

# Relatório de Prestação de Contas

Comitê de Investimentos

1º Trimestre 2021

# Composição

## Comitê de Investimentos

- Pedro Jorge Guimarães\*\* – Gestor de Recursos
- Carlos Henrique da Rocha Santos\* \*\* – Membro Presidente
- Ernâni Bernardino Alves de Sena\* – Membro Nato
- Mateus Reissurreição\* – Membro
- Tiago Cacim D'errico\* – Membro

## Gestor de Recursos

- Pedro Jorge Guimarães – Gestor de Recursos

\*Certificado de investimentos CPA 10 ANBIMA.

\*\*Certificado de Gestores de Regime Próprio de Previdência Social - CGRPPS pela APIMEC.

\*\*\*Certificado de investimentos CPA 20 ANBIMA.

No primeiro trimestre de 2021 foram realizadas 03 reuniões ordinárias e 15 reuniões extraordinárias.

# Reuniões e principais decisões

| REUNIÃO                   | DATA       | PRINCIPAIS DECISÕES  |
|---------------------------|------------|--|
| 1ª Reunião Extraordinária | 13/01/2021 | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Posse dos novos membros do comitê de investimento.</li><li>▪ Elaboração do escopo para o novo relatório do Comitê de Investimentos.</li></ul>  |
| 2ª Reunião Extraordinária | 14/01/2021 | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Videoconferência com os representantes da ASSET do Banco Safra com atualização do cenário macroeconômico e das expectativas de mercado.</li></ul>  |
| 1ª Reunião Ordinária      | 20/01/2021 | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Aprovação do calendário das reuniões ordinárias do ano de 2021.</li><li>▪ Atualização do cenário macroeconômico e das expectativas de mercado pela empresa SMI Consultoria.</li><li>▪ Atualização acerca do comportamento da carteira de investimentos.</li><li>▪ Realocação de R\$ 3.500.000,00 do fundo BRADESCO FIC FI MULTIMERCADO MACRO INSTITUCIONAL para o fundo BRADESCO FI MULTIMERCADO S&amp;P 500 MAIS.</li><li>▪ Pagamento da folha com os recursos do benchmark IRF-M1 e direcionamento dos novos recursos para este mesmo benchmark.</li></ul> |
| 3ª Reunião Extraordinária | 20/01/2021 | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Videoconferência com os representantes da ASSET do Banco Santander com atualização do cenário macroeconômico e das expectativas de mercado.</li></ul>  |
| 4ª Reunião Extraordinária | 27/01/2021 | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Credenciamento de instituições financeiras e fundos de investimentos.</li><li>▪ Acompanhamento da elaboração do relatório de gestão dos investimentos e aprovação do calendário das reuniões extraordinárias do ano de 2021 para validação do referido relatório.</li></ul>  |

# Reuniões e principais decisões

| REUNIÃO                   | DATA       | PRINCIPAIS DECISÕES   |
|---------------------------|------------|---|
| 5ª Reunião Extraordinária | 08/02/2021 | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Deliberação sobre a recomendação de realocação da SMI Consultoria.</li><li>▪ Resgate de R\$ 18 milhões do IRF-M1+ e aplicação de R\$ 9 milhões no IMA-B 5 e R\$ 9 milhões em investimentos no exterior, que repliquem o benchmark S&amp;P 500, distribuídos em lotes de R\$ 3.000.000,00 entre os seguintes fundos: <b>ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO S&amp;P500® BRL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO, CNPJ 26.269.692/0001-61; SAFRA S&amp;P REAIS PB FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO, CNPJ 21.595.829/0001-54 e FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO, CNPJ 30.036.235/0001-02.</b></li></ul> |
| 6ª Reunião Extraordinária | 10/02/2021 | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Videoconferência com os representantes da ASSET do Banco Safra com o propósito de dirimir possíveis dúvidas sobre as recomendações de investimentos propostos pelo Banco Safra na 2ª reunião extraordinária do Comitê de Investimentos, ocorrida em 14 de janeiro de 2021, sobretudo, em relação aos fundos com investimentos no exterior.</li></ul>  |
| 7ª Reunião Extraordinária | 17/02/2021 | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Videoconferência com a SMI Consultoria.</li><li>▪ Monitoramento da carteira de investimentos do ISSM.</li><li>▪ Análise de mercado e perspectivas dos cenários interno e externo.</li></ul>   |

