



COMITÊ DE INVESTIMENTOS

ATA N.º 261/2023

No vigésimo sétimo dia do mês de setembro de 2023, às dezesseis horas e doze minutos, na sede do ITAPREVI, situada na Rua Amélia Louzada nº 270, térreo, reuniram-se de acordo com a resolução nº 10 de 24 de agosto de 2023, o Presidente e os membros do Comitê de Investimentos desta Autarquia, Neilton Paixão de Jesus, matrícula. 939.347; Elaine de A. L. Ferreira, matrícula. 21.414; Oswaldo Luiz da Silva Mello, matrícula. 939.344, Gabriel Pimentel Sátyro, matrícula. 939.342 e André Luiz da Silva Miranda, matrícula. 34.656. **A PAUTA:** 1) Análise da Carteira de Investimentos; 2) Desenquadramento do Fundo DI do Itaú; 3) Informação das Aplicações e resgate dos Fundos no mês de setembro; 4) Reunião com o Banco do Brasil; 5) Elaboração da Política de Investimentos; 6) Definição do estudo ALM; 7) definição para reunião do Comitê de Investimentos, 8) As demandas do Comitê de Investimentos que devem ser apresentadas ao CMP. Oswaldo iniciou a reunião apresentando a 257ª ata do COPOM (Conselho de Política Monetária), na sequência pediu ao André para informar sobre a situação da carteira de Investimentos, André disse que até o fechamento de agosto a carteira de Investimentos tem performado positivamente, inclusive superando a meta atuarial. Após falou da situação do desenquadramento do Fundo Referenciado DI, primeiro pela rentabilidade ter sido positiva e segundo pelo fato do fundo que receber a maior parte das aplicações vindas da PMI devido o prazo para aplicação ser maior que os demais fundos ao longo do dia. Recebemos no dia 19/09/23, repasses do acordo de parcelamento nº 793, 802, 804 e 805/2018 parcela 63/200, no valor de R\$ 1.007.801,74 (Um milhão, sete mil, oitocentos e um reais e setenta e quatro centavos), no dia 18/09/23 foi recebido repasses de compensação previdenciária (Comprev) de competência de julho/23; No dia 20/09/23, houve resgate do Fundo DI do banco Itaú, conta 58.838-3 da Taxa administrativa, no valor de R\$ 20.000,00 (vinte mil reais) para complemento de pagamento de compensação de Comprev ref. Agosto/23 e serviços de Dataprev ref. Julho/23; Em 26/09/23, houve resgate do Fundo Referenciado DI do Itaú, para a conta corrente do plano previdenciária do mesmo banco e transferido para conta corrente e aplicação do banco Itaú referente a 3ª parcela do percentual da taxa administrativa; Oswaldo comentou sobre a reunião com o banco do Brasil no dia 18/09/23, relatou que além da apresentação de Fundo de Ações Small Caps como sugestão de investimentos para o Instituto, destacou a apresentação do cenário econômico interno e externo expondo a visão do banco para os próximos meses; Até o final do mês de dezembro o Comitê de Investimentos deve apresentar a Política de Investimentos para o ano de 2024, o Diretor Atuário Gabriel, disse ao Presidente que já dispõe do cálculo do Duration do passivo e da taxa de juros para a composição, faltando falar com o Ronaldo, economista da Mais Valia Consultoria para alinhar as projeções junto ao estudo da ALM realizado e formalizar a Política de Investimentos; Quanto a finalização do estudo da ALM, André comentou que o estudo foi apresentado, mas precisa fazer uns pequenos ajustes no texto para dar como concluído; Elaine

