 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI	D+0	4.737.003,27	4,40	Artigo. 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN	D+1	3.570.539,48	3,31	Artigo. 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI	D+0	44.573,08	0,04	Artigo. 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	19.250.070,72	17,86	Artigo. 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE	D+0	1.746.237,70	1,62	Artigo. 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F	D+0	8.914.890,03	8,27	Artigo. 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F	D+0	0	0,00	Artigo. 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX	D+0	3.710.724,32	3,44	Artigo. 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P	D+3	4.969.266,26	4,61	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	494.109,36	0,46	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	210.363,42	0,20	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	58.557,18	0,05	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	1.527.851,64	1,42	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	3.925.908,68	3,64	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	3.734.634,57	3,47	Artigo 8º, Inciso III
TOTAL		107.767.738,92	100	

* Disponibilidades financeiras: R\$ 1.760.846,71

2 - Enquadramento na Resolução 3.922/2010 e na Política de Investimento

2.1 - Limites de investimento em renda fixa:

ARTIGOS – RENDA FIXA	LIM. RESOLUÇÃO	LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTO			CARTEIRA %	CARTEIRA \$
		INF.	ALVO	SUP.		
Art. 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00 %	11,53%	57,60%	89,19%	86,15 %	R\$ 92.847.047,81
Art. 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00 %	4,09%	20,43%	40,00%	5,07 %	R\$ 5.463.375,62
Total Renda fixa	100,00 %	15,62%	78,03%	100,00%	91,22 %	R\$ 98.310.423,43

2.2 - Limites de investimento em renda variável:

ARTIGOS – RENDA VARIÁVEL	LIM. RESOLUÇÃO	LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTO			CARTEIRA %	CARTEIRA \$
		INF.	ALVO	SUP.		
Art. 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00%	0,00%	2,23%	0,25 %	R\$ 268.920,60
Art. 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	3,58%	17,91%	20,00%	5,06 %	R\$ 5.453.760,32
Art. 8º, Inciso III	10,00%	3,14%	3,14%	10,00%	3,47 %	R\$ 3.734.634,57
Total Renda Variável	30,00%	6,72%	21,05%	32,23%	8,78 %	R\$ 9.457.315,49

2.3 - Limites de investimento no exterior:

ARTIGOS – EXTERIOR	LIM. RESOLUÇÃO	LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTO			CARTEIRA %	CARTEIRA \$
		INF.	ALVO	SUP.		
Art. 9º – A, Inciso II	10,00%	0,00 %	0,43 %	5,00 %	0,00 %	R\$ 0,00
Art. 9º – A, Inciso III	10,00%	0,00 %	0,43 %	5,00 %	0,00 %	R\$ 0,00
Total Exterior	10,00%	0,00 %	0,86 %	10,00 %	0,00 %	R\$ 0,00

3 - Distribuição por Administradores Credenciados

GESTÃO	VALOR	% DA CARTEIRA
BANCO DO BRASIL	R\$ 74.087.258,97	68,75%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	R\$ 33.680.479,95	31,25%
TOTAL	R\$ 107.767.738,92	100,00 %

4 - Distribuição por Sub-segmento

ORDEM	SUB-SEGMENTO	VALOR	% DA CARTEIRA
1	FI IMA-B5	R\$ 29.407.501,81	27,29 %
2	FI GESTÃO ATIVA	R\$ 24.219.336,98	22,47 %
3	FI IDKA IPCA 2A	R\$ 22.324.427,00	20,72 %
4	FI IMA-GERAL EX-C	R\$ 9.846.781,21	9,14 %
5	FI IRF-M	R\$ 7.281.263,80	6,76 %
6	FI IRF-M1	R\$ 4.737.003,27	4,40 %
7	FI AÇÕES	R\$ 5.722.680,92	5,29 %
8	FI MULTIMERCADO	R\$ 3.734.634,57	3,47 %
9	FI CDI	R\$ 494.109,36	0,46 %
	TOTAL	R\$ 107.767.738,92	100,00%

