

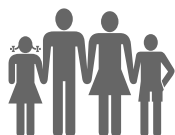


Plano de Ação 2023

Comitê de Investimentos

Relatório Anual de Atividades





1- Apresentação

O Comitê de Investimentos, órgão de deliberação vinculado ao Conselho de Administração, responsável para tomar decisões sobre a movimentação das aplicações financeiras do IPMU, atuará de forma colegiada, de acordo com as normas expedidas pelo Banco Central do Brasil, Comissão de Valores Mobiliários, Secretaria da Previdência Social, Tribunal de Contas do Estado de São Paulo e Política de Investimentos do IPMU.

O Comitê de Investimentos é composto por 05 membros, todos com direito a voz e voto.

São membros natos do Comitê de Investimentos:

- ✓ Presidente do IPMU
- ✓ Diretor Financeiro do IPMU

Serão membros indicados pelo Conselho de Administração do IPMU:

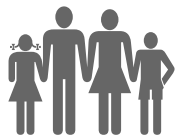
- ✓ 01 membro do Conselho de Administração eleito ou indicado
- ✓ 01 membro do Conselho de Administração responsável pela movimentação financeira juntamente como o Presidente e o Diretor Financeiro

O Comitê de Investimentos do IPMU foi instituído através do Decreto Municipal 5571/2012. Todos os membros do Comitê de Investimentos designados pela Portaria IPMU nº 049/2022, possuem certificação profissional através da prova da ANBIMA – CPA 10, atendendo parcialmente ao disposto no art. 2º da Portaria nº 519/2011 e alterações do MPS.

Membros a partir de 28/09/2022

Fernando Augusto Matsumoto	Diretor Financeiro
Sirleide da Silva	Presidente
Flávio Bellard Gomes	Membro do Conselho de Administração
Lucas Gustavo Ferreira Castanho	Membro do Conselho de Administração
Marcelo da Cruz Lima	Membro do Conselho de Administração

O Comitê de Investimentos do IPMU, em atendimento ao Programa de Certificação Institucional e Modernização da Gestão dos Regimes Próprios de Previdência Social da União, dos Estados, do Distrito Federal e dos Municípios, instituído pela Portaria MPS Portaria MPS nº 185/2015, apresenta Relatório de Prestação de Contas do exercício de 2023, com a síntese dos trabalhos realizados e demais considerações sobre suas atividades realizadas no exercício.



2- Das Reuniões

O Comitê de Investimentos do IPMU funciona através de reuniões ordinárias e extraordinárias. As reuniões ordinárias realizar-se-ão mensalmente, em data, hora e local segundo calendário aprovado para o exercício de 2023.

No exercício de 2023 foram realizadas 12 reuniões ordinárias e 07 reunião extraordinária:

