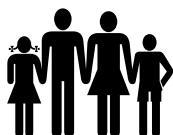


Relatório
Controle Interno
Plano de Ação Mensal
Comitê de Investimentos
Processo IPMU/046/2022





1- Introdução

O Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba - IPMU é um 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:

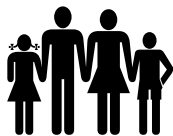
- ✓ Presidente do IPMU
- ✓ Diretor Financeiro do IPMU

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 5.571/2012. Todos os membros do Comitê de Investimentos designados pela Portaria IPMU nº 031/2019, possuem certificação profissional através da prova da ANBIMA – CPA 10 e CGRPPS, atendendo ao disposto no art. 2º da Portaria nº 519/2011 e alterações do MPS.

Fernando Augusto Matsumoto	Diretor Financeiro	Certificação CPA 10 Anbima
Sirleide da Silva	Presidente	Certificação CPA 10 Anbima
Flávio Bellard Gomes	Membro do Conselho de Administração	Certificação CPA 10 Anbima
Lucas Gustavo Ferreira Castanho	Membro do Conselho de Administração	CGRPPS
Marcelo da Cruz Lima	Membro do Conselho de Administração	Certificação CPA 10 Anbima



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

Portaria n.º 049, de 28 de setembro de 2022.

SIRLEIDE DA SILVA, Presidente do Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba - IPMU, no uso das atribuições que lhe confere o artigo 89, inciso XV da Lei Municipal n.º 2.650, de 16 de Fevereiro de 2005 e após deliberação do Conselho de Administração do IPMU.

RESOLVE:

Art. 1º- Nos termos dos artigos 89 e 90 da Lei Municipal 2.650/05, artigo 3º do Regimento Interno do Conselho de Administração e artigo 1º do Decreto 7156/2019, designar os servidores relacionados para integrar o **“COMITÊ DE INVESTIMENTOS”** do Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba - IPMU, sem prejuízo de suas contribuições normais:

Sirleide da Silva	Presidente	RG 22.892.691-9 SSP/SP
Fernando Augusto Matsumoto	Diretor Financeiro	RG 25.905.591-8 SSP/SP
Flávio Bellard Gomes	Membro do Conselho de Administração	RG 22.329.422-9 SSP/SP
Lucas Gustavo Ferreira Castanho	Membro do Conselho de Administração	RG 40.794.381-X SSP/SP
Marcelo da Cruz Lima	Membro do Conselho de Administração	RG 19.990.082-6 SSP/SP

Art. 2º- Esta portaria entra em vigor nesta data, revogando as disposições em contrário.

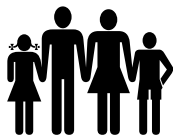
REGISTRE-SE, PUBLIQUE-SE E CUMPRA-SE.

IPMU - Ubatuba, 28 de setembro de 2022

SIRLEIDE DA SILVA

Presidente do Instituto de Previdência
Municipal de Ubatuba - IPMU

Registrada na Seção de Arquivo e Documentação da Diretoria Administrativa do Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU, nesta data.



2- Plano de Ação

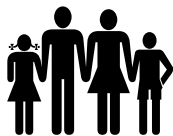
A Política de Investimentos é um dos processos estratégicos do **Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU**, pois a adequada administração dos ativos é fundamental para que se assegure a sua sustentabilidade.

Sua formulação encontra-se prevista nos art. 4º e 5º da Resolução CMN nº 3.922/2010 e representa instrumento para a observância dos princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, diversificação, adequação à natureza de suas obrigações e transparência na aplicação dos recursos, e na avaliação de seus riscos. Seu conteúdo deve ser disponibilizado anualmente à Secretaria de Previdência - SPREV da Secretaria Especial de Previdência e Trabalho - SEPRT do Ministério da Economia, por meio do Demonstrativo da Política de Investimentos - DPIN, conforme art. 1º da Portaria MPS nº 519/2011, art. 22 da Portaria MPS nº 402/2008 e art. 5º, XVI, “g” da Portaria MPS nº 204/2008.

