

COMITÊ DE INVESTIMENTOS REUNIÃO ORDINÁRIA

ATA Nº 01/2023

DATA: 10.01.2023

HORA: 8:30

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
CGINV 1 – TOTUM
CGRPPS – APIMEC
CPA 10 – ANBIMA

VALIDADE:

12.08.2023
19.03.2024
29.11.2026
12.08.2023
06.03.2024

QUÓRUM:

Presente
Presente
Presente
Presente
Presente

CONVIDADOS:

Thiago Fonseca Gonçalves – Chefe de Gabinete da Superintendência

Com quórum suficiente para deliberações, foram apresentados e discutidos os seguintes assuntos da pauta previamente informada:

1- Eleição do presidente, vice-presidente e secretário (a) do Comitê. A reunião iniciou-se com a eleição para presidente, vice-presidente e secretário (a). Os membros, em votação verbal, elegeram: para presidente o Sr. Antonio Corrêa, para vice-presidente, Dernival Luiz Steves e para secretária, Daniela Pazini Jacober.

2- Apresentação do relatório mensal com os resultados do mês de dezembro/2022: O diretor financeiro apresentou o relatório com os resultados dos investimentos no mês de dezembro, e o cenário econômico. O resultado mensal foi negativo em R\$ 9.161.686,22 e o patrimônio financeiro total ficou em R\$ 1.537.344.362,92. A desvalorização no mês foi de 0,61% diante da meta de 1,11%. No ano a rentabilidade acumulada ficou em 3,05% contra uma meta de 11,08%. O diretor informou que em dezembro tivemos resultados negativos nos segmentos de renda variável, fundos de ações Brasil e fundos multimercados S&P, assim como nos fundos do Exterior. Pelo terceiro ano consecutivo não atingimos a meta atuarial. Os investimentos foram afetados desde o início de 2020 com o surgimento da Covid-19 e suas consequências na economia global que perduram, em menor grau, até os dias atuais, assim como a guerra na Ucrânia iniciada em 2022, que também não tem previsão de cessar a curto prazo. Essas ocorrências, assim como o cenário político doméstico trouxeram muita volatilidade, principalmente nos segmentos de ações Brasil e Exterior, com alta inflacionária aqui e nas principais economias globais. A aquisição de títulos públicos iniciada em março de 2022 foi importante, mas não foi suficiente para reduzir os efeitos dessa volatilidade nos resultados de 2022. Por fim, o diretor informou que todos os investimentos estão enquadrados na Política de Investimentos 2023. Abaixo segue o quadro com a evolução das reservas financeiras em 2022:

	FUNPREV	RES. ADMIN.	F A S	TOTAL	RENDIMENTOS
31/12/2021	1.453.812.694,53	1.102.911,57	12.779.675,80	1.467.695.281,90	
31/01/2022	1.441.979.088,76	272.245,68	9.967.382,34	1.452.218.716,78	-6.995.740,58
25/02/2022	1.455.276.878,62	343.436,50	10.211.819,06	1.465.832.134,18	12.041.852,77
31/03/2022	1.487.360.718,25	378.046,26	10.409.998,93	1.498.148.763,44	31.073.542,48
29/04/2022	1.460.240.834,93	372.354,62	10.972.931,73	1.471.586.121,28	-28.678.250,50
31/05/2022	1.469.935.379,57	435.697,47	11.042.266,39	1.481.413.343,43	8.478.208,26
30/06/2022	1.440.022.354,45	565.024,25	11.306.287,35	1.451.893.666,05	-31.485.101,75
29/07/2022	1.473.258.547,93	604.501,48	11.421.882,55	1.485.284.931,96	36.151.531,37
31/08/2022	1.486.244.039,42	633.891,82	11.488.679,33	1.498.366.610,57	11.614.584,69
30/09/2022	1.474.451.580,60	647.040,35	11.308.132,56	1.486.406.753,51	-13.094.701,00
31/10/2022	1.509.102.733,13	702.916,33	10.896.400,37	1.520.702.049,83	33.461.285,77
30/11/2022	1.512.839.535,23	780.603,25	10.603.543,57	1.524.223.682,05	1.953.711,40
30/12/2022	1.518.827.150,56	1.144.952,59	17.372.259,77	1.537.344.362,92	-9.161.686,22
Evolução	65.014.456,03	42.041,02	4.592.583,97	56.528.400,15	45.359.236,69

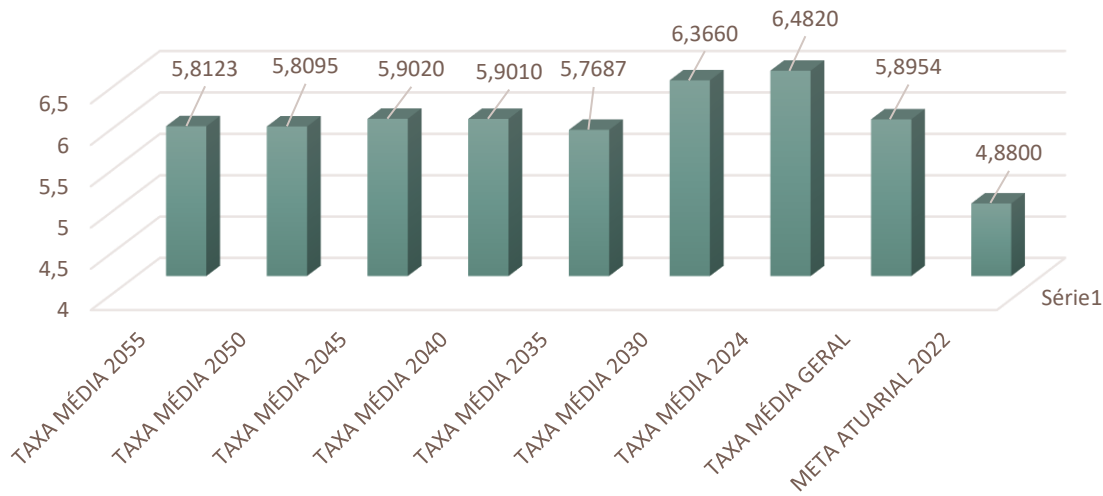
3- Propostas para investimentos das arrecadações mensais – FAS e FUNPREV. Com relação à arrecadação das contribuições do FAS-Fundo de Assistência à Saúde e FUNPREV-Fundo Previdenciário, referentes às competências de dezembro/2022 e 13º, o diretor financeiro informou que, com exceção do SAAE as

