

285ª Ata do Conselho Administrativo do Iperville

Aos vinte e oito dias do mês de novembro de dois mil e dezessete, às quatorze horas na Sala 201 do Edifício Freitag foram reunidos em sessão ordinária os membros do Conselho Administrativo do Iperville. Estiveram presentes os membros titulares do Conselho Administrativo: Sérgio Luiz Miers (Diretor Presidente do Iperville), Marcia Helena Valério Alacon (Presidente do Conselho), Ulrich Beathalter (Presidente do SINSEJ), Antonio Felix Mafra, Irving Ivo Hoppe, e os conselheiros suplentes, Maria Raquel Kormann Valdez representando o conselheiro titular Fábio Luis de Oliveira, Leonor Maria Trisotto, Maria Matilde Federico, Maria da Glória Berli Frohlich, representando o conselheiro titular Jose Mafra. Estavam presentes ainda, Cleusa Mara Amaral (Contadora do Iperville), Jucemeri Aparecida Fernandes Cabral (Assessora de investimentos), Keli Milene Fernandes (Gerente financeira do Iperville), Sahmara Liz Botemberger (Setor financeiro), Sr. Rafael Bordin da Aditus Consultoria Financeira . 1) A Presidente do Conselho Sra. Marcia Alacon fez abertura da sessão e leitura da ordem do dia. 2) Em seguida o secretário do Conselho Sr. Irving Ivo Hoppe, fez a leitura da Ata 208 do Conselho Fiscal. 3) Em seguida foi apresentada pelo Sr. Rafael Bordin da Aditus Consultoria Financeira, a Política de Investimentos para 2018, aprovado pelo comitê de investimentos conforme Ata 68/2017 de 21/11/2017 do comitê de investimentos. (em anexo). A Política contempla os seguintes itens: 1. Introdução, 2. Governança Corporativa, 2.1. Comitê de Investimentos, 2.2. Consultoria de investimentos, 3. Diretrizes Gerais, 4. Modelo de Gestão, 5. Carteira Atual, 6. Alocação de recursos e os limites por segmento de aplicação, 6.1. Limites, 6.2. Cenário, 6.3. Passivo, 6.4. Alocação objetivo, 6.5. Estratégia de Alocação para os próximos 5 anos, 7. Apreçamento de ativos financeiros, 8. Benchmarks por segmento, 9. Gestão de Risco, 9.1. Risco de Mercado, 9.1.1. VaR e BVar, 9.1.2. Análise de Stress, 9.2. Risco de crédito, 9.2.1. Abordagem Qualitativa, 9.2.2. Exposição a Crédito, 9.3. Risco de Liquidez, 9.3.1. Indisponibilidade de recursos para pagamento de obrigações (Passivo), 9.3.2. Redução de demanda de mercado (Ativo), 9.4. Risco Operacional, 9.5. Risco de Terceirização, 9.6. Risco Legal, 9.7. Risco Sistêmico, 10. Observação dos Princípios Sócio-Ambientais. Finda a apresentação, a Política foi colocada em votação sendo aprovada por unanimidade pelo Conselho Administrativo. A Íntegra da política de investimentos de 2018 do Iperville em anexo, após aprovação pelo Ministério da Previdência será publicada no site do Iperville e no Diário Oficial do Município. 4) O Sr. Rafael apresentou ainda o Resultado anual dos investimentos com os seguintes dados: Market Overview, FOMC – December Hike Probability, Treasuries (2 anos), Dólar Index, Moedas vs Dólar, Euro vs Dólar, IPCA (12 meses), IPCA - Grupos de Produtos, INPC – Grupos de Produtos, Expectativa IPCA – Relatórios Focus, Projeção SELIC – Mercado x Focus, Taxas médias – IMA B, Yield IPCA (Bootstrapped curve), Yield IPCA, Yield Pré, Yield Pré (Bootstrapped curve), Yield Pré, IBOVESPA (10 anos), IBOVESPA em USD (10 anos, Estrangeiros na BOVESPA (em bilhões R\$), Volume Diário, Multimercados – Exposição em Bolsa (% do PL), Medianas – Exposição do VAR Incremental, Risco vs Retorno (em 2017),

Justificou ausência

Fábio Luis de Oliveira
Titular

Antônio Felix Mafra
Titular

Justificou ausência

Cleide Maria Alves
Titular

Justificou ausência

José Mafra
Titular

Maria Matilde Federico
Suplente

Maria Raquel Kormann Valdez
Suplente

Leonor Maria Trisotto
Suplente

Maria da Glória Berli Frohlich
Suplente

Justificou ausência

Jamile Lorena Steingraber Kostelzer
Suplente

Justificou Ausência

Douglas Calheiros Machado
Suplente