



ATA DE REUNIÃO

ATA DA 13ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE RISCOS DE INVESTIMENTOS

DATA: 10/07/2024

HORA: 9h10

LOCAL: Por meio de videoconferência

Sr. Cícero Rafael Barros Dias, 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).

PRESENCAS:

Presentes também a Sra. Cristina Araujo Santana, Coordenadora de Compliance; a Sra. Anna Rosa Alux Simão, Analista de Previdência Complementar, membros suplentes; a Sra. Mirza Maria Farias Pinto, Analista de Previdência Complementar; a Sra. Patrícia Brito de Ávila, Coordenadora de Secretariado e Órgãos Colegiados; a Sra. Graciene Valdez Pereira Andrade, Analista de Previdência Complementar; e o Sr. Douglas Araújo Ruas, Analista de Previdência Complementar.

CONVIDADOS: Sr. Silvano Costa Barbosa, Gerente de Controle de Investimentos, Substituto; Sr. Thales Maia Mendonça, Coordenador de Monitoramento de Investimentos., todos com participação parcial.

Verificado o quórum necessário, de acordo com o art. 31, Inciso II, do Regimento Interno da Funpresp-Exe, o Presidente do Comitê de Riscos de Investimentos instalou a reunião e declarou iniciados os trabalhos.

ASSUNTOS DELIBERATIVOS:

1) Ordem do Dia

A ordem do dia foi aprovada pelos membros do colegiado e seguiu a sequência:1, 2, 4, 5, 3, 6, 7 e 8.

2) Ata da Reunião Anterior

A ata da 12ª reunião ordinária foi assinada pelos membros do Comitê por meio de ferramenta eletrônica.

3) Relatório Trimestral de Gestão de Riscos - 1º trimestre 2024

A Sra. Anna Rosa Simão apresentou, por intermédio da Nota Técnica nº 14/2024/CORIN/GECCI/PRESI, de 10 de junho de 2024, constante do processo SEI nº 03750.030304.000010/2024-64, o Relatório de Gestão de Riscos de Investimentos referente ao 1º trimestre de 2024, que tem como objetivo fornecer informações sobre os riscos associados aos investimentos administrados pela Funpresp-Exe, em conformidade com o preconizado na Seção II, do Capítulo II, da Resolução CMN nº 4.994, de 24 de março de 2022. Os membros do Comitê tomaram conhecimento do assunto, deram sugestões de melhoria para as próximas edições do documento à Gerência de Conformidade e Controles Internos e deliberaram nos termos da Resolução a seguir.

RESOLUÇÃO nº 003: 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 1º trimestre de 2024, com posterior encaminhamento à Diretoria Executiva, ao Conselho Fiscal, ao Comitê de Auditoria e ao Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado, para conhecimento.

4) Proposta de critérios para avaliação dos investimentos em ativos de emissores privados quanto ao Risco de Imagem

A Sra. Elvira Schulz apresentou, por intermédio da Nota Técnica nº 12/2024/CORIN/GECCI/PRESI, de 10 de junho de 2024, constante do processo SEI nº 3750.030304.000010/2024-64, proposta que contém critérios para avaliação dos investimentos em ativos de emissores privados quanto ao risco de imagem para a Funpresp-Exe, considerando, sempre que possível, os aspectos relacionados à sustentabilidade ambiental, social e de governança. Os membros tomaram conhecimento do assunto e sugeriram a elaboração de um cronograma de para as ações necessárias à implantação completa da metodologia prevista para dezoito meses após a aprovação pela Diretoria Executiva, a ser apresentado como item informativo na próxima reunião do colegiado. Após, deliberaram nos termos da Recomendação a seguir.

RECOMENDAÇÃO nº 022: 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, nos termos do art. 87, inciso X, do Regimento Interno da Funpresp-Exe e da Nota Técnica nº 12/2024/CORIN/GECCI/PRESI, de 10 de junho de 2024, constante do processo SEI nº 3750.030304.000010/2024-64, recomenda, à Diretoria Executiva, aprovar a proposta de critérios para avaliação dos investimentos em ativos de emissores privados quanto ao risco de imagem para a Funpresp-Exe, conforme referida Nota Técnica.

