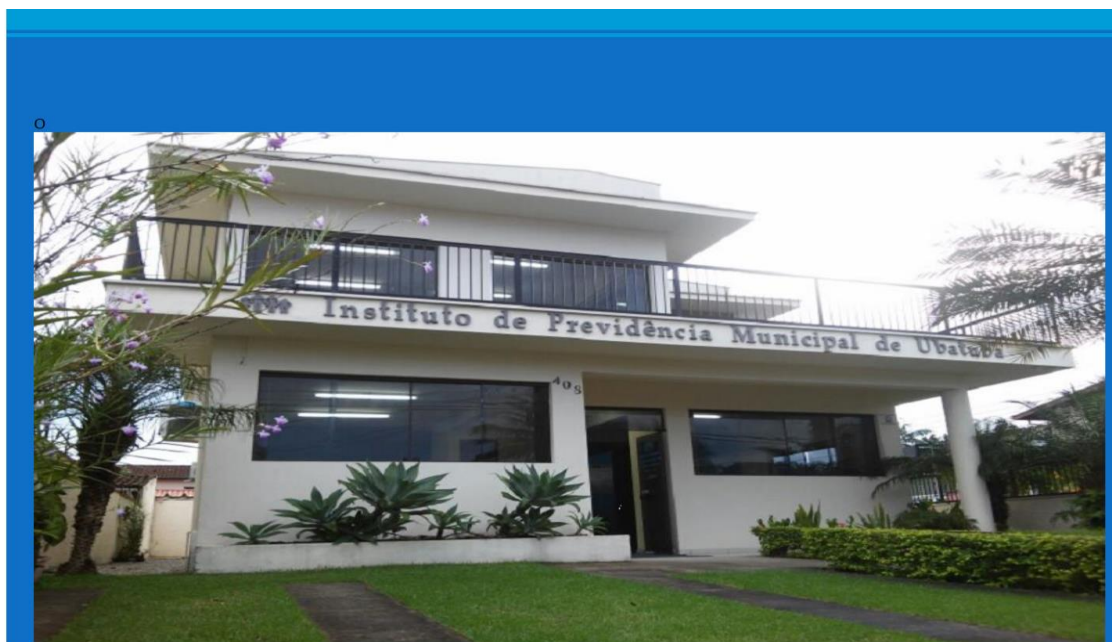


Controle Interno

Relatório de Investimentos

IPMU/093/2023

Através do processo financeiro “**IPMU/152/2023**”, a Diretoria Executiva do Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU atendeu as obrigações da Resolução 4.963/2021 e Portaria os relatórios da Portaria MPS 519/2011, apresentando as operações dos ativos alocados em fundos de investimentos de “Renda Fixa” e “Renda Variável”, mantidos pelo IPMU, aderência à Política de Investimentos e Meta Atuarial, referente ao mês de **outubro/2023**.

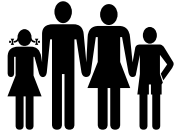


RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

OUTUBRO/2023

IPMU/152/2023





**Fluxo de Caixa dos
Investimentos
Projeção Orçamentária**

**Outubro/2023
IPMU/152/2023**

Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba - IPMU
Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

A análise do processo pelos membros do Comitê de Investimentos ocorreu nas reunião realizada no dia 14/11/2023.





Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba - IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba



O Comitê de Investimentos do **Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU**, fazendo uso da sua competência que lhe confere o Decreto nº 5.571/2012, Decreto nº 7.156/2019 e Portaria **IPMU nº 049/2022**, reunido no dia **14/11/2023**, para reunião, realizada na sede do IPMU, tendo como objetivo a deliberação sobre a pauta:

Relatório Gerencial das Aplicações Financeiras.

O Relatório Mensal com a finalidade de demonstrar o cenário econômico, as informações relevantes sobre os investimentos e apresentar a evolução patrimonial dos recursos financeiros do IPMU no mês, em consonância com a legislação em vigor, a transparência da gestão e a diligência dos produtos que compõem a carteira de investimentos do IPMU, atendendo ao Manual Pró-Gestão RPPS.

