

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS
SERVIDORES PÚBLICOS DE NOVO HORIZONTE
DO OESTE

CNPJ 08.611.715/0001-92

RELATÓRIO TRIMESTRAL DE INVESTIMENTOS

PRIMEIRO TRIMESTRE

2022

**REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA DO CONSELHO DELIBERATIVO DO
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE NOVO HORIZONTE
DO OESTE**

RELATÓRIO TRIMESTRAL DE RENTABILIDADE

Ao dia 26 04 2022, reuniu-se o Conselho Deliberativo do INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE NOVO HORIZONTE DO OESTE, os seguintes conselheiros: Dgeime Marconato Oliveira , Nara simene Alves Portugal, Flavio de Oliveira do Nascimento, Aglisson Carlos Guedes Moraes, Renato José Cusinato e o Presidente Dgeime Marconato Oliveira para em conjunto do cumprimento previsto na legislação vigente, deliberam sobre a rentabilidade dos investimentos nos meses de JANEIRO, FEVEREIRO e MARÇO de 2022 como abaixo demonstrados:

1. RENTABILIDADE VERSUS META ATUARIAL

A rentabilidade média da carteira é obtida através da média ponderada da rentabilidade dos fundos pelo seu respectivo peso na carteira.

A seguir iremos apresentar os investimentos mensalmente comparando sua rentabilidade com a meta atuarial.

1.1. JANEIRO

JANEIRO 2022						
Fundo	Aplicação	Rentab.	CDI	%CDI	Meta Atuarial	%Meta Atuarial
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 278.798,23	0,65%	0,73%	89,07%	0,94%	69,15%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 3.532.308,80	0,01%	0,73%	1,32%	0,94%	1,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	R\$ 1.062.134,38	0,08%	0,73%	10,49%	0,94%	8,14%
BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	R\$ 1.310.769,46	-1,63%	0,73%	-222,32%	0,94%	-172,59%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 908.901,23	-0,77%	0,73%	-104,86%	0,94%	-81,41%
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	R\$ 1.054.630,03	0,08%	0,73%	10,48%	0,94%	8,14%
BB IRF-M 1 TP FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 1.995.871,06	0,61%	0,73%	83,86%	0,94%	65,10%
BB IRF-M TP FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 3.623.737,65	-0,13%	0,73%	-17,38%	0,94%	-13,49%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	R\$ 1.327.555,98	-0,58%	0,73%	-79,56%	0,94%	-61,77%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RENDA FIXA LP	R\$ 2.038.826,13	0,02%	0,73%	2,57%	0,94%	1,99%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	R\$ 3.339.420,62	0,61%	0,73%	83,17%	0,94%	64,57%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AME. MULTIMERCADO	R\$ 827.096,84	-5,30%	0,73%	-724,17%	0,94%	-562,20%
TOTAL	R\$ 21.300.050,41	-0,23%	0,73%	-32,04%	0,94%	-24,88%

1.2. FEVEREIRO

FEVEREIRO 2022						
Fundo	Aplicação	Rentab.	CDI	%CDI	Meta Atuarial	%Meta Atuarial
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 602.148,22	0,68%	0,76%	89,76%	1,42%	47,89%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 3.573.166,41	1,16%	0,76%	153,19%	1,42%	81,74%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	R\$ 1.073.333,11	1,05%	0,76%	139,64%	1,42%	74,51%
BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	R\$ 1.310.495,77	-0,02%	0,76%	-2,77%	1,42%	-1,48%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 913.750,88	0,53%	0,76%	70,67%	1,42%	37,70%
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	R\$ 1.061.715,80	0,67%	0,76%	88,98%	1,42%	47,48%
BB IRF-M 1 TP FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 1.933.281,97	0,74%	0,76%	97,63%	1,42%	52,09%
BB IRF-M TP FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 3.644.316,85	0,57%	0,76%	75,21%	1,42%	40,13%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	R\$ 1.333.980,93	0,48%	0,76%	64,10%	1,42%	34,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RENDA FIXA LP	R\$ 2.062.196,20	1,15%	0,76%	151,81%	1,42%	81,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	R\$ 3.363.624,61	0,72%	0,76%	95,99%	1,42%	51,22%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AME. MULTIMERCADO	R\$ 809.773,73	-2,09%	0,76%	-277,40%	1,42%	-148,00%
TOTAL	R\$ 21.681.784,48	0,64%	0,76%	84,80%	1,42%	45,25%