A Política de Investimentos (ou Plano Anual de Investimentos) não se limita à obrigatoriedade de elaboração de um documento anual, mas se constitui em importante instrumento de planejamento, por definir o índice referencial de rentabilidade a ser buscado pelos gestores no exercício seguinte, estabelecer estratégias de alocação, diretrizes e metas de investimentos, bem como permitir monitorar ao longo do ano, por meio de relatórios de acompanhamento, os resultados que forem sendo alcançados durante a sua execução.

Mensalmente é elaborado Relatório de Investimentos do **IPMU**, contemplando as obrigações da Resolução CMN 3.922/2010, alterada pela Resolução CMN nº 4.604/2017, Resolução CMN nº 4.695/2018, Portaria 419/2002, Portaria 185/2015 e Portaria MPS 519/2011, apresentando as operações dos ativos alocados em fundos de investimentos e aderência à Política de Investimentos e Meta Atuarial para o exercício de 2021.

O Relatório Mensal tem por finalidade 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 item 3.2.6 – Política de Investimentos, Manual Pró-Gestão, versão 3.2.



3- Das Reuniões

O Conselho de Administração funciona através de reuniões ordinárias e extraordinárias, realizadas em horário de expediente normal das repartições municipais.

As reuniões ordinárias realizar-se-ão segundo calendário aprovado na última reunião ordinária de cada ano referente ao ano subsequente.

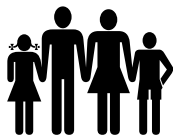
No exercício de 2022 foram realizadas 12 (doze) reuniões ordinárias e 07 (sete) reuniões extraordinárias.

Todas as atas foram publicadas no site no ipmu: www.ipmu.com.br

Contagem de Processo	Tipo de Processo	
Rótulos de Linha	Investimentos / Financeiro	Total Geral
14/01/2022	4	4
25/01/2022	1	1
14/02/2022	4	4
21/03/2022	1	1
28/03/2022	1	1
13/04/2022	15	15
17/05/2022	1	1
25/05/2022	1	1
30/05/2022	1	1
27/06/2022	1	1
05/07/2022	1	1
18/07/2022	1	1
22/07/2022	1	1
11/08/2022	1	1
23/08/2022	1	1
28/09/2022	1	1
19/10/2022	1	1
25/11/2022	5	5
12/12/2022	1	1
Total Geral	43	43

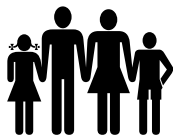
* Reuniões Ordinárias	12
------------------------------	----

* Reuniões Extraordinárias	7
-----------------------------------	---



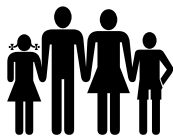
Atas do Comitê de Investimentos – IPMU

ANO	REFERÊNCIA	TAMANHO	TIPO
2022	01/ Janeiro (14 01 2022)	54.2 MiB	pdf
2022	01/ Janeiro (25 01 2022)	50.8 MiB	pdf
2022	02/ Fevereiro (14 02 2022)	63.0 MiB	pdf
2022	03/ Março (21 03 2022)	58.5 MiB	pdf
2022	03/ Março (28 03 2022)	40.4 MiB	pdf
2022	04/ Abril (13 04 2022)	54.5 MiB	pdf
2022	05/ Maio (17 05 2022)	13.9 MiB	pdf
2022	05/ Maio (27 05 2022)	22.0 MiB	pdf
2022	05/ Maio (30 05 2022)	12.2 MiB	pdf
2022	06/ Junho (27 06 2022)	61.8 MiB	pdf
2022	07/ Julho (05 07 2022)	5.0 MiB	pdf
2022	07/ Julho (18 07 2022)	84.2 MiB	pdf
2022	07/ Julho (22 07 2022)	6.8 MiB	pdf
2022	08/ Agosto (11 08 2022)	157.6 KiB	pdf
2022	08/ Agosto (23 08 2022)	63.7 MiB	pdf
2022	09/ Setembro (28 09 2022)	161.5 KiB	pdf
2022	10/ Outubro (19 10 2022)	158.6 KiB	pdf
2022	11/ Novembro (25 11 2022)	446.9 KiB	pdf
2022	12/Dezembro (12 12 2022)	255.0 KiB	pdf



