



PREFEITURA MUNICIPAL DE ITAPEVI

ITAPEVIPREV

Rua Geraldo Vasques, 112 – Nova Itapevi | Itapevi | São Paulo | CEP: 06694-150

Tel.: (11) 4144-6752

COMITÊ DE INVESTIMENTOS –

**FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPEVI – ITAPEVIPREV –
CNPJ: 11.377.303/0001-44**

ATA Nº09/2024 DA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Ao Quatorze Dias do Mês de Agosto de 2024 às 14:00 na sala reunião do Fundo de Previdência do Município de Itapevi, na Rua Geraldo Vasques, 112 – Vila Nova Itapevi- SP, reuniram-se os três membros do Comitê de investimentos deste Fundo, conforme decreto Municipal que alterou o Comitê de número 5.394 de 14 de Agosto de 2018 alterando dispositivos do decreto 5297 de 14 de novembro de 2017 que define a estrutura, a composição e o funcionamento do Comitê de Investimentos do Fundo de Previdência do Município de Itapevi – ITAPEVIPREV - Decreta Art. 1 – Ficam alterados os incisos I e III do artigo 5º do Decreto número 5.297 de 14 de Novembro de 2017 que passam a vigorar com a seguinte composição Artigo 5 , inciso I - **Antonio Carlos de Oliveira** RG 17.911.770-1 CPF 088.827.188-32 Gestor de Investimentos – Servidor Comissionado; artigo 5 inciso III - **Lucas Chalupe Coelho de Almeida** RG 43.846.078 CPF 369.108.498-25 Chefe de Gabinete Servidor Comissionado Artigo 2 – Este Decreto entra em vigor na data de sua publicação, revogando-se as disposições em contrário. Publicado, no Diário Oficial do Município de Itapevi, afixado no lugar de costume e registrado em livro próprio, na Prefeitura do Município de Itapevi aos 14 de Agosto de 2018. Publicado em Diário Oficial ano 10 número 556 Itapevi, 04 de Agosto de 2018 e **Sra. Edna Aparecida de Almeida Santos**. O Gestor de Investimentos Sr. Antonio Carlos de Oliveira presidirá este Comitê de Investimentos e Iniciou-se, com essa composição, a referida reunião para atendimento a pauta do dia, **Alocações de recursos Caixa Econômica Federal e Banco Bradesco S/A. Alocações, Renovações e Aportes entre Instituições Financeiras conforme abaixo:**

Entende-se como participação do processo decisório avaliar a conveniência e adequação dos investimentos, monitorar o grau de risco dos investimentos, observar que a rentabilidade dos recursos estejam de

ATA ORDINÁRIA Nº09/2024 COMITÊ DE INVESTIMENTOS



PREFEITURA MUNICIPAL DE ITAPEVI

ITAPEVIPREV

Rua Geraldo Vasques, 112 – Nova Itapevi | Itapevi | São Paulo | CEP: 06694-150

Tel.: (11) 4144-6752

acordo com o nível de risco assumido pelo Fundo de Previdência do Município de Itapevi, garantir a gestão ética e transparente dos recursos, garantir a execução dos processos internos e externos voltados para investimentos e garantir que alocação estratégica dos recursos estejam em consonância com os estudos técnicos que tem como a perspectiva de captura de melhores retornos e cumprimento de nossos compromissos com a finalidade, ou com estimativa, perspectiva de fechamento superior a nossa meta estabelecida pela nossa Política de Investimentos.

A estratégia que utilizamos para efeito de alocações, aportes, desinvestimentos ou propriamente investimentos de recursos é a **carteira eficiente de Markowitz**. Onde vemos o conjunto de carteiras de investimentos **que oferecem a máxima taxa de retorno para um determinado nível de risco** ou o **mínimo nível de risco para uma determinada taxa de retorno**. A carteira eficiente é formada pela tangência do linha de orçamento do investidor com a fronteira eficiente.

A fronteira eficiente é um gráfico, que mostra todas as combinações possíveis de risco e retorno para um determinado conjunto de ativos. **A forma da fronteira eficiente é determinada pela correlação entre os retornos dos ativos**. Se os retornos dos ativos forem perfeitamente correlacionados, a fronteira eficiente será uma linha reta. Se os retornos dos ativos forem não correlacionados, a fronteira eficiente será uma curva parabólica.