5 – Retornos
5.1 – Recursos previdenciários

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO NO MÊS	RETORNO	RETORNO ACUMULADO	RETORNO %	RETORNO NO ACUM. %	META MÊS	META ACUM.	VAR
JAN	R\$ 104.953.741,10	R\$ 55.166,18	R\$ 500.896,66	R\$ 104.373.404,22	-R\$ 134.606,40	-R\$ 134.606,40	-0,13%	-0,13%	0,67%	0,67 %	1,08 %
FEV	R\$ 104.373.404,22	R\$ 935.739,70	R\$ 701.425,73	R\$ 103.903.796,95	-R\$ 703.921,24	-R\$ 838.527,64	-0,67%	-0,80%	1,24%	1,92 %	1,06 %
MAR	R\$ 103.903.796,95	R\$ 854.280,66	R\$ 718.304,34	R\$ 104.106.147,71	R\$ 66.374,44	-R\$ 772.153,20	0,06%	-0,74%	1,41%	3,36 %	1,62 %
ABR	R\$ 104.106.147,71	R\$ 892.654,67	R\$ 731.671,87	R\$ 105.048.811,20	R\$ 781.680,69	R\$ 9.527,49	0,75%	0,01%	0,73%	4,11 %	1,27 %
MAI	R\$ 105.048.811,20	R\$ 1.200.309,27	R\$ 711.762,66	R\$ 106.061.419,22	R\$ 524.061,41	R\$ 533.588,90	0,50%	0,50%	1,27%	5,44 %	1,03 %
JUN	R\$ 106.061.419,22	R\$ 13.559.317,51	R\$ 13.722.053,44	R\$ 105.796.193,86	-R\$ 102.489,43	R\$ 431.099,47	-0,10%	0,41%	0,97%	6,46 %	1,38 %
JUL	R\$ 105.796.193,86	R\$ 1.182.335,62	R\$ 734.320,28	R\$ 106.008.218,35	-235.990,85	R\$ 195.108,62	-0,22%	0,18%	1,42%	7,97 %	1,35 %

AG O	106.008.218,35	926.311,18	754.008,74	105.873.322,75	- 307.198,04	- 112.089,42	-0,29%	-0,11%	1,33%	9,41%	1,49%
SE T	105.873.322,75	3.949.386,57	5.531.755,03	104.640.015,94	349.061,65	236.972,23	0,33%	0,22%	1,60%	11,17%	1,26%

5.2 – Recursos da taxa de administração

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO NO MÊS	RETORNO	RETORNO ACUMULADO	RETORNO %	RETORNO ACUM. %	META MÊS	META ACUM.	VAR
JAN	R\$ 3.035.329,35	R\$ 51.596,88	R\$ 33.967,35	R\$ 3.044.152,38	-R\$ 8.806,50	-R\$ 8.806,50	-0,29%	-0,29%	0,67%	0,67%	1,11%
FEV	R\$ 3.044.152,38	R\$ 61.822,11	R\$ 45.117,23	R\$ 3.037.405,37	-R\$ 23.451,89	-R\$ 32.258,39	-0,77%	-1,05%	1,24%	1,92%	0,94%
MAR	R\$ 3.037.405,37	R\$ 50.167,13	R\$ 36.067,37	R\$ 3.045.339,22	-R\$ 6.165,91	-R\$ 38.424,30	-0,20%	-1,25%	1,41%	3,36%	1,56%
ABR	R\$ 3.045.339,22	R\$ 50.167,13	R\$ 40.529,81	R\$ 3.077.385,74	R\$ 22.409,20	-R\$ 16.015,10	0,73%	-0,53%	0,73%	4,11%	1,23%
MAI	R\$ 3.077.385,74	R\$ 50.167,13	R\$ 45.948,95	R\$ 3.093.757,70	R\$ 12.153,78	-R\$ 3.861,32	0,39%	-0,14%	1,27%	5,44%	0,94%
JUN	R\$ 3.093.757,70	R\$ 50.167,13	R\$ 37.442,92	R\$ 3.107.207,76	R\$ 725,85	-R\$ 3.135,47	0,02%	-0,11%	0,97%	6,46%	1,15%
JUL	3.107.207,76	50.167,13	40.949,03	3.111.516,97	-4.908,89	-8.044,36	-0,16%	-0,27%	1,42%	7,97%	0,97%
AGO	3.111.516,97	50.167,13	35.675,27	3.120.639,37	-5.369,46	-13.413,82	-0,17%	-0,44%	1,33%	9,41%	1,17%
SET	3.120.639,37	50.167,13	53.316,58	3.127.722,98	10.233,06	-3.180,76	0,33%	-0,11%	1,60%	11,17%	0,93%