1.3. MARÇO

MARÇO 2022						
Fundo	Aplicação	Rentab.	CDI	%CDI	Meta Atuarial	%Meta Atuarial
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 690.435,73	0,83%	0,93%	89,84%	2,03%	41,08%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 3.850.625,81	2,62%	0,93%	282,63%	2,03%	129,23%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	R\$ 1.101.011,07	2,58%	0,93%	278,16%	2,03%	127,18%
BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	R\$ 1.356.653,76	3,52%	0,93%	379,93%	2,03%	173,71%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 941.253,18	3,01%	0,93%	324,67%	2,03%	148,44%
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	R\$ 1.078.237,25	1,56%	0,93%	167,86%	2,03%	76,75%
BB IRF-M 1 TP FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 1.949.877,10	0,87%	0,93%	93,54%	2,03%	42,77%
BB IRF-M TP FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 3.675.087,42	0,84%	0,93%	91,08%	2,03%	41,64%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	R\$ 1.346.148,19	0,91%	0,93%	98,39%	2,03%	44,98%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RENDA FIXA LP	R\$ 2.116.359,09	2,63%	0,93%	283,31%	2,03%	129,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	R\$ 3.392.746,34	0,87%	0,93%	93,39%	2,03%	42,70%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AME. MULTIMERCADO	R\$ 846.775,29	4,57%	0,93%	492,89%	2,03%	225,36%
TOTAL	R\$ 22.345.210,23	1,82%	0,93%	196,69%	2,03%	89,93%

2. RENTABILIDADE VERSUS META ATUARIAL NO TRIMESTRE

RENTABILIDADE TRIMESTRAL DE JANEIRO A MARÇO DE 2022								
Fundo	JAN	FEV	MAR	Acum.	CDI Acum.	%CDI	Meta Acum.	%Meta Atuarial
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	0,68%	0,83%	2,18%	2,43%	89,50%	4,45%	48,98%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	1,16%	2,62%	3,82%	2,43%	156,84%	4,45%	85,83%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,08%	1,05%	2,58%	3,74%	2,43%	153,67%	4,45%	84,09%
BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	-1,63%	-0,02%	3,52%	1,82%	2,43%	74,60%	4,45%	40,82%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,77%	0,53%	3,01%	2,76%	2,43%	113,58%	4,45%	62,15%
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,08%	0,67%	1,56%	2,32%	2,43%	95,20%	4,45%	52,10%
BB IRF-M 1 TP FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	0,74%	0,87%	2,23%	2,43%	91,82%	4,45%	50,25%
BB IRF-M TP FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,13%	0,57%	0,84%	1,29%	2,43%	52,92%	4,45%	28,96%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	-0,58%	0,48%	0,91%	0,81%	2,43%	33,27%	4,45%	18,21%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RENDA FIXA LP	0,02%	1,15%	2,63%	3,82%	2,43%	157,06%	4,45%	85,95%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	0,72%	0,87%	2,22%	2,43%	91,04%	4,45%	49,82%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AME. MULTIMERCADO	-5,30%	-2,09%	4,57%	-3,05%	2,43%	-125,31%	4,45%	-68,58%
TOTAL	-0,23%	0,64%	1,82%	2,23%	2,43%	91,83%	4,45%	50,25%

Como pode ser observado pela tabela acima a rentabilidade no acumulado do trimestre ficou em 2,23% enquanto que a meta acumulada ficou em 4,45%, ou seja, o Instituto atingiu 50,25% da meta atuarial.

3. ENQUADRAMENTO

Os investimentos se subordinam ao permitido na legislação em vigor. Assim a cada mês fez-se a análise de enquadramento como abaixo demonstrado:

3.1. JANEIRO

OBJETIVO DE ALOCAÇÃO DOS RECURSOS POR SEGMENTO DE APLICAÇÃO E CARTEIRA			
Alocação dos Recursos / Diversificação	Alocação dos Recursos		
	Limite da Resolução	Enquadramento Atual	%
Renda Fixa			
Títulos TN SELIC - Art.7º, I, "a"	100%	R\$ 0,00	0,00%
FI 100% Títulos TN - Art. 7º, I, "b"		R\$ 20.194.155,34	94,81%
FI Ref em Índices de RF 100 TP - Art.7º, I, "c"		R\$ 0,00	0,00%
Oper. Compromissadas em TP TN - Art. 7º, II	5%	R\$ 0,00	0,00%
FI referenciados RF - Art. 7º, III, "a"	60%	R\$ 278.798,23	1,31%
FI de Índices Referenciado RF - Art. 7º, III, "b"		R\$ 0,00	0,00%
Renda Fixa de emissão Bancária - Art. 7º, IV	20%	R\$ 0,00	0,00%
FI em Direito Creditório - Sênior - Art. 7º, V, "a"	5%	R\$ 0,00	0,00%
FI Renda Fixa "Credito Privado" - Art. 7º, V, "b"		R\$ 0,00	0,00%
FI de Debêntures de infraestrutura - Art. 7º, V, "c"		R\$ 0,00	0,00%
Renda Variável e Investimentos Estruturados			
FI de Ações - Art. 8, I	30%	R\$ 0,00	0,00%
ETF - Índices de ações - Art. 8º, II		R\$ 0,00	0,00%
Investimento do Exterior			
Renda Fixa - Dívida Externa - Art. 9º, I	10%	R\$ 0,00	0,00%
Constituído no Brasil - Art. 9º, II		R\$ 0,00	0,00%
Ações - BDR Nível I - Art. 9º, III		R\$ 0,00	0,00%
Estruturado			
FI Multimercados - Art. 10, I	10%	R\$ 827.096,84	3,88%
FI em Participações - Art. 10, II	5%	R\$ 0,00	0,00%
FI Mercado de Acesso - Art. 10, III		R\$ 0,00	0,00%
Imobiliário			
FI Imobiliários - Art. 11	5%	R\$ 0,00	0,00%
Consignado			
Empréstimos consignado - Art. 12	5%	R\$ 0,00	0,00%
TOTAL GERAL		R\$ 21.300.050,41	100,00%

3.2. FEVEREIRO

OBJETIVO DE ALOCAÇÃO DOS RECURSOS POR SEGMENTO DE APLICAÇÃO E CARTEIRA			
Alocação dos Recursos / Diversificação	Alocação dos Recursos		
	Limite da Resolução	Enquadramento Atual	%
Renda Fixa			
Títulos TN SELIC - Art.7º, I, "a"	100%	R\$ 0,00	0,00%
FI 100% Títulos TN - Art. 7º, I, "b"		R\$ 20.269.862,53	93,49%
FI Ref em Índices de RF 100 TP - Art.7º, I, "c"		R\$ 0,00	0,00%
Oper. Compromissadas em TP TN - Art. 7º, II	5%	R\$ 0,00	0,00%
FI referenciados RF - Art. 7º, III, "a"	60%	R\$ 602.148,22	2,78%
FI de Índices Referenciado RF - Art. 7º, III, "b"		R\$ 0,00	0,00%
Renda Fixa de emissão Bancária - Art. 7º, IV	20%	R\$ 0,00	0,00%
FI em Direito Creditório - Sênior - Art. 7º, V, "a"	5%	R\$ 0,00	0,00%
FI Renda Fixa "Credito Privado" - Art. 7º, V, "b"		R\$ 0,00	0,00%
FI de Debêntures de infraestrutura - Art. 7º, V, "c"		R\$ 0,00	0,00%
Renda Variável e Investimentos Estruturados			
FI de Ações - Art. 8, I	30%	R\$ 0,00	0,00%
ETF - Índices de ações - Art. 8º, II		R\$ 0,00	0,00%
Investimento do Exterior			
Renda Fixa - Dívida Externa - Art. 9º, I	10%	R\$ 0,00	0,00%
Constituído no Brasil - Art. 9º, II		R\$ 0,00	0,00%
Ações - BDR Nível I - Art. 9º, III		R\$ 0,00	0,00%
Estruturado			
FI Multimercados - Art. 10, I	10%	R\$ 809.773,73	3,73%
FI em Participações - Art. 10, II	5%	R\$ 0,00	0,00%
FI Mercado de Acesso - Art. 10, III		R\$ 0,00	0,00%
Imobiliário			
FI Imobiliários - Art. 11	5%	R\$ 0,00	0,00%
Consignado			
Empréstimos consignado - Art. 12	5%	R\$ 0,00	0,00%
TOTAL GERAL		R\$ 21.681.784,48	100,00%

