

COMITÊ DE INVESTIMENTOS REUNIÃO ORDINÁRIA

ATA Nº 03/2023

DATA: 15.03.2023

HORA: 8:00

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:

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 fevereiro/2023: O diretor financeiro apresentou o relatório com os resultados dos investimentos no mês de fevereiro, e os principais fatos que impactaram no desempenho da carteira. O resultado mensal foi negativo em **R\$ 8.089.772,65** e o patrimônio financeiro total ficou em **R\$ 1.547.607.036,42**. A variação no mês foi de -0,53% diante da meta de 1,27%. No ano a rentabilidade acumulada ficou em 1,40% contra uma meta de 2,25%. O diretor informou que em fevereiro o segmento responsável pelo mau desempenho foi o dos fundos de ações domésticos. A bolsa brasileira caiu 7,49%, em parte pela saída de estrangeiros na esteira de reavaliações sobre o ciclo de alta dos juros nos Estados Unidos, e em parte pelas preocupações locais envolvendo a relação entre governo e Banco Central e as metas de inflação. Os investimentos em renda fixa e exterior trouxeram resultados positivos, mas não foram suficientes para compensar a queda do mercado de ações no Brasil. O diretor reafirmou que o objetivo para este ano é reduzir os investimentos em renda variável e ampliar a carteira de títulos públicos, para assim diminuir a volatilidade que tem prejudicado muito o desempenho global da carteira e também aproveitar o momento de taxas acima de 6,00%aa nas NTNBS. Por fim, o diretor informou que está avaliando a viabilidade de resgate dos fundos que se desequilibraram em virtude de deterem papéis das Lojas Americanas em suas carteiras. O quadro abaixo demonstra o saldo dos investimentos do **FUNPREV** por segmento, a rentabilidade, os respectivos percentuais e os limites definidos na Política de Investimentos:

INVESTIMENTOS DO FUNPREV - POLÍTICA 2023					
Segmento	Saldo	Rentabilidade	%	Alvo	Sup
TÍT. PÚBL. TESOUREIRO - Art 7º I a	843.637.420,05	7.850.241,31	54,96%	50	70
FI 100% TÍT. TESOUREIRO - Art 7º I b	71.000.457,70	1.005.454,40	4,63%	10	20
FI RENDA FIXA - Art 7º III a	71.504.229,60	537.938,31	4,66%	5	10
FI RENDA FIXA EMISSÃO BANCÁRIA - Art. 7º IV	0,00	0,00	0,00%	2	5
FI RF CRÉD. PRIVADO - Art 7º V b	7.685.352,34	6.189,55	0,50%	3	5
RENDA FIXA	993.827.459,69	9.399.823,57	64,75%	70	110
FI DE AÇÕES - Art 8º I	209.944.847,07	-16.496.235,11	13,68%	10	23
FI CONST. BRASIL INV EXT - Art 9º II	78.666.542,65	1.046.145,74	5,13%	4	10
FI EM AÇÕES BDR NÍVEL I - Art 9º III	42.206.136,39	215.473,00	2,75%	3	10
FI MULTIMERCADOS - Art 10º I	132.849.166,11	-2.394.732,64	8,66%	8	10
FI EM PARTICIPAÇÕES - Art 10º II	73.912.824,90	144.001,25	4,82%	4	5
FI IMOBILIÁRIO - Art 11	3.504.142,00	-89.765,40	0,23%	1	2
RENDA VARIÁVEL	541.083.659,12	-17.575.113,16	35,25%	30	60
TOTAL	1.534.911.118,81	-8.175.289,59	100,00%	100	170

2- Propostas para investimentos das arrecadações mensais – FAS e FUNPREV. Com relação à arrecadação do FAS-Fundo de Assistência à Saúde referente à competência de fevereiro/2023, o diretor financeiro

recomendou que seja aplicada no fundo Santander Institucional DI. Para a arrecadação do FUNPREV, recomendou que seja utilizada na aquisição de títulos públicos NTN B 2040, conforme detalhado no item seguinte, e no caso de não ser utilizada integralmente, aplicar no fundo Santander Institucional DI. 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.

3- Atualização do Processo de aquisição de títulos públicos e novas aquisições. O diretor financeiro apresentou o quadro abaixo com o resumo das aquisições até o mês de fevereiro. A média da carteira chegou a 5,94%. Também apresentou proposta para nova aquisição de NTN Bs. Recomendou a compra de mais 5.000 títulos, com vencimento para 2040, marcação na curva de juros, taxa mínima de 5,94% (atual média da carteira) e utilização dos recursos da arrecadação mensal e resgate total do fundo ITAÚ Institucional Legend. O Comitê aprovou por unanimidade e encaminhou a proposta para deliberação do Conselho Administrativo que é o detentor da alçada.

	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
19	13.01.2023	BRADESCO	NTN B	5.000	Curva	15.08.2026	20.537.759,60	IPCA	6,0200
20	16.01.2023	BGC DTVM	NTN B	10.000	Curva	15.05.2035	40.232.306,93	IPCA	6,1080
21	14.02.2023	ITAÚ	NTN B	10.000	Curva	15.05.2045	39.085.146,50	IPCA	6,4170
TOTAL INVESTIDO				190.000			771.595.772,60		
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				40.000			160.905.619,51		6,0310
TAXA MÉDIA 2040				30.000			122.137.809,45		5,9013
TAXA MÉDIA 2035				20.000			80.366.670,12		5,9384
TAXA MÉDIA 2030				10.000			39.837.270,67		6,3660
TAXA MÉDIA 2026				5.000			20.537.759,60		6,0200
TAXA MÉDIA 2024				5.000			19.701.895,79		6,4820
TAXA MÉDIA GERAL									5,9373
META ATUARIAL 2023									5,1800

4- Apresentação do relatório anual 2022. O diretor financeiro apresentou o relatório anual de investimentos relativo ao exercício de 2022. O Comitê tomou conhecimento do conteúdo e aprovou o relatório, devendo ser disponibilizado no site do SEPREV.

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.



VERIFICAÇÃO DAS ASSINATURAS



Código para verificação: 84B9-5E4D-12DD-1800

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

- ✓ DANIELA PAZINI JACOBBER (CPF 216.XXX.XXX-86) em 17/03/2023 08:31:31 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

- ✓ MARCOS BARCE (CPF 016.XXX.XXX-18) em 17/03/2023 16:13:06 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

- ✓ ANTONIO CORREA (CPF 107.XXX.XXX-04) em 20/03/2023 08:07:36 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: AC SERASA RFB v5 << AC Secretaria da Receita Federal do Brasil v4 << Autoridade Certificadora Raiz Brasileira v5 (Assinatura ICP-Brasil)

- ✓ DERNIVAL LUIZ STEVES (CPF 083.XXX.XXX-73) em 20/03/2023 09:03:00 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

- ✓ ANA REGINA BERNARDINI BRAZ (CPF 808.XXX.XXX-49) em 20/03/2023 12:28:10 (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/84B9-5E4D-12DD-1800>