# Reuniões e principais decisões

| REUNIÃO                    | DATA       | PRINCIPAIS DECISÕES   |
|----------------------------|------------|---|
| 2ª Reunião Ordinária       | 19/02/2021 | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Atualização acerca do cenário macroeconômico das expectativas de mercado.</li><li>▪ Atualização acerca do comportamento da carteira de investimentos.</li><li>▪ Foi colocado em votação e decidido pelos membros do Comitê de Investimentos que o pagamento da folha do mês de fevereiro/21 seria efetuado com os recursos do benchmark IRF-M1.</li><li>▪ Foi decidido por unanimidade pelo Comitê de Investimentos, que os novos recursos seriam alocados gradativamente em fundos BDR nível 1 até alcançar o montante de R\$ 4.000.000,00 e, caso houvesse recebimento de recursos que superasse esse valor, deveriam ser alocados no benchmark IRF-M1.</li></ul>   |
| 8ª Reunião Extraordinária  | 19/02/2021 | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Videoconferência com os representantes da ASSET da Caixa Econômica Federal.</li></ul>   |
| 9ª Reunião Extraordinária  | 26/02/2021 | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Acompanhamento da elaboração do Relatório de gestão dos investimentos.</li></ul>  |
| 10ª Reunião Extraordinária | 03/03/2021 | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Análise de adequação da Política de Investimentos do ano de 21, elaborada pela SMI Consultoria, onde houve alteração de redação do item 6 – VEDAÇÕES E RECOMENDAÇÕES, subitem 6.1.2 para: “Em se tratando de alocações em gestores e/ou produtos financeiros enquadrados no art. 7º, VII, B, bem como nas hipóteses previstas nos artigos 8º e 9º da Resolução CMN nº 3.922/2010 e suas alterações, não existentes na carteira do Instituto de Seguridade do Servidor Municipal – ISSM até 31/10/20, deverão ser submetidas a aprovação prévia do Conselho Administrativo e Previdenciário, <b>exceto se o valor investido em cada fundo de investimento for inferior a 1% (um por cento)</b> do Patrimônio Líquido do ISSM no último dia útil do mês anterior à aplicação”.</li><li>▪ Credenciamento de fundos de investimentos (BDR).</li></ul> |

# Reuniões e principais decisões

| REUNIÃO                    | DATA       | PRINCIPAIS DECISÕES   |
|----------------------------|------------|---|
| 11ª Reunião Extraordinária | 03/03/21   | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Videoconferência com os representantes da ASSET do Banco Bradesco com atualização do cenário macroeconômico e das expectativas de mercado.</li></ul>  |
| 12ª Reunião Extraordinária | 10/03/21   | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Videoconferência com a ASSET do Banco Itaú com atualização do cenário macroeconômico e das expectativas de mercado.</li></ul>   |
| 13ª Reunião Extraordinária | 10/03/21   | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Validação do relatório de gestão dos investimentos de janeiro/21.</li><li>▪ Aprovação da nova Política de Investimentos de 2021 em virtude da certificação nível II do Pró-Gestão.</li><li>▪ Credenciamento de instituições financeiras e fundos de investimentos.</li></ul>  |
| 3ª Reunião Ordinária       | 18/03/2021 | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Atualização acerca do cenário macroeconômico das expectativas de mercado com a SMI Consultoria.</li><li>▪ Atualização acerca do comportamento da carteira de investimentos que teve um resultado de - 1,01% enquanto a meta seria 1,31% , rentabilidade decorrente da instabilidade do mercado financeiro com origem no Coronavírus.</li><li>▪ Realocação de R\$10.000.000,00 (dez milhões de reais) do fundo <b>BRDESCO FIC ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA</b>, CNPJ: 28.515.874/0001-09, para o <b>H FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA NILO</b>, CNPJ 15.529.071/0001-80.</li><li>▪ Para pagamento da folha foi decidido que seria realizado com os recursos do benchmark IRF-M1 e que novos recursos sejam alocados em fundos BDR nível 1, até alcançar o montante de R\$ 4.000.000,00 (quatro milhões de reais) e o que exceder esse valor alocar em fundos de benchmark IRF-M1.</li></ul> |

