

SERVIÇO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL SEPREV

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

ATA DE REUNIÃO ORDINÁRIA DO CONSELHO ADMINISTRATIVO (MEMBROS EMPOSSADOS PELO DECRETO Nº 2.979/2020 DE 10 DE NOVEMBRO DE 2020)

Aos quinze dias do mês de novembro do ano de dois mil e vinte e dois, reuniram-se os membros do Conselho Administrativo do Seprev com a presença dos Conselheiros abaixo assinados a fim de realizar reunião ordinária. Dando início a reunião foram definidos como ponto de pauta o seguinte: Verificação de relatório de contas do conselho fiscal e análise dos investimentos enviados pelo comitê de investimentos. De início, verificou-se que a disponibilidade financeira em 31 de outubro de 2022 era de R\$ 283.245.151,40 (duzentos e oitenta e três milhões, duzentos e quarenta e cinco mil, cento e cinquenta e um reais e quarenta centavos) e que se encontram aplicados em fundos de investimentos permitidos pela Resolução do Conselho Monetário Nacional 3.922/10 e suas alterações, devidamente aprovados pelo Comitê de Investimentos. A receita arrecadada contabilizada no mês de outubro de 2022 foi de R\$ 2.942.622,82 (dois milhões, novecentos e quarenta e dois mil, seiscentos e vinte e dois reais e oitenta e dois centavos), para uma despesa no valor de R\$ 1.939.064,34 (um milhão, novecentos e trinta e nove mil, sessenta e quatro reais e trinta e quatro centavos). Os gastos com despesas administrativas no mês em análise foram de R\$ 156.016,75 (cento e cinquenta e seis mil, dezesseis centavos e setenta e cinco centavos), observado em planilha anexo ao balancete, cujo percentual equivale a 0,17% (zero virgula dezessete por cento) no mês e com percentual de 1,51% (um virgula dezessete por cento) acumulado no ano, cujo valor é de R\$ 1.420.310,10 (um milhão, quatrocentos e vinte mil, trezentos e dez reais e dez centavos) estando, portanto, dentro do limite de 3% estabelecidos por lei. Os processos contábeis encontram-se em ordem, com os documentos comprobatórios dos lançamentos realizados e de acordo com a conciliação bancária apresentada. A Folha de Pagamento do mês de outubro de 2022 apresenta os seguintes valores: Folha Ordinária: Servidores ativos da autarquia - R\$ 65.394,72 (setenta e cinco mil, trezentos e noventa e quatro reais e setenta e dois centavos) – Aposentados: R\$ 1.529.362,02 (um milhão, quinhentos e vinte e nove mil, trezentos e sessenta e dois reais e dois centavos) – Pensionistas: R\$ 253.377,77 (duzentos e cinquenta e três mil, trezentos e setenta e sete reais e setenta e sete centavos). Observou-se que houve contabilização no valor de R\$ 37.378,77 (trinta e sete mil, trezentos e setenta e oito reais e setenta e sete centavos) referente a pagamento de aporte para cobertura de déficit técnico atuarial por parte da Câmara Municipal referente as parcelas 03 a 05, cujos valores foram pagos com correção pelo INPC – índice Nacional de Preços ao Consumidor. Houve o pagamento da 21ª parcela do termo de acordo de parcelamento de cujos valores referem-se a suspensão parcial de pagamento das contribuições patronais do período retro citado nos termos do artigo 15 da Lei Complementar Municipal

