

**IPREM***Instituto de Previdência Municipal
Mogi das Cruzes -SP*

COMITÊ DE INVESTIMENTOS – Decreto 12.786/2012

ATA DA 05ª REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA (25/10/2023) DO EXERCÍCIO DE 2023 DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO IPREM – INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE MOGI DAS CRUZES

Aos vinte e cinco dias do mês de outubro do ano de dois mil e vinte e três, na sala de reuniões do IPREM – Instituto de Previdência Municipal de Mogi das Cruzes, instalada no 2º andar do prédio sede da Prefeitura Municipal de Mogi das Cruzes, às quatorze horas, reuniu-se o Comitê de Investimentos dos Recursos do IPREM - Instituto de Previdência de Mogi das Cruzes - para a 05ª Reunião Extraordinária do exercício de 2023, conforme convocação realizada pelo sr. presidente do Comitê através de e-mail. Presentes presencialmente Pedro Ivo, diretor superintendente, os membros do Comitê Edson, Teofilo, Rafael, Poliana, e Paulo, por via digital, e Vitor Pavan, da Crédito e Mercado. Dando início a apresentação do relatório da ALM (Asset Liability Management), que objetiva um melhor entendimento dos riscos inerentes à gestão dos recursos e propõe-se a diagnosticar a melhor Alocação Estratégica dos ativos, considerando o fluxo de suas obrigações definidas em seu cálculo atuarial. Por questões técnicas, Sr. Paulo não conseguiu se conectar de forma adequada para ouvir a apresentação, e foi dado continuidade para não atrasar a apresentação.

ANÁLISE DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO (ATIVO)

Ressaltou-se o Patrimônio Líquido dos investimentos de R\$ 937.666.820,33, em 56 ativos (carteira de investimentos de agosto de 2023). Apresentado gráfico que mostram as 10 maiores por participação do ativo, porém, os fundos podem omitir a participação em quais ativos eles alocam, de acordo com a cm 175, 3 meses passou a serem 6 meses, Vitor irá ver se consegue atualizar o prazo por conta disso e enviar novamente.

Poliana e Pedro tiveram que se ausentar da apresentação em razão de outra reunião marcada em urgência.

ANÁLISE DE RISCO

É utilizado VAR, envolve fatores da parte histórica, mudanças que ocorreram afetaram na carteira, estimando perda máxima esperada para dias úteis (DU). O risco da carteira do IPREM está confortável dentro dos riscos.

Risco de Crédito

É a possibilidade de perda de capital diante do não cumprimento de obrigação por alguma instituição financeira. O risco da carteira do IPREM está confortável dentro dos riscos, por ter ativos alocados em instituições com boa reputação.

Risco de liquidez

Instituto de Previdência Municipal de Mogi das Cruzes – IPREM

Av. Vereador Narciso Yague Guimarães, nº 277 – Centro Cívico – Mogi das Cruzes – São Paulo – CEP 08780-900

Fone: (11) 4798-5076 – <http://www.iprem.pmmc.com.br> / E-mail: iprem@mogidascruzes.sp.gov.br

Hash SHA256 do PDF original #e1843c2fcd23374aca84595667328e31463ab364e466e1fe280b5b477ad3b0f2

<https://valida.ae/34d13afdcc7cfed72b7a8e770ddc9c474dfa607c679c36e54>





IPREM

Instituto de Previdência Municipal
Mogi das Cruzes -SP

Temos investimentos com cupom semestral e uma boa parte da carteirinha em d+30.

PROGNÓSTICO DE CARTEIRA

A Fronteira Eficiente explica como investidores racionais irão usar o princípio da diversificação para otimizar as suas carteiras de investimentos, e como um ativo arriscado deve ser precificado. Destaque na matriz Risco contra Retorno, com data desde 2013.

Pelas métricas da Secretaria de Previdência em 15,25 anos, aproximando-se da Duration da Carteira Eficiente 06, que possui a composição da carteira disposta no slide 24.

SIMULAÇÕES DE LONGO PRAZO (CENÁRIO BASE)

Utilizou-se dados do relatório Focus e projeções próprias da Credito e Mercado.

CASH FLOW MATCHING – CFM (IMUNIZAÇÃO DO PASSIVO)

É o processo de hedge no qual uma empresa ou outra entidade combina suas saídas de caixa (ou seja, obrigações financeiras) com suas entradas de caixa ao longo de um determinado horizonte de tempo. Destaca-se o slide 35, que mostra o máximo que pode ser colocado em cada investimento de acordo com a data de vencimento.

