



JAPERI, 25DE JULHO DE 2023

Página | 1

ATA Nº 007/2023 – ATA DE REUNIÃO DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE JAPERI, REALIZADA EM 25 DE JULHO DE 2023, ÀS QUATORZE HORAS, NA SALA DE REUNIÕES DESTES INSTITUTO, SITUADO À ESTRADA SÃO PEDRO, 987, TEÓFILO CUNHA – JAPERI – RJ, reuniram-se ordinariamente os seguintes membros do COMITÊ: DIMAS FERREIRA VIDAL (Gestor de Finanças e Administração), ILKA CRISTINA DA SILVANASCIMENTO NUNES, (Servidora ativa) e MÁRCIO CRISTIANO DE CARVALHO SANTOS (Servidor ativo).

Dando início à reunião, o GFA, Dimas Ferreira Vidal, cumprimentou a todos e apresentou os assuntos da reunião, a saber: **Apresentação do Relatório de informações da Gestão de Ativos e Passivos da PREVI projetadas para 2023; Acompanhamento e relatório mensal dos ativos investidos em Títulos Públicos Federais no mês de julho, análise de novas estratégias em função da queda das taxas de juros e outros assuntos.**

O GFA explanou sobre a Gestão de ativos e passivos do PREVI projetados para o exercício de 2023, informando sobre a movimentação na carteira de ativos da PREVI-JAPERI, rendimentos projetados e recebidos, de acordo com a estratégia estabelecida pela Política de Investimento de 2023 e o Plano de Custeio Atuarial, bem como a apresentação de resultados no recebimento de cupons de juros das aplicações realizadas. As tabelas abaixo apresentam as informações dos TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOIRO NACIONAL adquiridos pela PREVI nos leilões do Tesouro Nacional através das mesas de operações do Banco do Brasil e da Caixa Econômica Federal.

A tabela a seguir apresenta os títulos adquiridos e custodiados pelo BANCO DO BRASIL:

TÍTULO	QTD	ADQUIRIDO	VENCIMENTO	TAXA %	Julho 2022	Valor atual
NTN-B	2050	04/05/2022	15/05/2025	5,586877	6.881.374,35	8.584.599,03
NTN-B	1200	13/04/2022	15/05/2027	5,480160	8.429.547,35	5.074.772,25
NTN-B	1500	21/06/2022	15/05/2027	5,588787	4.943.404,28	6.320.684,05
NTN-B	1500	26/07/2022	15/08/2032	6,233832	6.152.675,40	6.234.511,46
NTN-B	1200	13/04/2022	15/05/2035	5,619973	6.045.752,06	5.153.142,43
NTN-B	1750	26/07/2022	15/05/2045	6,236300	5.010.065,37	7.091.989,49
TOTAL DOS ATIVOS					37.462.818,99	38.459.698,71

Fonte: Custódia do BB.



A tabela a seguir apresenta os títulos adquiridos e custodiados pela CAIXA ECONÔMICA FEDERAL:

Página | 2

TÍTULO	QTD	ADQUIRIDOS	VENCIMENTO	TAXA %	Agosto 2022	VALOR ATUAL
NTN-B	1750	24/08/2022	15/05/2025	5,941272	7.074.070,61	7.308.597,41
NTN-B	1550	24/08/2022	15/08/2032	5,856822	6.231.990,24	6.625.821,73
NTN-B	1850	28/09/2022	15/05/2035	5,815100		7.843.669,64
NTN-B	1100	21/09/2022	15/05/2045	5,888000		4.657.772,41
NTN-B	1.100	13/10/2022	15/05/2027	5,715171		4.631.914,20
NTN-B	800	03/11/2022	15/08/2032	5,699193		3.455.506,34
NTN-B	500	03/11/2022	15/05/2045	5,744425		2.153.313,34
NTN-B	750	23/11/2022	15/05/2035	6,206500		3.081.192,89
NTN-B	1.100	15/03/2023	15/08/2040	6,397001		4.480.581,50
NTN-B	500	26/04/2023	15/08/2040	6,018321		2.115.094,12
NTN-B	200	07/06/2023	15/08/2040	5,519070		890.119,29
NTN-B	400	19/07/2023	15/08/2040	5,437577		1.795.244,09
TOTAL DOS ATIVOS					13.306.060,85	52.895.458,99

