

Ata nº 03/2020 – Comitê de Investimentos RECIPREV

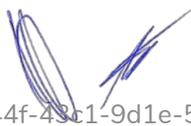
Ata da Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos, realizada no dia 16 de março de 2020; Presidência do Diretor Presidente da Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores o Excelentíssimo Sr. Manoel Carneiro Soares Cardoso;

Aos dezesseis (16) dias do mês de março do ano de dois mil e vinte (2020), às 9:30 horas, na sala de reuniões da Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores, situada na Avenida Manoel Borba, número quatrocentos e oitenta e oito (488), no bairro da Boa Vista, na cidade do Recife, capital do Estado de Pernambuco, reuniu-se o Comitê de Investimentos, sob a presidência do Diretor Presidente da Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores o Excelentíssimo Sr. Manoel Carneiro Soares Cardoso.

Presentes: O Diretor Presidente, **Manoel Carneiro Soares Cardoso**; O Diretor Vice Presidente, **Francisco Canindé Antunes Furtado Júnior**, O Gerente de Investimentos, **José Marcos Alves de Barro**; O chefe de Divisão de Investimento, **Andreson Carlos Gomes de Oliveira**, o servidor da Gerência de Investimentos, **Paulo José Barbosa**, O representante titular da Secretaria de Finanças, **Rodrigo Chagas de Sá**; O representante titular da Secretaria Planejamento, Administração e Gestão de Pessoas, **Roberto Wagner Martins Mateus**. Havendo o número legal, o senhor Presidente declarou abertos os trabalhos, agradecendo a presença dos participantes. Dando continuidade, o senhor José Marcos apresentou os relatórios da carteira de investimentos RECIPREV, com posição em 28.02.2020 e 12.03.2020. Com relação a posição de 28.02.2020, foram apresentados os seguintes dados da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário RECIPREV: Volume e % dos gestores e administradores por RF, RV e Exterior; Arquivo contendo: Nome do Fundo; Gestor; Administrador; Taxa de Administração Anual (%); Benchmark (Índice de Referência anual); Taxa Performance; % PL RECIPREV; % PL Fundo; Saldo (R\$); CNPJ do fundo; Rentabilidade do Produto (mensal); Rentabilidade do Produto (anual); Prazo de Liquidação; Artigo da Resolução 3.922/10; Classificação Risco do Fundo; Gráfico da Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos RECIPREV – Ano Atual; Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPREV – Ano; Percentual de Participação das Instituições Administradoras Consolidado por Grupo Econômico - Carteira RECIPREV – Ano Atual; Percentual de Participação das Instituições Gestoras na Carteira RECIPREV – Ano Atual; Percentual de participação dos investimentos da RECIPREV em relação ao Volume sob Administração ANBIMA; Percentual de participação dos investimentos da RECIPREV em relação ao Volume



Consolidado por Grupo Econômico sob Administração ANBIMA; Percentual de participação dos investimentos da RECIPIREV em relação ao Volume sob Gestão ANBIMA; Percentual de participação dos RPPS em relação ao Volume sob Gestão ANBIMA – Ano Atual; Percentual de participação dos RPPS em relação ao Volume sob Administração ANBIMA – Ano Atual; Percentual de Composição da Carteira RECIPIREV por Benchmark – Ano Atual; Composição da Carteira de Investimentos RECIPIREV – Ano Atual: Renda Fixa x Renda Variável; Volatilidade da Carteira por Fundos de Investimentos e Títulos: muito baixa; baixa; média; alta e muito alta; Prazos Gerais de Liquidação: Curto Prazo (Até 60 dias); Médio Prazo (Até 5 anos); Longo Prazo (Acima de 5 anos); Acompanhamento Geral da Política de Investimentos; Acompanhamento Geral da Política de Investimentos projetada e realizada; Rentabilidade Mensal por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPIREV – Ano Atual; Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPIREV – Ano Atual; Rentabilidades na curva e à mercado mensal e anual da Carteira de Investimentos RECIPIREV; Resumo do Patrimônio Líquido e Rentabilidade da Carteira de Investimentos - Fundo Previdenciário RECIPIREV e Fundo Financeira RECIFIN Contendo os seguintes dados: Data; Saldo; Rendimento mês; % Rendimento Carteira e o resumo anual; Gráfico comparativo da carteira RECIPIREV: Rendimento da Carteira (%) x Crescimento da Carteira (%) do Ano Atual; Rendimento da Carteira (%) x IPCA + 5,87% x CDI x IMA-B x IBOVESPA do ano atual; Rendimento da Carteira (%) x IPCA + 5,87% x CDI x IMA-B x IBOVESPA de 2013 até o Ano atual; o gráfico de comportamento das NTN-B 2045, desde outubro de 2008 até o ano atual comparado o seu preço à mercado, pela curva de juros e IPCA+5,87% ao ano, Fluxo mensal de caixa com resumo anual de recebimentos/pagamentos do Fundo Previdenciário RECIPIREV; Contratos de prestação de serviços da Gerência de Investimentos com os fluxos de pagamentos mensais e resumo anual; Estatística da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário RECIPIREV; Evolução da Carteira de Investimentos e Superávit atuarial da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário RECIPIREV; Rentabilidades anuais e acumulada de 2014 até posição atual da Carteira de Investimentos RECIPIREV; Panorama Macroeconômico; Desempenho da Carteira de Investimentos RECIPIREV; Parecer do Comitê de Investimentos da Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde do Servidores (RECIPIREV). Com relação a posição de 12.03.2020, foram apresentados os seguintes dados da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário RECIPIREV: Volume e % dos gestores e administradores por RF, RV e Exterior; Arquivo contendo: Nome do Fundo; Gestor; Administrador; Taxa de Administração Anual (%); Benchmark (Índice de Referência anual); Taxa Performance; % PL RECIPIREV; % PL Fundo;



