

ATA Nº. 008/2023

ATA DA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITAQUIRAÍ EM DEZOITO DE DEZEMBRO DE 2023.

Aos dezoito dias do mês de dezembro do ano de 2023, as 08:00h, na sala de reuniões do Instituto de Previdência Social dos Servidores Municipais de Itaquiraí/MS – ITAQUI-PREV, nesta cidade de Itaquiraí, Estado de Mato Grosso do Sul, foi realizada a reunião ordinária tendo como objetivo discutir e decidir sobre a seguinte pauta: **1. Análise da Documentação de Renovação do Credenciamento de Instituições Financeiras (RJI Corretora de Títulos e Valores Mobiliários LTDA); 2. Definir alocação de recursos previdenciários repassados relativo ao mês de novembro/2023 e os recursos recebidos em dezembro/2023 do RGPS/INSS referente à Compensação Previdenciária.** Estavam presentes os seguintes membros do Comitê de Investimentos: Andrei Marcelo Faria, Áurio Luiz Costa, Marcos Daniel Echeverria e Fábía Messias de Oliveira. Iniciada a reunião foi apresentada a documentação para o Credenciamento de Instituições Financeiras encaminhadas ao ITAQUI-PREV até o momento, após análise, o Comitê de Investimentos, por votação unânime, sugere ao Conselho Curador Aprovação do Credenciamento da **RJI Corretora de Títulos e Valores Mobiliários LTDA**, CNPJ: **42.066.258/0001-30**, como administradora de recursos, podendo administrar os recursos a serem aplicados até o limite da **Resolução BC CMN nº 4.963/2021**, e a **Portaria MTP nº 1467/2022**, e alterações posteriores, bem como todos os Fundos analisados compatíveis com o Perfil da Carteira do ITAQUI-PREV e aderentes a Política de Investimentos. Logo em seguida o Diretor Financeiro demonstrou os resultados dos retornos de Investimentos obtidos no mês de **novembro/2023**, com a Carteira do ITAQUI-PREV obtendo **3,38%** de retorno, frente à Meta Atuarial de **0,51%** no mês de novembro/2023, e no acumulado de 2023 com **1,05%** de retorno da Carteira do ITAQUI-PREV, frente a uma Meta Atuarial acumulada de **7,91%**, até o mês de novembro/2023, gerando um gap de atingimento de **-6,86%** da Meta Atuarial no acumulado de 2023, o que representou no mês de **novembro/2023** uma rentabilidade de **R\$ 1.837.951,95** (um milhão oitocentos e trinta e sete mil novecentos e cinquenta e um reais e noventa e cinco centavos), e no acumulado de 2023 o valor total de **R\$ 581.992,01** (quinhentos e oitenta e um mil novecentos e noventa e dois reais e um centavo), com os Fundos da **Carteira Previdenciária** totalizando o montante de **R\$ 54.650.311,05** (cinquenta e quatro milhões, seiscentos e cinquenta mil, trezentos e onze reais e cinco centavos). Os Fundos da Carteira Administrativa, vinculados a C/C: **15.636-1**, o valor de **R\$ 1.618.671,24** (um milhão seiscentos e dezoito mil, seiscentos e setenta e um reais e vinte e quatro centavos) de saldo no Fundo **IRF-M 1** (Taxa de Reserva Administrativa acumulada), e no Fundo **BB RF FLUXO** o valor de **R\$ 54.313,47** (cinquenta e quatro mil, trezentos e treze reais e quarenta e sete centavos), de saldo da Taxa Anual para Despesas Administrativas mensais em 2023, com o Saldo Financeiro total de **R\$ 56.337.137,35** (cinquenta e seis milhões, trezentos e trinta e sete mil, cento e trinta e sete reais e trinta e cinco centavos). Dando continuidade na reunião o Diretor Financeiro apresentou os fatos ocorridos com