# Reuniões e principais decisões

| REUNIÃO                    | DATA       | PRINCIPAIS DECISÕES  |
|----------------------------|------------|--|
| 14ª Reunião Extraordinária | 24/03/2021 | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Videoconferência com o representante da XP ASSET Management.</li></ul>   |
| 15ª Reunião Extraordinária | 24/03/2021 | <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Monitoramento da carteira de investimentos do ISSM.</li><li>▪ Validação do relatório de gestão de investimentos de fevereiro/2021.</li></ul> |

# Ativos

| FUNDOS DE RENDA FIXA                              | SALDO INICIAL EM JAN/2021 | %             | APLICAÇÕES           | RESGATES             | RENDIMENTOS          | SALDO FINAL EM MAR/2021 | %             |
|---|---------------------------|---------------|----------------------|----------------------|----------------------|-------------------------|---------------|
| BB FIC Prev. Alocação Ativa Retorno Total RF      | 10.272.968,22             | 2,95%         |                      |                      | -177.741,83          | 10.095.226,39           | 2,92%         |
| BB FIC Previdenciário Alocação Ativa              | 20.222.141,30             | 5,81%         |                      |                      | -379.414,72          | 19.842.726,58           | 5,74%         |
| BB FIC Previdenciário Títulos Públicos IRF-M 1    | 10.290.258,54             | 2,96%         | 1.217.262,88         | 11.000.010,45        | -3.739,28            | 503.771,69              | 0,15%         |
| Bradesco FIC Alocação Dinâmica Renda Fixa         | 24.021.434,86             | 6,91%         |                      | 10.000.000,00        | -531.229,51          | 13.490.205,35           | 3,90%         |
| Bradesco FIC Títulos Públicos Institucional IMA-B | 10.372.390,98             | 2,98%         |                      |                      | -300.764,23          | 10.071.626,75           | 2,91%         |
| Bradesco H Nilo Renda Fixa                        | 0,00                      | 0,00%         | 10.000.000,00        |                      | 29.897,31            | 10.029.897,31           | 2,90%         |
| Bradesco Maxi Poder Público Renda Fixa            | 0,00                      | 0,00%         |                      |                      | 0,00                 | 0,00                    | 0,00%         |
| Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B               | 10.961.194,24             | 3,15%         |                      |                      | -313.817,23          | 10.647.377,01           | 3,08%         |
| Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5             | 32.218.564,74             | 9,26%         | 9.000.000,00         |                      | -116.512,78          | 41.102.051,96           | 11,90%        |
| Caixa Brasil Títulos Públicos IRF-M 1             | 4.426.644,91              | 1,27%         | 27.582.710,47        | 24.153.582,08        | 4.820,34             | 7.860.593,64            | 2,27%         |
| Caixa Brasil Títulos Públicos IRF-M 1+            | 24.996.826,61             | 7,19%         |                      | 18.000.000,00        | -632.178,21          | 6.364.648,40            | 1,84%         |
| Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica Renda Fixa    | 65.603.736,51             | 18,86%        |                      |                      | -119.912,25          | 65.483.824,26           | 18,95%        |
| Gradual Previdenciário Crédito Privado            | 6.428.930,25              | 1,85%         |                      |                      | 0,00                 | 6.428.930,25            | 1,86%         |
| Itaú FIC Alocação Dinâmica Renda Fixa             | 0,00                      | 0,00%         |                      |                      | 0,00                 | 0,00                    | 0,00%         |
| Itaú FIC Soberano Simples Renda Fixa              | 1.730.220,36              | 0,50%         | 1.288.438,62         | 1.091.390,17         | 6.251,74             | 1.933.520,55            | 0,56%         |
| Santander FIC Ativo Renda Fixa                    | 24.918.844,19             | 7,16%         |                      |                      | 1.461,39             | 24.920.305,58           | 7,21%         |
| Security Referenciado Crédito Privado             | 829.907,04                | 0,24%         |                      |                      | -370,37              | 829.536,67              | 0,24%         |
| <b>TOTAL FUNDO DE RENDA FIXA</b>                  | <b>247.294.062,75</b>     | <b>71,10%</b> | <b>49.088.411,97</b> | <b>64.244.982,70</b> | <b>-2.533.249,63</b> | <b>229.604.242,39</b>   | <b>66,45%</b> |



