



ATA DE REUNIÃO

ATA DA 4ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE RISCOS DE INVESTIMENTOS REALIZADA EM 1º DE JUNHO DE 2023

DATA, HORA E LOCAL: Às nove horas do primeiro dia do mês de junho do ano de dois mil e vinte e três, por intermédio de ferramenta eletrônica de reuniões. **PRESENCAS:** Sr. Cristiano Rocha Heckert, 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). Presentes também a Sra. Cristina Araújo Santana, Coordenadora de *Compliance* e a Sra. Anna Rosa Alux Simão, Analista de Previdência Complementar, membros suplentes do Comitê; a Sra. Patrícia Brito de Ávila, Coordenadora de Secretariado e Órgãos Colegiados e a Sra. Jamile Bilu Rodrigues, Analista de Previdência Complementar. **PARTICIPANTES EVENTUAIS:** Não houve. **MESA:** Presidiu a sessão o Sr. Cristiano Rocha Heckert e a secretariou a Sra. Patrícia Brito de Ávila. **ORDEM DO DIA:** **Assunto Deliberativo:** 1) Ordem do Dia; 2) Ata da Reunião Anterior – 3ª RO CORIC; 3) Relatório Trimestral de Gestão de Riscos – 1º trimestre de 2023; **Assuntos Informativos:** 4) Avaliação do cumprimento regulatório em relação às obrigações de investimentos; e 5) Informes. **INSTALAÇÃO:** O Sr. Cristiano Rocha Heckert instalou a reunião e declarou abertos os trabalhos. **DELIBERAÇÕES:** **Item 1)** A ordem do dia foi aprovada. **Item 2)** A ata da 3ª reunião ordinária do Comitê de Riscos de Investimentos foi aprovada pelos membros. **Item 3)** A Sra. Elvira Schulz apresentou o Relatório de Gestão de Riscos de Investimentos referente ao 1º trimestre de 2023, que tem por 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. No exercício da função de gestão do risco, segregada da gestão dos investimentos, a cargo do Comitê de Investimentos, a produção do relatório gerencial por este Comitê reforça o papel de proteção do Sistema de Controles Internos da Entidade, conforme prevê o art. 24 da Política de Gestão de Riscos e Controles Internos da Funpresp-Exe, estando aderente à Instrução Previc nº 35, de 11 de novembro de 2020. Lembrou ainda que, nos termos da Resolução DE nº 2.027, de 7 de fevereiro de 2023, a Diretoria Executiva aprovou a proposta de indicação do Comitê de Riscos de Investimentos como Comitê Responsável pela Gestão de Riscos da Fundação, nos termos do art. 13 da Instrução Normativa Previc nº 35, de 11 de novembro de 2020. A análise contida no referido Relatório abrange os Riscos de Mercado, de Liquidez e de Crédito referentes aos Planos de Benefícios ExecPrev e LegisPrev e ao Plano de Gestão Administrativa (PGA) na posição de março de 2023, que se mostram adequados às políticas de investimentos da Funpresp-Exe e à legislação em vigor. Também são abordados aspectos relacionados ao Risco Sistêmico, em que a ata do Comitê de Estabilidade Financeira e o Relatório de Estabilidade Financeira, publicados pelo Banco Central do Brasil, apontam que não há risco relevante quanto à estabilidade financeira no período relativo ao 1º trimestre de 2023. O monitoramento do *Credit Default Swap* (CDS) e *CBOE Market Volatility Index* (VIX) também não apresentou indícios de aumento de riscos que poderiam levar a uma crise sistêmica. Os membros tomaram conhecimento do assunto e sugeriram que, a partir do próximo relatório, seja incluído um item sobre eventos subsequentes, caso haja, e um quadro indicando as análises econômico-financeiras elaboradas pela Corin, explicando de que forma subsidiam a área de investimentos. Após, os membros deliberaram nos termos da Resolução a seguir. **RECOMENDAÇÃO nº 007:** O COMITÊ DE RISCOS DE INVESTIMENTOS DA FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA COMPLEMENTAR DO SERVIDOR PÚBLICO FEDERAL DO PODER EXECUTIVO – FUNPRESP-EXE, no uso de suas atribuições e, nos termos do art. 87, inciso XIV do Regimento Interno da Fundação, recomenda, à Diretoria Executiva, aprovar o Relatório de Gestão de Riscos de Investimentos