Extraordinária

27/02/2023

29/03/2023

15/05/2023

28/09/2023

Ordinária

20/01/2023

13/02/2023

21/03/2023

25/04/2023

18/05/2023

21/06/2023

20/07/2023

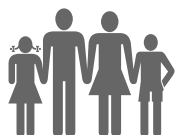
25/08/2023

26/09/2023

24/10/2023

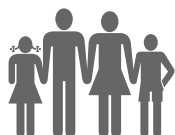
14/11/2023

14/12/2023

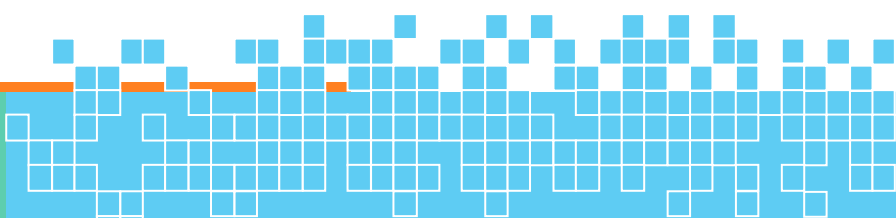


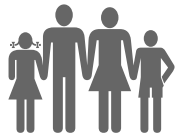
Reunião 20/01/2023





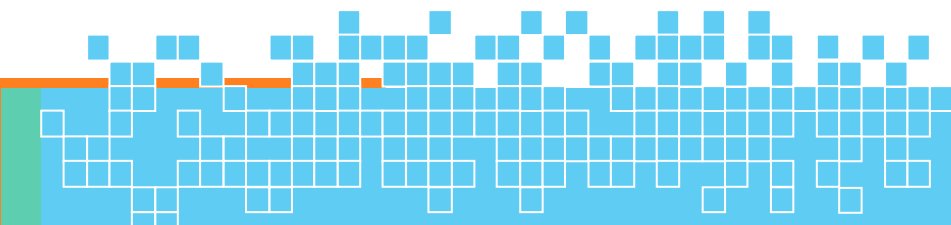
Reunião 13/02/2023

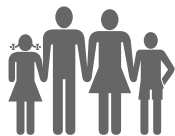




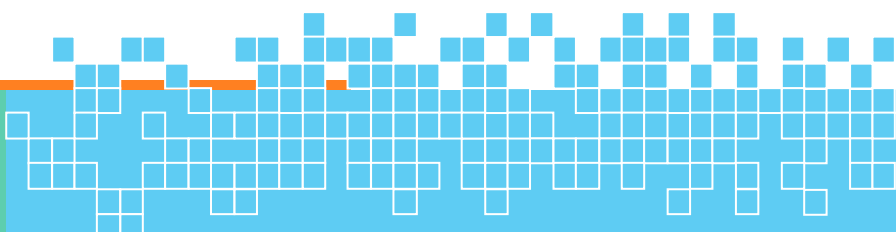
Reunião 27/03/2023

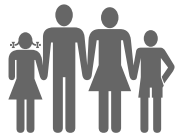
The collage displays several screenshots from a Zoom meeting. The top-left screenshot shows a slide titled 'Comparativo x CDI - Fundos DI' with a table of data. The top-middle screenshot shows a line graph titled 'Americanas' with the subtitle 'Spread Crédito'. The top-right screenshot shows a grid of video thumbnails of participants. The middle-left screenshot shows a grid of video thumbnails. The middle-right screenshot shows a grid of video thumbnails. The bottom-left screenshot shows a grid of video thumbnails. The bottom-middle screenshot shows a table titled 'INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UB' with columns for 'Família', 'Fundo', 'Saldo Líquido', 'Bônus', and 'Térmo'. The bottom-right screenshot shows a chat window titled 'Chat de reunião' with messages from participants.



