



RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

PBPREV - PARAÍBA PREVIDÊNCIA

Período: 01/10/2019 a 31/10/2019

1- Introdução

A PBPREV - PARAÍBA PREVIDÊNCIA, seguindo as diretrizes estabelecidas em sua Política de Investimentos, despendeu seus esforços visando aplicar no **terceiro trimestre** de 2019 os seus recursos financeiros disponíveis em operações financeiras que trouxessem o **menor risco**, e **maior liquidez** e a **maior rentabilidade** possível.

E neste contexto, este órgão optou em adequar a maior parte dos seus recursos disponíveis no segmento de **Renda Fixa** e uma pequena parte no segmento de **Renda Variável**, especificamente em fundos Multimercado, conforme previsto, também, em sua Política Anual de Investimentos para 2019 e preceituado nos Art. 7º e 8º da Resolução n. 3.922/10 do CMN - CONSELHO MONETÁRIO NACIONAL e suas alterações.

2 - Investimentos

A PBPREV - PARAÍBA PREVIDÊNCIA, a fim de diversificar os investimentos, buscando atingir a meta atuarial, iniciou relacionamento com mais uma Instituição Financeira, o BTG Pactual e, assim, finalizou o **Mês de outubro de 2019** com aplicações financeiras distribuídas de acordo com a tabela abaixo (Tabela I).

Tabela I - Instituições Financeiras e Produtos

Instituição Financeira	Produto	CNPJ FUNDO
Banco do Brasil	BB Previdenciário Renda Fixa IRF-M1 TP	11.328.882/0001-35
Banco do Brasil	BB Previdenciário Renda Fixa IDKa 2 anos	13.322.205/0001-35
Banco do Brasil	BB Previdenciário IMA Geral Ex C	14.964.240/0001-10
Banco do Brasil	BB Previdenciário Multimercado	10.418.362/0001-50
Santander	Santander FIC FI RF IMA-B Títulos Públicos	11.180.607/0001-17
Santander	Santander FIC FI Soberano Curto Prazo	04.871.634/0001-70
Bradesco	Bradesco Renda Fixa IDKA Pré 2	24.022.566/0001-82
Bradesco	Bradesco Renda Fixa Nilo	15.259.071/0001-80
Bradesco	Bradesco Renda Fixa IRF-M 1	11.492.176/0001-24
Bridge Trust	Terra Nova Prime Fundo Renda Fixa IMA-B	27.746.705/0001-09
Banco do Nordeste	BNB Institucional FIC FI Renda Fixa REF DI	21.307.581/0001-89



Banco do Nordeste	BNB RPPS IMA B	08.266.261/0001-60
BTG Pactual	BTG Pactual Crédito Corporativo 60	29.177.021/0001-69

O saldo ao final do mês de outubro está descrito nas Tabelas II e III.

Tabela II - Saldo Aplicado - Fundo Financeiro

Tipo de Aplicação	Valor em 31/10/2019	% do RPPS	Artigo
FI IRF-M1	3.047.653,24	69,97	7º I "b"
FI RPPS IMA-B	1.296.287,01	29,75	7º I "b"
FI Soberano CP	11.875,08	0,28	7º IV "a"
Total	4.355.815,33	100,00	

Tabela III - Saldo Aplicado - Fundo Capitalizado

Tipo de Aplicação	Valor em 31/10/2019	% do RPPS	Artigo
BB PREV MM	22.766.341,87	5,12%	8º III "a"
BB FI IRF-M1	81.234.235,54	18,26%	7º I "b"
BB RF IDKa 2 ANOS	36.867.643,61	8,29%	7º I "b"
BB PREV IMA GERAL	57.183.437,63	12,86%	7º I "b"
Prime Terra Nova IMA-B	3.670.805,11	0,83%	7º IV "a"
Bradesco FI Nilo	75.506.571,92	16,97%	7º IV "a"
Bradesco FI IDKa 2 anos	59.543.019,02	13,38%	7º I "b"
Bradesco IRF-M1	72.295.345,19	16,24%	7º I "b"
BNB INSTITUCIONAL	10.442.036,51	2,34%	7º IV "a"
BNB RPPS IMA B	5.396.957,57	1,21%	7º I "b"
BTG Pactual CORP 60	20.068.211,70	4,50%	7º VII "a"
Total	444.974.605,67	100,00%	

Com isso, encerramos o mês de outubro de 2019 no **Fundo Financeiro** com aplicações em fundos de investimentos cujas carteiras respeitam o que determina o inciso I "b" do art. 7º da Resolução 3.922/10, com exceção do Fundo Soberano que se enquadra no inciso IV "a" da mesma resolução.

Já no **Fundo Capitalizado**, devido à necessidade de diversificação, encerramos o mês de outubro de 2019 com aplicações em fundos de investimentos cujas carteiras respeitam o que determina os inciso I "b" e IV "a" do art. 7º além do inciso III do art. 8º da Resolução 3.922/10.



Nesse trimestre, mesmo exercendo gestão de fluxo de caixa, aplicando os recursos provindos das contribuições previdenciárias ao longo do mês e em seguida utilizando-os para o pagamento de benefícios, conseguimos encerrar o mês de outubro com um saldo positivo em caixa, mantendo os outros valores pelos motivos citados anteriormente. Neste trimestre tivemos a seguinte movimentação de aplicações e resgates (Tabela IV e V).

Tabela IV - Resumo da Movimentação Financeira - Fundo Financeiro

Data:	31/10/2019
Valor Inicial	4.634.830,12
Aplicações	24.220.923,41
Resgates	24.596.289,15
RENDIMENTO LIQUIDO	96.350,93
Valor Final	4.355.815,31

O rendimento líquido total obtido no mês de outubro, no fundo financeiro, foi um montante de R\$ 96.350,93 (Noventa e seis mil, trezentos e cinquenta reais e noventa e três centavos).

Tabela V - Resumo da Movimentação Financeira - Fundo Capitalizado

Data:	31/10/2019
Valor Inicial	431.713.332,39
Aplicações	16.992.804,14
Resgates	10.021.031,06
RENDIMENTO LIQUIDO	6.289.500,21
Valor Final	444.974.605,68

O rendimento líquido total obtido no mês de outubro no fundo capitalizado ficou positivo no valor R\$6.289.500,21 (seis milhões, duzentos e oitenta e nove mil, quinhentos reais e vinte e um centavos), ou seja, houve um ganho financeiro expressivo no período, resultado da diversificação e da recuperação do mercado financeiro, conforme veremos na análise do cenário econômico.

3 - Rentabilidades dos Investimentos

A carteira de investimentos da Paraíba Previdência - PBPREV encerrou outubro de 2019 com R\$ 449.330.421,00, resultado dos aportes nos fundos Financeiro e Capitalizado e da rentabilidade acumulada de 1,01% no Fundo Financeiro e de 1,44% no Fundo Capitalizado. Na média a rentabilidade da carteira do RPPS foi de 1,43%.



Considerando a INFLAÇÃO do INPC de outubro (0,04%), divulgado pelo Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE), a meta atuarial do Instituto que é INPC + 5% ao ano ficou em 0,45%.

Dessa forma, a carteira de investimentos da Paraíba Previdência - PBPREV ficou muito acima da meta atuarial no mês de outubro com 392% da meta cumprida, e no acumulado do ano de 2019, segue acima com 144% da meta.


Regina Karla Batista Alves
Gestora de Investimentos
Matr 460.162-9

CPA 10 - ANBIMA


Creso Rocha Junior, CFP®
Matrícula: 460.133-5