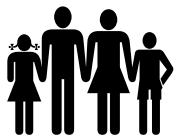
Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU
Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Data da Reunião	Tipo	Processo	Nome
14/01/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/027/2022	Credenciamento - Caixa DTVM S.A
14/01/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/026/2022	Credenciamento - Itaú Institucional Optimus Renda Fixa LP FI
14/01/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/028/2022	Credenciamento - Caixa Master Capital Protegido Bolsa de Valores IV Multimercado
14/01/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/191/2021	Relatório Financeiro - Dezembro/2021
25/01/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/037/2022	Credenciamento - BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos 2023
14/02/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/003/2022	Relatório Financeiro - Janeiro/2022
14/02/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/037/2022	Credenciamento - BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos 2023
14/02/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/048/2022	Credenciamento - Santander Renda Fixa Referenciado DI Institucional Premium
14/02/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/049/2022	Credenciamento - (diversos fundos da Caixa)
21/03/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/047/2022	Relatório Financeiro - Fevereiro/2022
28/03/2022	Investimentos / Financeiro	n/a	Reunião com representantes do Banco do Brasil
13/04/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/026/2022	Itaú Institucional Renda Fixa Referenciado DI FI
13/04/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/072/2022	Bradesco Fundo de Investimento Renda Fixa Referenciado DI
13/04/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/197/2018	Sicredi (diversos fundos)
13/04/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/073/2022	Daycoval, Guepardo, Porto Seguro, Brasil Capital, Rio Verde, Tarpon (diversos fundos)
13/04/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/074/2022	XP (diversos fundos)
13/04/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/075/2022	Safra (diversos fundos)
13/04/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/076/2022	Sulamérica (diversos fundos)
13/04/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/040/2019	Caixa Brasil IMA-B 5+ Títulos Públicos Renda Fixa LP
13/04/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/036/2020	Caixa Ações Infraestrutura
13/04/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/062/2022	Relatório Financeiro - Março/2022
13/04/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/197/2018	Não credenciar fundos que não estão entre os 10+ da Anbima
13/04/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/073/2022	Não credenciar fundos que não estão entre os 10+ da Anbima
13/04/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/074/2022	Acompanhamento de fundos para credenciamento
13/04/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/075/2022	Não credenciar fundos que não estão entre os 10+ da Anbima
13/04/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/076/2022	Não credenciar fundos que não estão entre os 10+ da Anbima
17/05/2022	Investimentos / Financeiro	n/a	Reunião com representantes do Banco do Brasil
25/05/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/085/2022	Relatório Financeiro - Abril/2022
30/05/2022	Investimentos / Financeiro	n/a	Reunião com representantes do Banco Bradesco
27/06/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/092/2022	Relatório Financeiro - Maio/2022
05/07/2022	Investimentos / Financeiro	n/a	Análise do Relatório Financeiro
18/07/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/110/2022	Relatório Financeiro - Junho/2022
22/07/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/127/2022	Regulamento de Credenciamento de Instituição Financeira e Fundo de Investimento
11/08/2022	Investimentos / Financeiro	n/a	Reunião com representantes do Banco do Brasil
23/08/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/120/2022	Relatório Financeiro - Julho/2022
28/09/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/146/2022	Relatório Financeiro - Agosto/2022
19/10/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/159/2022	Relatório Financeiro - Setembro/2022
25/11/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/135/2022	Credenciamento - Banco do Brasil, Bradesco, Caixa Econômica Federal, Itaú e Santander (24 meses)
25/11/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/069/2022	Relatório de ALM
25/11/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/182/2022	Aprovação da Política de Investimentos para 2023
25/11/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/168/2022	Relatório de Aplicações Financeiras
25/11/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/041/2016	Resgate total do fundo de investimentos BB Previdenciário Renda Fixa Títulos Públicos XI FI 2022
12/12/2022	Investimentos / Financeiro	IPMU/181/2022	Relatório de Aplicações Financeiras