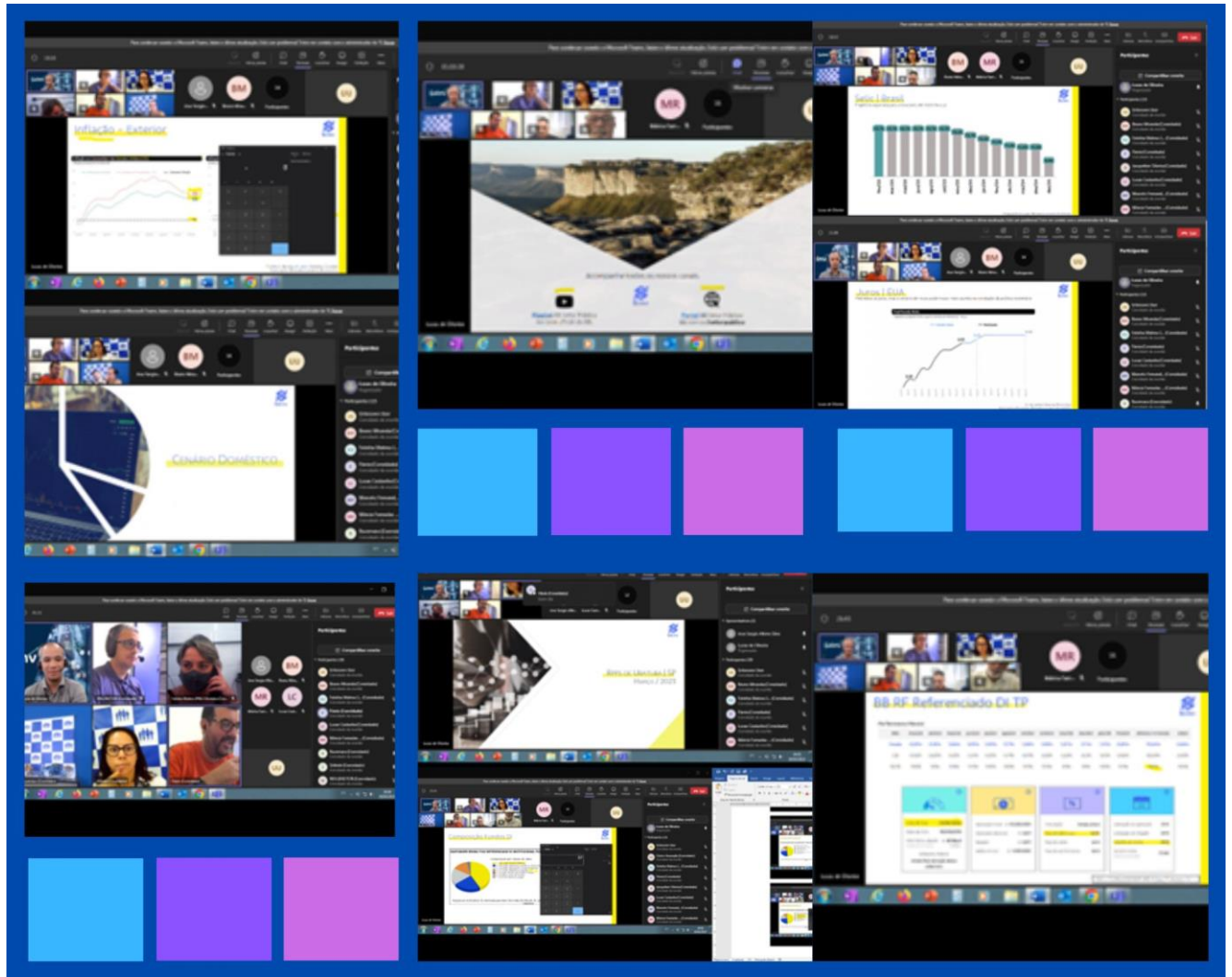


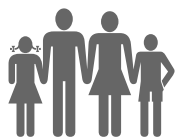
Reunião 21/03/2023





Reunião 29/03/2023



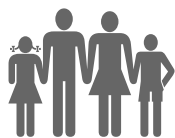


Reunião 25/04/2023



Reunião 15/05/2023



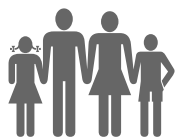


Reunião 18/06/2023

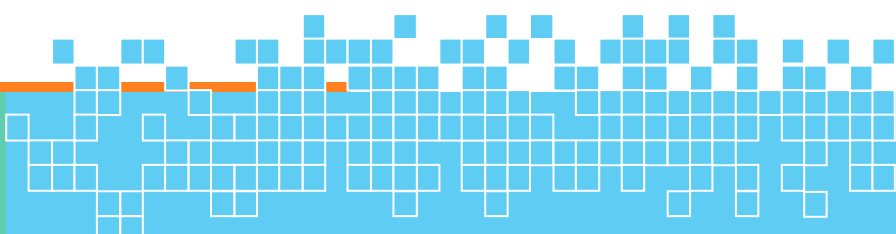
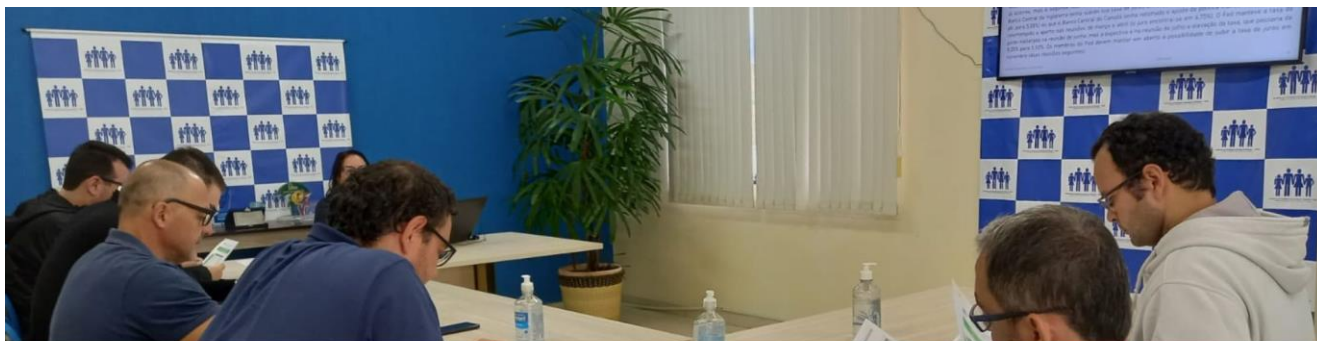