SERVIÇO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL SEPREV

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

nº 354/2020 e Portaria MPS nº 14.816/2020, cadastrado junto ao CADPREV da Secretaria da Previdência Social do Ministério da Economia. O pagamento foi realizado no dia 27 de outubro de 2022 no valor de R\$ 112.352,65 (cento e doze mil, trezentos e cinquenta e dois reais e quarenta e sessenta e cinco centavos). Em relação ao COMPREV, houve repasse no mês em referência no valor de R\$ 25.166,13 (vinte e cinco mil, cento e sessenta e seis reais e treze centavos). Houve ainda um repasse de R\$ 302,80 (trezentos e dois reais e oitenta centavos) referente a parte devida pelo Seprev devido ao INSS. O saldo acumulado, somados os rendimentos de aplicação, recebidos por meio de convênio junto ao Comprev é de R\$ 11.935.772,83 (onze milhões, novecentos e trinta e cinco mil, setecentos e setenta e dois reais e oitenta e três centavos), valores que se encontram depositados junto à Caixa Econômica Federal, Agência 0907 na conta corrente nº 110-4, aplicados no fundo de investimento Caixa Brasil TP Renda Fixa 2023. Os encargos sociais foram pagos em data correta, ou seja, no seu vencimento. As guias de recolhimento referente aos repasses das contribuições previdenciárias dos servidores e da parte patronal da Prefeitura e Câmara coincidem com os resumos de empenho apresentados pelos mesmos. Todos os documentos encontram-se devidamente arquivados em pastas próprias e dentro da regularidade. Foi emitido pelo Ministério da Previdência o Certificado de Regularidade Previdenciária – CRP, demonstrando que todos os documentos obrigatórios foram remetidos ao MPS tempestivamente. No mês em referência, foram concedidos os benefícios de 01 (uma) aposentadoria e 01 (uma) pensão por morte. Após, de posse dos balancetes de receita e despesas do mês de outubro de 2022, dos extratos bancários e demais documentos apresentados pela gerência financeira, deliberaram pela aprovação dos mesmos, sem ressalvas. Quanto aos investimentos, observa-se que 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 4963/21. Quanto a rentabilidade observou-se que o retorno das aplicações no mês em análise, ou seja, outubro de 2022, foi positiva em R\$ 4.967.695,57 que equivale a um percentual positivo de 1,79% de rendimento, percentual este que ficou acima da meta atuarial medida no mês que foi em 0,97%. Os valores de retorno acumulados no exercício fecharam em R\$ 19.284.695,83 que perfaz um percentual de 7,50% contra 8,95% da meta atuarial medida até o mês de outubro de 2022. O saldo da última aplicação era de R\$ 277.095.734,50 e houve novas aplicações no valor de R\$ 2.809.863,33 e resgates que monta o valor de R\$1.890.000,00, gerando um saldo final de R\$ 282.983.131,40. Os fundos estão distribuídos de acordo com o estipulado na carteira de investimentos, estando posicionados da seguinte forma:


Carteira consolidada de investimentos - base (outubro/2022)



SERVIÇO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL SEPREV

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

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	15.395.478,87	5,44%	1.030	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	5.084.671,10	1,80%	1.094	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	549.524,70	0,19%	140	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	76.749.026,05	27,12%	274	3,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRANDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.030.179,91	0,36%	70	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRANDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	21.918.041,35	7,75%	99	4,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	13.526.693,40	4,78%	285	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	38.152.135,69	13,48%	252	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	47.856.773,75	16,91%	1.014	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA	D+1	Não há	16.991.463,80	6,00%	219	2,48%	Artigo 7º,



SERVIÇO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL SEPREV

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

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
FIXA PREVIDENCIÁRIO							Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	10.296.956,67	3,64%	1.033	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.875.924,72	3,49%	302	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	13.237.688,33	4,68%	980	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	433.310,42	0,15%	26	0,80%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	982.112,83	0,35%	31	1,42%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	1.130.801,17	0,40%	70	1,52%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	9.552.877,42	3,38%	191	1,47%	Artigo 8º, Inciso I
PUMA FIP MULTI-ESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	219.471,22	0,08%	42	5,89%	Artigo 10º, Inciso II
Total para cálculo dos limites da Resolução			282.983.131,40				






SERVIÇO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL SEPREV

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

Quanto ao Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de outubro/2022, observa-se o seguinte:

RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatili- dade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	0,70%	7,67%	4,56%	6,67%	11,97%	6,68%	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,67%	7,12%	4,52%	6,41%	11,45%	5,87%	1,01%	0,03%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,78%	8,84%	2,04%	3,22%	12,50%	17,69%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,85%	8,72%	2,35%	3,19%	12,14%	17,05%	0,82%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,83%	8,48%	2,24%	3,04%	11,90%	16,82%	0,85%	0,03%

IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,13%	10,75%	1,67%	3,90%	13,92%	34,83%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	- 0,07%	2,87%	-0,03%	0,72%	3,68%	2,12%	0,64%	0,01%

IRF-M 1 (Benchmark)	1,00%	9,68%	3,38%	6,44%	11,52%	13,50%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI-	0,98%	9,45%	3,31%	6,32%	11,23%	12,92%	0,04%	0,01%

[Handwritten signatures and initials]

SERVIÇO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL SEPREV

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatili- dade 12M
DENCIÁRIO								

IMA-B 5 (Benchmark)	1,91%	9,12%	2,35%	3,50%	12,73%	17,73%	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	- 0,09%	- 20,16%	- 16,18%	- 16,12%	- 20,38%	- 73,56%	0,70%	0,14%
TOWER II IMA-B 5 FI REN- DA FIXA	1,00%	3,38%	0,85%	0,96%	4,29%	- 20,16%	0,25%	0,02%

IMA-B (Benchmark)	1,23%	7,43%	3,86%	3,57%	11,40%	13,44%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,18%	7,12%	3,73%	3,27%	11,06%	12,77%	1,56%	0,05%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,20%	7,11%	3,78%	3,36%	11,02%	12,64%	1,56%	0,05%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilida- de 12M
--	-----	-----	----	----	-----	-----	------------	-----------------------

CDI (Benchmark)	1,02%	10,00%	3,30%	6,51%	11,49%	15,20%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA RE- FERENCIADO DI PREVIDEN- CIÁRIO LP	1,04%	10,21%	3,35%	6,62%	11,79%	15,78%	0,01%	0,01%
BRDESCO PREMIUM FI REN- DA FIXA REFERENCIADO DI	1,07%	10,53%	3,44%	6,84%	12,13%	16,28%	0,02%	0,01%

SERVIÇO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL SEPREV

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilida- de 12M
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,03%	10,25%	3,36%	6,65%	11,77%	15,91%	0,02%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,59%	4,70%	- 0,06%	0,39%	6,47%	17,83%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,89%	9,75%	2,20%	3,72%	12,72%	19,13%	0,85%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,89%	-	2,21%	3,00%	-	-	0,85%	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,89%	2,34%	- 0,81%	- 0,03%	6,01%	4,24%	0,85%	0,06%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,24%	-	2,18%	- 0,23%	-	-	0,53%	-

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilida- de 12M
Ibovespa (Benchmark)	5,45%	10,70%	12,48%	7,57%	12,11%	23,51%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5,78%	9,32%	8,90%	4,61%	15,03%	37,52%	12,63%	0,18%

IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,21%	11,60%	1,91%	4,39%	14,99%	37,36%	-	-
---------------------------------	-------	--------	-------	-------	--------	--------	---	---

[Handwritten signatures]

SERVIÇO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL SEPREV

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilida- de 12M
PUMA FIP MULTISTRATÉ- GIA	- 0,10%	-1,29%	-0,30%	- 0,61%	-1,49%	-2,65%	-	0,00%

Após análise da carteira, ratificou-se a determinação de que as novas aplicações no exercício de 2022, 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, IPCA e DI e poderão ser realizados a critério e análise da Diretoria Executiva do Seprev, devendo, no entanto, ser comunicado imediatamente o aporte na primeira reunião do comitê de investimentos. Nada mais havendo a tratar, deu-se por encerrada a reunião sendo lavrada em ata e após lida, vai assinada por todos.


Andressa Cristina Teixeira dos Santos


Beatriz da Silva Fontes


Joselma de Sena da Mota


Maristela Zanandrea Lanfranchi


Rosana Aparecida Muller