



Ata da primeira reunião extraordinária de acompanhamento dos investimentos do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, ocorrida em 15 de dezembro de 2021, com as seguintes presenças: Rossana Vasques - Presidente do IPMJ, Renata de Souza Santos Esteves - Diretora do Departamento Administrativo-Financeiro, Vanderlei Massarioli - Gestor dos Recursos, Amauri Arnaldo Júnior - Supervisor da Unidade de Gestão de Investimentos. A reunião teve início às 15h09, na modalidade presencial, autorizada conforme Decreto nº 196, de agosto de 2021, de acordo com as regras e medidas de segurança estabelecidas no Art. 2º do mesmo. A reunião foi solicitada pelo Sr Vanderlei Gestor dos Recursos do IPMJ, visto que esse mês de dezembro é atípico com relação ao comitê de investimentos, o qual acompanha o mandato dos conselheiros. Pauta da reunião: 1) Apresentação do fechamento da carteira de novembro de 2021; 2) Análise parcial carteira dezembro até 10/12; 3) Fundo Pátria Special Opportunies 1 - FIC FIP; 4) Fundo Santos Credit Yield Fundo de Investimento RF Credito Privado; 5) Relatório Mensal; 6) Assuntos Diversos. A reunião registrou o encerramento do mês de novembro, com a elaboração do relatório gerencial. Execução Orçamentária: as receitas orçamentárias acumuladas totalizaram R\$ 198.911.316,39 (cento e noventa e oito milhões e novecentos e onze mil e trezentos e dezesseis reais e trinta e nove centavos) e as despesas orçamentárias empenhadas acumuladas o montante de R\$ 96.697.070,84 (noventa e seis milhões e seiscentos e noventa e sete mil e setenta reais e oitenta e quatro centavos). A maioria dos índices de renda fixa encerraram o mês de novembro positivos: IRF-M 1,79%, IMA-B 3,47%, IMA-B5 2,50% e IMA-B5+ 4,47% e na renda variável os índices ficaram negativos: IBOV -1,53%, o Índice Small Cap. -2,29%, IBRX 50 -1,81%. 1) Análise da carteira de novembro/2021: O comitê analisou a carteira fechada de novembro/2021. O patrimônio do IPMJ no fechamento do mês de novembro de 2021 foi de R\$ 619.884.986,94 (Seiscentos e dezenove milhões, oitocentos e oitenta e quatro mil e noventa e quatro centavos). A carteira de renda fixa rendeu R\$ 5.777.199,87 (cinco milhões e setecentos e setenta e sete mil e cento e noventa e nove reais e oitenta e sete centavos). Com a carteira de renda variável a rentabilidade foi de R\$ -2.365.706,09 (dois milhões e trezentos e sessenta e cinco mil e setecentos e seis reais e nove centavos negativos). A carteira do exterior rendeu R\$ -1.232.315,75 (um milhão e duzentos e trinta e dois mil e trezentos e quinze reais e setenta e cinco centavos negativos), nota-se um desenquadramento passivo no Artigo 9º, em 0,54%, entretanto, o instituto ainda está dentro do prazo de 180 dias para realizar as devidas movimentações para correção e encontra-se estudando a situação. Assim, a rentabilidade da carteira no mês de novembro de 2021 foi de R\$ 2.179.178,04 (dois milhões e cento e setenta e nove mil e cento e setenta e oito reais e quatro centavos). O rendimento acumulado no ano fechou o mês de novembro de 2021 em R\$ -3.526.500,55 (três milhões e quinhentos e vinte e