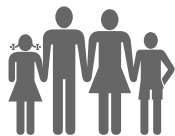
Reunião 21/06/2023





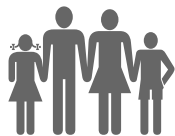
Reunião 20/07/2023





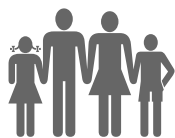
Reunião 25/08/2023



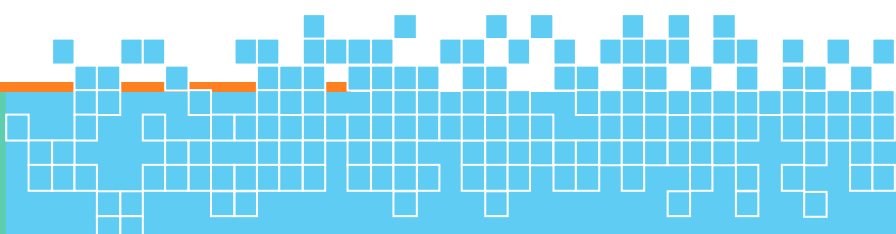


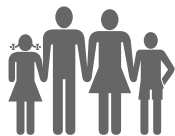
Reunião 26/09/2023





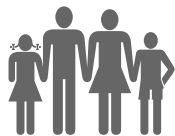
Reunião 24/10/2023





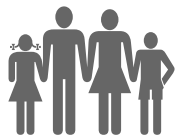
Reunião 14/11/2023





Reunião 14/12/2023

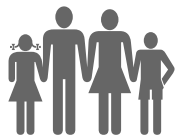




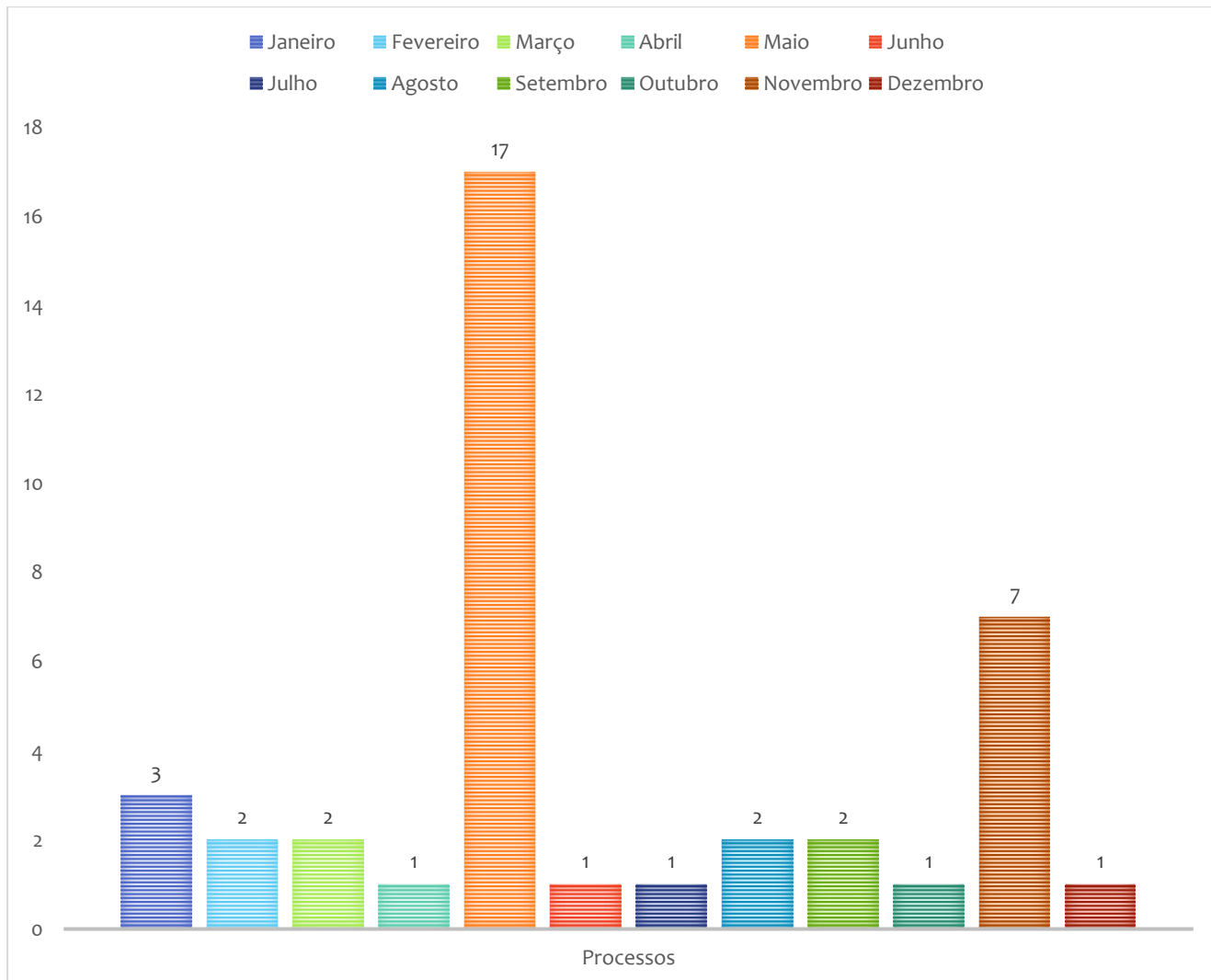
3- Síntese dos Trabalhos

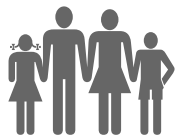
Conforme legislação vigente, ao Comitê de Investimentos do IPMU compete:

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 conforme Resolução CMN 3922/2010;
16. Aplicação por estratégia;
17. Aplicação por gestor;
18. Aplicação por segmento (renta fixa, renda variável e exterior);
19. Credenciamento de fundos de investimentos;
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).



No ano de 2023, os membros do Comitê de Investimentos analisaram **40** (quarenta) processos:





Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Os documentos analisados pelos membros do Comitê de Investimentos do IPMU ao longo do ano de 2023 trataram de: investimentos, credenciamento de fundos de investimentos, credenciamento de gestores, credenciamento de administradores, credenciamento de custodiante e outros assuntos de contexto econômico e financeiro:

BTG Pactual

Apresentação de Gabriel Kami, representante do BTG Pactual Asset Management

IPMU/003/2023

