

COMITÊ DE INVESTIMENTOS REUNIÃO ORDINÁRIA

ATA Nº 10/2022

DATA: 14.10.2022

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

QUÓRUM:

Presente
Ausente
Presente

Presente
Presente

CONVIDADOS: Marcos Rogério Fregate Baraldi – Assessor do Depto Financeiro

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 setembro/2022: O diretor financeiro apresentou o relatório com os resultados dos investimentos no mês de setembro, e o cenário econômico. O resultado mensal foi negativo em R\$ 13.094.701,00 e o patrimônio financeiro total ficou em R\$ 1.486.421.753,51. A desvalorização no mês foi de -0,89% diante da meta de 0,08%. No ano a rentabilidade acumulada ficou em 1,26% contra uma meta de 8,11%. O diretor informou que, setembro foi o terceiro mês de deflação fazendo com que a meta atuarial se mantivesse com certa estabilidade. Informou que o resultado negativo foi causado principalmente pela performance dos fundos do exterior e multimercados-bolsa americana que vem sofrendo com a alta da inflação e dos juros americanos. Também pesa no cenário externo a situação da economia da união europeia com a crise energética provocada pela guerra na Ucrânia, o que por sua vez leva a uma alta inflacionária com previsão de recessão para 2023. Também os fundos de renda variável-Brasil tiveram em sua maioria, resultados negativos, exceção para o fundo Caixa Construção Civil que valorizou 11,99%. O diretor explicou que com mais esse resultado negativo, o atingimento da meta atuarial fica praticamente impossível restando apenas três meses para o encerramento do ano. O Comitê atestou a conformidade desse relatório quanto à rentabilidade, enquadramentos 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. Com relação à arrecadação das contribuições deste mês, o diretor financeiro recomendou que a arrecadação do FAS, estimada em R\$ 4,515 milhões, seja aplicada no fundo Santander Institucional DI. Quanto à arrecadação do FUNPREV, o diretor informou que utilizou a mesma para a compra de títulos públicos NTN-B 2035, autorizada na reunião anterior, aquisição essa que foi liquidada na data de ontem. O Comitê aprovou a aplicação dos recursos do FAS na forma proposta e homologou a utilização da arrecadação do FUNPREV para a compra de NTN-Bs.

3- Processo nº 050/2022 – Aquisição de Títulos Públicos Federais – Atualização de dados: O diretor financeiro atualizou as informações sobre às aquisições de títulos públicos, apresentando o resumo das compras de 155.000 NTN-Bs, conforme quadro abaixo. Informou que nesta semana concluiu a aquisição de mais 10.000 NTN-Bs 2035, em dois lotes de 5.000, com taxas de 5,736% e 5,801%. Com essa aquisição a taxa média das 17 operações efetuadas desde março ficou em 5,865% num total de R\$ 631.903.288,90:

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	5,9450
2	23.03.2022	XP CCTVM	NTN B	10.000	Curva	15.08.2050	40.119.541,98	IPCA	5,7750
3	30.03.2022	BTG	NTN B	10.000	Curva	15.05.2045	41.445.162,11	IPCA	5,6420
4	06.04.2022	BRADESCO	NTN B	10.000	Curva	15.05.2055	42.220.290,80	IPCA	5,5900
5	11.04.2022	BCO BRASIL	NTN B	10.000	Curva	15.08.2050	41.052.754,56	IPCA	5,7080
6	18.04.2022	BRADESCO	NTN B	10.000	Curva	15.05.2045	41.511.559,45	IPCA	5,7320
7	26.04.2022	XP CCTVM	NTN B	10.000	Curva	15.08.2040	41.122.763,22	IPCA	5,6780
8	03.05.2022	XP CCTVM	NTN B	10.000	Curva	15.05.2055	41.405.287,60	IPCA	5,8420
9	09.05.2022	BTG	NTN B	10.000	Curva	15.08.2050	40.696.417,03	IPCA	5,8750
10	11.05.2022	BTG	NTN B	10.000	Curva	15.08.2040	40.869.252,06	IPCA	5,8240
11	30.05.2022	BRADESCO	NTN B	10.000	Curva	15.05.2055	40.572.346,44	IPCA	5,8720
12	08.06.2022	XP CCTVM	NTN B	10.000	Curva	15.08.2050	41.200.065,00	IPCA	5,8800
13	12.07.2022	BGC DTVM	NTN B	10.000	Curva	15.05.2045	38.863.751,45	IPCA	6,3330
14	03.08.2022	BGC DTVM	NTN B	10.000	Curva	15.08.2040	40.145.794,17	IPCA	6,2020
15	17.08.2022	BGC DTVM	NTN B	5.000	Curva	15.08.2024	19.701.895,79	IPCA	6,4820
16	07.10.2022	BGC DTVM	NTN B	5.000	Curva	15.05.2035	20.693.111,54	IPCA	5,7360
17	11.10.2022	BRADESCO	NTN B	5.000	Curva	15.05.2035	20.588.412,08	IPCA	5,8015
TOTAL INVESTIDO				155.000			631.903.288,90		
TAXA MÉDIA 2055				40.000			163.892.808,46	5,8123	
TAXA MÉDIA 2050				40.000			163.068.778,57	5,8095	
TAXA MÉDIA 2045				30.000			121.820.473,01	5,9020	
TAXA MÉDIA 2040				30.000			122.137.809,45	5,9010	
TAXA MÉDIA 2035				10.000			41.281.523,62	5,7687	
TAXA MÉDIA 2024				5.000			19.701.895,79	6,4820	
TAXA MÉDIA GERAL								5,8650	
META ATUARIAL 2022								4,8800	

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 presentes-.....

Antonio Corrêa

Dernival Luiz Steves

Ausente

Daniela Pazini Jacober

Ana Regina Bernardini Braz

Marcos Barce