

Ata nº 05/2020 – Comitê de Investimentos RECIPREV

Ata da Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos, realizada no dia 19 de maio 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 dezenove (19) dias do mês de maio do ano de dois mil e vinte (2020), às 9:00 horas, através do aplicativo Zoom foi realizada a reunião do Comitê de Investimentos por teleconferência através do link <https://us02web.zoom.us/j/88904730470?pwd=a2IzbEVNVStBYi9CVUxDZFFiQTcrQT09> ID da reunião: 889 0473 0470, 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 30.04.2020 e 15.05.2020. Com relação a posição de 30.04.2020, 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 + 5,00% x CDI x IMA-B x IBOVESPA do ano atual; Rendimento da Carteira (%) x IPCA + 5,00% 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+5,00% 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 15.05.2020, 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. Foram discutidas as perspectivas para o IPCA e a taxa SELIC, principais variáveis econômicas que afetam os investimentos do Fundo Previdenciário RECIPIREV. 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 15 de maio de 2020, a expectativa para o IPCA de 2020 teve mais uma redução, saindo de 2,72%, no mês anterior, para 1,59%. Para 2021 a expectativa também teve redução saindo de 3,50%, para 3,20%. Com relação a Selic, a mediana do mercado para o ano corrente, teve relevante redução de 3,25% para 2,25%. Para 2021 a projeção teve, também, redução relevante, saindo de 4,75% para 3,50%. Para os anos de 2022 e 2023, de acordo com o relatório, a expectativa para o IPCA permanece em 3,50%. Já a SELIC teve redução de 6,00% para 5,25% em 2022 e permanece em 6,00% para 2023.

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\$ 30.000.000,00 (Trinta milhões de reais), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ:07.442.078/0001-05;
- b) Resgatar o valor de R\$ 120.000.000,00 (Cento e vinte milhões de reais), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 03.543.447/0001-03;
- c) Resgatar o valor de R\$ 180.000.000,00 (Cento e oitenta milhões de reais), do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 11.060.913/0001-10;
- d) Resgatar o valor de R\$ 20.000.000,00 (Vinte milhões de reais), do fundo WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR CNPJ:22.282.992/0001-20;
- e) Resgatar o valor de R\$ 8.671.991,12 (Oito milhões, seiscentos e setenta e um mil, novecentos e noventa e um reais e doze 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\$ 1.832.334,14 (Um milhão, oitocentos e trinta e dois mil, trezentos e trinta e quatro reais e quatorze centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- g) Resgatar total no valor de R\$ 110.190.997,12 (Cento e dez milhões, cento e noventa mil, novecentos e noventa e sete reais e doze centavos), do fundo SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF CNPJ: 13.455.117/0001-01;
- h) Resgatar total no valor de R\$ 9.288.213,90 (Nove milhões, duzentos e oitenta e oito mil, duzentos e treze reais e noventa centavos), do

FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 11.060.913/0001-10;

- i) Resgatar o valor de R\$ 30.000.000,00 (Trinta milhões de reais), do fundo BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B CNPJ: 08.702.798/0001-25.

Aplicar os seguintes valores nos fundos de investimentos:

- a) Aplicar o valor de R\$ 74.000.000,00 (Setenta e quatro milhões de reais), no fundo ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 21.838.150/0001-49;
- b) Aplicar o valor de R\$ 30.000.000,00 (Trinta milhões de reais), no fundo ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI CNPJ: 10.474.513/0001-98;
- c) Aplicar o valor de R\$ 60.000.000,00 (Sessenta milhões de reais), no fundo ITAÚ INFLATION 5 RENDA FIXA FICFI CNPJ: 09.093.819/0001-15;
- d) Aplicar o valor de R\$ 16.000.000,00 (Dezesseis milhões de reais), no fundo SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL RF LP CNPJ: 14.504.578/0001-90;
- e) Aplicar o valor de R\$ 80.000.000,00 (Oitenta milhões de reais), no fundo SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL RF LP CNPJ: 14.504.578/0001-90;
- f) Aplicar o valor de R\$ 70.000.000,00 (Setenta milhões de reais), no fundo SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI CNPJ: 26.507.132/0001-06;
- g) Aplicar o valor de R\$ 15.000.000,00 (Quinze milhões de reais), no fundo MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO AÇÕES INVESTIMENTO NO EXTERIOR CNPJ: 33.913.562/0001-85;
- h) Aplicar o valor de R\$ 5.000.000,00 (Cinco milhões de reais), no fundo CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA CNPJ: 11.182.064/0001-77;
- i) Aplicar o valor de R\$ 367.453,00 (Trezentos e sessenta e sete mil, quatrocentos e cinquenta e três reais), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- j) Aplicar o valor de R\$ 119.479.211,02 (Cento de dezenove milhões, quatrocentos e setenta e nove mil, duzentos e onze reais e dois centavos), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 25.078.994/0001-90;
- k) Aplicar o valor de R\$ 9.294.118,52 (Nove milhões, duzentos e noventa e quatro mil, cento e dezoito reais e cinquenta e dois

centavos), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 11.328.882/0001-35;

l) Aplicar o valor de R\$ 20.705.881,48 (Vinte milhões, setecentos e cinco mil, oitocentos e oitenta e um reais e quarenta e oito centavos), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 11.328.882/0001-35.

m) Aplicar o valor de R\$ 190.780,88 (Cento e noventa mil, setecentos e oitenta reais e oitenta e oito centavos), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05.

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

ASSINATURAS DIGITAL



ASSINADO DIGITALMENTE POR

ROBERTO WAGNER MARTINS MATEUS

CPF: 638.253.413-72 DATA: 10/06/2020 14:40

LOCAL: RECIFE-PE

REGULADO PELO DECRETO MUNICIPAL N° 33.682 de 25/05/2020 (RECIFE-PE)