Todos os documentos das reuniões do Comitê de Investimentos fazem parte de processos administrativos:





Relatório de Investimentos
MAIO/2022
Processo IPMU/092/2022



Relatório de Investimentos
Junho/2022
Processo IPMU/110/2022

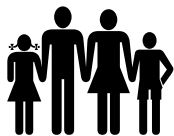


Relatório de Investimentos
Julho/2022
Processo IPMU/120/2022



Relatório de Investimentos
Agosto/2022
Processo IPMU/146/2022





Relatório de Investimentos
Setembro/2022
Processo IPMU/159/2022



Relatório de Investimentos
Outubro/2022
Processo IPMU/168/2022

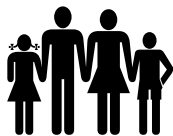


Relatório de Investimentos
Novembro/2022
Processo IPMU/181/2022



Relatório de Investimentos
Dezembro/2022
Processo IPMU/193/2022





Reunião 14/01/2022



Reunião 25/01/2022

CREDENCIAMENTO DE FUNDO DE INVESTIMENTO PROCESSO IPMU/037/2022

BB Previdenciário Renda Fixa Títulos

Objetivo
O FUNDO buscará proporcionar aos RPPS rentabilidade de suas cotas mediante aplicação de seus recursos em Títulos Públicos Federais Marcados a Mercado.

Janela de Captação
A abordagem dos clientes pelos Gerentes de Relacionamento e de Investimento buscará garantir o volume a ser aplicado pelo cliente e a disponibilidade de recursos na data de captação.

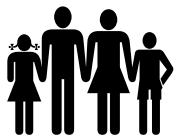
Vantagens

- Nível de rentabilidade esperado compatível com a Meta Atuarial do RPPS.
- Sem custo de operacionalização para aquisição e manutenção do título público encartelado.
- Título negociado pelo valor de mercado sem spread de intervenção.

Aplicações

- Valores previamente negociados com a agência de relacionamento.
- As aplicações serão operacionalizadas pela dependência em data específica, sem aplicações posteriores.

