



DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS – INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE OSASCO – IPMO – ATA DE 18/10/2021

Em 18 de outubro de 2021, às 14h00min., na sala de Reuniões do Gabinete da Presidência do IPMO, situado na Rua Avelino Lopes, nº 70, nesta cidade, reuniu-se o Comitê de Investimento deste Instituto, Dr. Ivo Gobatto Jr., Sr. Ricardo de Camargo Sanchez Pereira e o Sr. Francisco Pedro da Silva. Dando início aos trabalhos o Comitê de Investimentos, após breve análise da conjuntura econômica, novamente optou por manter as aplicações dos novos valores em Fundos DI's até melhores oportunidades do mercado.

Registramos no dia 18 de outubro de 2021 a aprovação de resgate no valor de R\$ 5.000.000,00 (Cinco milhões de reais), do Fundo BB PERFIL DI FIC RF REF PREF CNPJ: 13.077.418/0001-49. Bem como, para Aplicação de Recursos em Renda Fixa no valor de R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais), do Fundo CAIXA BRASIL IDKA IPCA2A TP LONGO PRAZO CNPJ: 14.386.926/0001-71. (Art. 7º, I, b). A análise da curva juros na parte longa e a atual instabilidade de mercado sugere decisões buscando maior proteção do capital. Justificamos a escolha devido ser um fundo com cotização/resgate D+0, sofrendo menores efeitos devido à volatilidade provocada pelos sucessivos aumentos SELIC. Sendo um dos únicos índices da Renda Fixa positivo atualmente. Trata-se de um Fundo com mais 3 anos de existência para parâmetro de avaliação. Analisando os resultados obtidos pelo fundo, temos 3,42% de performance do fundo contra 11,65% da meta no ano, 6,36% contra 16,17% em 12 meses, 14,26% contra 26,67% em 24 meses, 27,06% contra 37,31% em 36 meses respectivamente, o dobro do CDI em 12 meses e em 24 meses. Já a volatilidade de 2,42% está inferior ao benchmark 2,50%, possui ainda beta de 0,95, menor que o beta do índice de referência do mercado. Quando comparadas as opções BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CNPJ: 13.322.205/0001-35 e BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA CNPJ: 21.007.180/0001-03, optou-se por investir no fundo em função da maior rentabilidade no ano, em 12 meses, sendo a maior volatilidade justificada com maior retorno, resultando em maior Sharpe no ano. E aplicação de Recursos em Renda Fixa no valor de R\$ 2.000.000,00 (Dois milhões de reais), no Fundo SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO CNPJ: 21.595.829/0001-54- (ART.8º, III). A análise da curva de juros e os aumentos sucessivos da taxa Selic tem impactado diretamente os resultados da Renda Fixa, aumentando a necessidade de exposição da carteira na Renda Variável para compensação de rentabilidade. Trata-se de um Fundo com aproximadamente 6 anos de existência para parâmetro de avaliação. Analisando os resultados obtidos pelo Fundo, temos 18,82% de performance do fundo, contra 11,65% da meta no ano, 27,19% contra 16,17% em 12 meses, 48,48% contra 26,67% em 24 meses, 55,13% contra 37,31% em 36 meses respectivamente, ou seja, o fundo supera a meta atuarial com folga nos períodos analisados em sua lâmina de rentabilidades, demonstra este também ter superado o CDI (índice padrão do mercado para categoria Multimercado) no mesmo período. Já a Volatilidade de 15,53%, VaR 7,37% são maiores que o índice padrão do mercado, porém a melhor performance demonstra um bom risco retorno. Quando comparada com as opções CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP CNPJ: 30.036.235/0001-02 (já presente na carteira) e BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO CNPJ: 18.079.540/0001-78, optou-se por investir no fundo em função da rentabilidade equivalente, menor volatilidade, Sharpe Superior em 12 meses e o menor VaR em 12 meses, sendo importante na diversificação das estratégias utilizadas por diferentes gestores na mesma categoria de investimento.

Registramos no dia 18 de outubro de 2021 a aprovação de resgate no valor de R\$5.000.000,00 (Cinco milhões de reais), do fundo BB PREV ALOC ATIVA FIC FI RF CNPJ: 25.078.994-0001-90, para repor o saldo do Fundo BB PERFIL DI FIC RF REF PREV CNPJ: 13.077.418/0001-49, para manutenção das operações futuras, uma vez que com os sucessivos aumentos da taxa de juros SELIC, justifica-se aplicar em FUNDO DI, com taxa acumulada de 2,51% no ano e com maior expectativa de retorno durante o ciclo de aumentos Selic. A opção do resgate para esta operação baseou-se no resultado negativo do fundo durante o ano.



Registramos no dia 05 de outubro de 2021 FATO RELEVANTE, a RJI Corretora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda., inscrita no CNPJ/MF sob o nº 42.066.258/0002-11, com endereço no Município do Rio de Janeiro, Estado do Rio de Janeiro, na Rua do Ouvidor nº97, 7º andar, na qualidade de administradora do **TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA**, inscrito no CNPJ/MF sob o nº 13.594.637/0001-69, vem informar que o Fundo teve a carteira ajustada no dia 29 de setembro de 2021, em razão do aumento da Previsão de Devedores Duvidosos (“PDD”) no ativo da composição da carteira do Fundo denominado “CRI HABITASEC”, que passou a ser de 66%. Ressalta que o reprocessamento foi realizado após análise e definição do Comitê de Risco e Precificação interno da RJI.