Marcos


os Fundos da VANQUISH no mês de **novembro/2023**. A rentabilidade da Carteira foi impactada novamente pela desvalorização dos Fundos da VANQUISH. O Fundo Vanquish Coral FIRF LP sofreu desvalorização, obtendo retorno de -0,5358% no montante de R\$ -1.529,29 (um mil quinhentos e vinte e nove reais e vinte e nove centavos), já o Fundo Vanquish Forte Alocação Dinâmica FIRF LP sofreu desvalorização no importe de -1,7097%, no total de R\$ -3.077,22 (três mil setenta e sete reais e vinte e dois centavos) fechando os mês de novembro/2023 com os 02 (dois) fundos somando o montante total de R\$ -4.606,51 (quatro mil seiscientos e seis reais e cinquenta e um centavos) de desvalorização. O Sr. Marcos questionou sobre a judicialização do caso, o Diretor Financeiro Sr. Andrei, respondeu que o plano inicial proposto para devolução dos recursos e aprovado em Assembleia Geral dos Cotistas e a reprecificação das cotas dos referidos fundos é 12/02/2024, e que por força de uma cláusula de confidencialidade constante no Contrato com a Contraparte, caso o pagamento não ocorra na data acordada, será divulgado o nome da Contraparte devedora da operação BOX PU de IDI'S Flexíveis que gerou o Default no dia 17/05/2023, e com isso, após identificação ocorrerá a judicialização. Na pauta seguinte os membros do Comitê debateram sobre os recursos previdenciários repassados, relativos ao mês de **novembro/2023** e os recursos recebidos em **dezembro/2023** do **RGPS/INSS** referente à **Compensação Previdenciária**. Conforme sugestão de alocação enviada por e-mail pela LEMA – Consultoria em Investimentos. Nas últimas semanas, temos observado um fechamento significativo das curvas de juros, particularmente influenciado por uma melhor definição no cenário externo, onde se espera que o Banco Central norte-americano inicie cortes nas taxas de juros no próximo ano. Simultaneamente, a melhoria na definição do cenário fiscal interno contribuiu para a modificação das expectativas dos investidores. A Sra. Fábiana, questionou sobre a performance do Fundo sugerido pela LEMA para receber o aporte dos repasses previdenciários, O FI BB IMA-B TP RF, o Diretor Financeiro respondeu que se trata de um Fundo de Renda Fixa de longo prazo, atrelado à inflação, e que faz parte da estratégia de alongamento da Carteira conforme mencionado na Sugestão de Alocação da LEMA, com retorno acumulado obtido até o mês de novembro/2023 de 12,80%, frente a Meta Atuarial de 7,91%, portanto o Fundo está com bom desempenho e batendo a Meta Atuarial com um gap de cerca de 161,82%. Após análise e discussão, ficou decidida por unanimidade dos votos, a continuidade da estratégia de alongamento da carteira, especialmente em relação aos investimentos atrelados à inflação de prazo mais longo (IMA-B e IMA-B 5+), na alocação desses recursos em fundos já presentes na carteira, cujo benchmark seja o IMA-B, aportar o repasse no valor total aproximado de **R\$ 400.000,00 (quatrocentos mil reais)**, no Fundo do segmento de Renda Fixa de longo prazo, **BB IMA-B TP FI RF – CNPJ: 07.442.078/0001-05 - art. 7º, Inciso I, Alínea "b"**. Desta forma o Comitê de Investimentos sugere ao Conselho Curador que delibere sobre a aprovação da Renovação do Credenciamento da **RJI Corretora de Títulos e Valores Mobiliários LTDA, CNPJ: 42.066.258/0001-30**, como administradora de recursos, bem como da aplicação dos recursos previdenciários repassados no Fundo acima sugerido. Nada mais havendo para tratar foi encerrada a reunião, tendo eu, Andrei Marcelo Faria, lavrado a presente ata, que depois de lida e achada conforme, fica assinada por todos os presentes.

Marcos

Comitê de Investimentos:



Andrei Marcelo Faria



Aurio Luiz Costa



Fabia Messias de Oliveira



Marcos Daniel Echeverria