15/08/2024

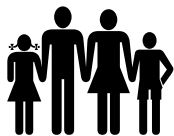


Reunião 14/02/2022

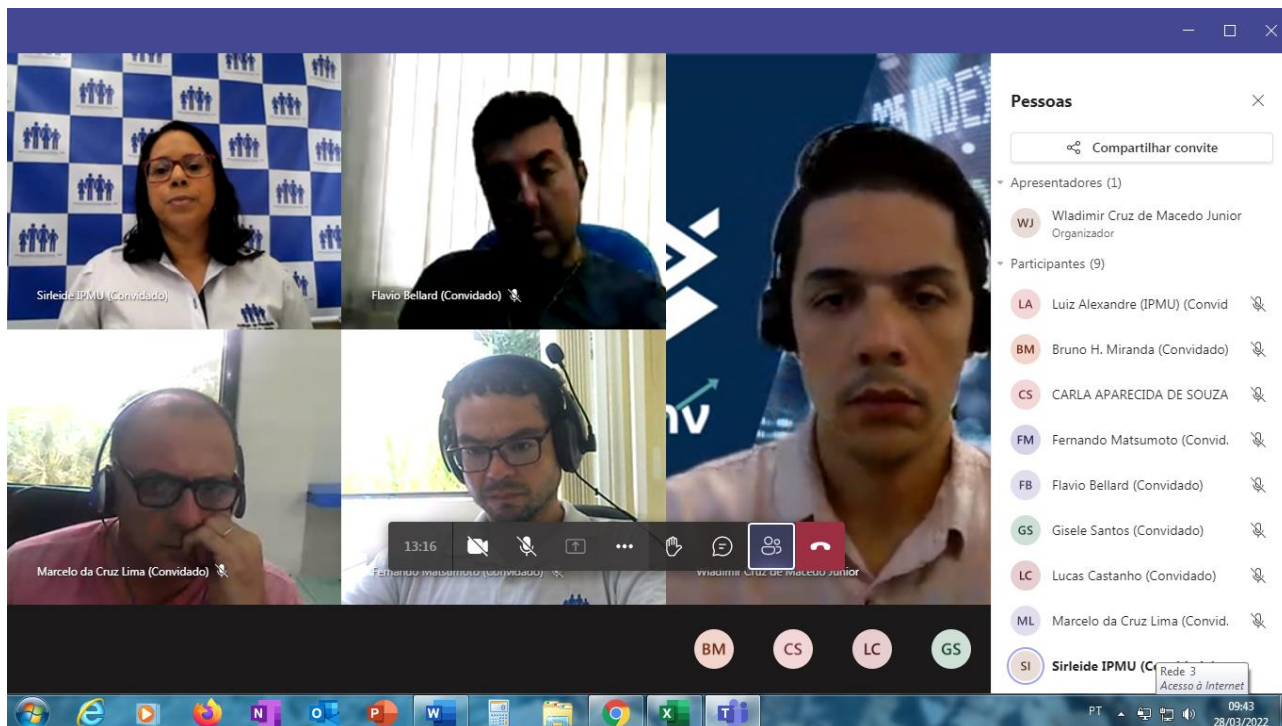


Reunião 21/03/2022



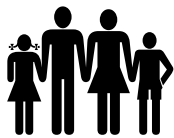


Reunião 28/03/2022

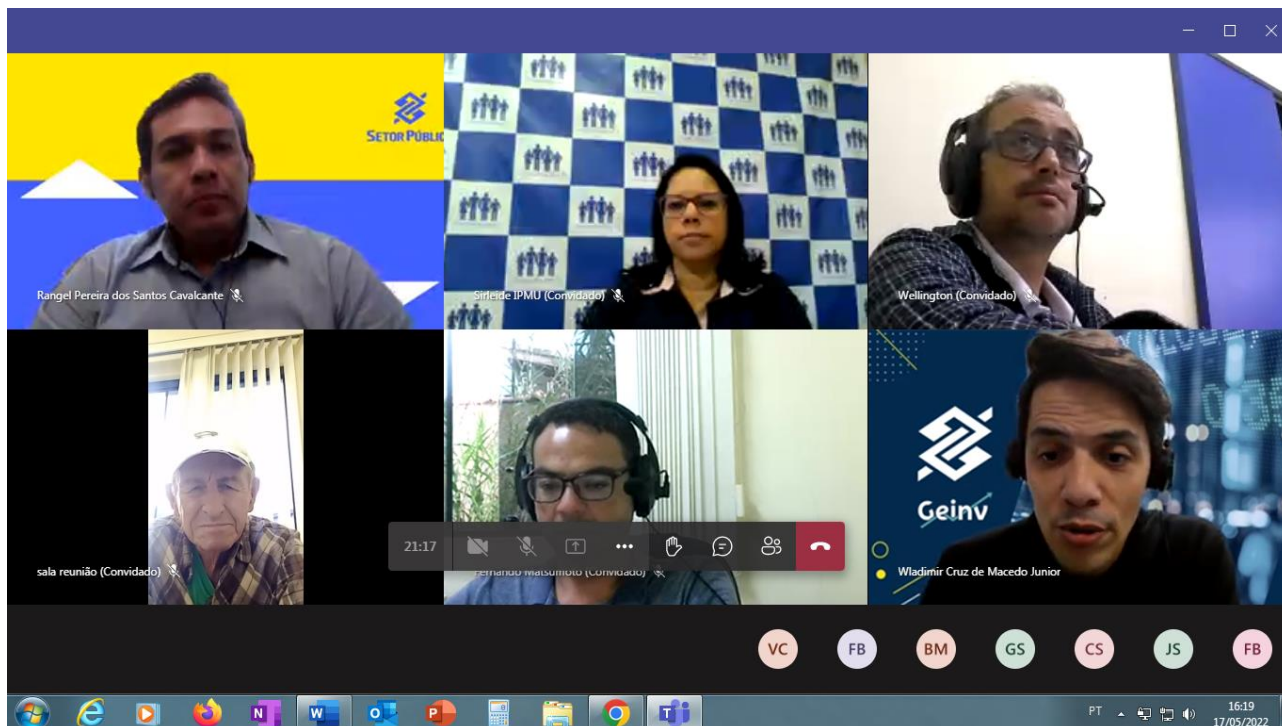


Reunião 13/04/2022



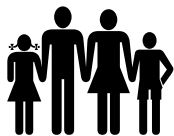


Reunião 17/05/2022

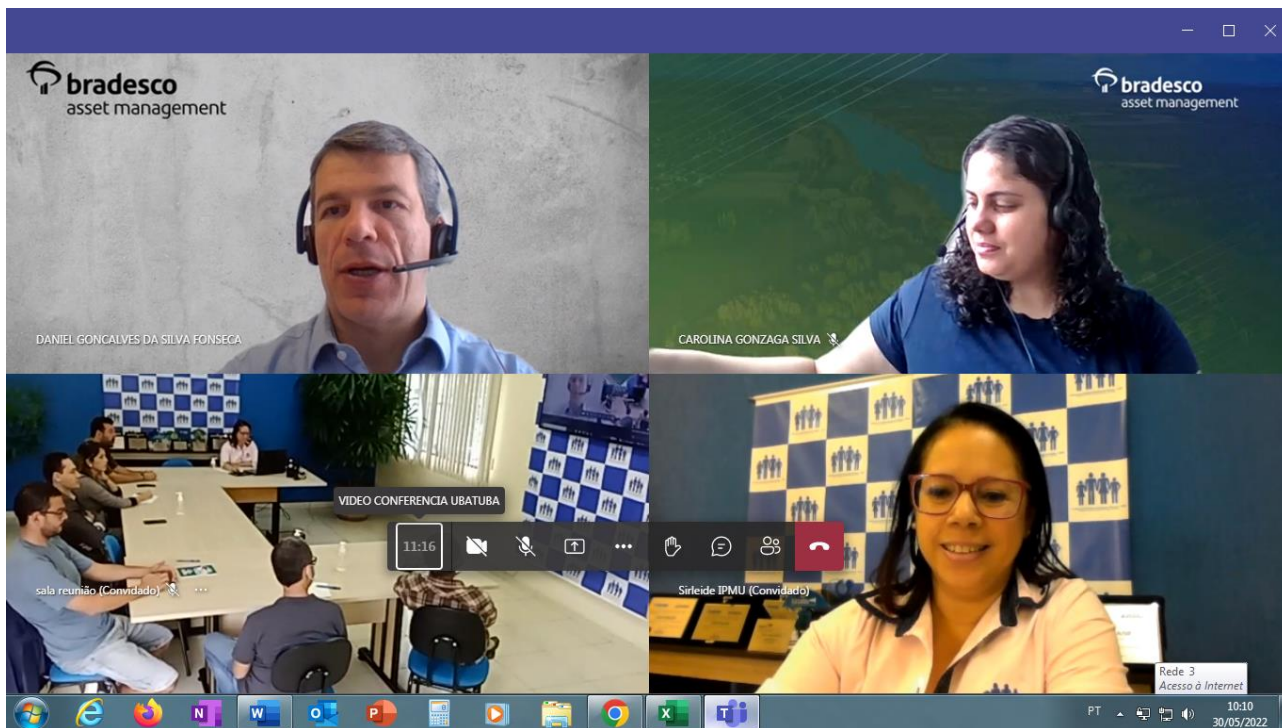


Reunião 25/05/2022



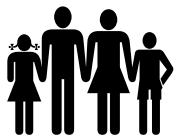


Reunião 30/05/2022



Reunião 27/06/2022



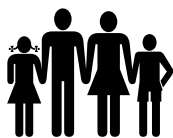


Reunião 05/07/2022



Reunião 18/07/2022



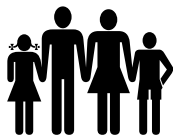


Reunião 22/07/2022



Reunião 11/08/2022



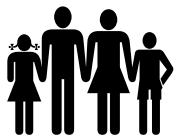


Reunião 23/08/2022



Reunião 28/09/2022



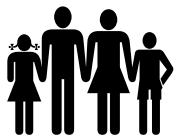


Reunião 19/10/2022



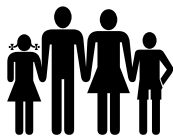
Reunião 25/11/2022





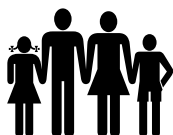
Reunião 12/12/2022



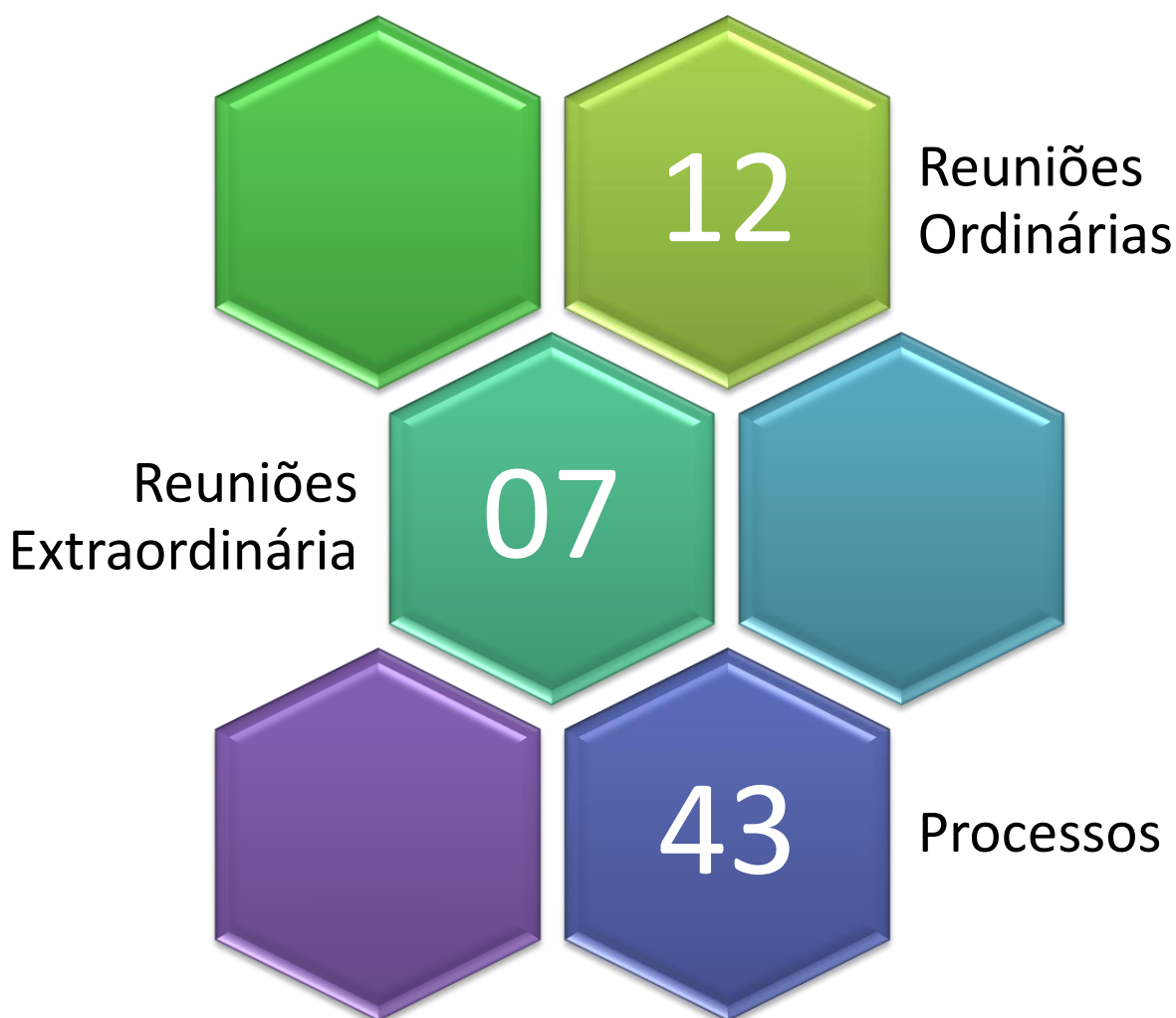


