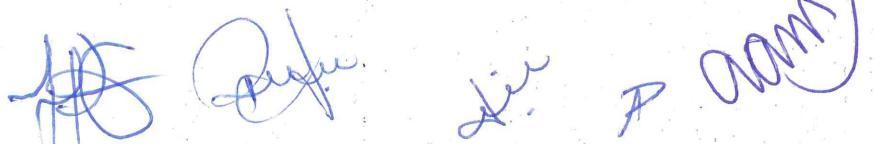


ATA DA 2ª REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS  
DO IPREVI – 27/11/2020.

Aos vinte e sete dias do mês de novembro de dois mil e vinte às 10:00 (dez) horas, deu-se início a 2ª (segunda) Reunião Extraordinária deste Comitê de Investimentos, na Sala de Reuniões do Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Itatiaia – IPREVI, localizado a Avenida dos Expedicionários, nº 301, Centro, Itatiaia-RJ, convocados através da Carta/COMINIPREVI/013/2020. Neste ato estiveram presentes os seguintes servidores: Alessandra Arantes Marques, Ana Paula Pires Alves, Isaltina Cássia da Silva Alvim Dias, Ives Pereira Tavares e Rosângela de Jesus Silva Oliveira. A reunião apresentou como pauta os seguintes assuntos: a) Apresentação do Relatório Mensal de Investimentos – Mês: Outubro/2020; b) Apresentação do Demonstrativo dos recursos aplicados pelo IPREVI – Competência: Outubro/2020; c) Análise dos Fundos de Investimentos para Credenciamento; d) Aprovação de APR para o mês de Dezembro de 2020; e) Aprovação do Relatório de Gestão Atuarial; f) Alterações no Manual de Credenciamento de Instituições Financeiras; g) Apresentação do Relatório de Diligência e Acompanhamento Sistemático; h) Apresentação do Estudo de Solvência e de Gestão de Ativos e Passivos (ALM); i) Aprovação do Plano de Ação Anual; j) Apresentação do Relatório de Ouvidoria. A Diretora Presidente, Alessandra Arantes Marques, iniciou a reunião agradecendo a presença de todos e a colaboração dos membros do colegiado no trabalho desenvolvido dentro da Autarquia, momento esse em que apresentou para os membros o Prêmio recebido pela Instituição pela ocasião de sua participação no 11º Prêmio de Boas Práticas de Gestão Previdenciária da ANEPREM. Em seguida, agradeceu a presença dos consultores da Crédito & Mercado, Sr. Thiago Norte Natario e Sra. Samanta Zanquelli, que por meio de chamada de vídeo, procederiam a apresentação do Estudo ALM, bem como do Relatório de Diligência do mês de outubro de 2020. Dessa maneira, passou a palavra aos consultores para que procedessem com a apresentação dos temas que foram aprovados aos presentes. Após a apresentação dos relatórios e aprovação pelos membros, a Diretora Presidente discursou sobre o cenário econômico

A

atual de acordo com o relatório "Nossa Visão" acerca dos acontecimentos no cenário internacional e nacional e seu impacto no mercado financeiro. Em seguida, foi entregue a todos o Demonstrativo dos Recursos aplicados pelo IPREVI, competência – Outubro/2020, apresentando um valor global de R\$ 139.845.805,15 (cento e trinta e nove milhões, oitocentos e quarenta e cinco mil, oitocentos e cinco reais e quinze centavos), evidenciando rentabilidade negativa de R\$ 960.438,40 (novecentos e sessenta mil, quatrocentos e trinta e oito reais e quarenta centavos) no mês e um retorno acumulado de rentabilidade negativa de R\$ 2.635.591,87 (dois milhões, seiscentos e trinta e cinco mil, quinhentos e noventa e um reais e oitenta e sete centavos) desde mês de janeiro. Foi apresentado o Relatório Mensal da Empresa Crédito e Mercado Consultoria em Investimentos, mês de Outubro, demonstrando que no fechamento de Outubro a rentabilidade da carteira do Instituto foi de -0,68% (menos zero vírgula sessenta e oito por cento) frente uma Meta Atuarial para o mesmo período de 1,34% (um vírgula trinta e quatro por cento), representando assim um atingimento acumulado de 7,18% (sete vírgula dezoito por cento) da Meta Atuarial. Ao expor as movimentações financeiras, foi demonstrado que na categoria de renda fixa, quanto aos fundos de curto prazo, a recomendação da consultoria foi de 5% (cinco por cento) e foram alocados 4,91% (quatro vírgula noventa e um por cento). Em relação aos fundos de médio prazo, a recomendação era de 20% (vinte por cento) e foram alocados 25,75% (vinte e cinco vírgula setenta e cinco por cento). Já nos fundos de longo prazo, o montante alocado representou 14,02% (quatorze vírgula zero dois por cento) face uma recomendação de 15% (quinze por cento). Já quanto à gestão duration, a recomendação era de 25% (vinte e cinco por cento) e foram alocados 26,20% (vinte e seis vírgula vinte por cento). Dos vinte e dois fundos que compõem a carteira de renda fixa, todos os de curto prazo apresentaram rentabilidade positiva, enquanto que os fundos com rentabilidade negativa ficaram distribuídos da seguinte maneira: dois em médio prazo, três em longo prazo e dois em gestão duration. Assim, no tocante à renda fixa, no geral, a rentabilidade foi de R\$ 56.500,76 (cinquenta e seis mil, quinhentos reais e setenta e seis centavos). Em renda variável, os fundos de ação livres tinham a recomendação de 15% (quinze por cento) e foram alocados 19,47% (dezenove vírgula quarenta e sete por cento) da carteira. Nos fundos de multimercado, a





