



PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS GUARATUBA-PR. GUARATUBA-PR.

Ata da terceira (3ª) reunião ordinária do Comitê de Investimentos do Guaraprev – Regime Próprio de Previdência Social dos Servidores Públicos do Município de Guaratuba realizado no dia quinze de março de dois mil e vinte e um (15/03/2021) às nove horas e trinta minutos e (9h30min) na sala de reuniões da GUARAPREV.

Devido a epidemia Covid-19, e por restrições impostas pelos governantes para conter a proliferação do *Coronavirus*, o Comitê de Investimento realizou a reunião mensal com o Consultor da FAHM, sr. Pery de Oliveira de forma remota, através do aplicativo ZOOM. Neste encontro estavam presentes o presidente do Guaraprev – Regime Próprio de Previdência Social dos Servidores Públicos do Município de Guaratuba, sr. Edilson Kalat, o Consultor de Valores Mobiliários da FAHM Consultoria e demais membros do Comitê. Inicialmente o sr. Edilson Kalat cumprimenta os participantes em seguida foi passada a palavra ao sr. Pery de Oliveira, Consultor de Valores Mobiliários da FAHM Consultoria, para falar sobre os principais fatos econômicos ocorridos no Brasil e no mundo e que impactaram a carteira de ativos do GUARAPREV no mês de fevereiro de 2021.

De acordo com o Consultor, o mês de fevereiro aqui no Brasil confirmou a expectativa das eleições de Rodrigo Pacheco e Arthur Lira para o comando do Senado e da Câmara respectivamente. Este evento traz a perspectiva de um maior alinhamento entre o poder Executivo e o Legislativo para a aprovação das reformas econômicas.

Além disso, segundo ele, parece que a ficha caiu no Ministério da Saúde e agora prega a vacinação em massa. A própria equipe econômica tem defendido a vacinação como o melhor estímulo para ajudar na recuperação da atividade econômica. Esses dois fatores aliados à alta nos juros para conter as pressões inflacionárias tendem a acalmar o mercado e trazer uma perspectiva de melhora nos preços dos ativos financeiros.

Dada a precificação atual da curva de juros curta, decidimos o comitê decidiu por manter posições compradas em inflação e aplicadas em juros reais na parte curta e intermediária da curva, representada pelos fundos atrelados ao IRF-M1, IDkA2 e IMA-B5.

O mês de fevereiro apresentou resultados negativos para a maioria dos títulos públicos negociados no mercado, tendo em vistas as pressões inflacionárias e possibilidade de o Banco Central elevar a SELIC já na próxima reunião, que ocorrem nos dias 16 e 17 de março. A expectativa do mercado financeiro é de que o COPOM eleve em 50 pontos base, passando dos atuais 2% ao ano para 2,50% ao ano.

Diante deste cenário, a carteira de ativos do GUARAPREV, apresentou o seguinte resultado no mês de fevereiro:

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	28.530.914,37	931.564,34	950.000,00	27.644.346,41	-868.132,30	-868.132,30	-3,04%	-3,04%	0,69%	0,69%	-440,40%	2,40%
Fevereiro	27.644.346,41	4.166.280,21	4.000.000,00	27.382.005,98	-428.620,64	-1.296.752,94	-1,54%	-4,54%	1,20%	1,90%	-238,79%	5,14%



PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS GUARATUBA-PR. GUARATUBA-PR.

Em janeiro, o fundo Catania apresentou queda na ordem de 37%, devido, segundo fato relevante, pela precificação do ativo investido M.Invest, que teve sua falência decretada. Ainda, em janeiro deste ano, o fundo RHODES foi liquidado e o GUARAPREV recebeu cotas do fundo Catania (Rhodes investia em M.Invest e Catania). O mês de fevereiro foi impactado pela queda no valor das cotas do fundo Austro IMA-B, que perdeu 5,76% devido ao péssimo desempenho das curvas de juros no mercado secundário da B3.

O patrimônio líquido do GUARAPREV finalizou o mês de fevereiro com R\$27.382.005,98.

Os fundos investidos no segmento tiveram rentabilidade média negativa de -1,47%.

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	427.460,33	0,00	0,00	427.715,97	255,64	0,06%	0,06%	0,01%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	234.188,34	0,00	0,00	234.165,11	-23,23	-0,01%	-0,01%	0,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.430.657,05	1.304.737,52	0,00	2.734.653,57	-741,00	-0,03%	0,00%	0,10%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	590.646,57	0,00	0,00	589.962,68	-683,89	-0,12%	-0,12%	0,57%
CATÂNIA FI RENDA FIXA LP	1.422.289,87	0,00	0,00	1.419.235,72	-3.054,15	-0,21%	-37,75%	66,81%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.543.522,42	0,00	0,00	1.538.570,26	-4.952,16	-0,32%	-0,32%	0,48%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.198.560,42	2.845.000,00	0,00	4.026.172,71	-17.387,71	-0,43%	-0,51%	0,95%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENC...	2.698.888,69	16.542,69	0,00	2.700.488,42	-14.942,96	-0,55%	-0,55%	1,09%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.732.739,72	0,00	4.000.000,00	3.682.044,81	-50.694,91	-0,66%	-0,91%	1,11%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA ...	2.387.995,31	0,00	0,00	2.360.459,28	-27.536,03	-1,15%	-1,15%	1,03%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	374.271,18	0,00	0,00	368.505,14	-5.766,04	-1,54%	-1,54%	2,32%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	474.751,13	0,00	0,00	461.971,69	-12.779,44	-2,69%	-2,69%	4,91%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	3.885.164,55	0,00	0,00	3.661.439,84	-223.724,71	-5,76%	-5,76%	3,71%
Total Renda Fixa	24.401.135,58	4.166.280,21	4.000.000,00	24.205.385,20	-362.030,59	-1,47%		5,21%

Já no segmento de renda variável, o resultado foi negativo em 2,05%, com destaque para o fundo PHOENIX, do Itaú, que acompanhou as oscilações da bolsa brasileira.

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	725.557,59	0,00	0,00	723.714,86	-1.842,73	-0,25%	-0,25%	0,00%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.198.690,43	0,00	0,00	1.190.650,92	-8.039,51	-0,67%	-0,67%	1,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.318.962,81	0,00	0,00	1.262.255,00	-56.707,81	-4,30%	-4,30%	10,53%
Total Renda Variável	3.243.210,83	0,00	0,00	3.176.620,78	-66.590,05	-2,05%		4,60%

O Consultor explicou aos presentes que os fundos ilíquidos estão sendo tratados com máxima urgência e que todas as diligências estão sendo realizadas, em conjunto com o Comitê de Investimentos do GUARAPREV e compartilhada ao Conselho Deliberativo.

O sr. Emerson Machado informou aos participantes que o Demonstrativo de Aplicação e Investimento, o DAIR, referente ao mês de fevereiro já foi enviado e está regular junto ao CADPREV. Nada mais havendo a tratar, encerrou-se a presente reunião às dez horas e dez minutos, e lavra-se a presente ata que vai assinado por mim, Edilson Garcia Kalat – Diretor Executivo e demais membros conforme lista de presença.

Rui Sergio Jacoboviski

Emerson Cesar Machado

Edilson Garcia Kalat