3.3. MARÇO

OBJETIVO DE ALOCAÇÃO DOS RECURSOS POR SEGMENTO DE APLICAÇÃO E CARTEIRA			
Alocação dos Recursos / Diversificação	Alocação dos Recursos		
	Limite da Resolução	Enquadramento Atual	%
Renda Fixa			
Títulos TN SELIC - Art.7º, I, "a"	100%	R\$ 0,00	0,00%
FI 100% Títulos TN - Art. 7º, I, "b"		R\$ 20.807.999,21	93,12%
FI Ref em Índices de RF 100 TP - Art.7º, I, "c"		R\$ 0,00	0,00%
Oper. Compromissadas em TP TN - Art. 7º, II	5%	R\$ 0,00	0,00%
FI referenciados RF - Art. 7º, III, "a"	60%	R\$ 690.435,73	3,09%
FI de Índices Referenciado RF - Art. 7º, III, "b"		R\$ 0,00	0,00%
Renda Fixa de emissão Bancária - Art. 7º, IV	20%	R\$ 0,00	0,00%
FI em Direito Creditório - Sênior - Art. 7º, V, "a"	5%	R\$ 0,00	0,00%
FI Renda Fixa "Credito Privado" - Art. 7º, V, "b"		R\$ 0,00	0,00%
FI de Debêntures de infraestrutura - Art. 7º, V, "c"		R\$ 0,00	0,00%
Renda Variável e Investimentos Estruturados			
FI de Ações - Art. 8, I	30%	R\$ 0,00	0,00%
ETF - Índices de ações - Art. 8º, II		R\$ 0,00	0,00%
Investimento do Exterior			
Renda Fixa - Dívida Externa - Art. 9º, I	10%	R\$ 0,00	0,00%
Constituído no Brasil - Art. 9º, II		R\$ 0,00	0,00%
Ações - BDR Nível I - Art. 9º, III		R\$ 0,00	0,00%
Estruturado			
FI Multimercados - Art. 10, I	10%	R\$ 846.775,29	3,79%
FI em Participações - Art. 10, II	5%	R\$ 0,00	0,00%
FI Mercado de Acesso - Art. 10, III		R\$ 0,00	0,00%
Imobiliário			
FI Imobiliários - Art. 11	5%	R\$ 0,00	0,00%
Consignado			
Empréstimos consignado - Art. 12	5%	R\$ 0,00	0,00%
TOTAL GERAL		R\$ 22.345.210,23	100,00%

4. GERENCIAMENTO DE RISCO

4.1. JANEIRO

Fundo	Sharpe	VAR	Modi M.	Sharpe M.
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,00%	0,04	0,00
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,01%	0,05	0,00
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	0,01%	0,05	0,00
BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,02%	0,04	0,00
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,02%	0,04	0,00
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,01%	0,04	0,00
BB IRF-M 1 TP FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,00%	0,04	0,00
BB IRF-M TP FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,01%	0,04	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	0,00	0,01%	0,04	0,00
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RENDA FIXA LP	0,00	0,01%	0,05	0,00
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	0,00%	0,04	0,00
FI CAIXA INDEXA BOLSA AME. MULTIMERCADO	0,05	0,02%	0,06	0,00

4.2. FEVEREIRO

Fundo	Sharpe	VAR	Modi M.	Sharpe M.
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,00%	0,05	0,00
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01	0,01%	0,06	0,01
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	0,01%	0,06	0,00
BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,02%	0,05	0,00
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,01%	0,05	0,00
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,01%	0,05	0,00
BB IRF-M 1 TP FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,00%	0,05	0,00
BB IRF-M TP FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,01%	0,05	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	0,00	0,01%	0,05	0,00
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RENDA FIXA LP	0,01	0,01%	0,06	0,01
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	0,00%	0,05	0,00
FI CAIXA INDEXA BOLSA AME. MULTIMERCADO	0,03	0,04%	0,06	0,00

4.3. MARÇO

Fundo	Sharpe	VAR	Modi M.	Sharpe M.
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,00%	0,05	0,00
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,02	0,01%	0,07	0,02
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,02	0,01%	0,07	0,00
BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,02%	0,06	0,00
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,01%	0,06	0,00
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,01%	0,06	0,00
BB IRF-M 1 TP FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,00%	0,06	0,00
BB IRF-M TP FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,01%	0,06	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1+ FI	0,00	0,01%	0,06	0,00
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RENDA FIXA LP	0,02	0,01%	0,07	0,02
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	0,00%	0,06	0,00
FI CAIXA INDEXA BOLSA AME. MULTIMERCADO	0,03	0,07%	0,07	0,00

Estando todos os presentes de acordo com os termos acima, subscrevem:
