

ATA DE REUNIÃO ORDINÁRIA
Comitê de Investimentos
10/2023

As nove horas do dia dezessete de outubro de dois mil e vinte e três, na sede do Instituto de Previdência Social dos Servidores Municipais de São Roque – SÃO ROQUE PREV localizada na Rua Marechal Deodoro da Fonseca, nº 119 – São Roque/SP, realizou-se a reunião ordinária do Comitê de Investimentos na presença dos membros assim nominados: **Vanderlei Massarioli** – Diretor Presidente do SÃO ROQUE PREV, **Solange Siqueira Duarte Silva** – membro do Conselho Deliberativo e **Margareth Andreoli Pinto** – membro do Conselho Fiscal e **Lisete de Fátima Oliveira** – membro do Conselho Deliberativo e **Gabriela Ribeiro do Prado** – Diretora Administrativa Financeira do São Roque Prev. Contou ainda com a presença da, **Sra. Simone Lopes** consultora de investimentos, e do **Sr. Ronaldo de Oliveira** representante da empresa contratada para elaboração da ALM. Foi designado para auxiliar nos trabalhos de secretária Vanderlei Massarioli. Pelo Diretor Presidente foi declarada aberta a reunião. Foi lida e aprovada a ata de nº 09/2023 da última reunião. **1) Cenário Econômico:** a consultora Sra Simone apresentou onde pautou que no exterior, yields sobem, índice dólar recua após dois dias de avanço e bolsas têm leve alta enquanto os investidores avaliam os esforços diplomáticos para tentar conter o conflito Israel-Hamas. O presidente Americano Joe Biden considera viagem a Israel, segundo pessoas a par do assunto, e secretário Antony Blinken pede à China que use sua influência para evitar que outras forças ataquem Israel. Sobre o relatório Focus, os economistas reduziram as projeções para IPCA 2023 de 4,86% para 4,75%, no teto da meta de inflação, após o IPCA de setembro, que ficou abaixo do previsto na semana passada, apesar da pressão em serviços. **2) Resultados:** na sequência a consultora Sra Simone apresentou os resultados do mês de setembro, sendo: meta atuarial para o mês foi de 0,66%, rendimento do mês foi de 0,46%, com retorno de R\$



- São Roque – a Terra do Vinho e Bonita por Natureza -


2.075.581,12; no acumulado do ano temos meta atuarial de 7,46%, rendimento 8,08%, com retorno de **R\$ 33.630.500,87**, chegando a **108,40%** da meta atuarial. O valor referente a Taxa de Administração terminou o período com R\$ 4.198.235,23, obtendo um rendimento no mês de agosto de 0,85%% com retorno de R\$ 259.753,99. O patrimônio total do São Roque Prev ao final de agosto de 2023 é de **R\$ 455.300.522,37**. O Diretor Presidente informou que referente a última reunião as deliberações do comitê foram atendidas, cabendo uma ressalva a aplicação ao fundo TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES CNPJ 35.726.741/0001-39, o qual recebeu somente R\$5 milhões dos R\$10 milhões deliberados, isso devido ao fechamento do fundo para aportes. Os membros do comitê reafirmaram pela continuidade das deliberações e movimentações já tomadas em reuniões passadas. **3) Apresentação do estudo de ALM 2023:** dado a palavra ao consultor Sr. Ronaldo que apresentou o estudo de ALM realizado pela consultoria LDB, o qual apresentou o contexto atual englobando o Cenário Econômico Atual, Riscos Financeiros (ativos), Riscos Atuariais (passivos), Cenários de Benchmarkes, projeção do passivo e Otimização do Ativo. Apresentou 13 (treze) pontos da construção a Fronteira de Eficiência de Markowitz, onde o São Roque Prev se apresenta no quarto ponto, culminando com Alocação Markowitz. O Sr. Ronaldo parabenizou o Comitê pela alocação em NTN-Bs a qual se apresenta dentro do estudo apresentado. Finalizou o diagnóstico onde o estudo sugere a diminuição de alocação em fundos que não estejam atrelados ao IMA-B, diminuição de alocação de fundos atrelados à SELIC/CDI, e ampliar alocação em fundos de ações do Art 8º. I. Os membros do Comitê parabenizaram o Sr Ronaldo pela apresentação e orientações. **4) Deliberações do comitê:** os membros do comitê após análise deliberaram por, a) pelo credenciamento do fundo BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP CNPJ 13.077.418/0001-49; b) pela aquisição de R\$45 milhões em Títulos Públicos NTN-B 2055 desde que seja superior a meta atuarial conforme resultado da ALM apresentada na data de hoje, com recursos vindo dos fundos BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CNPJ



- São Roque – a Terra do Vinho e Bonita por Natureza -

11.328.882/0001-35 (resgate total), CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP CNPJ 14.386.926/0001-71 (resgate total), CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA CNPJ 23.215.008/0001-70 (resgate total) e ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CNPJ 00.832.435/0001-00, todos os fundos a serem realizados são superavitários; c) substituir as aplicações do Fundo BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO CNPJ: 13.077.415/0001-05 pela aplicação no Fundo BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP CNPJ 13.077.418/0001-49 em todas as contas correntes, por ter uma menor Taxa de Administração, fundo a ser realizado se encontra superavitário. Ao final os membros do Comitê parabenizaram o diretor Presidente pela condução da Gestão dos Recursos do SRPREV. Fica designada para o dia 21 de novembro de 2023, às 09h na sede do SÃO ROQUE PREV a reunião ordinária do próximo mês. Nada mais havendo a constar, eu Vanderlei Vanderlei Massarioli, lavrei a presente ata que depois de lida, estava conforme e segue assinada por mim e demais membros presentes, encerrando-se a reunião na mesma data às doze horas e quarenta minutos. -----


Margareth Andreoli Pintos
Rep. Conselho Fiscal


Solange Siqueira Duarte Silva
Rep. Conselho Deliberativo


Lisete de Fátima Oliveira
Rep. Conselho Deliberativo


Vanderlei Massarioli
Diretor Presidente


Gabriela Ribeiro do Prado
Diretora Administrativa Financeira