

FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA  
COMPLEMENTAR DO  
SERVIDOR PÚBLICO FEDERAL  
DO PODER EXECUTIVO



## ATA DE REUNIÃO

### ATA DA 9ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE RISCOS DE INVESTIMENTOS REALIZADA EM 14 DE NOVEMBRO DE 2023

**DATA, HORA E LOCAL:** Às quinze horas e seis minutos do décimo quarto dia do mês de novembro do ano de dois mil e vinte e três, por intermédio de ferramenta eletrônica de reuniões. **PRESENCAS:** Sr. Cristiano Rocha Heckert, Presidente do Comitê de Riscos de Investimentos; Sr. Júlio Alexandre Menezes da Silva, membro do Conselho Deliberativo; Sr. Rafael Liberal Ferreira de Santana, Gerente de Conformidade e Controles Internos; e Sra. Elvira Mariane Schulz, Coordenadora de Riscos de Investimentos; todos membros no exercício da titularidade do Comitê de Riscos de Investimentos (Coric). Presentes também a Sra. Cristina Araújo Santana, Coordenadora de *Compliance*; a Sra. Anna Rosa Alux Simão, Analista de Previdência Complementar; a Sra. Patrícia Brito de Ávila, Coordenadora de Secretariado e Órgãos Colegiados; e a Sra. Graciene Valdez Pereira Andrade, Analista de Previdência Complementar. **PARTICIPANTES EVENTUAIS:** Sr. Cícero Rafael Barros Dias, Diretor de Seguridade. **MESA:** Presidiu a sessão o Sr. Cristiano Rocha Heckert e a secretariou a Sra. Patrícia Brito de Ávila. **ORDEM DO DIA: Assuntos Deliberativos:** 1) Ordem do Dia; 2) Ata da Reunião Anterior; 3) Calendário de Reuniões e Plano Anual de Trabalho; **Assuntos Informativos:** 4) Recomendações dos Comitês de Assessoramento referentes ao documento de Gestão de Riscos a ser referenciado nas Políticas de Investimentos do PGA e dos Planos ExecPrev e LegisPrev; 5) Relatório de Gestão de Riscos de Investimentos - 3º trimestre 2023; 6) Conformidade legal dos investimentos da Diretoria de Investimentos; 7) Controle e monitoramento de limites de Alçadas nas Operações de Investimento e de Desinvestimentos da Funpresp-Exe; 8) Informes. **INSTALAÇÃO:** O Sr. Cristiano Rocha Heckert instalou a reunião e declarou abertos os trabalhos. **DELIBERAÇÕES:** **Item 1)** A ordem do dia foi aprovada pelos membros. **Item 2)** A ata da 8ª reunião ordinária do Comitê de Riscos de Investimentos está disponível para assinatura por meio de ferramenta eletrônica. **Item 3)** A Coordenação de Riscos de Investimentos apresentou proposta de Plano Anual de Trabalho do Comitê de Riscos de Investimentos para o ano de 2024, acompanhada da proposta de Calendário de Reuniões do colegiado. Os membros tomaram conhecimento do assunto e, após ajustes, já consolidados por esta Coordenação, deliberaram nos termos da Recomendação a seguir. **RECOMENDAÇÃO Nº 016:** O COMITÊ DE RISCOS

DE INVESTIMENTOS DA FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA COMPLEMENTAR DO SERVIDOR PÚBLICO FEDERAL DO PODER EXECUTIVO – FUNPRES-EXE, no uso de suas atribuições e, nos termos do art. 24, inciso XIV c/c art. 87 do Regimento Interno da Fundação, recomenda, à Diretoria Executiva, aprovar o Calendário de Reuniões e o Plano de Trabalho do Comitê de Riscos de Investimentos para o ano de 2024, conforme documentos anexos. **Item 4)** A Coordenação de Secretariado e Órgãos Colegiados deu conhecimento aos membros do Comitê das recomendações dos Comitês de Assessoramento Técnico dos Planos de Benefícios referentes ao documento de Gestão de Riscos a ser referenciado nas Políticas de Investimentos do PGA e dos Planos ExecPrev e LegisPrev. **Item 5)** Inicialmente, foi feita uma correção, tendo sido o item de pauta alterado de informativo para deliberativo. Na sequência, a Sra. Anna Rosa apresentou, por intermédio da Nota Técnica nº 24/2023/CORIN/GECCI/PRESI, de 3 de novembro de 2023, o Relatório de Gestão de Riscos de Investimentos referente ao 3º trimestre de 2023, que contempla os resultados do monitoramento dos riscos de mercado, de crédito, de liquidez e sistêmico. Após, o Sr. Julio da Silva indagou sobre as providências tomadas junto aos gestores dos fundos de investimento diante de eventual aumento de volatilidade constatado durante o monitoramento do risco de crédito, bem como sobre os reflexos no mercado da guerra deflagrada no dia 7 de outubro de 2023. A Sra. Anna Rosa esclareceu que há comunicação semanal entre os gestores e a Diretoria de Investimento e reuniões mensais entre Diretoria de Investimentos, gestores e Coordenação de Riscos de Investimentos, ocasiões em que todos os assuntos relevantes são tratados tempestivamente. Em relação ao conflito internacional, a Analista observou que não houve reflexos nos indicadores que a área técnica acompanha. Adicionalmente, em razão do monitoramento do risco sistêmico, a Sra. Elvira Schulz destacou informações extraídas do Relatório de Estabilidade Financeira do Banco Central do Brasil, publicado em 9 de novembro de 2023, evento subsequente ao fechamento do Relatório de Gestão de Riscos. Os membros do Comitê tomaram conhecimento do assunto, demandaram ajustes no documento e a inclusão das informações relativas ao referido Relatório e deliberaram nos termos da Resolução a seguir. **RESOLUÇÃO nº 001:** O COMITÊ DE RISCOS DE INVESTIMENTOS DA FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA COMPLEMENTAR DO SERVIDOR PÚBLICO FEDERAL DO PODER EXECUTIVO – FUNPRES-EXE, no uso de suas atribuições e, nos termos do art. 87, inciso XIV, do Regimento Interno da Fundação, resolve aprovar o Relatório de Gestão de Riscos de Investimentos referente ao 3º trimestre de 2023, com posterior encaminhamento à Diretoria Executiva, ao Conselho Fiscal, ao Comitê de Auditoria e ao Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado, para conhecimento. **Item 6)** Os membros do Comitê tomaram conhecimento do cumprimento regulatório das obrigações referentes ao processo de investimentos. **Item 7)** Os membros tomaram conhecimento das informações relativas a controle, monitoramento e enquadramento dos limites de alçada das operações de investimento e desinvestimento da Funpres-Exe referentes ao 3º trimestre de 2023. O monitoramento observa o disposto na Política de Alçadas da Funpres-Exe, aprovada por meio da Resolução CD nº 546, de 15 de dezembro de 2022, que estabelece limites para investimentos e desinvestimentos. **Item 8)** Tendo em vista o término do mandato do Diretor-Presidente no mês corrente, os membros do Coric parabenizaram o Sr. Cristiano