A linha de orçamento do investidor é uma linha reta, que mostra todas as combinações possíveis de risco e retorno que estão disponíveis para o investidor. A inclinação da linha de orçamento do investidor é determinada pela razão do preço de risco do ativo livre de risco para o preço de risco do mercado.

O ponto de tangência entre a linha de orçamento do investidor e a fronteira eficiente é a carteira eficiente. **Esta carteira oferece a melhor combinação possível de risco e retorno para o investidor**.



PREFEITURA MUNICIPAL DE ITAPEVI

ITAPEVIPREV

Rua Geraldo Vasques, 112 – Nova Itapevi | Itapevi | São Paulo | CEP: 06694-150

Tel.: (11) 4144-6752



Carteira eficiente de Markowitz

A carteira eficiente de Markowitz é um importante conceito em finanças. Ele é ser usado por investidores, para ajudá-los a construir carteiras que atendam aos seus objetivos de investimento.

Aqui estão alguns dos benefícios de usar a carteira eficiente de Markowitz:

- Pode ajudar os investidores a encontrar a melhor combinação possível de risco e retorno.
- Pode ajudar os investidores a diversificar suas carteiras e reduzir o risco.
- Pode ajudar os investidores a alcançar seus objetivos de investimento de forma mais eficiente.

No entanto, também existem algumas desvantagens em usar a carteira eficiente de Markowitz:

- Pode ser difícil estimar o retorno esperado e a variância dos ativos.
- Pode ser difícil determinar a correlação entre os retornos dos ativos.
- Pode ser difícil encontrar ativos que estejam na fronteira eficiente.



PREFEITURA MUNICIPAL DE ITAPEVI

ITAPEVIPREV

Rua Geraldo Vasques, 112 – Nova Itapevi | Itapevi | São Paulo | CEP: 06694-150

Tel.: (11) 4144-6752

Apesar dessas desvantagens, a carteira eficiente de Markowitz é uma ferramenta valiosa que pode ser usada por investidores para ajudá-los a construir carteiras que atendam aos seus objetivos de investimento.

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 104 – Caixa Econômica Federal.

Debito: Agencia 1228 e Conta Corrente 06.062-2

Fundo/Resgate: CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES

CNPJ: 14.508.643/0001-55

Valor: 3.000.000,00 (Três Milhões de Reais) Folha de Pagamento.

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 237 – Banco Bradesco S/A.

Credito: Agencia 1253 e Conta Corrente 100.495-6

Fundo/Aplicação: BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO

CNPJ: 13.397.466/0001-14.

Valor: 3.000.000,00 (Três Milhões de Reais) Folha de Pagamento.

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 341 – Banco Itaú Unibanco S/A.

Debito: Agencia 7373 e Conta Corrente 37.357-5

Fundo/Aplicação: ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA

CNPJ: 50.236.636/0001-05

Valor: TOTAL.



PREFEITURA MUNICIPAL DE ITAPEVI

ITAPEVIPREV

Rua Geraldo Vasques, 112 – Nova Itapevi | Itapevi | São Paulo | CEP: 06694-150

Tel.: (11) 4144-6752

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 341 – Banco Itaú Unibanco S/A.

Credito: Agencia 7373 e Conta Corrente 37.357-5

Fundo/Aplicação: ITAÚ ASSET NTN-B 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA.

CNPJ: 55.363.896/0001-65

Valor: TOTAL.

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 341 – Banco Itaú Unibanco S/A.

Debito: Agencia 7373 e Conta Corrente 37.357-5

Fundo/Aplicação: Fundo de Previdência do Município de Itapevi

CNPJ: 11.377.303/0001-44

Valor: 10.000.000,00 APORTE/NOVO

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 341 – Banco Itaú Unibanco S/A.

Credito: Agencia 7373 e Conta Corrente 37.357-5

Fundo/Aplicação: ITAÚ ASSET NTN-B 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA.

CNPJ: 55.363.896/0001-65

Valor: 10.000.000,00 APORTE/NOVO



PREFEITURA MUNICIPAL DE ITAPEVI

ITAPEVIPREV

Rua Geraldo Vasques, 112 – Nova Itapevi | Itapevi | São Paulo | CEP: 06694-150

Tel.: (11) 4144-6752

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 237 – Banco Bradesco S/A.