Saldo (R\$); CNPJ do fundo; Rentabilidade do Produto (mensal); Rentabilidade do Produto (anual); Prazo de Liquidação; Artigo da Resolução 3.922/10; Classificação Risco do Fundo; Gráfico da Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos RECIPIREV – Ano Atual; Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECIPIREV – Ano; Percentual de Participação das Instituições Administradoras Consolidado por Grupo Econômico - Carteira RECIPIREV – Ano Atual; Percentual de Participação das Instituições Gestoras na Carteira RECIPIREV – Ano Atual; Percentual de participação dos investimentos da RECIPIREV em relação ao Volume sob Administração ANBIMA; Percentual de participação dos investimentos da RECIPIREV em relação ao Volume Consolidado por Grupo Econômico sob Administração ANBIMA; Percentual de participação dos investimentos da RECIPIREV em relação ao Volume sob Gestão ANBIMA; Percentual de participação dos RPPS em relação ao Volume sob Gestão ANBIMA – Ano Atual; Percentual de participação dos RPPS em relação ao Volume sob Administração ANBIMA – Ano Atual; Percentual de Composição da Carteira RECIPIREV por Benchmark – Ano Atual; Composição da Carteira de Investimentos RECIPIREV – Ano Atual: Renda Fixa x Renda Variável; Volatilidade da Carteira por Fundos de Investimentos e Títulos: muito baixa; baixa; média; alta e muito alta; Prazos Gerais de Liquidação: Curto Prazo (Até 60 dias); Médio Prazo (Até 5 anos); Longo Prazo (Acima de 5 anos); Acompanhamento Geral da Política de Investimentos; Acompanhamento Geral da Política de Investimentos projetada e realizada; Rentabilidade Mensal por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPIREV – Ano Atual; Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPIREV – Ano Atual; Rentabilidades na curva e à mercado mensal e anual da Carteira de Investimentos RECIPIREV; Resumo do Patrimônio Líquido e Rentabilidade da Carteira de Investimentos - Fundo Previdenciário RECIPIREV e Fundo Financeira RECIFIN Contendo os seguintes dados: Data; Saldo; Rendimento mês. Foi autorizado a participação do Sr. José Marcos Alves de Barros, na assembleia do FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP, que será realizada no dia 19/03/2020, em São Paulo, na sede da SOCOPA, para participar da apresentação dos resultados obtidos e andamento do plano de recuperação dos créditos aprovado pelos cotistas do referido fundo. Ainda, o Comitê de Investimentos convalidou o credenciamento dos seguintes fundos de investimentos: BB BLACKROCK INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO CNPJ: 17.397.125/0001-08; BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO CNPJ:17.413.636/0001-68; BB NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO CNPJ: 21.752.617/0001-33; BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI



MULTIMERCADO CNPJ: 17.431.816/0001-72; WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR CNPJ: 22.282.992/0001-20.

