

COMITÊ DE INVESTIMENTOS REUNIÃO ORDINÁRIA

ATA Nº 08/2022

DATA: 12.08.2022

HORA: 08:30

LOCAL: Sala de Reuniões do SEPREV

MEMBROS PRESENTES:

Antonio Corrêa – Presidente
Dernival Luiz Steves – Vice-Presidente
Daniela Pazini Jacober – Secretária

Ana Regina Bernardini Braz – Membro
Marcos Barce – Membro

CERTIFICAÇÃO:

CGRPPS – APIMEC
CPA 10 – ANBIMA
CPA 20 – ANBIMA
CGRPPS – APIMEC
CGRPPS – APIMEC
CPA 10 – ANBIMA
CGRPPS – APIMEC

VALIDADE:

12.08.2023
19.03.2024
15.01.2023
12.08.2023
12.08.2023
06.03.2024
22.07.2023

MEMBROS AUSENTES:

CONVIDADOS:

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 julho/2022:** Foi apresentado o relatório com os resultados dos investimentos referente ao mês de julho, e o cenário econômico. O resultado mensal foi positivo em R\$ 36.151.531,37 e o patrimônio financeiro total fechou em R\$ 1.485.284.931,96. A valorização no mês foi de 2,50% diante da meta de -0,20%. No ano a rentabilidade acumulada ficou em 1,38% contra uma meta de 7,90%. No mês de julho tivemos a melhor rentabilidade do ano, com performance positiva tanto na renda fixa (RF) como na renda variável (RV). Na RV doméstica, os melhores números de PIB e os indicativos de uma inflação mais fraca nos próximos meses, aliado a um cenário menos pessimista nos EUA e China, fizeram com que o IBOVESA fechasse no positivo. Os fundos de ações, tiveram uma recuperação expressiva após a queda ocorrida no mês de junho. Pelas mesmas razões os fundos multimercados bolsa americana S&P 500, tiveram uma valorização acima de 10%. Na renda fixa tivemos resultados mistos, negativos nos fundos IMA (marcados a mercado) e positivos nos fundos DI e na carteira de títulos públicos que tem marcação na curva. Com a deflação ocorrida em julho, o INPC fechou em -0,60% amenizando assim a meta atuarial acumulada. De forma geral houve uma melhora nas expectativas de mercado. Verificamos que todos os investimentos do SEPREV se encontram enquadrados na Resolução 4963/2021. O Comitê atestou a conformidade desse relatório quanto à rentabilidade e a aderência das alocações e processos decisórios à Política Anual de Investimentos e encaminha aos Conselhos Administrativo e Fiscal para conhecimento e deliberação.
- 2- Propostas para investimentos das arrecadações mensais – FAS e FUNPREV, Fundos de vértice Banco do Brasil e Cupons de juros semestrais NTNBS:** a) Com relação à arrecadação das contribuições deste mês, o diretor financeiro recomendou que tanto as contribuições para o FAS, estimadas em R\$ 4,489 milhões, como as contribuições para o FUNPREV, estimadas em R\$ 9,587 milhões, sejam aplicadas no fundo Santander Institucional DI para atender às despesas administrativas e folhas de pagamentos dos benefícios previdenciários e do plano de saúde. Informou também que os repasses já foram parcialmente efetuados pelos entes e para que os recursos não ficassem parados em conta corrente já efetuou as aplicações. O comitê homologou as aplicações efetuadas; b) **Fundos de vértice BB IPCA IV, VII e X.** Os fundos de vértice do Banco do Brasil: “IV e VII” terão amortização integral em 15/08/2022 e o fundo “X” terá amortização parcial. O diretor financeiro apresentou duas alternativas para aplicação do valor resgatado que deve girar em torno de R\$ 18,7 milhões: alternativa a) fundo BB Alocação Ativa e alternativa b) aquisição de 5.000 NTNBS 2024 com marcação na curva e taxa mínima. O Comitê aprovou a alternativa (b), desde que obtenha

a taxa mínima de 6,00%aa, devendo ainda ser submetida à deliberação final do Conselho Administrativo, detentor da alçada; c) **Cupons de juros semestrais NTNbs anos pares.** No dia 15/08/2022 haverá o crédito de cupons de juros semestrais dos títulos NTN B 2024, 2040 e 2050, com valor estimado em R\$ 8.470.000,00 (oito milhões, quatrocentos e setenta mil reais). O diretor financeiro recomendou aplicar os valores recebidos no fundo BRADESCO RF IMA-B 5, para uma possível aquisição futura de títulos públicos. O Comitê aprovou por unanimidade a aplicação recomendada que está dentro de sua alçada.-.-.