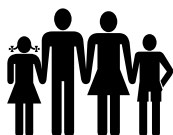
Conforme Plano de Ação, mensalmente os membros do Comitê de Investimentos realizam as seguintes atividades gerenciais (análise de relatórios gerenciais financeiros) da Carteira de Investimentos do IPMU elaborado pela Diretoria Financeira:

1. Acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS
2. Acompanhamento dos indicadores de desempenho global, B3, ANBIMA e IBGE (mês, ano e 12 meses);
3. Acompanhamento e monitoramento dos riscos dos recursos investidos;
4. Acompanhamento sistemático da situação patrimonial, fiscal, comercial e jurídica das instituições investidas;
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 Shape;
10. Análise de Risco VaR (mês/ano);
11. Análise de Volatilidade (mês/ano);
12. Análise do comportamento do mercado (conjuntura macroeconômica);
13. Análise Quantitativa;
14. Aplicação por enquadramento conforme Resolução CMN 3922/2010;
15. Aplicação por estratégia;
16. Aplicação por gestor;
17. Aplicação por Segmento (renda fixa, renda variável e exterior);
18. Relatório Meta Atuarial (mês, ano, 3 meses, 6 meses, 12 meses e 36 meses);
19. Desempenho da Carteira de Investimentos (mês, ano, 3 meses, 6 meses, 12 meses e 36 meses);
20. Critérios de credenciamento para escolha das instituições financeiras e dos produtos financeiros onde os recursos do RPPS serão aplicados.
21. Definição das estratégias de alocação;
22. Relatórios de diligências de verificação dos lastros relativos aos títulos ou a papéis incluídos em operações estruturadas adquiridas por meio de veículos de investimento;
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/ lastros dos títulos e papéis);
28. Limites mínimos e máximos de enquadramento e estratégias de investimento para cada segmento de aplicação financeira;
29. Matriz de correção dos retornos (mês);
30. Monitoramento das cotas médias dos fundos de investimentos;



31. Monitoramento do patrimônio dos fundos de investimentos;
32. Monitoramento dos cotistas dos fundos de investimentos;
33. Portfólio da Carteira Retorno (%);
34. Preencher a planilha BACEN - IPCA x Selic (cenário/perspectiva quatro exercícios);
35. Planilha de análise mensal de Correlação;
36. Planilha de análise mensal de Risco x Retorno;
37. Planilha de Resultado Atuarial x Resultado Financeiro;
38. Relatório Mensal dos investimentos;
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);
43. Resultados esperados das projeções financeiras.





4- CONCLUSÃO

Não foram encontrados erros ou vícios formais nos procedimentos administrativos dos membros do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU, no cumprimento de suas obrigações estabelecidas na legislação vigente no **exercício de 2022**.

Ubatuba, 03 de janeiro de 2023

Wellington Diniz

Responsável pelo Controle Interno

Portaria IPMU nº 011/2018

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