Foram discutidas as perspectivas para o IPCA e a taxa SELIC, principais variáveis econômicas que afetam os investimentos do Fundo Previdenciário RECIPREV. De acordo com as expectativas de mercado do Relatório de Mercado do Banco Central, utilizadas como cenário base para tomadas de decisões de investimentos, do dia 16 de março de 2020, a expectativa para o IPCA de 2020 teve nova redução, saindo de 3,22%, no mês anterior, para 3,10%. Para 2021 a expectativa também teve redução saindo de 3,75%, para 3,65%. Com relação a Selic, a mediana do mercado para o ano corrente, teve redução de 4,25% para 3,75%. Para 2021 a projeção teve redução de 0,75%, indo para 5,25%. Para os anos de 2022 e 2023, de acordo com o relatório, a expectativa para o IPCA permanece em 3,50%. Já a SELIC foi reduzida para 6,0% em 2022(antes 6,5%) e para 6,25% em 2023(antes 6,5%).

Na sequência, o senhor José Marcos apresentou a planilha com todos os dados técnicos e análises e as propostas de investimentos e desinvestimentos enquadrados na resolução do CMN nº 3.922/2010, para discussão e deliberação por parte de todos os Membros do Comitê de Investimentos do Fundo Previdenciário RECIPREV. Após todas as análises e discussões técnicas pelo Comitê de Investimento sobre as propostas apresentadas, foram aprovados por unanimidade as seguintes operações:

Resgatar os seguintes valores dos fundos de investimentos:

- a) Resgatar o valor de R\$ 16.500.000,00 (Dezesseis milhões e quinhentos mil reais), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- b) Resgatar o valor de R\$ 796,67 (Setecentos e noventa e seis reais e sessenta e sete centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- c) Resgatar o valor de R\$ R\$ 10.650.000,00 (Dez milhões, seiscentos e cinquenta mil reais), do fundo CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP 10.577.519/0001-90;
- d) Resgatar o valor de R\$ 1.981.300,34 (Um milhão, novecentos e oitenta e um. Mil, trezentos reais e trinta e quatro centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE

- INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- e) Resgatar o valor de R\$ 8.997.065,32 (Oito milhões, novecentos e noventa e sete mil, sessenta e cinco reais e trinta e dois centavos), do FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO CNPJ: 13.397.466/0001-14;
 - f) Resgatar o valor de R\$ 250.000.000,00 (Duzentos e cinquenta milhões de reais), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 07.442.078/0001-05;
 - g) Resgatar o valor de R\$ 357.593,93 (Trezentos e cinquenta e sete mil, quinhentos e noventa e três reais e noventa e três centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05;
 - h) Resgatar o valor de R\$ 3.206,17 (Três mil, duzentos e seis reais e dezessete centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05;
 - i) Resgate total do FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50 CNPJ: 03.737.217/0001-77;
 - j) Resgate total do FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO CNPJ 15.154.220/0001-47;
 - k) Resgate total do FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES CAIXA AÇÕES CNPJ: 30.068.224/0001-04;
 - l) Resgate total do FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS CNPJ: 15.154.441/0001-15;
 - m) Resgate de até R\$ 53.000.000,00 (Cinquenta e três milhões de reais), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 07.442.078/0001-05.

Aplicar os seguintes valores nos fundos de investimentos:

- a) Aplicar o valor de R\$ 16.500.000,00 (Dezesseis milhões e quinhentos mil reais), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 25.078.994/0001-90;
- b) Aplicar o valor de R\$ 796,67 (Setecentos e noventa e seis reais e sessenta e sete centavos), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05;



- c) Aplicar o valor de R\$ 9.050.000,00 (Nove milhões e cinquenta mil reais), no FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO CNPJ: 13.397.466/0001-14;
- d) Aplicar o valor de R\$ 1.963.497,23 (Um milhão, novecentos e sessenta e três mil, quatrocentos e noventa e sete reais e vinte e três centavos), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- e) Aplicar R\$ 250.000.000,00 (Duzentos e cinquenta milhões de reais), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 03.543.447/0001-03;
- f) Aplicar o valor de R\$ 7.761,27 (Sete mil, setecentos e sessenta e um reais e vinte e sete centavos), no FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO CNPJ: 13.397.466/0001-14;
- g) Aplicar até o valor de R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais), no fundo MONGERAL AEGON FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CNPJ: 33.254.944/0001-44;
- h) Aplicar até o valor de R\$ R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais), no fundo MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP CNPJ: 14.115.118/0001-70;
- i) Aplicar até o valor de R\$ 80.000.000,00 (Oitenta milhões de reais), no fundo BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO CNPJ: 17.413.636/0001-68;
- j) Aplicar até o valor de R\$ 80.000.000,00 (Oitenta milhões de reais), no fundo WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR CNPJ: 22.282.992/0001-20;
- k) Aplicar até o valor de R\$ 10.000.000,00 (Dez milhões de reais), no fundo XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LP CNPJ: 14.146.491/0001-98;
- l) Aplicar até o valor de R\$ 30.000.000,00 (Trinta milhões de reais), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 18.270.783/0001-99;
- m) Aplicar até o valor de R\$ 3.000.000,00 (Três milhões de reais), no fundo CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CNPJ: 14.550.994/0001-24.