6 – Rentabilidade da Carteira no 3º Trimestre de 2021
6.1 – Renda Fixa

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	R\$ 20.314.460,64	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 20.578.189,30	R\$ 263.728,66	1,30%
BB IMA-B 5 FIC	R\$ 20.224.553,28	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 20.448.038,70	R\$ 223.485,42	1,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC	R\$ 8.815.253,46	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 8.914.890,03	R\$ 99.636,57	1,13%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC	R\$ 3.892.710,12	R\$ 4.558.033,37	R\$ 3.757.988,31	R\$ 4.737.003,27	R\$ 44.248,09	0,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI	R\$ 1.725.378,44	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 1.746.237,70	R\$ 20.859,26	1,21%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI	R\$ 1.745.296,71	R\$ 0,00	R\$ 1.760.846,71	R\$ 0,00	R\$ 15.550,00	0,89%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI	R\$ 469.194,02	R\$ 150.501,39	R\$ 129.940,88	R\$ 494.109,36	R\$ 4.354,83	0,70%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI	R\$ 44.757,21	R\$ 0,00	R\$ 1.249,03	R\$ 44.573,08	R\$ 1.064,90	2,38%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC	R\$ 4.992.177,01	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 4.969.266,26	-R\$ 22.910,75	-0,46%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI	R\$ 3.765.867,56	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 3.710.724,32	-R\$ 55.143,24	-1,46%
BB FLUXO FIC	R\$ 9.916.462,95	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 9.846.781,21	-R\$ 69.681,74	-0,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	R\$ 5.147.520,07	R\$ 0,00	R\$ 1.500.000,00	R\$ 3.570.539,48	-R\$ 76.980,59	-1,50%

BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC	R\$ 19.616.280,39	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 19.250.070,72	-R\$ 366.209,67	-1,87%
Total Renda Fixa					R\$ 82.001,74	0,08%

6.2 – Renda variável

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1517666,52	0	0	1527851,64	10185,12	0,67%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	3741372,39	0	0	3734634,57	-6737,82	-0,18%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	68361,06	0	0	58557,18	-9803,88	-14,34%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	243107,45	0	0	210363,42	-32744,03	-13,47%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2662982,34	1500000	0	3925908,68	-237073,66	-5,69%
Total Renda Variável					-R\$ 276.174,27	-2,84%

Maurício Chizini Barreto
Diretor Presidente

Emanuelle de Almeida Ravarena
Presidente do Conselho de Administração

Marina Sampaio Cruzetta
Presidente do Conselho Fiscal

Evelyn de Souza Soares
Diretora Adm. E Financeira

Ana Mery Naconezi
Diretor de Previdência e Atuária

Robert Wesley dos Santos de Melo
Gestor de Recursos

Ata de reunião do Comitê de Investimentos 06/2021 – Tibagiprev

Nº	PAUTA
1	Análise da Carteira – Relatório Trimestral
2	Política de Investimentos
3	Plano de Ação

Tibagi, 22 de Outubro de 2021

Às 09:00 horas do dia 22 de outubro de 2021 o Comitê de investimentos reuniu-se no TIBAGIPREV. Estiveram presentes o Gestor de Recursos - Robert Wesley dos Santos de Melo, a Responsável pela Liquidação - Tânia Mara Naconezi, a Proponente - Evelyn de Souza Soares.

O Gestor de Recursos iniciou a reunião comunicando a ausência do membro da consultoria que havia sido convidado para participar da reunião com o objetivo de apresentar uma análise de mercado e da carteira de investimentos do Tibagiprev, porém o mesmo um dia antes comunicou que não poderia participar.

