

ATA Nº 01/2023 DE REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO IPREJ.

Ata do mês de janeiro de 2023, da Reunião Ordinária do Comitê de Investimento do IPREJ, realizada no dia 15 de fevereiro de dois mil e vinte e três, às 10:00 horas, com a presença dos integrantes do Comitê José Alves de Oliveira, Rosemary Sales da Silva e Sonilda Nunes da Silva Souza.

Tendo como pauta as deliberações mensais de investimentos e resgates, José Alves de Oliveira, fez um resumo e análise sobre o desempenho das rentabilidades e os riscos das aplicações financeiras do IPREJ, evidenciando a análise comportamental da mesma, com base no Relatório mensal de Investimentos do mês de janeiro 2023.

Em relação a Movimentação da Carteira de Investimentos do mês de janeiro, a carteira apresentou o Saldo Inicial de R\$ 23.507.023,58, Aportes de R\$ 824.712,31, Resgates de R\$ 1.179.712,31, Rentabilidade Consolidada de R\$ 292.296,11 e Saldo Final de R\$ 23.444.319,69. (2.1 – Rel. Mensal).

Em relação ao Enquadramento e Composição sobre Segmentos e Fundos de Investimentos do mês de Janeiro do IPREJ, a carteira de investimentos apresentou a composição dos fundos de investimentos (3.1 – Rel. Mensal).

Em relação a Disponibilidade Financeira e Total por Segmento do RPPS, a carteira de investimentos do mês de janeiro apresentou renda fixa de R\$ 23.042.806,83, correspondendo 91,03%, renda variável de R\$ 401.512,86 correspondendo 1,59% e conta corrente de R\$ 1.869.551,38 correspondendo 7,39% (3.1.1- Rel. Mensal).

Em relação ao Enquadramento sobre os Recursos de Terceiros dos Gestores, no mês de janeiro, a carteira de investimentos apresentou aplicado por gestor no BB Gestão de Recursos DTVM S.A. R\$ 22.130.563,71 e na Caixa Asset DTVM R\$ 1.313.755,98. (3.5 – Rel. Mensal).

e

Em relação a Distribuição por Instituição Financeira, a carteira de investimentos apresentou, por segmento aplicado no mês de janeiro, no Banco do Brasil R\$ 22.130.563,71, 88,34% sobre o patrimônio líquido do RPPS, e na Caixa Econômica Federal R\$ 1.313.755,98, 5,24% sobre o patrimônio líquido do RPPS e disponibilidade financeira R\$ 1.606.924,48, 6,41% sobre o patrimônio líquido do RPPS, totalizando 25.051.244,17. (6.3 Rel. Mensal).

Em relação à Rentabilidade Mensal da Carteira de Investimento do mês de janeiro apresentou, R\$ 292.296,11 e da Meta Atuarial do mês de janeiro foi de R\$ 124.587,22. (8.1. Rel. Mensal).

Em relação à Rentabilidade Acumulada da Carteira de investimento do mês de janeiro apresentou, de rentabilidade acumulada R\$ 292.296,11 e da Meta Atuarial acumulada R\$ 124.587,22. Correspondendo um ganho sobre a Meta Atuarial de R\$ 167.708,89. (8.2. Rel. Mensal).

Em relação à Rentabilidade da Carteira. A carteira de investimentos do IPREJ, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada de 1,26% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado de 1,12% a.a.,



ou seja, uma carteira que alcançou até o momento, uma rentabilidade de 112,71% sobre o índice de referência do mercado. (8.3 Rel. Mensal).

Em relação à Meta Atuarial. Enquanto a rentabilidade acumulada do IPREJ é de 1,26% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de 0,53%, ou seja, até o momento, a carteira alcançou uma rentabilidade de 238,21% sobre a Meta Atuarial. (8.4 Rel. Mensal)

O Comitê de Investimentos deliberou também que a Diretoria Administrativa e Financeira, enviasse a consultoria Atuarial as carteira sugerida encaminhadas pelas instituições financeiras, para análise e avaliação da performance, dos fundos e avaliarem a oportunidade para diversificar nossas aplicações, levando em consideração a rentabilidade mais atrativa para a carteira de investimento do IPERJ.

E que fizesse via e-mail, as solicitações para elaboração do Relatório de Orientação de Investimento – O. I. quando houver disponibilidade financeiro para aportes em fundos de investimentos. Ficou decidido pelo Comitê de Investimentos que as alocações financeiras para tomada de decisões em compra de títulos seriam de acordo as orientações/recomendações do Relatório de Orientação de Investimento – O. I. da Atuarial, levadas em considerações o atual cenário econômico.

