

PREVIGUABA

Instituto de Previdência dos Servidores
Públicos do Município de Iguaba Grande

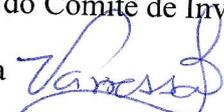
ATA Nº 491 30 DE MAIO DE 2023

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Aos trinta dias do mês de maio de 2023, às onze horas na sala do Gabinete da Presidência - do PREVIGUABA, situado na situado na Rua Altieres Mello dos Santos, 20 – Cidade Nova – Iguaba Grande/RJ, reuniu-se o Comitê de Investimentos, com a presença da Presidente do Comitê Rosana Aparecida, os membros Rogerio Maia, Victor Medeiros e Vanessa Ferreira. Recebemos da empresa de consultoria Mais Valia, a análise do Fundo ITAÚ ASSER NTN-B 2024 FI RENDA FIXA – CNPJ: 50.236.636/0001-05. Trata-se de fundo enquadrado na Resolução 4.963/2021 no artigo 7o, I, b, onde estão os fundos com carteira formada exclusivamente por títulos públicos federais. Fundo de Renda Fixa que busca alocar seus recursos de forma direta ou sintética na NTN-B 2024 com pagamento de cupons até o vencimento. O objetivo do fundo é aplicar, no mínimo, 90% de seus recursos em ativos financeiros de renda fixa relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, ao fator de risco que dá nome à classe, buscando alocar totalmente os recursos na NTN-B 24. Cabe ressaltar que é necessária a permanência sem a realização de resgates até o vencimento, conforme estabelecido no regulamento do fundo. O fundo tem taxa de administração de 0,15%, ligeiramente abaixo dos demais fundos desta categoria. Em nossos comunicados enviados aos clientes, temos demonstrado essa oportunidade de investimento nas atuais e elevadas taxas em que os títulos públicos federais têm sido negociados no mercado secundário. A taxa da NTN-B 2024 negociada no mercado secundário está acima de IPCA + 7,00%, estando acima da meta atuarial do RPPS. Ressaltamos que o Fundo não pode marcar na curva os Títulos Públicos adquiridos porque isso não é permitido pela ICVM 555 e pelo Código de Fundos de Investimentos da ANBIMA. Ressaltamos também que esta aplicação teria maior rentabilidade se o mesmo título fosse adquirido diretamente no mercado e mantido até o vencimento, pois não teria o pagamento de taxa de administração e demais custos que incidem nos fundos de investimentos. Além disso, comprando o título diretamente é possível fazer a marcação na curva, que tira a volatilidade da aplicação. Uma característica importante das NTN-Bs é o pagamento semestral de juros. Para a NTN-B 2024, os juros são pagos nos meses de fevereiro e agosto. Os juros semestrais pagos serão recebidos pelo fundo e pagos ao seu RPPS na proporção de sua participação no patrimônio líquido do fundo. Nossa conclusão é de que somos favoráveis ao seu investimento por se tratar de um fundo com rentabilidade esperada acima da meta atuarial do PREVIGUABA para o período compreendido entre a aplicação e a data de vencimento do título. Nada mais havendo a tratar eu Vanessa da

Silva Ferreira dos Santos, lavrei e assino a presente Ata juntamente com os demais presentes que assim quiseram assinar, Iguaba Grande/RJ, 30 de maio de 2023.

Rosana Aparecida Rodrigues Alves – Presidente do Comitê de Investimento. 

Vanessa da Silva Ferreira dos Santos – Secretária 

Victor Medeiros Mendes da Silva – Membro Comitê de Investimento. 

Rogério Maia Vieira – Membro Comitê de Investimento. 

ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA

50.236.636/0001-05

28/04/2023

CARACTERÍSTICAS

Administrador
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Gestão
ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA

Custodiante
ITAÚ UNIBANCO S.A.

Taxa de Administração
0,15%

Taxa de Performance
Não Possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
1

Patrimônio Líquido Fundo
2.000.000,00

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
Não definido

Público Alvo
Exclusivo do administrador

Classificação ANBIMA
Não classificado

Política de Investimento
Aplica seus recursos em ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, derivativos e cotas de fundos de investimento, negociados nos mercados interno e externo.
Busca alocar totalmente seus recursos na NTN-B 24.

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	0,92%	4,20%	3,04%	6,44%	13,37%	21,40%		

ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA

50.236.636/0001-05

CARTEIRA DO FUNDO

** Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo	Divulgação
Compras a termo a receber - MINISTÉRIO DA FAZENDA (00.394....	1.985,62	99,28	Valores a pagar/receber	06/05/2023
LFT - Venc: 01/09/2024	1.946,06	97,30	Títulos Federais	06/05/2023
Outras Disponibilidades	53,96	2,70	Valores a pagar/receber	06/05/2023
Outros Valores a receber	0,67	0,03	Valores a pagar/receber	06/05/2023
Outros Valores a pagar	0,00	0,00	Valores a pagar/receber	06/05/2023
Outras Obrigações por compra a termo a pagar	-1.986,30	-99,32	Derivativos	06/05/2023

** Demonstramos os 10 maiores ativos que compõem a carteira.