1ª Pauta – Foi realizada a análise da carteira referente ao mês de setembro. No critério de risco de liquidez foi observada a capacidade de conversão das cotas dos recursos aplicados para cumprimento das obrigações do TIBAGIPREV, No momento 100% da carteira de investimentos do Tibagi pode ser resgatada em até D+4. Quanto ao risco de Mercado foi verificado o Value at Risk (V@R) modelo paramétrico com intervalo de confiança de 95% para horizonte temporal de 21 dias. Limite de 2,65% para renda fixa e 14,46% para renda variável. Na renda fixa o fundo com pior VaR na Carteira foi 1,41 % nos Fundos atrelados ao IRF-M e na renda variável o fundo com o pior var foi de 12,81% no fundo atrelado ao IBX-50. Foi verificado que não há desenquadramento na carteira, e os parâmetros de risco estão de acordo com a política de investimentos. Foi apresentado o relatório trimestral que será encaminhado para a diretoria e conselheiros para ciência e acompanhamento.

2ª Pauta – Os membros foram comunicados a respeito da elaboração da Política de Investimentos que deverá ser realizada e encaminhada para a SPREV até o dia 31/12/2021, o Gestor ressaltou que já foi encaminhado para a Diretoria as propostas comerciais para a contratação do estudo de Gestão de Descasamentos entre Ativos e Passivos (ALM), que seria fundamental para a compra de títulos públicos marcados na curva, e que consistiria em uma ferramenta para a redução de volatilidade na carteira de investimentos e forneceria um instrumento objetivo para subsidiar a tomada de decisão na aplicação dos recursos.

3ª Pauta – O Gestor sugeriu a aplicação dos recursos para o cumprimento das despesas correntes em fundos atrelados ao CDI devido ao aumento da taxa SELIC, foi indicado o Fundo BB Institucional, foram analisadas as lâminas e verificado que o fundo exige um investimento inicial mínimo de R\$ 1.000.000,00. Foi decidido que esses valores serão resgatados do fundo BB IRF-M1, que tem sido utilizado até então para o cumprimento das obrigações de curto prazo.

Terminadas as pautas, foi encerrada a reunião.

Assinam a presente ata:

Evelyn de Souza Soares	Proponente	
Tânia Mara Naconezi	Responsável pela Liquidação	
Robert Wesley dos Santos de Melo	Gestor	

DECRETO Nº 365.

O PREFEITO MUNICIPAL DE TIBAGI, Estado do Paraná, no uso de suas atribuições, em conformidade com o art. 66, inciso VI da Lei Orgânica do Município, de acordo com o Decreto Municipal 340/2021, e considerando o Memorando nº 373/2021 da Secretaria Municipal de Educação e Cultura,

RESOLVE

Tornar público o resultado das eleições para diretoras das instituições da rede municipal de ensino de Tibagi:

ESCOLA MUNICIPAL PROFESSOR AROLDO
- ANA CLÁUDIA PINHEIRO DA COSTA – 104 VOTOS – ELEITA

ESCOLA MUNICIPAL PROFESSORA IDA VIANA DE OLIVEIRA
- ELIANE APARECIDA PACHECO DOS SANTOS – 96 VOTOS – ELEITA

ESCOLA MUNICIPAL TELÊMACO BORBA
- NAZIRA FÉLIX DA SILVA – 148 VOTOS – ELEITA

ESCOLA MUNICIPAL DEPUTADO DAVID FEDERMANN
- JULIANA APARECIDA REGNIEL DE SOUZA – 90 VOTOS – ELEITA

ESCOLA MUNICIPAL SÃO BENTO
- RAQUEL BUENO DA COSTA WIEDERMANN – 101 VOTOS – ELEITA

PRÉ-ESCOLA MUNICIPAL AQUARELA
- NOELISA RIBEIRO DOS SANTOS – 64 VOTOS – ELEITA

CMEI MADRINHA AUGUSTA
- LILIAN GRACIELA DE OLIVEIRA RODRIGUES – 55 VOTOS – ELEITA

CMEI DONA MATHILDE
- NIUCÉIA SOARES MAGNEZI – 32 VOTOS – ELEITA

CMEI DONA INEZ
- IRENE CARNEIRO – 30 VOTOS – ELEITA

CMEI SÃO JOSÉ
- LUCIMARA APARECIDA MEIRA MITTELSTEDT – 33 VOTOS - ELEITA

GABINETE DO PREFEITO MUNICIPAL DE TIBAGI, em 08 de novembro de 2021.

ARTUR RICARDO NOLTE
PREFEITO MUNICIPAL