O Comitê de Investimento acatou as orientações da Atuarial, decidindo pela aplicação, visando a formação de reservas para cobrir as obrigações futuras do IPREJ:

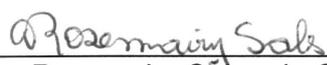
Data	CNPJ	Fundo	Valor R\$
26/01/2023	11.328.882/0001-35	BB PREV. RF IRF-M1 TP	824.712,31
		TOTAL	824.712,31

As análises do Relatório de Investimento são feitas na carteira de investimento deste RPPS, com o objetivo de atender a resolução CMN 4.963/2021, Política Anual de Investimento, cenário econômico e a necessidade desta autarquia, bem como o Inciso V, do Art. 3º da Portaria MPS 519/2011 que exige a elaboração de relatórios mensalmente, sobre a rentabilidade, das aplicações dos recursos do RPPS e a aderência à política anual de investimentos

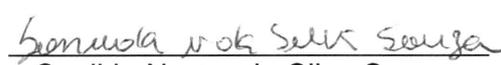
Concluídas as deliberações, e não havendo mais nenhum assunto a ser tratado, deu-se por encerrada a reunião. Rosemary Sales da Silva, lavra a presente ata, que após a leitura e aprovada é assinada pelos membros do Comitê de Investimentos do IPREJ.



José Alves de Oliveira



Rosemary Sales da Silva



Sonilda Nunes da Silva Souza

2.1-MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2023 - IPREJ

Nº	MESES	SALDO INICIAL	APORTES (Aplicação)	RESGATES	VARIÇÃO PU - TÍTULOS PÚBLICOS	RENTABILIDADE			SALDO FINAL
						Positiva (a)	Negativa (b)	Consolidado c = (a) - (b)	
1	JANEIRO	23.507.023,58	824.712,31	(1.179.712,31)	-	292.296,11	-	292.296,11	23.444.319,69
2	FEVEREIRO	23.444.319,69	-	-	-	-	-	-	23.444.319,69
3	MARÇO	23.444.319,69	-	-	-	-	-	-	23.444.319,69
4	ABRIL	23.444.319,69	-	-	-	-	-	-	23.444.319,69
5	MAIO	23.444.319,69	-	-	-	-	-	-	23.444.319,69
6	JUNHO	23.444.319,69	-	-	-	-	-	-	23.444.319,69
7	JULHO	23.444.319,69	-	-	-	-	-	-	23.444.319,69
8	AGOSTO	23.444.319,69	-	-	-	-	-	-	23.444.319,69
9	SETEMBRO	23.444.319,69	-	-	-	-	-	-	23.444.319,69
10	OUTUBRO	23.444.319,69	-	-	-	-	-	-	23.444.319,69
11	NOVEMBRO	23.444.319,69	-	-	-	-	-	-	23.444.319,69
12	DEZEMBRO	23.444.319,69	-	-	-	-	-	-	23.444.319,69
13	ANO	23.507.023,58	824.712,31	(1.179.712,31)	-	292.296,11	-	292.296,11	23.444.319,69

*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

3.1-ENQUADRAMENTO SOBRE SEGMENTOS E FUNDOS DE INVESTIMENTOS

RENDA FIXA

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
1	10.577.519/0001-90	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 + TP RF LP	912.243,12	3,60%	SIM	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	73,75%	SIM
2	35.292.588/0001-89	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1.848.318,48	7,30%	SIM			
3	03.543.447/0001-03	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	5.084.901,63	20,09%	SIM			
4	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	5.716.195,24	22,58%	SIM			
5	11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	5.106.500,79	20,17%	SIM			
6	13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.374.647,57	17,28%	SIM			
(1) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA			23.042.806,83	91,03%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JANEIRO

RENDA VARIÁVEL

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
7	15.154.220/0001-47	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	120.616,68	0,48%	SIM	F.I. Ações, Art. 8, I (30%)	0,9%	SIM
8	01.525.057/0001-77	FIC FI AÇÕES CAIXA IBOVESPA	107.034,00	0,42%	SIM			
9	30.036.235/0001-02	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	173.862,18	0,69%	SIM	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	0,7%	SIM
(2) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL			401.512,86	1,59%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JANEIRO

3.1.1-DISPONIBILIDADE FINANCEIRA E TOTAL POR SEGMENTO

Nº DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)			
10	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	1.834.666,50	7,25%
11	Caixa Econômica Federal	1.448,15	0,01%
12	Itaú Unibanco S.A.	33.436,73	0,13%
(3) TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		1.869.551,38	7,39%

TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS			
(1)	TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	23.042.806,83	91,03%
(2)	TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL	401.512,86	1,59%
(3)	TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)	1.869.551,38	7,39%
PATRIMÔNIO LÍQUIDO TOTAL (1 + 2 + 3)		25.313.871,07	100,00%

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JANEIRO

3.5-ENQUADRAMENTO SOBRE OS RECURSOS DE TERCEIROS DOS GESTORES

Nº	Gestor de Recursos	Recursos do RPPS aplicado no Gestor	Total de Recursos de Terceiros geridos pelo GESTOR	(%) Recursos do RPPS sobre o PL* do GESTOR	Enquadrado?
1	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	22.130.563,71	1.401.527.113.346,63	0,0016%	SIM
2	CAIXA ASSET DTVM	1.313.755,98	481.650.462.530,98	0,0003%	SIM
TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO		23.444.319,69			
TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		1.869.551,38			
PATRIMÔNIO LÍQUIDO		25.313.871,07			

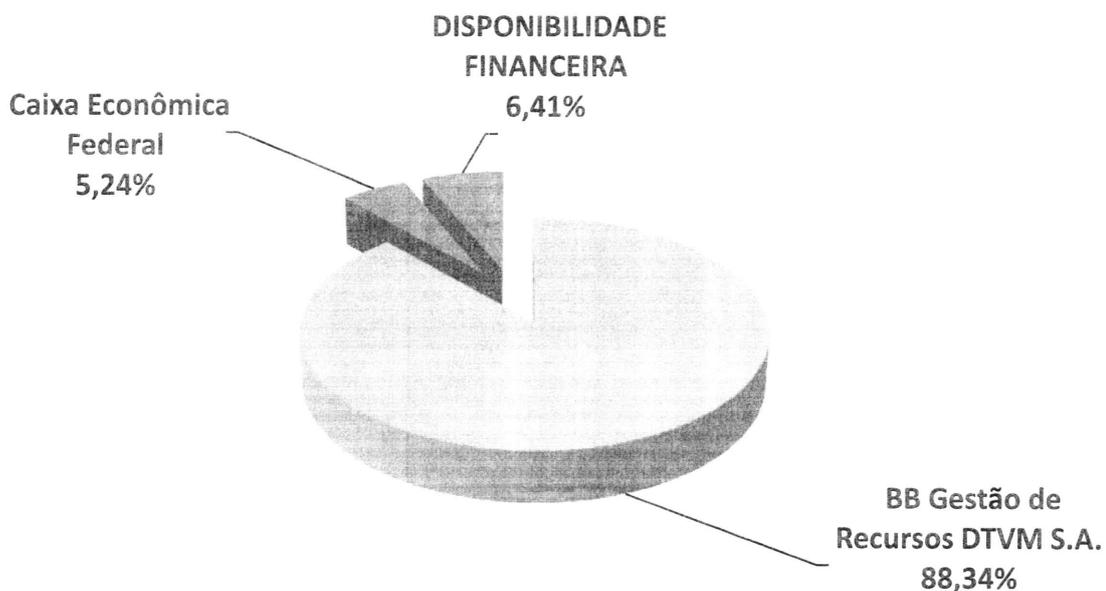
* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JANEIRO

6.3-DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	22.130.563,71	88,34%
Caixa Econômica Federal	1.313.755,98	5,24%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.606.924,48	6,41%
TOTAL	25.051.244,17	100,00%

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



8-RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

8.1-RENTABILIDADE MENSAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2023 - IPREJ

JAN	
RENTABILIDADE MENSAL DA CARTEIRA	1,26%
CDI	1,12%
IBOVESPA	3,37%
META ATUARIAL	0,53%

A RENTABILIDADE DA CARTEIRA DO IPREJ NO MÊS DE JANEIRO FOI DE:

R\$ 292.296,11

A META ATUARIAL NO MÊS DE JANEIRO FOI DE:

R\$ 124.587,22

8.2-RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2023 - IPREJ

	JAN
RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA	1,26%
CDI	1,12%
IBOVESPA	3,37%
META ATUARIAL	0,53%

RENTABILIDADE ACUMULADA DO IPREJ: R\$ 292.296,11

META ATUARIAL ACUMULADA: R\$ 124.587,22

GANHO SOBRE A META ATUARIAL R\$ 167.708,89

8.3.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA

A Carteira de Investimentos do IPREJ, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada de 1,26% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado de 1,12% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou até o momento, uma rentabilidade de 112,72% sobre o índice de referência do mercado.

8.4-META ATUARIAL

Enquanto a rentabilidade acumulada do IPREJ é de 1,26% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de 0,53%, ou seja, até o momento, a carteira alcançou uma rentabilidade de 238,21% sobre a Meta Atuarial.