

Ato oficial Ata Comitê de Investimentos - 005/2024

De: Jorge Z. - COMINV

Para: COMINV - Comitê de Investimento

Data: 15/03/2024 às 13:25:48

Setores (CC):

COMINV

Setores envolvidos:

COMINV

Reunião

Aos quatorze dias do mês de março do ano de dois mil e vinte e quatro, às nove horas, reuniram-se na sede do FUNPREVMMAR, os membros titulares do Comitê de Investimentos, Roseli Bauer, Jorge Lopes Zaatreh, Evandro Marciel Alves Bezerra, Eduardo Luiz Castrioto de Jesus e Alander Matheus Taube de Lima. Passou-se a pauta da reunião: **1- Realocações na carteira e análise de fundos de investimentos; 2- Empréstimos Consignados. Ítem 1** – Iniciada a reunião pelo Sr Jorge Zaatreh, foi colocado em discussão a análise técnica solicitada para consultoria de investimentos, decidida em reuniões anteriores. Os resultados da análise foram apresentados via plataforma SIRU, contendo a análise técnica dos seguintes fundos no segmento de renda fixa: CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP CNPJ 14.508.605/0001-00; CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP CNPJ 45.163.710/0001-70; no segmento de renda variável: AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES CNPJ 37.569.846/0001-57. Foram apresentados para análise as características e fundamentos dos fundos tais como: objetivo, política de investimentos, características gerais e taxas, rentabilidade do fundo e do benchmark, riscos, enquadramentos, avaliação dos fundos dentro do contexto da carteira do instituto e conclusão da consultoria de investimentos sobre eventual aporte. Após a leitura do relatório de análise da consultoria de investimentos e ponderações dos membros, visando melhor análise dos documentos dos fundos e demais informações ficou decidido providenciar o prévio credenciamento dos fundos acima descritos para análise em reunião posterior e decisão de realocações na carteira de investimentos. Foi proposto pelo membro Sr Alander a análise dos índices de renda fixa dos fundos apresentados. Foi frisado pelo Sr Jorge que para aporte nos fundos, os prestadores de serviços dos mesmos, devem estar credenciados junto ao instituto, conforme legislação vigente. Ainda na análise da carteira de investimentos foi discutido o desempenho dos fundos de renda variável, que vem sendo monitorado pelo comitê de investimentos, onde se observou um descompasso de rentabilidade em várias janelas de tempo do fundo Itaú Momento 30 II Fic Ações e seu benchmark, sendo pertinente acompanhamento de riscos e estratégias de investimento do fundo, buscando compreender as perspectivas futuras do mesmo. Quanto ao fundo Az Quest Ações Fic Ações, em reunião com o Sr José França, da Privatiza Investimentos, em 28/02/2024, foi proposto a realocação dos valores investidos no fundo Az Quest Ações Fic Ações – CNPJ 07.279.657/0001-89 para o fundo Az Quest Bayes Sistemático Ações Fic Ações CNPJ 37.569.846/0001-57, uma vez que o fundo vem apresentando melhor desempenho em várias janelas de tempo analisadas, conforme dados apresentados pelo Sr José França, da Privatiza Investimentos, e que pode melhorar o desempenho da carteira no segmento de renda variável. Dessa forma ficou

decidido pelos membros do comitê a análise dos documentos do fundo para uma possível realocação. Foi repassado aos membros do comitê todas as análises da consultoria sobre os fundos para pontuações nas próximas reuniões. **Item 2** – Logo após seguiu-se para segunda pauta do dia com a discussão sobre concessão de empréstimos consignados. Foi salientado aos membros que o instituto vem sendo demandado para concessão de crédito consignado na carteira de investimentos. Dessa forma buscou-se agendar reuniões com instituições que fornecem assessoria para análise e implantação dos empréstimos consignados. No dia 13/03/2024 foi realizada uma reunião “on line” com o Sr Luiz Claudio Kogut – da empresa Actuarial – Assessoria e Consultoria Atuarial Ltda – com a participação dos conselheiros e diretoria do instituto, para apresentação dos serviços da empresa na análise, implementação e operacionalização da carteira de empréstimos consignados, apresentando os critérios legais, condições de implementação e acompanhamento através de plataforma de gestão dos recursos e estudo de viabilidade, caso o instituto queira implantar a modalidade de investimentos. Na reunião foi possível esclarecer dúvidas dos conselheiros sobre o tema. Logo após os membros do comitê passaram a discutir sobre a implantação dessa modalidade de investimentos para o FUNPREVMAR. Foi salientado pelo Sr Jorge e pelos demais membros que empréstimo consignado é uma modalidade de investimentos disponível para os RPPS, com embasamento legal de sua implantação e operacionalização na Resolução CMN 4963/2021 e Portaria MTP 1467/2022, sendo um segmento de investimento, e que deve constar na Política de Investimentos do instituto de previdência, com aprovação do percentual do patrimônio líquido, de acordo com o porte do instituto e nível do programa Prógestão, aprovadas em todas as instâncias de deliberação do instituto antes de sua implementação. Deve-se atender a todos os critérios das normas legais vigentes quanto à este segmento para a carteira de investimentos do instituto, conforme previstos no Anexo VIII, Seção III, da portaria MTP 1467/2022 e demais alterações vigentes. Dessa forma este comitê de investimentos orienta que seja realizado estudo de viabilidade técnica, para análise dos impactos atuariais nas obrigações futuras do instituto, tendo em vista a manutenção do equilíbrio financeiro e atuarial, visando embasar a discussão de implementação de uma carteira de empréstimos consignados no FUNPREVMAR. Finalizado todos os conteúdos pautados e nada mais tendo a tratar, deu-se por encerrada a presente reunião. Eu, Jorge Lopes Zaatreh, lavrei a presente ata no sistema 1DOC, que vai assinada digitalmente por mim e por todos os membros presentes na reunião.