sugere e o presidente Neilton ratifica a necessidade de estabelecer uma data específica para as reuniões do Comitê de Investimentos, mas entende que poderá ter flexibilidade de alteração de data em ocasiões pontuais, Elaine pontua que como previsão legal, deve-se dar ciência ao CMP das decisões tomadas em Atas pelo Comitê de Investimentos. **DECISÃO:** Fica deliberado pelo Comitê de Investimentos: 1) Por unanimidade, estabelece que mensalmente, antes do fechamento do mês, faça a realocação do montante do fundo, para diversificação na carteira de forma que mantenha o enquadramento do fundo Referenciado DI; 2) Apesar da sugestão de Investimento em Fundo de ações Small Caps como opção de rentabilidade, os membros do Comitê decidem por unanimidade por não fazer esse tipo de investimentos no momento; 3) Fica estabelecido marcar uma reunião, à definir, com a equipe da Mais Valia Consultoria de Investimentos para, em conjunto, elaborar a Política de Investimentos; 4) Quanto ao estudo da ALM, Gabriel se comprometeu de cobrar a finalização do texto à Mais Valia para utilizar como base para a Política de Investimentos a ser elaborada; 5) Fica estabelecido por unanimidade que as reuniões do Comitê de Investimentos serão realizadas às segundas-feiras às 16:00 h. salvo as exceções; 6) O Presidente Neilton concluiu ao estabelecer que, até o final de fevereiro de 2024 todos os membros do Comitê de Investimentos apresentem a nova Certificação RPPS; 7)) Fica estabelecido por unanimidade a apresentação das Atas do Comitê de Investimentos ao CMP para ciência. Nada mais havendo a tratar, foi lavrada a presente ATA, redigida por Elaine de A. L. Ferreira e assinada pelos componentes deste Comitê de Investimentos. Finalizada a plenária às dezoito horas e vinte e sete minutos do vigésimo sétimo dia do mês de setembro de 2023.



ELAINE DE A. L. FERREIRA
MEMBRO



OSWALDO DA SILVA MELLO
MEMBRO



ANDRÉ LUIZ DA SILVA MIRANDA
MEMBRO



GABRIEL PIMENTEL SÁTYRO
MEMBRO



NEILTON PAIXÃO DE JESUS
PRESIDENTE

aplicação ser maior que os demais fundos ao longo do dia. Recebemos no dia 19/09/23, repasses do acordo de parcelamento nº 793, 802, 804 e 805/2018 parcela 63/200, no valor de R\$ 1.007.801,74 (Um milhão, sete mil, oitocentos e um reais e setenta e quatro centavos), no dia 18/09/23 foi recebido repasses de compensação previdenciária (Comprev) de competência de julho/23; No dia 20/09/23, houve resgate do Fundo DI do banco Itaú, conta 58.838-3 da Taxa administrativa, no valor de R\$ 20.000,00 (vinte mil reais) para complemento de pagamento de compensação de Comprev ref. Agosto/23 e serviços de Dataprev ref. Julho/23; Em 26/09/23, houve resgate do Fundo Referenciado DI do Itaú, para a conta corrente do plano previdenciária do mesmo banco e transferido para conta corrente e aplicação do banco Itaú referente a 3ª parcela do percentual da taxa administrativa; Oswaldo comentou sobre a reunião com o banco do Brasil no dia 18/09/23, relatou que além da apresentação de Fundo de Ações Small Caps como sugestão de investimentos para o Instituto, destacou a apresentação do cenário econômico interno e externo expondo a visão do banco para os próximos meses; Até o final do mês de dezembro o Comitê de Investimentos deve apresentar a Política de Investimentos para o ano de 2024, o Diretor Atuário Gabriel, disse ao Presidente que já dispõe do cálculo do Duration do passivo e da taxa de juros para a composição, faltando falar com o Ronaldo, economista da Mais Valia Consultoria para alinhar as projeções junto ao estudo da ALM realizado e formalizar a Política de Investimentos; Quanto a finalização do estudo da ALM, André comentou que o estudo foi apresentado, mas precisa fazer uns pequenos ajustes no texto para dar como concluído, Elaine sugere e o presidente Neilton ratifica a necessidade de estabelecer uma data específica para as reuniões do Comitê de Investimentos, mas entende que poderá ter flexibilidade de alteração de data em ocasiões pontuais, Elaine pontua que como previsão legal, deve-se dar ciência ao CMP das decisões tomadas em Atas pelo Comitê de Investimentos. **DECISÃO:** Fica deliberado pelo Comitê de Investimentos: 1) Por unanimidade, estabelece que mensalmente, antes do fechamento do mês, faça a realocação do montante do fundo, para diversificação na carteira de forma que mantenha o enquadramento do fundo Referenciado DI; 2) Apesar da sugestão de Investimento em Fundo de ações Small Caps como opção de rentabilidade, os membros do Comitê decidem por unanimidade por não fazer esse tipo de investimentos no momento; 3) Fica estabelecido marcar uma reunião, à definir, com a equipe da Mais Valia Consultoria de Investimentos para, em conjunto, elaborar a Política de Investimentos; 4) Quanto ao estudo da ALM, Gabriel se comprometeu de cobrar a finalização do texto à Mais Valia para utilizar como base para a Política de Investimentos a ser elaborada; 5) Fica estabelecido por unanimidade que as reuniões do Comitê de Investimentos serão realizadas às segundas-feiras às 16:00 h. salvo as