# Ativos

| FUNDOS IMOBILIÁRIOS E PARTICIPAÇÕES              | SALDO INICIAL EM JAN/2021 | %            | APLICAÇÕES  | RESGATES    | RENDIMENTOS        | SALDO FINAL EM MAR/2021 | %            |
|--|---------------------------|--------------|-------------|-------------|--------------------|-------------------------|--------------|
| Reag FII Renda Imobiliária                       | 4.650.000,00              | 1,34%        |             |             | -265.000,00        | 4.385.000,00            | 1,27%        |
| <b>TOTAL FUNDOS IMOBILIÁRIOS E PARTICIPAÇÕES</b> | <b>4.650.000,00</b>       | <b>1,34%</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>-265.000,00</b> | <b>4.385.000,00</b>     | <b>1,27%</b> |

| FUNDOS MULTIMERCADO                           | SALDO INICIAL EM JAN/2021 | %            | APLICAÇÕES           | RESGATES            | RENDIMENTOS       | SALDO FINAL EM MAR/2021 | %            |
|---|---------------------------|--------------|----------------------|---------------------|-------------------|-------------------------|--------------|
| Bradesco FIC Macro Institucional Multimercado | 6.982.914,36              | 2,01%        |                      | 3.500.000,00        | -14.765,13        | 3.468.149,23            | 1,00%        |
| Bradesco Multimercado SP 500 Mais             | 1.111.797,34              | 0,32%        | 3.500.000,00         |                     | 196.244,22        | 4.808.041,56            | 1,39%        |
| Caixa Multimercado RV 30                      | 0,00                      | 0,00%        |                      |                     | 0,00              | 0,00                    | 0,00%        |
| Caixa Bolsa Americana Multimercado            | 1.106.362,29              | 0,32%        | 3.000.000,00         |                     | 127.911,22        | 4.234.273,51            | 1,23%        |
| Itaú FIC Private Multimercado SP500           | 1.111.664,28              | 0,32%        | 3.000.000,00         |                     | 132.275,75        | 4.243.940,03            | 1,23%        |
| Safrá SP Reais PB Multimercado                | 1.089.054,87              | 0,31%        | 3.000.000,00         |                     | 127.408,94        | 4.216.463,81            | 1,22%        |
| Sculptor Crédito Privado Multimercado         | 11.497.184,15             | 3,31%        |                      |                     | 265.898,04        | 11.763.082,19           | 3,40%        |
| <b>TOTAL FUNDOS MULTIMERCADO</b>              | <b>22.898.977,29</b>      | <b>6,58%</b> | <b>12.500.000,00</b> | <b>3.500.000,00</b> | <b>834.973,04</b> | <b>32.733.950,33</b>    | <b>9,47%</b> |

| FUNDOS DE AÇÕES                       | SALDO INICIAL EM JAN/2021 | %             | APLICAÇÕES  | RESGATES    | RENDIMENTOS          | SALDO FINAL EM MAR/2021 | %             |
|---------------------------------------|---------------------------|---------------|-------------|-------------|----------------------|-------------------------|---------------|
| BB FIC FIA Valor                      | 21.751.876,99             | 6,25%         |             |             | -564.393,61          | 21.187.483,38           | 6,13%         |
| Caixa FIC FIA Multigestor             | 16.364.491,80             | 4,71%         |             |             | -372.720,14          | 15.991.771,66           | 4,63%         |
| Itaú FIC FIA Dunamis                  | 20.439.284,87             | 5,88%         |             |             | 224.641,21           | 20.663.926,08           | 5,98%         |
| Safra FIC FIA Selection               | 14.356.250,51             | 4,13%         |             |             | -572.965,31          | 13.783.285,20           | 3,99%         |
| <b>TOTAL FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL</b> | <b>72.911.904,17</b>      | <b>20,96%</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>-1.285.437,85</b> | <b>71.626.466,32</b>    | <b>20,73%</b> |

