



**PARECER MENSAL DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS AO CONSELHO FISCAL DO
SISPREV/TO – OUTUBRO DE 2024**

Os membros do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Teófilo Otoni, no exercício de suas atribuições e de acordo com a Resolução CMN nº4.963/2021, a Portaria MTP nº1.467/2022, bem como a Lei Municipal nº7.656/2022 e o Decreto nº7.653/2017 que aprova o Regimento Interno do Comitê de Investimentos, em reunião realizada no dia 22 de outubro de 2024, examinaram o Relatório de Investimentos referente ao mês de outubro de 2024, constatando as observações abaixo:

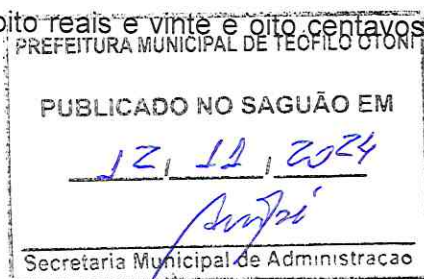
- Foram adotados procedimentos de diligência no processo de credenciamento das Instituições Financeiras e Fundos de Investimentos onde os recursos do SISPREV/TO se encontram aplicados, conforme legislação aplicável, em especial a Portaria nº11/2022 do SISPREV/TO;

- O Relatório de Investimentos de outubro de 2024, o credenciamento das Instituições Financeiras e dos Fundos de Investimentos estão disponíveis no site oficial do SISPREV/TO (<https://sisprevto.mg.gov.br/>);

- A carteira do mês de outubro de 2024 está devidamente diversificada e os recursos estão alocados em conformidade com a Política de Investimentos de 2024, o Estudo de ALM realizado em 2023, o cenário econômico e as melhores práticas para a gestão de recursos observando as necessidades de curto prazo referente ao fluxo de caixa do SISPREV/TO e o foco no longo prazo das aplicações garantidoras do equilíbrio financeiro e atuarial para pagamento dos benefícios previdenciários e despesas administrativas. Os limites das aplicações respeitam a Res. CMN nº4.963/2021 em títulos públicos emitidos pelo Tesouro Nacional, títulos privados emitidos por instituição financeira autorizada pelo BACEN em conformidade com o inciso I do § 2º do art. 21 com a Res. CMN nº4.963/2021 e nos segmentos de fundos de renda fixa, renda variável e multimercado;

- A carteira do mês de outubro apresenta retorno de 0,79% contra 0,96% da meta atuarial e retorno líquido financeiro de R\$ 671.740,48 (seiscentos e setenta e um mil setecentos e quarenta reais e quarenta e oito centavos), o qual representa 82% da meta atuarial para o mês;

- A rentabilidade anual da carteira apresenta retorno de 6,19% contra 8,13% da meta atuarial e retorno líquido financeiro de R\$ 5.046.488,28 (cinco milhões quarenta e seis mil e quatrocentos e oitenta e oito reais e vinte e oito centavos), o qual representa 76% da meta atuarial anual;





Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Teófilo
Otoni - MG – SISPREV-TO
CNPJ: 05.110.612-0001/50
E-mail: sisprev@yahoo.com.br

- O valor total da carteira em outubro de 2024 soma R\$ 84.366.995,69 (oitenta e quatro milhões trezentos e sessenta e seis mil novecentos e noventa e cinco reais e sessenta e nove centavos);

- Na análise da rentabilidade e risco da carteira foram utilizadas métricas amplamente difundidas no mercado financeiro como volatilidade anualizada, Value at Risk (Var), Drawn-Down, Beta, Tracking Error, índice Sharpe, índice de Treynor e Alfa de Jensen.

- A análise do cenário econômico e as decisões de alocação dos recursos se encontram devidamente registradas na Ata nº11/2024, assim como os montantes e prazos de vencimento dos investimentos, conforme o caso, registrados posteriormente no Relatório de Investimentos no mês da liquidação da operação, ambos são publicados e ficarão disponíveis para consulta e acompanhamento no site oficial do SISPREV/TO.

Este é o parecer do Comitê de Investimentos, que segue para apreciação pelo Conselho Fiscal, referente ao Relatório de Investimentos do mês de outubro de 2024.

Teófilo Otoni, 12 de novembro de 2024.

SOLANGE LOPES DE
MIRANDA
FERNANDES:78521904649

Digitally signed by SOLANGE LOPES DE MIRANDA
FERNANDES:78521904649
DN: c=BR, o=ICP-Brasil, ou=Secretaria da Receita
Federal do Brasil - RFB, ou=RFB e-CPF A3, ou=AC VALID
RFB, cn=ICP-Brasil, ou=SECRETARIA DE SEGURANÇA
PÚBLICA, ou=Presencial, ou=15492917000199, cn=SOLANGE
LOPES DE MIRANDA FERNANDES:78521904649
Date: 2024.11.13 11:20:49 -03'00'

Solange Lopes de Miranda Fernandes
Diretora Presidente do SISPREV/TO

CLAUDIONICE
SIQUEIRA
CHAVES:00172522617

Assinado de forma digital por
CLAUDIONICE SIQUEIRA
CHAVES:00172522617
Dados: 2024.11.13 12:06:21 -03'00'

Claudionice Siqueira Chaves
Diretora Administrativo-Financeira

HUGO FIGUEIREDO
RIEVERS:08698510639
39

Assinado de forma digital
por HUGO FIGUEIREDO
RIEVERS:08698510639
Dados: 2024.11.12
12:48:55 -03'00'

Hugo Figueiredo Rievers

Gestor de Recursos do SISPREV/TO

Documento assinado digitalmente



NATAN OLIVEIRA CAIRES
Data: 13/11/2024 09:36:15-0300
Verifique em <https://validar.iti.gov.br>

Natan Oliveira Caires

Membro do Comitê de Investimentos

Documento assinado digitalmente



NUBIA GLAIA VIEIRA SALZMANN
Data: 13/11/2024 11:12:13-0300
Verifique em <https://validar.iti.gov.br>

Núbia Glaia Vieira Salzmann

Membro do Comitê de Investimentos