Relatório Gerencial das Aplicações Financeiras (janeiro/2023)

IPMU/024/2018

Bradesco Alocação Dinâmica (análise de fundo de investimentos)

IPMU/036/2023

Relatório Gerencial das Aplicações Financeiras (fevereiro/2023)

Relatório Gerencial das Aplicações Financeiras (fundos de investimentos Banco do Brasil)

IPMU/037/2022

BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA 2023 (análise)

IPMU/045/2023

Santander Renda Fixa DI Títulos Públicos Premium FIC FI (análise de credenciamento)

Santander Títulos Públicos Premium (análise de fundo de investimentos)

IPMU/049/2022

Caixa Brasil Títulos Públicos Renda Fixa 2023 (análise)

IPMU/050/2023

Relatório Gerencial das Aplicações Financeiras (março/2023)

IPMU/062/2023

Relatório Gerencial das Aplicações Financeiras (abril/2023)

IPMU/071/2023

BB Previdenciário RF IRFM 1 Títulos Públicos FIC FI (análise de credenciamento)

Bradesco Federal Extra FI Renda Fixa Referenciado DI (análise de credenciamento)

Bradesco FIC FI Renda Fixa Crédito Privado Longo Prazo Inflação (análise de credenciamento)

Bradesco Premium FI Renda Fixa Referenciado DI (análise de credenciamento)

IPMU/072/2022

Bradesco Premium FI Renda Fixa Referenciado DI (análise de credenciamento)

IPMU/072/2023

BB Previdenciário RF IRFM Títulos Públicos FI (análise de credenciamento)

BB Previdenciário RF Referenciado DI TP FI LP (análise de credenciamento)

IPMU/073/2023

Constância Absoluto FI Multimercado (análise de credenciamento)

Constância FIFE FI Multimercado Previdenciário Crédito Privado (análise de credenciamento)