Registramos no dia 06 de outubro de 2021 o EDITAL DE CONVOCAÇÃO do LME REC MULTISSETORIAL IPCA – FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS, inscritos no CNPJ/MF sob o nº 12.440.789/0001-80, nos termos do art.28, §1º da Instrução CVM356/2001 e do art.51, §1º do Regulamento do Fundo, convocados pela RJI Corretora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda., na qualidade de administradora do Fundo, para **Assembleia Geral de Cotistas a ser realizada no dia 21 de outubro 2021**, exclusivamente com envio de votos, dada a impossibilidade de realização da assembleia de forma presencial, com a seguinte **Ordem do Dia: 1)** Aprovação das Demonstrações Financeiras do Fundo do período 18 de agosto de 2020 a 30 de junho de 2021.

Registramos no dia 06 de outubro de 2021 a Renovação de Credenciamento do Administrador BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S/A., inscrita no CNPJ sob o nº 02.201.501/0001-61, administrador do Fundo presente em nossa carteira: **BRASIL FLORESTAL FIC FIP** inscrito no CNPJ sob o nº 15.190.417/0001-31. (Optamos por realizar a Renovação do credenciamento do Administrador mesmo faltando as declarações, pois o fundo já está presente em nossas carteiras e não receberá aportes).

Registramos no dia 07 de outubro de 2021 Renovação de Credenciamento do Gestor SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT, inscrita no CNPJ sob o nº CNPJ: 10.231.177/0001-52, empresa Gestora do Fundo presente em nossa carteira: **SANTANDER ATIVO FIC FI RF** inscrito no CNPJ sob o nº 26.507.132/0001-06. (Favorável a renovação de Credenciamento da Administradora, após consulta aos sites da CVM e BACEN, nada encontramos que desabone a administradora).

Registramos no dia 13 de outubro de 2021 Renovação de Credenciamento do Administrador INTRADER DTVM LTDA., inscrita no CNPJ sob o nº CNPJ: 15.489.568/0001-95, Administrador do Fundo presente em nossa carteira: **PIATÃ FI RF PREV CP LP** inscrito no CNPJ sob o nº 09.613.226/0001-32. (Optamos por realizar a Renovação do Credenciamento mesmo com o documento vencido, certidão de Débitos Relativos a Créditos Tributários Federais e a Dívida Ativa da União, pois o fundo administrado já está presente em nossa carteira, e não realizaremos novos aportes).

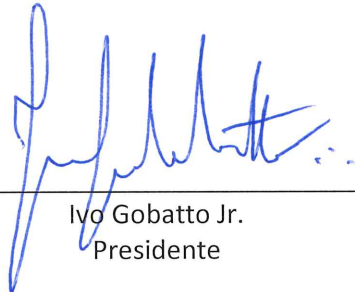
Registramos no dia 15 de outubro de 2021 Renovação de Credenciamento do Administrador PLANNER TRUSTEE DTVM LTDA. inscrita no CNPJ sob o nº CNPJ: 67.030.395/0001-46, Administradora dos Fundos presentes em nossa carteira: **PYXIS INST IMA-B FI RF** inscrito no CNPJ sob o nº 23.896.287/0001-85. **ILLUMINATI FIDC** inscrito no CNPJ sob o nº 23.033.577/0001-03. (Optamos por realizar a Renovação do credenciamento do Administrador mesmo faltando alguns documentos, pois o fundo já está presente em nossas carteiras e não receberá aportes).

Registramos no dia 18 de outubro de 2021 a Apreciação das APR's: 3169/2021 até 3179/2021, estando aprovadas por este Comitê de Investimentos.

Aprovação do Extrato Mensal de Investimentos de setembro/2021, pelo Comitê de Investimentos, demonstrando um saldo de R\$ 460.392.751,95 (quatrocentos e sessenta milhões, trezentos e noventa e dois mil, setecentos e cinquenta e um reais e noventa e cinco centavos) com um desempenho de -0,22% no mês e -0,15% no ano, contra 1,60% do IPCA+5,45% no mês e 11,21% acumulado no ano.

Aprovação do Relatório Mensal de Investimentos setembro/2021.

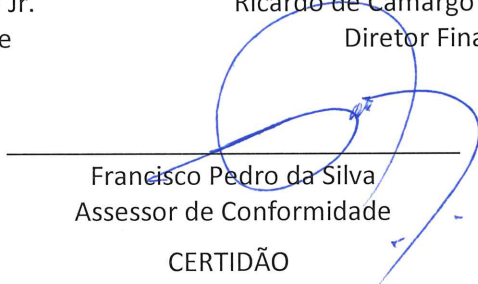
Nada mais havendo para decidir o Senhor Presidente deu por encerrada a reunião, determinando a lavratura desta Ata, que segue assinada pelos membros do Comitê de Investimentos deste Instituto.



Ivo Gobatto Jr.
Presidente



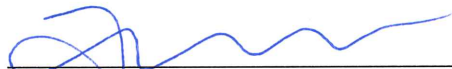
Ricardo de Camargo Sanchez Pereira
Diretor Financeiro



Francisco Pedro da Silva
Assessor de Conformidade

CERTIDÃO

Declaro para os devidos fins que as informações prestadas
acima foram lançadas por mim na ata, retratando
fielmente a discussão estabelecida.



Marcos Antonio da Cruz
Supervisor de Mercado Financeiro