exceções; 6) O Presidente Neilton concluiu ao estabelecer que, até o final de fevereiro de 2024 todos os membros do Comitê de Investimentos apresentem a nova Certificação RPPS; 7)) Fica estabelecido por unanimidade a apresentação das Atas do Comitê de Investimentos ao CMP para ciência. Nada mais havendo a tratar, foi lavrada a presente ATA, redigida por Elaine de A. L. Ferreira e assinada pelos componentes deste Comitê de Investimentos. Finalizada a plenária às dezoito horas e vinte e sete minutos do vigésimo sétimo dia do mês de setembro de 2023.

(a) Elaine de A. L. Ferreira

Membro

(a) André Luiz da Silva Miranda

Membro

(a) Oswaldo da Silva Mello

Membro

(a) Gabriel Pimentel Sátyro

Membro

(a) Neilton Paixão de Jesus

Presidente

COMITÊ DE INVESTIMENTOS ATA N.º 262/2023

No quarto dia do mês de outubro de 2023, às dezessete horas e dez minutos, na sede do ITAPREVI, situada na Rua Amélia Louzada nº 270, térreo, reuniram-se de acordo com a resolução nº 10 de 24 de agosto de 2023, o Presidente e os membros do Comitê de Investimentos desta Autarquia, Neilton Paixão de Jesus, matrícula. 939.347; André Luiz da Silva Miranda, matrícula. 34.656; Oswaldo Luiz da Silva Mello, matrícula. 939.344, Gabriel Pimentel Sátyro, matrícula. 939.342 e Elaine de A. L. Ferreira, matrícula. 21.414. **PAUTA:** 1) Mudança no formato de recebimento das Atas; 2) Análise da carteira de investimentos do Itaprevi; 3) Estabelecer registro nas atas dos repasses, aportes e acordos, além das aplicações e resgates para realocações e novos investimentos da carteira do Itaprevi; 4) Confirmação de Reunião com a Mais Valia Consultoria de Investimentos. O Presidente Neilton deu aberta a reunião e registrou que a reunião está acontecendo na quarta feira de forma extraordinária devido a impossibilidade de ser na segunda-feira dia 02/10. André indaga ao comitê sobre possibilidade de a cada duas atas publicadas em diário Oficial os membros do comitê poderem ser remunerados, conforme dita a lei municipal 2.499 no Art. 12 § 21 III - *Os integrantes do Comitê de Investimento deverão ter sido aprovados em exame de certificação organizado, por entidade autônoma, de reconhecida capacidade técnica e difusão no mercado brasileiro de capitais e perceberão 60 UFIR-ITA por reunião, limitada à 1 (uma) reunião semanal.* Em seguida foram apresentados pelo André a carteira de investimentos do Itaprevi, e a análise para melhor desempenho. Ele lembrou que precisamos realocar valores do Fundo Itaú Referenciado DI para manter-se enquadrado conforme a Resolução nº 4.963/2022. Elaine comentou que é muito importante os registros em ata dos repasses previdenciários: Patronal, Servidor e Aporte para cobertura do déficit do passivo da

comitê de investimentos com a participação do senhor Francisco Iran, que cuida da carteira de investimentos do Banco do Brasil, para análise do cenário econômico no exterior e mercado interno e apresentação de alguns fundos de investimentos em renda variável. **DECISÃO:** O Comitê de Investimentos deliberou por unanimidade em fazer uma análise da carteira de investimentos para realocação dos ativos; deliberou por agendar para na semana seguinte uma reunião com o Gerente do Banco do Brasil, senhor Carlos Gomes e o Senhor Francisco Iran, responsável pela carteira de investimentos do Banco do Brasil, para tratar de cenário econômico. Nada mais havendo a tratar, foi lavrada a presente ata, redigida por mim, André Luiz da Silva Miranda e assinada pelos membros do Comitê de Investimentos. Finalizada a reunião às dezesseis horas e quarenta cinco minutos do quarto dia do mês de setembro do ano de dois mil e vinte e três.

