

Ata da Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos**ATA Nº 10/2019**

Aos onze dias do mês de outubro do ano de 2019, às 8:30h, na sala de reuniões do SEPREV, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos para realização da décima reunião ordinária do ano de 2019. Contando com as presenças dos membros: Antonio Corrêa, Ana Regina Bernardini Braz, Vani Rosa Moreira Rieder, Dernal Luiz Steves e Daniela Pazini Jacober. A reunião contou ainda com a presença do Diretor Financeiro/Gestor Marcos Barce. Foram apresentados e discutidos os seguintes assuntos da pauta: **1) Apresentação dos resultados do mês de setembro/2019:** o Diretor Financeiro apresentou o relatório com os resultados do mês de setembro, com a performance individualizada dos investimentos. O resultado mensal foi positivo em R\$ 22.939.752,92 e o patrimônio financeiro total alcançou R\$ 1.299.111.690,37. O resultado mensal foi de 1,80% diante da meta de 0,44%. No ano a rentabilidade acumulada ficou em 13,69% contra uma meta de 7,24%, equivalente a 189% da meta. O Diretor Financeiro informou que o resultado desse mês deveu-se principalmente ao mercado de renda fixa, refletindo sinalizações de novos cortes na taxa básica de juros. A inflação comportada e os dados da atividade econômica compatíveis com uma retomada modesta do crescimento em 2019 e 2020 também apoiaram o recuo das taxas prefixadas, que atingiram novas mínimas históricas; **2) Matérias e Comentários sobre o Cenário Econômico:** foram apresentadas as seguintes matérias, que ficam fazendo parte integrante desta ata: da Itaú Asset Management, a matéria: “Por dentro do cenário mensal” de 30/09/2019 e da Mongeral a “Carta Econômica” de Setembro/2019; **3) Processo nº 727/2019. Credenciamento do Fundo CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP.** O Comitê analisou o processo e o parecer do gestor, aprovando o seu credenciamento e recomendou a sua aprovação ao Conselho Administrativo; **4) Análise do Credenciamento do Banco BNP Paribas:** O Diretor Financeiro informou que recebeu a visita de representantes do Banco BNP Paribas, no mês passado, os quais apresentaram fundos do Banco, adequados aos RPPS e solicitaram o credenciamento do Banco junto ao SEPREV. O Diretor informou que pelas atuais regras da legislação do SEPREV o credenciamento não será possível, pois o Banco não possui o Patrimônio Líquido superior a R\$ 3 bilhões; **5) Propostas para investimentos da arrecadação mensal:** o Diretor Financeiro apresentou as seguintes propostas para a aplicação da arrecadação da competência de setembro: a) da arrecadação do FAS, estimada em R\$ 3.500.000,00 (três milhões e quinhentos mil reais) aplicar R\$ 3.300.000,00 no fundo CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP e R\$ 200.000,00 transferir para a conta corrente do FAS no Banco Santander para fazer frente às despesas administrativas; b) para a arrecadação do FUNPREV, estimada em R\$ 6.950.000,00 (seis milhões, novecentos e cinquenta mil reais) recomendou que seja aplicada da seguinte forma: R\$ 2.000.000,00 (dois milhões de reais) no fundo SAFRA IMA INSTITUCIONAL, e R\$ 4.950.000,00 (quatro milhões, novecentos e cinquenta mil reais) no fundo CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO. O Comitê, avaliando as propostas, decidiu pela aplicação de R\$ 3.500.000,00 (três milhões e quinhentos mil reais) no fundo SAFRA IMA INSTITUCIONAL, e R\$ 3.450.000,00 (três milhões quatrocentos e cinquenta mil reais) no fundo CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC

MULTIMERCADO. As aplicações autorizadas estão dentro da alçada do Comitê e compatíveis com a Política de Investimentos 2019 e com a execução orçamentária; **6) Processo nº 0757//2019. Análise da minuta da Política de Investimentos para 2020:** Foi apresentada a minuta da Política de Investimentos, elaborada pela Diretoria Financeira, contemplando entre outras alterações, os limites do nível II do Pró Gestão, alteração da meta atuarial de juros de 5,86%, alterações nas alçadas de decisão e inclusão dos investimentos previstos no art. 9º da Resolução 3922 (investimentos no exterior). O Comitê aprovou a minuta, conforme consta do processo, devendo ser submetida à apreciação final do Conselho Administrativo; **7) Proposta de alteração no Regimento do Comitê de Investimentos:** O Diretor Financeiro apresentou minuta com alterações no regimento do Comitê de Investimentos. As principais alterações dizem respeito à composição do Comitê, exigindo a capacitação de todos os membros, conforme exigência do Pró-Gestão, e a criação do cargo de vice-presidente. O Comitê aprovou a minuta, que fica fazendo parte integrante desta ata e recomenda a sua aprovação ao Conselho Administrativo; **8) APRs de setembro/2019.** Foram apresentadas para conhecimento e assinaturas, as APRs (autorizações para aplicações e resgates) do mês de setembro de 2019, de nºs 140 a 156. 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 por todos os presentes.

Antonio Corrêa

Presidente

Daniela Pazini Jacober

Secretária

Vani Rosa Moreira Rieder

Ana Regina Bernardini Braz

Dernival Luiz Steves

Marcos Barce

Diretor Financeiro/Gestor