Constância Icatu FI Multimercado Previdenciário Crédito Privado (análise de credenciamento)

IPMU/078/2023

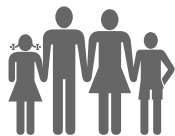
Relatório Gerencial das Aplicações Financeiras (maio/2023)

IPMU/082/2023

Caixa Brasil Matriz Renda Fixa (análise de credenciamento)

Caixa Brasil Renda Fixa Referenciado DI Longo Prazo (análise de credenciamento)

Caixa Brasil Títulos Públicos Longo Prazo (análise de credenciamento)



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

IPMU/092/2023

Relatório Gerencial das Aplicações Financeiras (junho/2023)

IPMU/096/2023

Relatório Gerencial das Aplicações Financeiras (junho/2023)

IPMU/098/2017

Santander Ativo Renda Fixa (análise de fundo de investimentos)

IPMU/129/2023

Relatório Financeiro

IPMU/135/2023

Relatório ALM Asset Liability Management

IPMU/143/2023

Relatório Financeiro

IPMU/152/2023

Relatório Financeiro

IPMU/165/2023

Estoril Investimentos (credenciamento de fundos de investimentos)

IPMU/173/2023

Relatório Financeiro

IPMU/174/2023

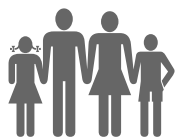
Política de Investimentos 2024

IPMU/192/2022

Plural Dividendos Fundo de Investimentos Ações (análise de credenciamento)

Relatório Gerencial das Aplicações Financeiras (dezembro/2023)

Taruá FIC FIA (análise de credenciamento)

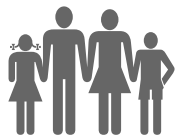


18/12/2023, 15:18

Atas do Comitê de Investimentos – IPMU

Atas do Comitê de Investimentos – IPMU

ANO	REFERÊNCIA	TAMANHO	TIPO
2023	01/ Janeiro (20 01 2023)	56.5 MiB	pdf
2023	02/ Fevereiro (13 02 2023)	9.9 MiB	pdf
2023	02/ Fevereiro (27 02 2023)	10.6 MiB	pdf
2023	03/ Março (21 03 2023)	179.7 KiB	pdf
2023	03/ Março (29 03 2023)	173.7 KiB	pdf
2023	04/ Abril (25 04 2023)	230.1 KiB	pdf
2023	05/ Maio (15 05 2023)	193.1 KiB	pdf
2023	05/ Maio (18 05 2023)	239.7 KiB	pdf
2023	06/ Junho (21 06 2023)	243.3 KiB	pdf
2023	07/ Julho (20 07 2023)	233.0 KiB	pdf
2023	08/ Agosto (25 08 2023)	252.2 KiB	pdf
2023	09/ Setembro (26 09 2023)	222.1 KiB	pdf
2023	09/ Setembro (28 09 2023)	290.4 KiB	pdf
2023	10/ Outubro (24 10 2023)	34.1 MiB	pdf
2023	11/ Novembro (14 11 2023)	11.5 MiB	pdf
2023	12/ Dezembro (15 12 2023)	464.1 KiB	pdf



4- Conclusão

Os membros do Comitê de Investimentos do IPMU, ao longo do ano de 2023, cumpriram o Plano de Trabalho Anual, os procedimentos, o cronograma de reuniões, a análise dos processos, bem como as demais atividades estabelecidas na Lei Municipal 2650/2005, conforme documentos acostados no processo administrativo IPMU/025/2023.

Ubatuba, 02 de janeiro de 2024

Flávio Bellard Gomes

Presidente do Conselho de
Administração do Instituto de
Previdência Municipal de Ubatuba

Sirleide da Silva

Presidente do Instituto de Previdência
Municipal de Ubatuba – IPMU

Luiz Alexandre de Oliveira

Responsável pelo Controle Interno
Instituto de Previdência Municipal de
Ubatuba – IPMU

Antônio Carlos Berti Gomes

Presidente do Conselho Fiscal
Instituto de Previdência Municipal de
Ubatuba

Fernando Augusto Matsumoto

Diretor Financeiro do Instituto de
Previdência Municipal de Ubatuba –
IPMU

Wellington Diniz

Contador e Gestor de Recursos do
Instituto de Previdência Municipal de
Ubatuba – IPMU