

ATA DA REUNIÃO DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO SEPREV
(INSTITUIDO PELO DECRETO Nº 2.180 DE 06 DE JANEIRO DE 2014 E
PORTARIA 153/2021 DE 06 DE JANEIRO DE 2021)

Aos doze dias do mês de junho do ano de dois mil e vinte e três, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos abaixo assinados, para reunião ordinária do mês. Presentes os membros abaixo assinados, juntamente com o presidente da Autarquia Sr. Elias Alves. Dando início a reunião, os membros do Comitê de Investimentos, de posse dos relatórios de aplicações, passaram a analisar as rentabilidades e enquadramento dos fundos de investimentos realizados pela diretoria executiva do SEPREV. Da análise foi verificado que os fundos se encontram regularmente enquadrados nos termos da Resolução CMN 3.922/10, alterada pela Resolução 4.604/17, alterada pela Resolução CMN 4.963/21. Quanto a rentabilidade observou-se que o retorno das aplicações no mês em análise, maio de 2023, foi positiva em R\$ 2.354.788,06 que equivale a 0,77% de rendimento, percentual que ficou acima da meta atuarial medida no mês que foi de 0,66%. O saldo da última aplicação era de R\$ 303.185.410,02 e houve novas aplicações no valor de R\$ 17.677.502,40 e resgates que monta o valor de R\$ 16.677.502,40, gerando um saldo final de R\$ 306.505.210,68. Os fundos de investimentos estão distribuídos de acordo com o estipulado na Política de Investimentos, estando posicionados da seguinte forma:

Carteira consolidada de investimentos - base (maio/ 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotis- tas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	18.723.249,25	6,11%	953	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	6.082.599,77	1,98%	1.127	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	562.715,58	0,18%	140	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	78.641.704,38	25,66%	370	2,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '

SERVIÇO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL SEPREV

C.N.P.J. 96.493.648/0001-16

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotis- tas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.502.331,05	2,12%	70	2,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	39.054.840,76	12,74%	301	1,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	10.185.480,10	3,32%	921	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	14.742.649,73	4,81%	934	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	24.866.745,13	8,11%	156	1,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	19.619.030,95	6,40%	1.116	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	28.068.799,16	9,16%	357	0,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	47.452.856,06	15,48%	1.003	0,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	446.055,17	0,15%	26	0,80%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	934.264,56	0,30%	31	1,42%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSE-TORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	1.128.748,02	0,37%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	9.276.449,63	3,03%	185	1,45%	Artigo 8º, Inciso I
PUMA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	216.691,38	0,07%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
Total para cálculo dos limites da Resolução			306.505.210,68				

Quanto ao Retorno dos investimentos e Benchmarks de ativos no mês de maio/2023, observa-se o seguinte:

RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	2,29%	7,61%	5,61%	9,62%	14,73%	15,00%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2,30%	7,41%	5,50%	9,30%	14,06%	13,90%	0,96%	0,04%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,29%	5,76%	2,60%	7,07%	8,74%	18,79%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,36%	5,50%	2,49%	6,80%	8,35%	18,22%	0,75%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	5,49%	2,47%	6,77%	8,61%	18,88%	0,68%	0,03%

IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,82%	5,84%	3,29%	7,13%	11,18%	32,92%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	- 0,30%	- 0,68%	- 0,83%	- 0,49%	0,30%	4,16%	-	-

IRF-M 1 (Benchmark)	1,14%	5,42%	3,26%	6,67%	13,53%	20,82%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	5,27%	3,18%	6,49%	13,21%	20,16%	0,09%	0,00%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	0,57%	5,93%	3,02%	6,92%	9,45%	19,90%	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	- 0,21%	- 5,35%	- 0,53%	- 5,23%	- 20,23%	- 27,97%	0,16%	0,14%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,53%	2,24%	1,31%	2,66%	3,80%	5,28%	0,07%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	5,91%	3,04%	6,89%	9,41%	19,60%	0,63%	0,02%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	- 0,01%	1,56%	1,78%	2,89%	1,43%	4,52%	0,51%	0,05%

CDI (Benchmark)	1,12%	5,37%	3,25%	6,55%	13,48%	22,43%	-	-
-----------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,18%	5,25%	3,28%	6,46%	13,49%	22,99%	0,03%	0,00%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,16%	5,34%	3,26%	6,57%	13,81%	23,57%	0,03%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,15%	5,29%	3,24%	6,47%	13,47%	22,81%	0,02%	0,00%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,18%	4,77%	3,20%	5,96%	13,02%	22,47%	0,03%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,23%	2,95%	1,56%	3,59%	3,94%	16,13%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	- 0,01%	4,58%	1,78%	5,96%	7,63%	-	0,51%	0,03%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	- 0,01%	4,57%	1,78%	5,94%	8,55%	20,30%	0,51%	0,03%

RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	3,74%	- 1,28%	3,24%	- 3,69%	-2,71%	- 14,17%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,20%	3,59%	6,51%	1,03%	-1,45%	-7,32%	8,54%	0,19%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,91%	6,24%	3,53%	7,62%	12,22%	35,41%	-	-
PUMA FIP MULTIESTRATÉGIA	- 0,11%	- 0,49%	- 0,30%	- 1,17%	-1,76%	-3,23%	-	-

Por fim, ratificou-se a determinação de que as novas aplicações no exercício de 2023, sejam realizadas somente nos bancos considerados “primeira linha”, quais sejam: Caixa Econômica Federal, Banco do Brasil, Bradesco e Itaú, sendo que os novos aportes deverão ser atrelados aos índices referenciados na família IMA, IRFM, IDKA e CDI poderão ser realizados a critério e análise da Diretoria Executiva do Seprev, devendo, no entanto, ser comunicado imediatamente o aporte na primeira reunião desse sodalício. Nada mais havendo a tratar deram por encerrada a reunião, tendo todos os seus termos lavrados na presente ata que após lida vai assinada por todos.



SERVIÇO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL SEPREV

C.N.P.J. 96.493.648/0001-16