Fonte: Custodia da Caixa Econômica Federal

O GFA informou que até este momento o valor total em títulos públicos é de R\$ 91.355.157,70 (NOVENTA E UM MILHÕES, TREZENTOS E CINQUENTA E CINCO MIL, CENTO E CINQUENTA E SETE REAIS E SETENTA CENTAVOS), com um pagamento de cupom de juros projetados para este ano, em valor presente, de R\$ 5.310.473,12 (CINCO MILHÕES, TREZENTOS E DEZ MIL, QUATROCENTOS E SETENTA E TRES REAIS E DOZE CENTAVOS), dos quais o Instituto já recebeu R\$ 2.367.934,97 (DOIS MILHÕES, TREZENTOS E SESSENTA E SETE MIL, NOVECENTOS E TRINTA E QUATRO REAIS E NOVENTA E SETE CENTAVOS), isto, sem considerar ganhos financeiros em função da correção dos títulos pelo IPCA, destacando que os valores recebidos em cupons de juros estão sendo reinvestidos em Títulos Públicos, em consonância à estratégia estabelecida pela Política de Investimentos de 2023. Foi ressaltado que, em consonância com a Política de Investimento, o PREVI ainda possui os seguintes ativos: R\$ 1.555.888,73 em cotas do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS e R\$ 381.023,73 em cotas do FUNDO CAIXA BRASIL IDKA IPCA, recursos estes destinados à contingência para fluxo de caixa, sendo o primeiro vinculado ao Fundo Previdenciário e o segundo, às operações do Instituto, relacionados à Taxa de



Administração. Já em relação aos ativos herdados, o Instituto possui em sua carteira de investimentos os seguintes ativos: R\$ 2.159.189,97 em cotas do FUNDO TMJIMA-B RENDA FIXA, R\$ 2.432.915,05 em cotas do FUNDO AUSTRO IMA-B ATIVO RF, R\$ 1.846.872,88 em cotas do FUNDO TOWER IMA-B 5 RF, R\$ 354.721,16 em cotas do FUNDO SECURITY REFERENCIADO CP, R\$ 2.115.577,29 em cotas do FUNDO FP2 FI EM PARTICIPAÇÕES, e R\$ 1.282.006,89 em cotas do FUNDO AQUILLA FII, todos em processo de liquidação, sendo que ao longo deste ano foram repassados ao PREVI R\$ 312.516,26 como resultado deste processo de liquidação em andamento. Assim, o valor total de ativos da carteira de investimentos do Instituto é de R\$ 103.483.353,40 (CENTO E TRES MILHÕES, QUATROCENTOS E OITENTA E TRES MIL, TREZENTOS E CINQUENTA E TRES REAIS, E QUARENTA CENTAVOS), sendo 90 % com garantia de rendimento bem acima de nossa meta atuarial, com ativos a serem mantidos até o vencimento, apesar de terem liquidez diária, com recebimento de cupom de juros semestrais. Dando continuidade a reunião, foi apresentado o relatório das movimentações na carteira de ativos do PREVI-JAPERI em julho:

Em 19 de julho de 2023 houve uma AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO EM 400 TÍTULOS PUBLICOS NOTA DO TESOURO NACIONAL SÉRIE B – NTN-B, VENCIMENTO EM 15/08/2040 com PREÇO UNITÁRIO DE R\$ 4.485,800847, TOTALIZANDO R\$ 1.794.320,33 (UM MILHÃO, SETECENTOS E NOVENTA E QUATRO MIL, TREZENTOS E VINTE REAIS E TRINTA E TRÊS CENTAVOS), COM TAXA CORRESPONDENTE DE 5,4379 % AO ANO, MAIS IPCA.

Colocado em deliberação, os integrantes do Comitê de Investimento destacaram que apesar das expectativas na queda das taxas de juros no mercado financeiro, os resultados obtidos com a estratégia de investimento definida pela Política de Investimento tem apresentado resultados bastante satisfatórios, com taxas de juros negociadas nas aquisições dos títulos, bem acima de nossa taxa atuarial de 4,9% estabelecida para 2023. Considerando ainda a questão da queda das taxas de juros dos Títulos do Tesouro Nacional, o Comitê de Investimento considerou importante iniciar estudos de alternativas de estratégias de investimentos e de composição da carteira, para quando as taxas de juros de títulos públicos ficarem abaixo da taxa atuarial. Importante salientar que estas estratégias seriam direcionadas para os recursos de repasses previdenciários, particularmente do aporte mensal, e também dos recursos do pagamento de cupom de juros dos títulos da carteira, visto que não faz nenhum sentido fazer movimentação nos ativos atuais de Títulos Públicos, visto que os mesmos têm garantia de rendimentos acima



da taxa atuarial de forma escalonada até 2045, e deverão ser mantidos até o vencimento dos mesmos.

Nada mais havendo a tratar, deu-se por encerrada esta reunião às 16:35h. E para constar, eu, DIMAS FERREIRA VIDAL, lavrei a presente ata, que após lida em voz alta irá assinada por mim e por todos os presentes.

JAPERI, 25 DE JULHO DE 2023

DIMAS FERREIRA VIDAL

ILKA CRISTINA DA SILVA NASCIMENTO NUNES

MÁRCIO CRISTIANO DE CARVALHO SANTOS