Finalizando a apresentação, Sr Vitor agradeceu a atenção de todos e se dispôs a marcar outra reunião para eventuais dúvidas, se for o caso. O presidente do comitê, Rafael, deu por encerrada a apresentação, e eu, Edson S Takimoto, lavro a presente ata que segue assinada por todos.

Edson Shigueaki Takimoto

Rafael Ballestero

Téofilo Ivo Pucha

Poliana Lima

Paulo Marrano Feijó (on line)

Pedro Ivo Campos Barbosa



Página de assinaturas



edson takimoto
418.435.058-51
Signatário



Pedro Barbosa
251.486.758-45
Signatário



Teofilo Pucha
063.755.978-97
Signatário



Poliana Noronha
097.039.274-59
Signatário



Rafael Balletero
323.134.228-79
Signatário



Paulo Feijó
671.414.718-04
Signatário

HISTÓRICO

- 07 nov 2023** 09:16:34  **edson shigueaki takimoto** criou este documento. (E-mail: edson.iprem@mogidascruzes.sp.gov.br, CPF: 418.435.058-51)
- 07 nov 2023** 09:16:34  **edson shigueaki takimoto** (E-mail: edson.iprem@mogidascruzes.sp.gov.br, CPF: 418.435.058-51) visualizou este documento por meio do IP 189.109.252.36 localizado em Campinas - Sao Paulo - Brazil
- 07 nov 2023** 09:16:38  **edson shigueaki takimoto** (E-mail: edson.iprem@mogidascruzes.sp.gov.br, CPF: 418.435.058-51) assinou este documento por meio do IP 189.109.252.36 localizado em Campinas - Sao Paulo - Brazil
- 07 nov 2023** 10:41:47  **Paulo Marrano Feijó** (E-mail: paulofeijo45@gmail.com, CPF: 671.414.718-04) visualizou este documento por meio do IP 177.45.72.65 localizado em Mogi das Cruzes - Sao Paulo - Brazil



- 07 nov 2023**
14:34:23  **Paulo Marrano Feijó** (E-mail: paulofeijo45@gmail.com, CPF: 671.414.718-04) assinou este documento por meio do IP 177.63.200.162 localizado em Poa - Sao Paulo - Brazil
- 07 nov 2023**
09:33:30  **Poliana De Lima Noronha** (E-mail: poliana.noronha@cmmc.com.br, CPF: 097.039.274-59) visualizou este documento por meio do IP 200.229.233.200 localizado em Mogi das Cruzes - Sao Paulo - Brazil
- 07 nov 2023**
12:26:37  **Poliana De Lima Noronha** (E-mail: poliana.noronha@cmmc.com.br, CPF: 097.039.274-59) assinou este documento por meio do IP 200.229.233.200 localizado em Mogi das Cruzes - Sao Paulo - Brazil
- 07 nov 2023**
09:19:16  **Pedro Ivo Campos Barbosa** (E-mail: iprem@mogidascruzes.sp.gov.br, CPF: 251.486.758-45) visualizou este documento por meio do IP 189.109.252.36 localizado em Campinas - Sao Paulo - Brazil
- 07 nov 2023**
09:22:36  **Pedro Ivo Campos Barbosa** (E-mail: iprem@mogidascruzes.sp.gov.br, CPF: 251.486.758-45) assinou este documento por meio do IP 189.109.252.36 localizado em Campinas - Sao Paulo - Brazil
- 07 nov 2023**
12:27:50  **Rafael Ballestero** (E-mail: rafaball@gmail.com, CPF: 323.134.228-79) visualizou este documento por meio do IP 179.106.34.205 localizado em São Paulo - Sao Paulo - Brazil
- 07 nov 2023**
12:27:59  **Rafael Ballestero** (E-mail: rafaball@gmail.com, CPF: 323.134.228-79) assinou este documento por meio do IP 179.106.34.205 localizado em São Paulo - Sao Paulo - Brazil
- 07 nov 2023**
10:12:58  **Teofilo Ivo Pucha** (E-mail: teopucha@yahoo.com.br, CPF: 063.755.978-97) visualizou este documento por meio do IP 191.249.51.22 localizado em São Paulo - Sao Paulo - Brazil
- 07 nov 2023**
10:13:55  **Teofilo Ivo Pucha** (E-mail: teopucha@yahoo.com.br, CPF: 063.755.978-97) assinou este documento por meio do IP 191.249.51.22 localizado em São Paulo - Sao Paulo - Brazil

