

Ata 08/2024 – Comitê de Investimentos

Aos vinte e seis dias do mês de agosto de dois mil e vinte e quatro, as quinze horas, na sala de reuniões do AmperePrevi, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos para a reunião mensal. A gestora de recursos Andreia agradeceu a presença dos membros e em seguida foi discutido sobre cenário econômico e político e análise dos resultados de julho. Inicialmente a Diretora Andreia deu início informando os dados financeiros do mês de julho. Informou o saldo do patrimônio líquido Previdenciário que fechou julho no total de R\$ 47.643.747,05 (quarenta e sete milhões, seiscentos e quarenta e três mil, setecentos e quarenta e sete reais e cinco centavos), com rendimento mensal de R\$ 510.158,72 (quinhentos e dez mil, cento e cinquenta e oito reais e setenta e dois centavos); total acumulado de rendimentos até julho de R\$ 1.645.966,91 (um milhão, seiscentos e quarenta e cinco mil, novecentos e sessenta e seis reais e noventa e um centavos). Saldo da Taxa Administrativa de R\$ 1.014.165,92 (um milhão, quatorze mil, cento e sessenta e cinco reais e noventa e dois centavos), com rendimento mensal de R\$ 9.202,77 (nove mil, duzentos e dois reais e setenta e sete centavos). A conta do Compreve com saldo de R\$ 1.106.372,09 (um milhão, centos e seis reais, trezentos e setenta e dois reais e nove centavos), com rendimento mensal de R\$ 10.132,09 (dez mil, centos e trinta e dois reais e nove centavos); As entradas do Compreve no mês de julho foram no valor de R\$ 7.014,68 (sete mil, quatorze reais e sessenta e oito centavos) referente a pró-rata do mês e pagamento realizado ao INSS no valor de R\$ 18.968,78 (dezoito mil, novecentos e sessenta e oito reais e setenta e oito centavos) referente a pró-rata do mês e R\$ 70,79 (setenta reais e setenta e nove centavos) ao Paranaprevidência. Repasse dos Servidores R\$ 341.503,97 (trezentos e quarenta e um mil, quinhentos e três reais e noventa e sete centavos), repasse patronal de R\$ 487.862,97 (quatrocentos e oitenta e sete reais, oitocentos e sessenta e dois reais e noventa e sete centavos), contribuição dos Aposentados no valor de R\$ 33.467,86 (trinta e três mil, quatrocentos e sessenta e sete reais e oitenta e seis centavos). Entrada da 6ª e 7ª parcelas do déficit Atuarial no valor de R\$ 11.759,81 (onze mil, setecentos e cinquenta e nove reais e oitenta e um centavos) cada, visto que mês de junho não havia sido depositada. Total de recursos que entraram no mês de julho da Taxa Administrativa R\$ 31.929,92 (trinta e um mil novecentos e vinte e nove reais e noventa e dois centavos). Referente as despesas: Folha dos aposentados de julho no valor de R\$ 318.127,64 (trezentos e dezoito mil, cento e vinte e sete reais e sessenta e quatro centavos); Despesas de junho no valor de R\$ 25.501,56 (vinte e cinco mil, quinhentos e um reais e cinquenta e seis centavos). Sobre a meta atuarial referente junho foi de 0,63% e julho de 0,80% e os resultados obtidos em junho foram de 0,38% e em julho de 1,06%. Em relação as movimentações financeiras realizadas em julho foram: Resgates no Banco do Brasil: Ações Seleção Fator no valor de R\$ 115.681,65. Ações Retorno Total no valor de R\$ 316.456,05; Ações Governança no valor de R\$ 334.243,81; Ações Agro no valor de R\$ 113.427,32 e DI Fluxo – R\$ 1.231.306,03. Aplicações no Banco do Brasil no DI no valor de R\$ 1.200.000,00 e transferência de R\$ 500.000,00 para o Banco Bradesco. Na Caixa Econômica Federal não teve resgate e aplicação no fundo DI no valor de R\$ 4.424,21 e transferência para aplicação no Sicredi no valor de R\$ 80.000,00. No Banco Bradesco foi aplicado valor de R\$ 500.000,00 em DI Federal Extra. Em sequência o consultor de investimentos Sergio participou online da reunião do conselho como já aviamos falado e contratado ele apresentou o estudo de Desenvolvimento do ALM - Asset Liability Management (Gerenciamento de Ativos e Passivos) com a empresa Gestor Um que já realiza a consultoria financeira do Instituto no valor de R\$ 10.000,00 dividido em duas parcelas em seguida o Consultor passou ao comite uma análise da carteira do RPPS de Ampére a carteira do RPPS de Ampére rendeu 1,08% no mês de julho/24, ante uma meta atuarial de 0,79% (IPCA + 5,02%). No acumulado do ano, a carteira rende 3,83% contra 5,85% da meta atuarial. A deterioração das expectativas de juros prejudicou especialmente os títulos de médio e longo prazos, com o IMA-B e o IMA-B5 Os prefixados sofreram menos, com o IRF-M e o IRF-M1+ caindo 0,29% e 0,72% respectivamente. Apesar do impacto negativo observado, a forte abertura da curva de juros pode ter um componente especulativo, e sua possível correção para patamares mais próximos do anterior (caso a inflação corrente não acelere) poderá corrigir também os IMA para

J. Maicon

patamares mais positivos. a consultoria aproveitou a apresentou orçamento sobre o estudo de ALM solicitado pelo membro Antonio no mês de julho onde o valor para confecção do estudo ficou em R\$ 10.000,00 (Dez mil reais) este estudo de tem como objetivo harmonizar a carteira de investimentos do RPPS com o fluxo atuarial projetado de receitas e despesas e assim também habilitando o RPPS a investir em títulos NTNbs com preço marcado na curva, após a apresentação do orçamento os membro do comitê autorizaram a Consultoria Gestor Um a elaborar esta analise para o Instituto de Ampere, sendo assim as recomendações para alocações de recursos novos no mês de Agosto foram as seguintes. Recomentou que os recursos novos sejam alocados em títulos públicos federais. Até a elaboração do ALM recomendamos que esses recursos fiquem alocados em CDI. Nada mais havendo a tratar encerrou-se a reunião e segue assinatura dos presentes. Ampere, vinte e seis de agosto de dois mil e vinte e quatro. -----

Antonio A.R. de Silva Nairon P.P. Martini Andreia Bodio