

ATA DE REUNIÃO – DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Reunião Extraordinária nº 008/2022

Data: 09 de novembro de 2022

Hora: 13:00h

Local: Sala da Diretoria de Investimentos no 3º andar do IPAJM

Participantes:

Gilberto de Souza Tulli - Diretor de Investimentos

Elisa do Carmo Medeiros Fonseca - Gerente de Investimentos

Edmilson Nunes de Castro - Membro do Comitê de Investimentos

Bruno Tamanini Lopes - Membro do Comitê de Investimentos

Tatiana Gasparini Silva Stelzer - Membro do Comitê de Investimentos

Ordem do Dia:

1. Estratégia e Proposta de alocação de recursos;
2. Deliberações.

Item 01:

Reuniram-se na sala da DI a Diretoria de Investimentos e o Comitê de Investimentos para deliberar sobre a alocação de recursos da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário, referente ao crédito de Cupom de Juros de NTN-B com vencimentos ímpares, além da realocação de recursos do Banestes e de fundos com alta concentração, para manutenção do enquadramento. Será creditado na conta do IPAJM número 807.596, na XP Investimentos, o montante aproximado de R\$ 38.500.000,00 (trinta e oito milhões e quinhentos mil reais) relativos aos Cupons de Juros de 330.000 (trezentos e trinta mil) títulos de NTN-B com vencimentos ímpares. Considerando o cenário atual de alta volatilidade tanto no ambiente interno quanto no exterior, a alta taxa de juros e a tendência de queda da inflação, foi sugerido pelo Diretor de Investimentos a alocação dos recursos em Fundos DI, que prometem um bom ganho real com baixo risco. A Gerente de Investimentos informou sobre o acúmulo de recursos do Fundo Previdenciário, que ingressam mensalmente no Banestes e ficam alocados nos fundos DI, deixando o total de aplicações no banco no limite do enquadramento de 5% (cinco por cento), que precisam ser transferidos para outras instituições financeiras. Aproveitando a oportunidade, os membros do comitê de investimentos sugeriram avaliar a realocação de recursos de fundos de investimentos que estão com alta concentração de aplicação, próximo aos 15% (quinze por cento) permitidos pela norma, desde que não sejam realizados resgates com ganho negativo.

Item 02:

Com base nas informações expostas e na situação atual da Carteira sob gestão, foi deliberado pelos participantes a transferência dos recursos dos Cupons de Juros, da conta da XP Investimentos, para o Banco do Brasil e a transferência

de R\$ 100.000.000,00 (cem milhões de reais) do Banestes, sendo R\$ 30.000.000,00 (trinta milhões de reais) para o Banco do Brasil e R\$ 70.000.000,00 (setenta milhões de reais) para a Caixa, realocando os recursos transferidos para fundos DI nas respectivas instituições financeiras. Quanto à realocação de fundos com alta concentração, após análise do histórico de aplicações e respectivos valores de cotas, foi deliberado realocar para o DI R\$ 35.000.000,00 (trinta e cinco milhões de reais) do FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS e R\$ 90.000.000,00 (noventa milhões de reais) do FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I. Por fim, considerando a informação do Banco do Brasil de que o fundo BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI será incorporado por outro fundo que não possuímos credenciamento, foi deliberado realocar o total de aplicações desse fundo para o BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI. O resumo das deliberações segue abaixo:

- **RESGATE** no dia 10/11/2022 do valor de **R\$ 35.000.000,00** (trinta e cinco milhões de reais) do FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS;
- **RESGATE** no dia 10/11/2022 do valor de **R\$ 90.000.000,00** (noventa milhões de reais) do FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I;
- **RESGATE** no dia 16/11/2022 do valor de **R\$ 100.000.000,00** (cem milhões de reais) do fundo BANESTES LIQUIDEZ LP;
- **RESGATE TOTAL** no dia 16/11/2022 do valor aproximado de **R\$ 166.000.000,00** (cento e sessenta e seis milhões de reais) do fundo BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI;
- **TRANSFERÊNCIA** no dia 16/11/2022 do valor aproximado de **R\$ 38.500.000,00** (trinta e oito milhões e quinhentos mil reais) da conta da XP Investimentos, para o Banco do Brasil;
- **TRANSFERÊNCIA** no dia 16/11/2022 do valor de **R\$ 30.000.000,00** (trinta milhões de reais) da conta do Banestes, para o Banco do Brasil;
- **TRANSFERÊNCIA** no dia 16/11/2022 do valor de **R\$ 70.000.000,00** (setenta milhões de reais) da conta do Banestes, para a Caixa;
- **APLICAÇÃO** no dia 17/11/2022 do valor aproximado de **R\$ 68.500.000,00** (sessenta e oito milhões e quinhentos mil reais) no fundo BB PREV RF PERFIL;
- **APLICAÇÃO** no dia 17/11/2022 do valor de **R\$ 160.000.000,00** (cento e sessenta milhões de reais) no fundo CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO;
- **APLICAÇÃO** no dia 21/11/2022 (data aproximada) do valor aproximado de **R\$ 166.000.000,00** (cento e sessenta e seis milhões de reais) no fundo BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI;

- **APLICAÇÃO** no dia 27/12/2022 (data aproximada) do valor de **R\$ 35.000.000,00** (trinta e cinco milhões de reais) no fundo CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO;

Considerações Finais:

Nada mais havendo a tratar, foi encerrada a reunião e lavrada a presente Ata, que vai assinada por todos os presentes.

ASSINATURAS (5)

Documento original assinado eletronicamente, conforme MP 2200-2/2001, art. 10, § 2º, por:

GILBERTO DE SOUZA TULLI
DIRETOR DE INVESTIMENTO
DIN - IPAJM - GOVES
assinado em 16/11/2022 10:48:54 -03:00

ELISA DO CARMO MEDEIROS FONSECA
GERENTE
GIN - IPAJM - GOVES
assinado em 16/11/2022 11:00:17 -03:00

BRUNO TAMANINI LOPES
MEMBRO DE COMITE DE INVESTIMENTOS
SAR - IPAJM - GOVES
assinado em 16/11/2022 11:12:37 -03:00

EDMILSON NUNES DE CASTRO
MEMBRO DE COMITE DE INVESTIMENTOS
GFI - IPAJM - GOVES
assinado em 16/11/2022 11:03:15 -03:00

TATIANA GASPARINI SILVA STELZER
MEMBRO DE COMITE DE INVESTIMENTOS
SAR - IPAJM - GOVES
assinado em 16/11/2022 10:51:42 -03:00



INFORMAÇÕES DO DOCUMENTO

Documento capturado em 16/11/2022 11:12:38 (HORÁRIO DE BRASÍLIA - UTC-3)
por GILBERTO DE SOUZA TULLI (DIRETOR DE INVESTIMENTO - DIN - IPAJM - GOVES)
Valor Legal: ORIGINAL | Natureza: DOCUMENTO NATO-DIGITAL

A disponibilidade do documento pode ser conferida pelo link: <https://e-docs.es.gov.br/d/2022-DZH8L4>