| POUPANÇA              | SALDO INICIAL EM JAN/2021 | %            | APLICAÇÕES      | RESGATES    | RENDIMENTOS   | SALDO FINAL EM MAR/2021 | %            |
|-----------------------|---------------------------|--------------|-----------------|-------------|---------------|-------------------------|--------------|
| Poupança - Bradesco   | 35.392,20                 | 0,01%        | 2.619,92        |             | 126,23        | 38.138,35               | 0,01%        |
| <b>TOTAL POUPANÇA</b> | <b>35.392,20</b>          | <b>0,01%</b> | <b>2.619,92</b> | <b>0,00</b> | <b>126,23</b> | <b>38.138,35</b>        | <b>0,01%</b> |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR                     | SALDO INICIAL EM JAN/2021 | %            | APLICAÇÕES          | RESGATES    | RENDIMENTOS    | SALDO FINAL EM MAR/2021 | %            |
|---|---------------------------|--------------|---------------------|-------------|----------------|-------------------------|--------------|
| Caixa FIA Institucional BDR Nível I           | 0,00                      | 0,00%        | 3.013.982,34        |             | 12.305,29      | 3.026.287,63            | 0,88%        |
| Itaú FIC FIA BDR Nível I                      | 0,00                      | 0,00%        | 2.634.496,09        |             | -53.158,92     | 2.581.337,17            | 0,75%        |
| Safra FIA Consumo Americano PB BDR Nível I    | 0,00                      | 0,00%        | 1.500.000,00        |             | 40.502,12      | 1.540.502,12            | 0,45%        |
| <b>TOTAL FUNDOS INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b> | <b>0,00</b>               | <b>0,00%</b> | <b>7.148.478,43</b> | <b>0,00</b> | <b>-351,51</b> | <b>7.148.126,92</b>     | <b>2,07%</b> |

# Ativos

| CONTAS CORRENTES             | SALDO INICIAL EM<br>JAN/2021 | %            | APLICAÇÕES  | RESGATES    | RENDIMENTOS | SALDO FINAL EM<br>MAR/2021 | %            |
|------------------------------|------------------------------|--------------|-------------|-------------|-------------|----------------------------|--------------|
| Banco do Brasil              | 0,00                         | 0,00%        |             |             | 0,00        | 0,00                       | 0,00%        |
| Bradesco                     | 2.186,75                     | 0,00%        |             |             | 0,00        | 874,98                     | 0,00%        |
| Caixa Econômica Federal      | 0,00                         | 0,00%        |             |             | 0,00        | 13,52                      | 0,00%        |
| Itaú Unibanco                | 0,00                         | 0,00%        |             |             | 0,00        | 0,00                       | 0,00%        |
| Safra                        | 0,00                         | 0,00%        |             |             | 0,00        | 0,00                       | 0,00%        |
| Santander                    | 0,00                         | 0,00%        |             |             | 0,00        | 0,00                       | 0,00%        |
| <b>TOTAL CONTAS CORRENTE</b> | <b>2.186,75</b>              | <b>0,00%</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>888,50</b>              | <b>0,00%</b> |

| TOTAL GERAL | SALDO INICIAL EM<br>JAN/2021 | %           | APLICAÇÕES           | RESGATES             | RENDIMENTOS          | SALDO FINAL EM<br>MAR/2021 | %           |
|-------------|------------------------------|-------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------------|-------------|
|             | <b>347.792.523,16</b>        | <b>100%</b> | <b>68.739.510,32</b> | <b>67.744.982,70</b> | <b>-3.248.939,72</b> | <b>345.536.812,81</b>      | <b>100%</b> |



INSTITUTO DE SEGURIDADE DO SERVIDOR MUNICIPAL

CAMAÇARI - BAHIA



<http://www.issm.camacari.ba.gov.br>



/issmpmc



/issm.camacari

Instituto de Seguridade do Servidor Municipal - ISSM  
Rua Francisco Drumond, S/N, Centro Administrativo.  
CEP. 42.800-970. Camaçari - Bahia - Brasil  
**Tel +55 71 3621-6632**