5) Cálculo de rating interno para instituições bancárias referente ao exercício 2023

A Sra. Elvira Schulz apresentou, por intermédio da Nota Técnica nº 13/2024/CORIN/GECCI/PRESI, de 10 de junho de 2024, constante do Processo SEI nº 3750.030304.000003/2024-62, avaliação da situação econômico-financeira de instituições bancárias referente a dezembro de 2023, que conclui pelo não óbice quanto ao investimento em letras financeiras, sob a ótica de risco de crédito, cujos emissores sejam os bancos b1 dos segmentos S1 e S2 e que tenham rating interno nos níveis de 1 a 3, conforme Tabela 11 da referida Nota Técnica. Ademais, a Diretoria de Investimentos deve considerar, dentre outros aspectos, (i) os limites previstos na Resolução CMN nº 4.994, de 2022, nas Políticas de Investimentos vigentes e na Metodologia para Avaliação da Situação Econômico-Financeira de bancos (rating) antes da aplicação nas letras financeiras; (ii) as características do ativo e as condições de mercado; e (iii) a realização de investimentos preferencialmente em letras financeiras que não contenham cláusula de subordinação. Os membros do Comitê tomaram conhecimento do assunto e deliberaram nos termos da Recomendação a seguir.

RECOMENDAÇÃO nº 023: 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, nos termos do art. 87, inciso XV, do Regimento Interno da Funpresp-Exe e da Nota Técnica nº 13/2024/CORIN/GECCI/PRESI, de 10 de junho de 2024, constante do Processo SEI nº 3750.030304.000003/2024-62, recomenda à Diretoria Executiva aprovar a avaliação da situação econômico-financeira de instituições bancárias (rating) referente a dezembro de 2023, conforme documento anexo.

ASSUNTOS INFORMATIVOS:

6) Radar de Investimentos

O Sr. Silvano Barbosa apresentou o 'Radar de Investimentos' referente a junho de 2024. Segundo ele, em relação à carteira de investimentos consolidada da Fundação, observou-se rentabilidade negativa de 0,01% no mês, abaixo dos 0,54% do índice de referência. Esse resultado foi impactado principalmente pelo desempenho dos títulos públicos federais indexados ao IPCA; contudo, o resultado positivo dos ativos de renda variável local e no exterior suavizaram o desempenho desfavorável no mês. Com esse resultado, a carteira consolidada acumulou retorno positivo de 1,57% no ano, 7,16% em doze meses e 203,04% desde o início da Fundação, superando o índice de referência no longo prazo. Os membros do Comitê tomaram conhecimento do assunto.

7) Sistema front to back – reporte

O Sr. Thales Mendonça apresentou reporte sobre a implantação do sistema front to back. Os membros do Comitê tomaram conhecimento do assunto.

8) Informes

A Coordenação de Secretariado e Órgãos Colegiados informou sobre o prazo para que os membros apresentem as certificações em investimentos, em conformidade com o disposto no art. 85, parágrafo único, do Regimento Interno da Fundação.

Nada mais havendo a tratar, o Sr. Cícero Rafael Barros Dias, Presidente do Comitê de Riscos de Investimentos, encerrou a reunião às 11h38, na qual eu, Patrícia Brito de Ávila, secretária da reunião, lavrei e subscrevi esta Ata, que após lida e aprovada, segue assinada pelos presentes.

Cícero Rafael Barros Dias
Presidente do Comitê

Júlio Alexandre Menezes da Silva
Membro do Comitê

Elvira Mariane Schulz
Membra do Comitê

Rafael Liberal Ferreira de Santana
Membro do Comitê

Patrícia Brito de Ávila
Secretária da Reunião



Documento assinado eletronicamente por **Patrícia Brito de Ávila, Coordenadora**, em 30/07/2024, às 16:20, 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 31/07/2024, às 15:48, 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 31/07/2024, às 16:13, 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 **Júlio Alexandre Menezes da Silva, Membro do Comitê de Riscos de Investimentos**, em 05/08/2024, às 14:18, 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 **Cícero Rafael Barros Dias, Membro do Comitê de Riscos de Investimentos**, em 21/08/2024, às 17:18, 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 **0168779** e o código CRC **1A5C823**.

<https://funpresp.com.br>