demais entidades (Prefeitura, Câmara e FIEC) anteciparam o recolhimento em dezembro/2022, e que assim, a arrecadação prevista para este mês é de R\$ 750.000,00 para o FAS e R\$ 1.400.000,00 para o FUNPREV. Para os recursos do FAS o diretor financeiro recomendou a aplicação no fundo SANTANDER INSTITUCIONAL DI e para os recursos do FUNPREV, recomendou a aplicação no fundo BTG CRÉDITO CORPORATIVO CRÉDITO PRIVADO, que apresentou a melhor rentabilidade entre os fundos de renda fixa da carteira do SEPREV em 2022. O Comitê, dentro de sua alçada aprovou por unanimidade as aplicações na forma recomendada pelo diretor financeiro, que estão de acordo com a Política de Investimentos 2023.

4- Aquisição de Títulos Públicos Federais NTNBS 2026 e 2035. O diretor financeiro recomendou a aquisição de 5.000 NTNBS 2026 e 10.000 NTNBS 2035. Justificou que as taxas estão atrativas, acima de 6,00%aa, sendo uma oportunidade de ampliar a carteira de títulos públicos com taxas acima da meta atuarial. Informou também que essas quantidades estão em conformidade com os limites recomendados no estudo de ALM-Asset Liability Management, realizado em setembro de 2022 pela consultoria LDB e nos limites da Política de Investimentos de 2023. Após as explanações o comitê aprovou por unanimidade a concessão desse novo mandato, nas quantidades propostas, com marcação na curva de juros, com taxa mínima de 5,90%aa (atual média da carteira de títulos públicos), mediante resgate dos recursos, dos fundos de renda fixa enquadrados nos artigos 7º, I, b e 7º, III, a, da Resolução CMN 4963/2021, existentes no Banco Bradesco, Banco do Brasil e Banco Safra, no montante estimado de R\$ 60.000.000,00 (sessenta milhões de reais). Encaminhe-se ao Conselho Administrativo, que é o detentor da alçada final para essa modalidade de investimento. Abaixo segue o quadro com o resumo das aquisições de títulos NTNBS realizadas em 2022:

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
18	14.12.2022	BGC DTVM	NTN B	10.000	Curva	15.08.2030	39.837.270,67	IPCA	6,3660
TOTAL INVESTIDO				165.000			671.740.559,57		
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			81.118.794,29	5,7687	
TAXA MÉDIA 2030				10.000			39.837.270,67	6,3660	
TAXA MÉDIA 2024				5.000			19.701.895,79	6,4820	
TAXA MÉDIA GERAL								5,8954	
META ATUARIAL 2022									4,8800

TAXAS MÉDIAS POR VENCIMENTO E MÉDIA GERAL



5- Certificação dos membros. O diretor financeiro recomendou aos membros Antonio Corrêa e Ana Regina Bernardini Braz, cujos atuais certificados CGRPPS vencem em 12/08/2023, que realizem em tempo hábil, as provas para a modalidade de certificação atualmente exigida para membros do comitê de investimentos. Registra-se ainda a certificação CGINV1 do Instituto Totum, obtida pela membro Daniela Pazini Jacober.

Nada mais havendo a tratar, eu, Daniela Pazini Jacober, secretária, lavrei a presente ata, que depois de lida e achada conforme, vai assinada digitalmente por mim e pelos demais membros presentes.....



VERIFICAÇÃO DAS ASSINATURAS



Código para verificação: B81F-E4FD-F878-8DDE

Este documento foi assinado digitalmente pelos seguintes signatários nas datas indicadas:

- ✓ DANIELA PAZINI JACOBBER (CPF 216.XXX.XXX-86) em 12/01/2023 17:02:14 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

- ✓ ANTONIO CORREA (CPF 107.XXX.XXX-04) em 12/01/2023 17:51:55 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: AC DIGITALSIGN RFB G2 << AC Secretaria da Receita Federal do Brasil v4 << Autoridade Certificadora Raiz Brasileira v5 (Assinatura ICP-Brasil)

- ✓ MARCOS BARCE (CPF 016.XXX.XXX-18) em 12/01/2023 17:58:11 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

- ✓ ANA REGINA BERNARDINI BRAZ (CPF 808.XXX.XXX-49) em 13/01/2023 11:43:27 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

- ✓ DERNIVAL LUIZ STEVES (CPF 083.XXX.XXX-73) em 13/01/2023 13:05:12 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

Para verificar a validade das assinaturas, acesse a Central de Verificação por meio do link:

<https://seprev.1doc.com.br/verificacao/B81F-E4FD-F878-8DDE>