recomendação era de 10% (dez por cento) e foram consolidados 7,56% (sete vírgula cinquenta e seis por cento). No tocante ao fundo imobiliário, o índice proposto era de 5% (cinco por cento) e o consolidado foi de 2,08% (dois vírgula zero oito por cento), dentre os dezessete fundos de renda variável, apenas seis apresentaram rentabilidade positiva, totalizando uma rentabilidade negativa de R\$ 1.018.506,10 (um milhão, dezoito mil, quinhentos e seis reais e dez centavos). No tocante aos fundos de curto prazo da Taxa de Administração, todos apresentaram rentabilidade positiva menor de um por cento, totalizando R\$ 5.118,24 (cinco mil, cento e dezoito reais e vinte e quatro centavos). Quanto aos recursos financeiros, 70,52% (setenta vírgula cinquenta e dois por cento) se encontram alocados em fundos de renda fixa, 28,97% (vinte e oito vírgula noventa e sete por cento) em fundos de renda variável e 0,51% (zero vírgula cinquenta e sete por cento) em DAV, totalizando R\$ 143.772.969,38 (cento e quarenta e três milhões, setecentos e setenta e dois mil, novecentos e sessenta e nove reais e trinta e oito centavos). Dentre as instituições financeiras, os recursos se encontram principalmente na Caixa Econômica Federal, 41,44% (quarenta e um vírgula quarenta e quatro por cento), Banco do Brasil, 18,09% (dezoito vírgula zero nove por cento), e Banco Itaú, 13,50% (treze vírgula cinquenta por cento). Dando prosseguimento, foram apresentadas as realocações sugeridas pela consultoria de investimentos Crédito e Mercado, visando à adequação da Carteira do IPREVI, objetivando o reenquadramento da mesma e melhor posição dessa, por meio do resgate de R\$ 5.000.000,00 (cinco milhões de reais) dos fundos IMA-B, direcionando-os para fundos de gestão duration. Dessa maneira, os membros presentes analisaram a performance dos fundos para decisão da nova realocação. O fundo escolhido para resgate foi o Caixa FI Brasil IMA-B TP RF LP, tal decisão se deu pelo fato do mesmo ter apresentado uma performance de -0,81% (menos zero vírgula oitenta e um por cento) no ano e -1,41% (menos um vírgula quarenta e um por cento) em doze meses. Nesse sentido, decidiu-se que o valor a ser resgatado será aportado no Caixa Brasil Gestão Estratégica FI, decisão essa que se deu pelo fato de ter apresentado resultado de 4,51% (quatro vírgula cinquenta e um por cento) nos períodos de um ano e nos últimos doze meses, respectivamente. Após, foram apresentadas as instituições e fundos para credenciamento, foram analisados e aprovados os



seguintes credenciamentos: INDIGO DTVM e MACROINVEST GESTÃO DE RECURSOS LTDA. Quanto a esses últimos, o credenciamento das instituições foi aprovado com ressalvas, tendo em vista o fato de não terem apresentado a documentação completa em conformidade, havendo por parte da Autarquia as devidas notificações, mas prosseguindo-se com o credenciamento devido a necessidade de manutenção da regularidade das aplicações do fundo administrado pelas entidades. Dando prosseguimento, houve a aprovação das APR's para o mês de novembro e, assim, do cronograma mensal de planejamento da gestão dos recursos da instituição. Em seguida, a Diretora Presidente apresentou o Plano de Ação Anual de 2020, momento em que resumizou o andamento das ações que foram planejadas e o que de fato já vinha sendo alcançado pela Instituição, tendo sido integralmente aprovado pelos presentes. A pauta posterior foi a do relatório de ouvidoria, no qual a Diretora fez a explanação dos três meios de contato externo para recebimento de indagações e sugestões a Autarquia, bem como da existência de chamados. Logo após, foram discutidas as alterações propostas ao Manual de Credenciamento, a Diretora Presidente explicou que as mesmas foram sugeridas pelos executores do processo, em vista da percepção dos mesmos ao aplicar o conteúdo a prática, que existiam procedimentos que poderiam ser otimizados. Após sua fala e exposição, as mudanças foram aceitas e a edição número dois aprovada. A Diretora Presidente apresentou ainda o novo relatório de Gestão Atuarial com os dados da Avaliação Atuarial de 2020 – data base 2019 –, o relatório, exigido pelo Pró-Gestão, ganhou uma nova versão devido que os trâmites do DRAA referente a Avaliação Atuarial começaram a ser formalizados pelo atuário da Instituição. Ocorrendo a aprovação desse último, todos os membros titulares do Comitê de Investimentos manifestaram-se favoravelmente pela conformidade com ressalva do parecer da 2ª Reunião Extraordinária. Nada mais havendo a ser tratado no dia, a Sra. Alessandra Arantes Marques deu por encerrada a reunião.

Alessandra Arantes  
Marques, Ana Paula Pinheiro Alves, Isabella Cassia da  
Silva Abreu Alves, Rosângela de Jesus  
Silva Oliveira, João Henrique Tavares