Debito: Agencia 1253 e Conta Corrente 100.495-6

Debito: BRADESCO ESTRATÉGIA XXIV FI RENDA FIXA

CNPJ: 50.591.807/0001-14

Valor: TOTAL.

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 237 – Banco Bradesco S/A.

Credito: Agencia 1253 e Conta Corrente 100.495-6

Fundo/Aplicação: BRADESCO ESTRATÉGIA XXVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA

CNPJ: 55.969.096/0001-92

Valor: TOTAL.

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 237 – Banco Bradesco S/A.

Debito: Agencia 1253 e Conta Corrente 100.495-6

Debito: Fundo de Previdência do Município de Itapevi

CNPJ: 11.377.303/0001-44

Valor: 50.000.000,00 APORTE/NOVO



PREFEITURA MUNICIPAL DE ITAPEVI
ITAPEVIPREV

Rua Geraldo Vasques, 112 – Nova Itapevi | Itapevi | São Paulo | CEP: 06694-150
Tel.: (11) 4144-6752

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.
Banco: 237 – Banco Bradesco S/A.
Credito: Agencia 1253 e Conta Corrente 100.495-6
Fundo/Aplicação: BRADESCO ESTRATÉGIA XXVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA
CNPJ: 55.969.096/0001-92
Valor: 50.000.000,00 APORTE/NOVO

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.
Banco: 104 – Caixa Econômica Federal.
Debito: Agencia 1228 e Conta Corrente 06.062-2
Fundo/Resgate: CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
CNPJ: 50.635.944/0001-03
Valor: TOTAL.

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.
Banco: 104 – Caixa Econômica Federal.
Credito: Agencia 1228 e Conta Corrente 06.062-2
Fundo/Aplicação: CAIXA APORTE IMEDIATO II TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA
CNPJ: 56.134.800/0001-50.
Valor: TOTAL.



PREFEITURA MUNICIPAL DE ITAPEVI

ITAPEVIPREV

Rua Geraldo Vasques, 112 – Nova Itapevi | Itapevi | São Paulo | CEP: 06694-150

Tel.: (11) 4144-6752

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 033 – Banco Santander do Brasil S/A.

Debito: Agencia 348 e Conta Corrente 45001455-1

Fundo/Aplicação: Fundo de Previdência do Município de Itapevi

CNPJ: 11.377.303/0001-44

Valor: 100.000.000,00 APORTE/NOVO

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 033 – Banco Santander do Brasil S/A.

Credito: Agencia 348 e Conta Corrente 45001455-1

Fundo/Aplicação: Santander NTN-B 2025 Renda Fixa Fundo de Investimento

CNPJ: 56.051.304/0001-32

Valor: 100.000.000,00 APORTE/NOVO

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 001 – Banco do Brasil S/A.

Debito: Agencia 2171 e Conta Corrente 200681-2

Fundo/Aplicação: Fundo de Previdência do Município de Itapevi

CNPJ: 11.377.303/0001-44

Valor: 100.000.000,00 (Cem Milhões de Reais). NOVO



PREFEITURA MUNICIPAL DE ITAPEVI
ITAPEVIPREV

Rua Geraldo Vasques, 112 – Nova Itapevi | Itapevi | São Paulo | CEP: 06694-150
Tel.: (11) 4144-6752

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 033 – Banco Santander do Brasil S/A.

Credito Ted: Agencia 033 e Conta Corrente 45001455-1

Credito Ted: Fundo de Previdência do Município de Itapevi

CNPJ: 11.377.303/0001-44

Valor: 100.000.000,00 (Cem Milhões de Reais).NOVO

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 001 – Banco do Brasil S/A.

Debito: Agencia 2171 e Conta Corrente 200681-2

Debito: Fundo de Previdência do Município de Itapevi

CNPJ: 11.377.303/0001-44

Valor: 50.000.000,00 (Cinquenta Milhões de Reais). NOVO/APORTE

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 237 – Banco Bradesco S/A.