referente ao 1º trimestre de 2023, com posterior encaminhamento ao Conselho Fiscal e ao Comitê de Auditoria. **Item 4)** A Sra. Cristina Santana apresentou, por intermédio da POC nº 214/2023/GECCI/PRESI/FUNPRESP-EXE, de 25 de maio de 2023, constante do processo SEI nº 03750.001003.000010/2023-70, a avaliação do cumprimento regulatório em relação às obrigações de investimentos referente ao 1º trimestre de 2023, no qual consta o cumprimento de duzentas e dez obrigações legais e próprias no período retratado, sendo vinte e três obrigações de investimentos cumpridas no período. O Comitê tomou conhecimento do assunto. **Item 5)** A Coordenação de Secretariado e Órgãos Colegiados informou aos membros o encaminhamento, por parte do Comitê de Investimentos, dos seguintes documentos, para conhecimento e providências consideradas cabíveis: a) Recomendação Coinv nº 005, de 26 de abril de 2023, que “recomenda, à Diretoria Executiva, a aprovação das propostas de habilitação dos instrumentos financeiros BDR de ETF em Renda Fixa no Exterior, restritos a índices de treasuries de curto/médio prazo, bem como de ETFs que invistam em títulos corporativos high grade, após análise de riscos feita pelo Comitê de Riscos de Investimentos.”; b) Solicitação Coinv nº 001, de 26 de abril de 2023, que “solicita ao Comitê de Riscos de Investimentos: (i) que se manifeste sobre as propostas de habilitação dos instrumentos financeiros BDR de ETF em Renda Fixa no Exterior, restritos a índices de treasuries de curto/médio prazo, bem como de ETFs que invistam em títulos corporativos high grade, no que couber, nos termos do art. 84 do Regimento Interno; e (ii) após apreciação da matéria, que encaminhe o conjunto de documentos à Diretoria Executiva, em prosseguimento, para deliberação, acompanhada da Recomendação Coinv nº 005, de 26 de abril de 2023.”; c) POC nº 148/2023/GEAPP/DIRIN/FUNPRESP-EXE, de 20 de abril de 2023, constante do Processo SEI nº 03750.000107.000004/2023-91, que trata da Nota Técnica nº 4/2023/GEAPP/DIRIN, que apresenta no documento a intenção de aprovar o novo mandato de investimentos em Renda Fixa no Exterior; e d) Memorando nº 2/2023/GEAPP/DIRIN/FUNPRESP-EXE, de 25 de abril de 2023, constante do Processo SEI nº 03750.000107.000004/2023-91, que trata da retificação da referida Nota Técnica nº 4/2023/GEAPP/DIRIN. Os membros tomaram conhecimento e solicitaram que o assunto seja apreciado pela Coordenação de Riscos de Investimentos para deliberação em reunião futura do colegiado. **ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, o Sr. Cristiano Rocha

Heckert, Presidente do Comitê de Investimentos e Riscos, encerrou a reunião às 10h05, na qual eu, Patrícia Brito de Ávila, secretária da reunião, lavei e subscrevi esta Ata, que após lida e aprovada, segue assinada pelos presentes.

Cristiano Rocha Heckert
Presidente do Comitê

Elvira Mariane Schulz
Membro do Comitê

Júlio Alexandre Menezes da Silva
Membro 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 03/07/2023, às 09:22, 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 **Cristiano Rocha Heckert, Membro do Comitê de Riscos de Investimentos**, em 03/07/2023, às 10:21, 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 03/07/2023, às 10:45, 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 03/07/2023, às 11:03, 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 **Julio Alexandre Menezes da Silva, Membro do Comitê de Riscos de Investimentos**, em 03/07/2023, às 18:42, 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 **0111794** e o código CRC **D2E939DD**.

Referência: Caso responda este documento, indicar expressamente o Processo nº 03750.001003.000017/2023-91

SEI nº 0111794

Fundação de Previdência Complementar do Servidor Público Federal do Poder Executivo – Funpresp-Exe

SCN Q 2 BL A Corporate Financial Center Salas 201-204 - CEP 70712-900 -

<https://funpresp.com.br>