Cronograma mensal das atividades gerenciais (relatórios gerenciais financeiros) da Carteira de Investimentos do IPMU, conforme documentos acostados no processo **IPMU/152/2023**:

1. Acompanhamento da rentabilidade dos fundos de investimentos;
2. Acompanhamento da situação patrimonial, fiscal, comercial e jurídica das instituições investidas;
3. Acompanhamento dos indicadores de desempenho (mês, ano e 12 meses);
4. Acompanhamento e monitoramento dos riscos dos recursos investidos;
5. Aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos
6. Análise da performance dos fundos de investimentos;
7. Análise de Dispersão (rentabilidade diária/ valor do ativo/fundo de investimentos);
8. Análise de Liquidez;
9. Análise de Risco Sharpe;
10. Análise de Risco VaR (mês/ano);
11. Análise de Volatilidade (mês/ano);
12. Análise do comportamento do mercado (conjuntura macroeconômica);
13. Análise do patrimônio líquido dos fundos de investimentos;
14. Análise Quantitativa;
15. Aplicação por enquadramento;
16. Aplicação por estratégia;
17. Aplicação por gestor;
18. Aplicação por segmento (renta fixa, renda variável e exterior);
19. Credenciamento de fundos de investimentos;



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba - IPMU
Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU
Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

20. Credenciamento de instituição financeira;
21. Definição das estratégias de alocação;
22. Desempenho da Carteira de Investimentos (histórico);
23. Gestão de investimentos, considerando sua estrutura, propostas de aprimoramento;
24. Gráfico Desvio Padrão;
25. Gráfico Drawdown (mês);
26. Lâmina Comparação dos Ativos (mensal);
27. Lâmina dos fundos de investimentos (características/perfil do fundo/ retorno acumulado/ evolução patrimônio/ histórico/informações operacionais/enquadramento);
28. Limites das aplicações (enquadramento / estratégias de investimento/ segmento);
29. Matriz de correlação dos retornos (mês);
30. Monitoramento dos fundos de investimentos (cotas / patrimônio /cotistas);
31. Planilha de análise mensal de Correlação;
32. Planilha de análise mensal de Risco x Retorno;
33. Planilha de Distribuição;
34. Planilha de Resultado Atuarial x Resultado Financeiro;
35. Planilha dos Investimentos com base nos extratos;
36. Portfólio da Carteira Retorno (%);
37. Relatório Gerencial Mensal dos investimentos;
38. Relatório Meta Atuarial (mês, ano, 3 meses, 6 meses, 12 meses e 36 meses);
39. Rentabilidade da Carteira de Investimentos por Estratégia;
40. Rentabilidade da Carteira de Investimentos por fundo de investimentos;
41. Rentabilidade da Carteira de Investimentos por Gestor;
42. Resultado dos Investimentos (valorização/desvalorização).

Deliberação do Comitê de Investimentos.

Com base nos dados técnicos, análises financeiras, dados atualizados dos fluxos de caixas e dos investimentos com visão de curto, médio e longo prazo, propostas de investimentos e desinvestimentos foram aprovadas por unanimidade as estratégias de investimentos para alteração pontual da carteira de investimentos, na busca de reduzir a volatilidade da Carteira de Investimento nos fundos de Renda Fixa de curto prazo.

1) Banco Santander 150-8: Fundo Santander Renda Fixa Títulos Públicos, utilizar para cobertura da folha de pagamento dos aposentados e pensionistas.

2) Investimentos no Exterior: acompanhamento do mercado e da carteira de investimentos.

3) Renda Variável: acompanhamento do mercado e da carteira de investimentos.

4) Fundos Referenciado DI: aplicação das receitas com compensação previdenciária, contribuição previdenciária e juros semestrais da carteira de títulos públicos.



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba - IPMU
Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU
Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

- 5) **Banco Santander 350-0:** Migrar a aplicação para o fundo de investimentos Santander Renda Fixa Títulos Públicos, utilizar para cobertura da folha de pagamento dos aposentados e pensionistas.
- 6) **Banco Bradesco:** Migrar a aplicação para o fundo de investimento Bradesco Referenciado DI.

Tendo encontrado tudo em perfeita ordem e exatidão é de parecer que os mencionados documentos merecem integral análise por parte dos membros do Comitê de Investimentos, manifestando pela sua **CONFORMIDADE**.

O Parecer encaminhado para os membros do Conselho de Administração e Conselho Fiscal para apreciação.

Fernando Augusto Matsumoto
Diretor Financeiro IPMU
Certificação - Anbima CPA 10
CP RPPS CGINV I

Flávio Bellard Gomes
Membro Comitê de Investimentos
Certificação - Anbima CPA 10
CP RPPS CGINV I

Lucas Gustavo Ferreira Castanho
Membro Comitê de Investimentos
Certificação - CGRPPS
CP RPPS CGINV I

Luiz Alexandre de Oliveira
Controle Interno
CP RPPS CGINV I

Sirleide da Silva
Presidente do IPMU
Certificação - Anbima CPA 10
Certificação - CGRPPS
CP RPPS CGINV I

Marcelo da Cruz Lima
Membro Comitê de Investimentos
Certificação - Anbima CPA 10
CP RPPS CGINV I

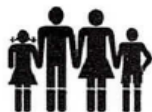
Wellington Diniz
Gestor de Recursos
Certificação - Anbima CPA 20
CP RPPS CGINV II



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba - IPMU
Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Na reunião do Conselho de Administração (21/11/2023) e do Conselho Fiscal (21/11/2023) foram aprovadas e ratificadas as estratégias de investimentos elaboradas pelo Comitê de Investimentos.





Parecer Conselho Fiscal Relatório de Investimentos

Conforme Lei Municipal nº 2.650 de 16 de Fevereiro de 2005, no desempenho de suas competências de que trata o Regimento Interno, os membros do Conselho Fiscal do Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba - IPMU, na reunião ordinária realizada nesta data, após a apresentação pelos membros do Comitê de Investimentos do **Relatório Financeiro** referente ao mês de **outubro de 2023** conforme processo **IPMU/152/2023** (análise conjuntural de mercado econômico, mercado financeiro e monitoramento das variáveis macroeconômicas, avaliação mensal de risco de mercado da carteira de Investimentos, análise de relatório de rentabilidade dos fundos de investimentos e acompanhamento da Política Anual de Investimentos - 2023) deliberaram por sua **APROVAÇÃO**, bem como as estratégias de investimentos adotadas até a presente data pelos membros do Comitê de Investimentos.

Ubatuba, 21 de novembro de 2023

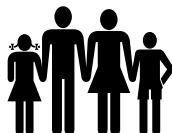
Antônio Carlos Berti Gomes
Membro Conselho Fiscal
CP RPPS COFIS I

Cícero José de Jesus Assunção
Membro do Conselho Fiscal
CP RPPS COFIS I

Edivan Silva Santos
Membro Conselho Fiscal

Ernely Fragoso
Membro Conselho Fiscal
CP RPPS COFIS I


Rozemara Mendes de Carvalho
Membro Conselho Fiscal
CP RPPS COFIS I

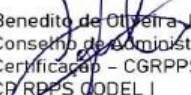



Parecer Conselho Administrativo
Relatório de Investimentos


Conforme Lei Municipal nº 2.650 de 16 de Fevereiro de 2005, no desempenho de suas competências de que trata o Regimento Interno, os membros do Conselho de Administração do Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba - IPMU, na reunião ordinária realizada nesta data, após a apresentação do **Relatório Financeiro** referente ao mês de **outubro de 2023** conforme processo **IPMU/152/2023** (análise conjuntural de mercado econômico, mercado financeiro e monitoramento das variáveis macroeconômicas, avaliação mensal de risco de mercado da carteira de Investimentos, análise de relatório de rentabilidade dos fundos de investimentos e acompanhamento da Política Anual de Investimentos - 2023), pelos membros do Comitê de Investimentos, deliberaram por sua **APROVAÇÃO**, bem como as estratégias de investimentos adotadas até a presente data pelos membros do Comitê de Investimentos.

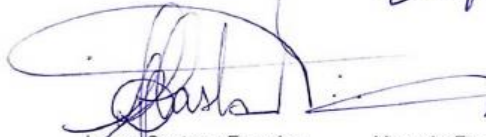
Ubatuba, 21 de novembro de 2023


Bruno Arruda de Oliveira
Conselho Administrativo
CP RPPS CODEL I



Benedito de Oliveira-Julio
Conselho de Administração
Certificação - CGRPPS
CP RPPS CODEL I



Flavio Bellard Gomes
Conselho Administrativo
Anbima CPA 10
CP RPPS CGINV I
CP RPPS CODEL I



Flavio Roberto Ribeiro
Conselho de Administração
CP RPPS CODEL I


Lucas Gustavo Ferreira
Castanho
Conselho de Administração
Certificação - CGRPPS
CP RPPS CGINV I
CP RPPS CODEL I


Marcelo Fernando Pereira
Conselho de Administração
CP RPPS CODEL I


Marcelo da Cruz Lima
Conselho de Administração
CP RPPS CGINV I
CP RPPS CODEL I


Maria de Fátima Mateus
Conselho de Administração
CP RPPS CODEL I


Silvia Moraes Stefani Lima
Conselho de Administração
CP RPPS CODEL I



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba - IPMU
Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Os documentos acostados no processo financeiro demonstra que o IPMU cumpriram as exigências da Portaria nº 1.467 de 02 de junho de 2022.

Desta forma, sugiro a regularidade das aplicações financeiras referentes ao mês de **outubro/2023**.

Ubatuba, 21 de novembro de 2023

Luiz Alexandre de Oliveira
Responsável pelo Controle Interno
Portaria IPMU nº 066/2022
Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba - IPMU

De acordo
Equipe de Controle Interno
Portaria IPMU nº 066/2022

Flávio Bellard Gomes
Membro do Conselho de Administração do
Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba

Antonio Carlos Berti Gomes
Membro do Conselho Fiscal do Instituto de
Previdência Municipal de Ubatuba

Ciente

Sirleide da Silva
Presidente do Instituto de Previdência
Municipal de Ubatuba