Heckert pelo trabalho executado e deram boas-vindas ao Sr. Cícero Dias, recentemente nomeado pelo Conselho Deliberativo para ocupar o cargo de Diretor-Presidente a partir de 30 de novembro de 2023, com votos de sucesso aos dois e reforço do comprometimento do Comitê no desempenho de suas atribuições nesse novo ciclo que se inicia. O Sr. Cristiano Heckert agradeceu as palavras dos membros e enfatizou o alto nível dos trabalhos técnicos realizados pela Corin e das discussões ocorridas no Comitê. Adicionalmente, destacou que, junto com o processo de migração desencadeado pela publicação da Medida Provisória nº 1.119, de 2022, a implementação da segregação dos riscos de investimentos na Fundação foi uma das realizações mais importantes efetuadas durante o período do seu mandato. **ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, o Sr. Cristiano Rocha Heckert, Presidente do Comitê de Riscos de Investimentos, encerrou a reunião às 16h07, na qual eu, Patrícia Brito de Ávila, secretária da reunião, lavrei e subscrevi esta Ata, que após lida e aprovada, segue assinada pelos presentes.

**Cristiano Rocha Heckert**

Presidente do Comitê

**Elvira Mariane Schulz**

Membro do Comitê

**Júlio Alexandre Menezes da Silva**

Membro do Comitê

**Rafael Liberal Ferreira de Santana**

Membro do Comitê

**Patrícia Brito de Ávila**

Secretária da Reunião



Documento assinado eletronicamente por **Rafael Liberal Ferreira de Santana, Membro do Comitê de Riscos de Investimentos**, em 24/11/2023, às 15:18, conforme horário oficial de Brasília, com fundamento no art. 6º, § 1º, do [Decreto nº 8.539, de 8 de outubro de 2015](#).



Documento assinado eletronicamente por **Elvira Mariane Schulz, Membro do Comitê de Riscos de Investimentos**, em 24/11/2023, às 15:23, conforme horário oficial de Brasília, com fundamento no art. 6º, § 1º, do [Decreto nº 8.539, de 8 de outubro de 2015](#).



Documento assinado eletronicamente por **Cristiano Rocha Heckert, Membro do Comitê de Riscos de Investimentos**, em 24/11/2023, às 15:38, conforme horário oficial de Brasília, com fundamento no art. 6º, § 1º, do [Decreto nº 8.539, de 8 de outubro de 2015](#).



Documento assinado eletronicamente por **Patrícia Brito de Ávila, Coordenadora**, em 24/11/2023, às 16:09, conforme horário oficial de Brasília, com fundamento no art. 6º, § 1º, do [Decreto nº 8.539, de 8 de outubro de 2015](#).



Documento assinado eletronicamente por **Julio Alexandre Menezes da Silva, Membro do Comitê de Riscos de Investimentos**, em 27/11/2023, às 09:58, conforme horário oficial de Brasília, com fundamento no art. 6º, § 1º, do [Decreto nº 8.539, de 8 de outubro de 2015](#).



A autenticidade deste documento pode ser conferida no site [https://sei.funpresp.com.br/sei/controlador\\_externo.php?acao=documento\\_conferir&id\\_orgao\\_acesso\\_externo=0](https://sei.funpresp.com.br/sei/controlador_externo.php?acao=documento_conferir&id_orgao_acesso_externo=0), informando o código verificador **0133057** e o código CRC **53397735**.

---

**Referência:** Caso responda este documento, indicar expressamente o Processo nº 03750.001003.000039/2023-51

SEI nº 0133057

Fundação de Previdência Complementar do Servidor Público Federal do Poder Executivo – Funpresp-Exe

SCN Q 2 BL A Corporate Financial Center Salas 201-204 - CEP 70712-900 -

<https://funpresp.com.br>