Credito Ted: Agencia 1253 e Conta Corrente 100.495-6

Credito Ted: Fundo de Previdência do Município de Itapevi

CNPJ: 11.377.303/0001-44

Valor: 50.000.000,00 (Cinquenta Milhões de Reais). NOVO/APORTRE



PREFEITURA MUNICIPAL DE ITAPEVI

ITAPEVIPREV

Rua Geraldo Vasques, 112 – Nova Itapevi | Itapevi | São Paulo | CEP: 06694-150

Tel.: (11) 4144-6752

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 001 – Banco do Brasil S/A.

Debito: Agencia 2171 e Conta Corrente 200681-2

Fundo: Fundo de Previdência do Município de Itapevi

CNPJ: 11.377.303/0001-44

Valor: 10.000.000,00 (Dez Milhões de Reais). NOVO APORTE

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 341 – Banco Itaú Unibanco S/A.

Credito Ted: Agencia 7373 e Conta Corrente 37.357-5

Credito: Fundo de Previdência do Município de Itapevi.

CNPJ: 11.377.303/0001-44

Valor: 10.000.000,00 (Dez Milhões de Reais). NOVO APORTE

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 001 – Banco do Brasil S/A.

Debito TED: Agencia 2171 e Conta Corrente 200681-2

Debito: Fundo de Previdência do Município de Itapevi

CNPJ: 11.377.303/0001-44

Valor: 3.000.000,00 (Três Milhões e Quinhentos Mil de Reais).



PREFEITURA MUNICIPAL DE ITAPEVI
ITAPEVIPREV

Rua Geraldo Vasques, 112 – Nova Itapevi | Itapevi | São Paulo | CEP: 06694-150
Tel.: (11) 4144-6752

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 104 – Caixa Econômica Federal.

Debito TED: Agencia 1228 e Conta Corrente 06.062-2

Fundo/Resgate: CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES

CNPJ: 14.508.643/0001-55

Valor: 7.000.000,00 (Três Milhões de Reais).

Razão Social: Fundo de Previdência do Município de Itapevi – Itapeviprev.

Banco: 422 – Banco SAFRA brasil S/A.

Credito Ted: Agencia 028 e Conta Corrente 30951-1

Fundo/Aplic: SAFRA NTN-B 2026

CNPJ: 56.225.663/0001-69

Valor: 10.000.000,00 (Dez Milhões de Reais). **NOVO.**

Após análise foi aprovado e estaremos efetuando a efetivação das alocações no decorrer do **mês de Agosto de 2024** e está adequado ao porte do **FUNDO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPEVI - ITAPEVIPREV**. Os relatórios supracitados serão mantidos e colocados à disposição da Secretária da Previdência Social - SPREV, Tribunal de Contas do Estado, Conselho Fiscal e demais órgãos fiscalizadores e interessados.



PREFEITURA MUNICIPAL DE ITAPEVI

ITAPEVIPREV

Rua Geraldo Vasques, 112 – Nova Itapevi | Itapevi | São Paulo | CEP: 06694-150

Tel.: (11) 4144-6752

ANTONIO CARLOS DE OLIVEIRA

Gestor de Investimentos

Membros:

EDNA APARECIDA DE ALMEIDA SANTOS

Diretora de Departamento de Benefícios

LUCAS CHALUPE COELHO DE ALMEIDA

Chefe de Gabinete



PREFEITURA MUNICIPAL DE ITAPEVI

ITAPEVIPREV

Rua Geraldo Vasques, 112 – Nova Itapevi | Itapevi | São Paulo | CEP: 06694-150

Tel.: (11) 4144-6752

ITAPEVI, 14 de Agosto de 2024.

Ao Conselho de Administração do Fundo de Previdência do Município de Itapevi

ITAPEVIPREV

PARECER

Comitê de Investimentos – Itapeviprev

Em conformidade com o Decreto nº 5297 de novembro de 2017, alterado Pelo Decreto nº 5394 de 14 de Agosto de 2018, este Comitê de Investimentos Aprova a pauta acima citada.

Antônio Carlos de Oliveira
Gestor de Investimentos
Presidente

Membros

Edna Aparecida de Almeida Santos
Diretora de Departamento de Benefícios

Lucas Chalupe Coelho de Almeida
Chefe de Gabinete

ATA ORDINÁRIA Nº09/2024 COMITÊ DE INVESTIMENTOS