Não havendo nada mais a tratar, o Diretor Presidente da Autarquia agradece a presença de todos e dá por encerrada a reunião; eu,



Andreson Carlos Gomes de Oliveira, lavrei a presente ata que será assinada por mim e pelos demais representantes do Comitê.

MANOEL CARNEIRO SOARES CARDOSO

FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JÚNIOR

JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS

ANDRESON CARLOS GOMES DE OLIVEIRA

PAULO JOSÉ BARBOSA

RODRIGO CHAGAS DE SÁ

ROBERTO WAGNER MARTINS MATEUS



Datas e horários baseados no fuso horário (GMT -3:00) em Brasília, Brasil
Sincronizado com o NTP.br e Observatório Nacional (ON)
Certificado de assinatura gerado em 11/05/2020 às 18:33:15 (GMT -3:00)

Ata Comitê de Investimentos - 16.03.2020.pdf

ID única do documento: #eaca6d85-644f-43c1-9d1e-5c58c63f3330

Hash do documento original (SHA256): a7377ffac030f0682b2083a76474a796090251c871ce5360c8f0b144677a887a

Este Log é exclusivo ao documento número #eaca6d85-644f-43c1-9d1e-5c58c63f3330 e deve ser considerado parte do mesmo, com os efeitos prescritos nos Termos de Uso.

Assinaturas (7)

- ✓ **Francisco Canindé (Participante)**
Assinou em 11/05/2020 às 20:44:01 (GMT -3:00)
- ✓ **Manoel Carneiro (Participante)**
Assinou em 11/05/2020 às 18:36:28 (GMT -3:00)
- ✓ **Roberto Wagner (Participante)**
Assinou em 11/05/2020 às 19:37:02 (GMT -3:00)
- ✓ **José Marcos Alves de Barros (Participante)**
Assinou em 11/05/2020 às 18:36:57 (GMT -3:00)
- ✓ **Rodrigo Chagas (Participante)**
Assinou em 11/05/2020 às 18:46:23 (GMT -3:00)
- ✓ **Paulo José Barbosa (Participante)**
Assinou em 11/05/2020 às 19:06:21 (GMT -3:00)
- ✓ **Andreson Carlos Gomes de Oliveira (Participante)**
Assinou em 11/05/2020 às 19:19:57 (GMT -3:00)

Histórico completo

Data e hora

Evento

Data e hora

Evento

11/05/2020 às 18:33:15
(GMT -3:00)

José Marcos Alves de Barros solicitou as assinaturas.

11/05/2020 às 18:36:28
(GMT -3:00)

Manoel Carneiro E-mail manoel.carneiro@recife.pe.gov.br, IP:
177.223.18.54 assinou.

11/05/2020 às 19:19:57
(GMT -3:00)

Andreson Carlos Gomes de Oliveira E-mail andreson@recife.pe.gov.br, IP:
179.235.210.160 assinou.

11/05/2020 às 18:46:23
(GMT -3:00)

Rodrigo Chagas E-mail rodrigocs@recife.pe.gov.br, IP: 187.21.8.87
assinou.

11/05/2020 às 19:06:21
(GMT -3:00)

Paulo José Barbosa E-mail paulo.barbosa@recife.pe.gov.br, IP:
191.179.99.13 assinou.

11/05/2020 às 18:36:57
(GMT -3:00)

José Marcos Alves de Barros E-mail zemarcos@recife.pe.gov.br, IP:
187.105.9.46 assinou.

11/05/2020 às 19:37:02
(GMT -3:00)

Roberto Wagner E-mail rwagner@recife.pe.gov.br, IP: 179.66.58.41
assinou.

11/05/2020 às 20:44:01
(GMT -3:00)

Francisco Canindé E-mail caninde@recife.pe.gov.br, IP: 187.26.100.103
assinou.