(a) Elaine de A. L. Ferreira
Membro

(a) André Luiz da Silva Miranda
Membro

(a) Oswaldo da Silva Mello
Membro

(a) Gabriel Pimentel Sátyro
Membro

(a) Neilton Paixão de Jesus
Presidente

COMITÊ DE INVESTIMENTOS ATA N.º 261/2023

No vigésimo sétimo dia do mês de setembro de 2023, às dezesseis horas e doze minutos, na sede do ITAPREVI, situada na Rua Amélia Louzada nº 270, térreo, reuniram-se de acordo com a resolução nº 10 de 24 de agosto de 2023, o Presidente e os membros do Comitê de Investimentos desta Autarquia, Neilton Paixão de Jesus, matrícula. 939.347; Elaine de A. L. Ferreira, matrícula. 21.414; Oswaldo Luiz da Silva Mello, matrícula. 939.344; Gabriel Pimentel Sátyro, matrícula. 939.342 e André Luiz da Silva Miranda, matrícula. 34.656. **A PAUTA:** 1) Análise da Carteira de Investimentos; 2) Desempenhamento do Fundo DI do Itau; 3) Informação das Aplicações e resgate dos Fundos no mês de setembro; 4) Reunião com o Banco do Brasil; 5) Elaboração da Política de Investimentos; 6) Definição do estudo ALM; 7) definição para reunião do Comitê de Investimentos; 8) As demandas do Comitê de Investimentos que devem ser apresentadas ao CMP. Os- waldo iniciou a reunião apresentando a 257ª ata do CO- POM (Conselho de Política Monetária), na sequência pe- diu ao André para informar sobre a situação da carteira de investimentos, André disse que até o fechamento de agosto a carteira de investimentos tem performado po- sitivamente, inclusive superando a meta atuarial. Após falou da situação do desempenho do Fundo Re- ferenciado DI, primeiro pela rentabilidade ter sido posi- tiva e segundo pelo fato do fundo que receber a maior parte das aplicações vindas da PMI devido o prazo para

803/23	805/23	806/23	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX
XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX
XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX
XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX

ADVERTÊNCIA POR ESCRITO

ENCERRAMENTO:
Nada mais tendo a tratar, determinou a Senhora Presi- dente o encerramento da presente Sessão às 20:00h do que consta, lavrou-se a Ata, que vai assinada por todos os Membros da Comissão.
(a) Leila Araújo dos Santos
Presidente
(a) Jose Glauber Robson Martins Rodrigues
Membro Titular
(a) Monica Santiago Cicarino
Membro Titular

ATOS DO ITAPREVI

COMITÊ DE INVESTIMENTOS ATA N.º 260/2023

PAUTA: Apresentação da nova composição do comitê de investimentos e apresentação da carteira de inves- timentos.
No quinto dia do mês de junho do ano de dois mil e vinte e três, às onze horas e nove minutos, na sede do ITAPREVI, situada na Rua Amélia Louzada nº 270, térreo, de acordo com a resolução nº 109/2023 de 24 de agosto de 2023, reuniram-se o Presidente e os membros do Co- mitê de Investimentos desta Autarquia, Carlos Aurélio da Costa Lopes, matr. 939.345; Elaine de A. L. Ferrei- ra, matr. 21.414 Oswaldo Luiz da Silva Mello, matrícula. 939.344, Gabriel Pimentel Sátyro, matrícula. 939.342e André Luiz da Silva Miranda, matr. 34.656. **A pauta:** apresentação da nova composição do comitê de inves- timentos e uma análise da carteira de investimentos o servidor André apresentou a nova composição do comi- tê de investimentos que passa a compor com Oswaldo Mello e Gabriel Sátyro. E, em seguida informou que o senhor Gabriel participa da reunião por via vídeo cha- mada e a servidora Elaine não pôde participar por mo- tivo particulares. Após as apresentações, foi dado o iní- cio da reunião no tema proposto. André inicia a reunião apresentando a composição da carteira de investimen- tos do Itaprevi que atualmente está composta de apro- ximadamente 96,40% de seus investimentos em renda fixa, 3,60% em renda variável, considerando o cenário econômico em que a meta atuarial é batida cada mês, com base no mês anterior. Outro ponto apresentado pelo membro André e discutido na plenária do comitê foi o resultado do estudo ALM realizado pela empresa de consultoria mais valia. Este estudo tem a finalidade de de otimizar a carteira de investimentos. Na ocasião foi apresentado três cenários no qual o índice da meta atuarial aceitável pelo tempo de duração da carteira. E por fim, foi ilustrado que o Gerente do Banco do Bra- sil, senhor Carlos Gomes, solicitou uma reunião com o