



ATA DE REUNIÃO

ATA DA 6ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE RISCOS DE INVESTIMENTOS REALIZADA EM 09 DE AGOSTO DE 2023

DATA, HORA E LOCAL: Às dez horas do nono dia do mês de agosto 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. Anna Rosa Alux Simão, Analista de Previdência Complementar; a Sra. Jamile Bilu Rodrigues, Coordenadora de Secretariado e Órgãos Colegiados, Substituta, e a Sra. Graciene Valdez Pereira Andrade, Analista de Previdência Complementar. **PARTICIPANTES EVENTUAIS:** Sr. Fabiano Soares dos Santos, Gerente de Análise, Planejamento e Pesquisa; e Sr. Anselmo Carvalho de Oliveira, Analista de Previdência Complementar. **MESA:** Presidiu a sessão o Sr. Cristiano Rocha Heckert e a secretariou a Sra. Jamile Bilu Rodrigues. **ORDEM DO DIA:** Assuntos Deliberativos: **1)** Ordem do Dia; **2)** Relatório Trimestral de Gestão de Riscos - 2º trimestre de 2023; e Assunto Informativo: **3)** Orçamento de Risco para Políticas de Investimentos; **4)** Acompanhamento de Crédito Privado; **5)** Controle e monitoramento de limites de Alçadas nas Operações de Investimento e de Desinvestimentos da Funpresp-Exe; **6)** 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 Sra. Elvira Schulz apresentou, por intermédio da POC nº 319/2023/CORIN/GECCI/PRESI/FUNPRESP-EXE, de 2 de agosto de 2023, o Relatório de Gestão de Riscos de Investimentos referente ao 2º trimestre de 2023, que contempla os resultados do monitoramento dos riscos de mercado, de crédito, de liquidez e sistêmico. Os membros do Comitê tomaram conhecimento do assunto, esclareceram suas dúvidas e deliberaram nos termos da Recomendação a seguir. **RECOMENDAÇÃO Nº 011:** O COMITÊ DE RISCOS DE INVESTIMENTOS DA FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA COMPLEMENTAR DO SERVIDOR PÚBLICO FEDERAL DO PODER EXECUTIVO – FUNPRESP-EXE, no uso de suas atribuições e, nos termos do art. 87, inciso XIV, do Regimento Interno da Fundação, recomenda, à Diretoria Executiva, aprovar o Relatório de Gestão de Riscos de Investimentos referente ao 2º trimestre de 2023. **Item 3)** Preliminarmente, o Sr. Fabiano Santos fez um panorama sobre o atual fluxo de governança empregado na revisão da Política de Investimentos dos planos administrados pela Funpresp-Exe, tendo em vista a segregação efetuada na gestão de riscos da Fundação. Na sequência, ele apresentou o Modelo de Otimização e Macroalocação subjacente à Política. Após, a Sra. Anna Rosa Simão apresentou, por intermédio da POC nº 320/2023/CORIN/GECCI/PRESI/FUNPRESP-EXE, de 2 de agosto de 2023, as simulações realizadas para definição de orçamento de risco para as carteiras Preservação e Performance, com o objetivo de subsidiar a elaboração das Políticas de Investimentos referentes ao período de 2024 a 2028. Os membros do Comitê discutiram o assunto e, objetivando o amadurecimento do tema, resolveram deliberar sobre ele em reunião extraordinária, agendada para a próxima quarta-feira, dia 16 de agosto, às 10h. **Item 4)** O item foi retirado de pauta e será apreciado em reunião futura do colegiado. **Item 5)** O item foi retirado de pauta e será apreciado em reunião futura do Comitê. **Item 6)** O item foi retirado de pauta e será apreciado em reunião futura do colegiado. **ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, o Sr. Cristiano Rocha Heckert, Presidente do Comitê de Investimentos e Riscos, encerrou a reunião às 11h32, na qual eu, Jamile Bilu Rodrigues, 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

Jamile Bilu Rodrigues

Secretária da Reunião



Documento assinado eletronicamente por **Jamile Bilu Rodrigues, Analista de Previdência Complementar**, em 11/09/2023, às 15:08, 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 12/09/2023, às 16:02, 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 12/09/2023, às 19:21, 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 13/09/2023, às 11:09, 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 **Rafael Liberal Ferreira de Santana, Membro do Comitê de Riscos de Investimentos**, em 20/09/2023, às 09:11, 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, informando o código verificador **0121807** e o código CRC **79A3F498**.

Referência: Caso responda este documento, indicar expressamente o Processo nº 03750.001003.000025/2023-38

SEI nº 0121807

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>