3- Processo nº 050/2022 – Aquisição de Títulos Públicos Federais – Atualização de dados: O diretor financeiro atualizou as informações relativas às aquisições de títulos públicos federais, apresentando o resumo das aquisições de 140.000 NTN-Bs, conforme quadro abaixo. Informou que foi concluída a quinta etapa do processo, com a aquisição de mais 10.000 NTN-Bs com vencimento para 2040, a qual obteve a taxa de 6,202%. Com essa aquisição a taxa média das quatorze operações efetuadas desde março ficou em 5,850% num total de R\$ 570.919.869,49. O diretor financeiro informou que após essa aquisição que ocorreu no dia 3 de agosto, as taxas tiveram queda, ficando abaixo de 6,00%aa, mas ainda atrativas por estarem acima da meta atuarial, mantendo-se assim a oportunidade para novas aquisições.-.-.-.-.-

PROCESSO Nº 050/2022 - AQUISIÇÕES DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS EM 2022									
	DATA DA COMPRA	CONTRAPARTE	TÍTULO	QUANTIDADE	MARCAÇÃO	VENCIMENTO	VALOR R\$	ÍNDICE	TAXAS %
1	16.03.2022	XP CCTVM	NTN B	10.000	Curva	15.05.2055	39.694.883,62	IPCA	5,945
2	23.03.2022	XP CCTVM	NTN B	10.000	Curva	15.08.2050	40.119.541,98	IPCA	5,775
3	30.03.2022	BTG	NTN B	10.000	Curva	15.05.2045	41.445.162,11	IPCA	5,642
4	06.04.2022	BRADESCO	NTN B	10.000	Curva	15.05.2055	42.220.290,80	IPCA	5,590
5	11.04.2022	BCO BRASIL	NTN B	10.000	Curva	15.08.2050	41.052.754,56	IPCA	5,708
6	18.04.2022	BRADESCO	NTN B	10.000	Curva	15.05.2045	41.511.559,45	IPCA	5,732
7	26.04.2022	XP CCTVM	NTN B	10.000	Curva	15.08.2040	41.122.763,22	IPCA	5,678
8	03.05.2022	XP CCTVM	NTN B	10.000	Curva	15.05.2055	41.405.287,60	IPCA	5,842
9	09.05.2022	BTG	NTN B	10.000	Curva	15.08.2050	40.696.417,03	IPCA	5,875
10	11.05.2022	BTG	NTN B	10.000	Curva	15.08.2040	40.869.252,06	IPCA	5,824
11	30.05.2022	BRADESCO	NTN B	10.000	Curva	15.05.2055	40.572.346,44	IPCA	5,872
12	08.06.2022	XP CCTVM	NTN B	10.000	Curva	15.08.2050	41.200.065,00	IPCA	5,880
13	12.07.2022	BGC DTVM	NTN B	10.000	Curva	15.05.2045	38.863.751,45	IPCA	6,333
14	03.08.2022	BGC DTVM	NTN B	10.000	Curva	15.08.2040	40.145.794,17	IPCA	6,202
TOTAL INVESTIDO				140.000			570.919.869,49		
TAXA MÉDIA 2055				40.000			163.892.808,46	5,812	
TAXA MÉDIA 2050				40.000			163.068.778,57	5,810	
TAXA MÉDIA 2045				30.000			121.820.473,01	5,902	
TAXA MÉDIA 2040				30.000			122.137.809,45	5,901	
TAXA MÉDIA GERAL								5,850	
META ATUARIAL 2022								4,880	

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.-.-.-.-.-

Antonio Corrêa	Dernival Luiz Steves
Daniela Pazini Jacober	Ana Regina Bernardini Braz
Marcos Barce	