seis mil e quinhentos reais e cinquenta e cinco centavos negativos). A rentabilidade da carteira no mês de novembro foi de 0,33%, atingindo 27,57% da meta atuarial mensal e o desempenho da carteira ficou em -1,03% no ano, atingindo -7,38% da meta atuarial anual. Ressalta-se ainda que, no mês de novembro, foram realizadas as seguintes compras de títulos públicos: em 23/11/2021 NTN-B 2023, PU 3.778,59381100, taxa indicativa de IPCA + 5,30, quantidade 529, de valor total R\$ 1.998.876,13; NTN-B- 2024, PU 3.856,68915800, taxa indicativa de IPCA + 5,3450, quantidade 518, de valor total R\$ 1.997.764,98. No mês de novembro também o pagamento dos cupons semestrais de títulos públicos de ano ímpar, no valor total de R\$ 1.118.493,21 (um milhão e cento e dezoito mil e quatrocentos e noventa e três reais e vinte e um centavos). 2) Análise parcial da carteira. O comitê analisou a carteira de investimentos com posição em 10 de dezembro de 2021. O patrimônio do IPMJ apresenta R\$ 629.539.880,82 (seiscentos e vinte e nove milhões e quinhentos e trinta e nove mil e oitocentos e oitenta reais e oitenta e dois centavos). A carteira de renda fixa rendeu R\$ 1.086.911,09 (um milhão e oitenta e seis mil e novecentos e onze reais e nove centavos). No acumulado do ano a renda fixa está com a rentabilidade de R\$ 1.058.024,00 (um milhão e cinquenta e oito mil e vinte e quatro reais). A rentabilidade da carteira de renda variável está em R\$ 8.636.262,60 (oito milhões e seiscentos e trinta e seis mil e duzentos e sessenta e dois reais e sessenta centavos). No acumulado do ano a rentabilidade da renda variável apresenta R\$ -1.307.115,35 (um milhão e trezentos e sete mil e cento e quinze reais e trinta e cinco centavos negativos). A carteira do exterior rendeu R\$ 7.720,15 (sete mil e setecentos e vinte reais e quinze centavos). No acumulado do ano os fundos do exterior têm rentabilidade de R\$ 6.453.484,64 (seis milhões e quatrocentos e cinquenta e três mil e quatrocentos e oitenta e quatro reais e sessenta e quatro centavos). A rentabilidade dos fundos da carteira no mês de dezembro até 10/12 foi de 1,56%, atingindo 331,38% da meta atuarial mensal, quanto desempenho anual da carteira foi atingido 0,51% no ano, atingindo 3,48% da meta atuarial anual; 3) Fundo Patria Special Opportunies I - FIC FIP: O Sr Vanderlei informou que recebemos o relatório do "Dia do Investidor" referente ao fundo Pátria Special Oppotunities I. Resultados apresentados no relatório: Market Consensus Indicator (MCI) tem como principal objetivo facilitar as decisões de investimento dos usuários, em uma escala de 0 (venda forte) a 5 (compra forte), obteve resultado zero, já na evolução da Receita Operacional Líquida o fundo apresentou de jan/21 a set/21 resultados - 53% e o plano de retomada (jan/21 a set/21) e 57% do resultado realizado entre jan/19 a set/149. Com relação aos próximos passos apresenta a busca de oportunidades de desinvestimentos, negociar com credores e preservar o fluxo de caixa e continuar otimizando as operações dos shoppings. Os resultados não apontam melhora no fundo. O IPMJ recebeu o convite e participou de uma reunião com os institutos de Diadema e Paraguaçu Paulista com a finalidade de avaliar ações em conjunto. 4) Fundo Santos Credit



Yield Fundo de Investimento RF Credito Privado: Em relação ao fundo Santos Credit Yield Fundo de Investimento RF Credito Privado, CNPJ 04.877.280/0001-71, em assembléia realizada no dia 7 de dezembro/2021 as 10h00, os cotistas definiram pela liquidação do fundo, o IPMJ se absteve, sendo os valores incorporados pelo fundo MACROINVEST II FIRF Referenciado DI, CNPJ 28.365.488/0001-04. O resgate desse fundo já está disponível e irá ficar aberto por 60 dias, após será depositado em juízo. 5) Relatório Mensal: Atendendo a uma solicitação do Gestor de Recursos de se ter um relatório mensal contendo os resultados da carteira de investimentos do mês anterior, a aderência a política de investimentos e o acompanhamento de fundos estressados, sendo este a ser elaborado pela Unidade de Investimentos, o Sr Amauri apresentou um modelo para aprovação com dados referente a novembro de 2021, o qual se encontra anexo a esta ata. O modelo foi aprovado pelo Gestor de Recursos; 6) Assuntos Diversos: Envio do DPIN ficou para 31 de março de 2022. O Gestor dos Recursos, Sr. Vanderlei sugere que para elaboração da Política de Investimentos e enquadramento dos fundos na nova Resolução 4.963, suporte no acompanhamento e análise dos fundos estressados, e apoio ao Comitê de Investimentos, que seja realizada a contratação de uma consultoria financeira/investimentos, a Sra Rossana solicitou ao Sr. Amauri que elaborasse o escopo do serviço a ser presto com valor aproximado para sua análise e decisão. "Os presentes analisaram a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês 11/2021 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos, o qual deve ser encaminhado ao Conselho Fiscal para aprovação". Nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 16h26. Eu, Amauri Arnaldo Junior Amauri, servidor efetivo do Instituto de Previdência do Município de Jacareí, lavrei a presente ata que será assinada pelos membros do Comitê presentes. *****

Rossana Vasques

Renata de Souza Santos Esteves

Amauri Arnaldo Junior

Vanderlei Massarioli