

Ata da Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos

ATA Nº 01/2022

Aos quatorze dias do mês de janeiro do ano de 2022, reuniram-se, na sala de reuniões do SEPREV, os membros do Comitê de Investimentos para realização da primeira reunião ordinária do ano de 2022. Contando com a participação dos membros: Ana Regina Bernardini Braz, Daniela Pazini Jacober e Marcos Barce. Ausentes justificadamente os membros Antonio Corrêa e Dernal Luiz Steves, por motivo de férias. A reunião iniciou-se com a eleição para presidente, vice-presidente e secretário(a). Os membros presentes, em votação verbal, elegeram: para presidente o Sr. Antonio Corrêa, para vice-presidente, Dernal Luiz Steves e para secretária, Daniela Pazini Jacober. Com quórum suficiente para deliberações, foram apresentados e discutidos os seguintes assuntos da pauta previamente informada: **1) Apresentação do relatório mensal com os resultados do mês de dezembro/2021.** Foi apresentado o relatório com a performance individualizada dos investimentos. O resultado mensal foi positivo em R\$ 18.504.459,82 e o patrimônio financeiro total ficou em R\$ 1.467.695.281,90. A valorização no mês foi de 1,28% diante da meta de 1,22%, e no ano, a rentabilidade acumulada foi de -0,69% diante da meta de 16,10%. O diretor financeiro informou que esse foi o melhor resultado mensal do ano, porém insuficiente para evitar o resultado negativo do exercício, que ficou em -R\$ 9.562.223,78. Esse foi o pior resultado desde 2013, e causado principalmente pela crise gerada pela pandemia que ainda afeta a retomada das economias, com o surgimento de novas variantes do vírus e também por fatores internos relacionados ao cenário político. As melhores performances da carteira foram dos fundos multimercados *S&P* e fundos *BDRs* e *Global Equities*, todos ligados ao exterior e que superam com folga a meta atuarial. Esse resultado negativo do exercício de 2021 deverá afetar diretamente o resultado atuarial em 2022, elevando assim o atual déficit. O Comitê atestou a conformidade do relatório quanto à rentabilidade e da aderência das alocações e processos decisórios à Política Anual de Investimentos e encaminha ao Conselho Fiscal para deliberação; **2) Apresentação do relatório semestral de diligências.** Foi apresentado o relatório semestral de diligências e acompanhamento sistemático, relativo ao 1º semestre de 2021, elaborado pela consultoria *Crédito & Mercado*, em atendimento à certificação do Pró Gestão, contendo análises da carteira e seus resultados, abrangendo também a situação das instituições financeiras credenciadas e dos fundos investidos. O mesmo será disponibilizado no site do SEPREV; **3) Calendário de Reuniões.** Foi apresentado e aprovado o calendário de reuniões do comitê para o exercício de 2022; **4) Resgate e Liquidação do fundo Santos Credit Yield.** O diretor financeiro informou que no dia 07/12/2021 foi realizada assembleia virtual dos cotistas do fundo *Santos Credit Yield*, A principal deliberação da assembleia foi pela liquidação do fundo, com resgates no prazo de sessenta dias a partir de 09/12/2021. Passado esse prazo, os valores serão depositados em juízo. O diretor informou ainda que encaminhou o pedido de resgate, sendo que o crédito ocorreu no dia 07/01/2022, no valor de R\$ 239.704,52. Com esse resgate, o valor total recuperado desde 2005 ficou em R\$ 1.776.657,71 e o valor a ser contabilizado como perdas ficou em R\$ 2.031.350,33. Sendo que essa contabilização se faz necessária, inclusive por determinação do Tribunal de Contas, em sua última fiscalização. O comitê homologou o resgate realizado; **5) Propostas para investimentos das receitas mensais.** Com relação à arrecadação das contribuições

e demais receitas, o diretor financeiro informou que somente o SAAE recolheu neste mês, pois as demais entidades já haviam antecipado o recolhimento em dezembro/2021. Recomendou que das receitas do FAS, R\$ 800.000,00, sejam aplicados no fundo SANTANDER Institucional DI, e das receitas do FUNPREV, incluídos os créditos do COMPREV e da liquidação do fundo Santos Credit Yield, o montante de R\$ 1.400.000,00 também seja aplicado no fundo SANTANDER Institucional DI, por serem fundos conservadores e para utilização desses recursos no pagamento de despesas com os benefícios do FAS e FUNPREV. As aplicações foram aprovadas por unanimidade, e estão de acordo com a Política de Investimentos, com a execução orçamentária e o fluxo de caixa; **6) 5ª Chamada de Capital do fundo BTG FIP ECONOMIA REAL.** O diretor financeiro apresentou a notificação recebida da BTG DTVM para integralização até o dia 26/01/2022 da quinta chamada de capital para o fundo Economia Real, no valor de R\$ 1.973.769,30. Para esse fim, recomendou a transferência desse valor, do fundo Santander Institucional DI-FUNPREV. O comitê aprovou a transferência; **7) Processos de Credenciamentos de Instituições Financeiras.** O comitê analisou os processos de nºs 488/2021 e 501/2021, de credenciamento das instituições financeiras: XP Investimentos CCTVM S/A e CAIXA DTVM S/A. De acordo com os pareceres constantes dos processos, esses credenciamentos são justificados, sendo o credenciamento da XP CCTVM por ser *dealer* credenciada pelo Tesouro Nacional para operar nos mercados de títulos públicos federais e a CAIXA DTVM, por ter sido criada com a finalidade de fazer a gestão de todos os fundos da CAIXA. O comitê aprovou os credenciamentos, devendo ser submetidos à deliberação do Conselho Administrativo, detentor da alçada. Nada mais havendo a tratar, eu, Daniela Pazini Jacober, secretária, lavrei a presente ata, que depois de lida e achada conforme, vai assinada por mim e pelos demais membros.

ausente
Antonio Corrêa
Presidente

ausente
Dernival Luiz Steves
Vice-Presidente

Daniela Pazini Jacober
Secretária

Marcos Barce

Ana Regina Bernardini Braz