

## COMITÊ DE INVESTIMENTOS

ATA Nº 008/2024	Data: 27/08/2024
<b>Local:</b> Virtual – Google Meet	
<b>Membros Presentes:</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Marconi Muzzio Pires de Paiva Filho – Diretor-Presidente da AMPASS</li> <li>• Andreson Carlos Gomes de Oliveira – Gerência de Investimentos da AMPASS</li> <li>• Mariana Trigueiro de Freitas – Gestora da Unidade Jurídica</li> <li>• José Ricardo Wanderley Dantas de Oliveira – Controladoria-Geral do Município</li> <li>• Roberto Wagner Martins Mateus - Secretaria de Planejamento, Gestão e Transformação Digital</li> <li>• Francisco Canindé Antunes Furtado Júnior – Vice-Diretor-Presidente da AMPASS</li> </ul>	
<b>Membros Ausentes:</b>	
<b>Convidados Presentes:</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Gutemberg Peixoto Calazans Filho – Chefe de Divisão de Investimentos da AMPASS</li> <li>• Gustavo Lins Dourado – Gerência de Investimentos da AMPASS</li> </ul>	
<b>Presidente do Comitê:</b> Marconi Muzzio Pires de Paiva Filho	
<p>Havendo o número legal, o senhor Presidente Marconi Muzzio Pires de Paiva Filho declarou abertos os trabalhos, agradecendo a presença dos participantes e informou aos participantes que a pauta da reunião seria a apresentação da carteira de investimentos da RCEIPREV do mês de julho/2024. Dando continuidade, o Sr Andreson Oliveira apresentou os relatórios da carteira de investimentos RECI PREV, com posição em 31.07.2024. Foram apresentados os seguintes dados da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário RECI PREV: Volume e % dos gestores e administradores por RF, RV, Exterior, Estruturados e Imobiliários. Abertura da carteira com a identificação de todos os produtos de investimentos; Administrador; Taxa de Administração Anual (%); Benchmark (Índice de Referência anual); Taxa Performance; % PL RECI PREV; % PL Fundo; Saldo (R\$); CNPJ do fundo; Rentabilidade do Produto (mensal); Rentabilidade do Produto (anual); Prazo de Liquidação; Artigo da Resolução 4.963/21; Classificação Risco do Fundo; Gráfico da Evolução Mensal do Patrimônio Líquido da Carteira de Investimentos RECI PREV – Ano Atual; Percentual de Participação das Instituições Administradoras na Carteira RECI PREV – Ano; Percentual de Participação das Instituições Administradoras Consolidado por Grupo Econômico - Carteira RECI PREV – Ano Atual; Percentual de Participação das Instituições Gestoras na Carteira RECI PREV – Ano Atual; Percentual de participação dos investimentos da RECI PREV em relação ao Volume sob Administração ANBIMA; Percentual de participação dos investimentos da RECI PREV em relação ao Volume Consolidado por Grupo Econômico sob Administração ANBIMA;</p>	

Percentual de participação dos investimentos da RECIPREV 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 RECIPREV por Benchmark – Ano Atual; Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV – 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 RECIPREV – Ano Atual; Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPREV – Ano Atual; Rentabilidades na curva e à mercado mensal e anual da Carteira de Investimentos RECIPREV; Resumo do Patrimônio Líquido e Rentabilidade da Carteira de Investimentos - Fundo Previdenciário RECIPREV e Fundo Financeira RECIFIN Contendo os seguintes dados: Data; Saldo; Rendimento mês; % Rendimento Carteira e o resumo anual; Gráfico comparativo da carteira RECIPREV: Rendimento da Carteira (%) x Crescimento da Carteira (%) do Ano Atual; Rendimento da Carteira (%) x IPCA + 5,15% x CDI x IMA-B x IBOVESPA do ano atual; Rendimento da Carteira (%) x IPCA + 4,87% x CDI x IMA-B x IBOVESPA de 2013 até o Ano atual; o gráfico de comportamento das NTN-B 2040 e 2045, comparado o seu preço à mercado, pela curva de juros e IPCA+5,15% ao ano, Fluxo mensal de caixa com resumo anual de recebimentos/pagamentos do Fundo Previdenciário RECIPREV; 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 RECIPREV; Evolução da Carteira de Investimentos e Superávit/Deficit atuarial da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário RECIPREV; Rentabilidades anuais e acumulada de 2014 até posição atual da Carteira de Investimentos RECIPREV; Panorama Macroeconômico; Desempenho da Carteira de Investimentos RECIPREV; Parecer do Comitê de Investimentos da Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde do Servidores (AMPASS). Com relação a posição de XX.08.2023, foi apresentado relatório com os seguintes dados da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário RECIPREV: Volume e % dos gestores e administradores por RF, RV, Exterior, Estruturado e Imobiliários; 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 4.963/21; 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 RECIPREV 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 RECIPREV por Benchmark – Ano Atual; Composição da Carteira de Investimentos RECIPREV – Ano Atual: Renda Fixa x Renda Variável x Exterior x Estruturados x Imobiliários ; 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 RECIPREV – Ano Atual. No decorrer da apresentação o senhor Andreson Oliveira deu destaque aos controles dos limites aplicações do relatório em comparação com os limites definidos na legislação atual. Ainda, relativo à Política de Investimentos, o senhor Andreson destacou a aderência dos percentuais aplicados com os definidos como estratégia alvo na política de

investimentos. Quanto aos dados macroeconômicos, são acompanhadas as expectativas de mercado do Relatório de Mercado do Banco Central, utilizadas como cenário base para tomadas de decisões de investimentos. De acordo com o relatório publicado no dia 23 de agosto de 2024, a expectativa para o IPCA de 2024, está em 4,25% de 4,10% no mês anterior. Para 2025 o IPCA está em 3,93%, antes 3,96%. Com relação a Selic, a mediana do mercado para o ano corrente permanece em 10,5% e saiu de 9,50% para 10% em 2025. Para os anos seguintes, de acordo com o relatório, a expectativa para o IPCA de 2026 permanece em 3,60% e 3,50% para 2027. Já a Selic permanece em 9,00% para 2027 e saiu de 9,00% para 9,5% em 2026.

Na sequência, o Sr. Andreson Oliveira apresentou as sugestões de alocação para o próximo mês. Para a alocação estratégica, foi proposto o fundo MAG CASH FI RENDA FIXA LP (CNPJ: 17.899.612/0001-60). O fundo tem como benchmark o CDI, indicador com melhor performance no ano de 2024. A alocação visa reduzir a volatilidade da carteira de investimentos e aproveitar o momento de taxa de juros elevada. O fundo se destaca em termos de risco x retorno na comparação com os demais fundos da carteira do mesmo segmento. Além disso, foram aprovadas as movimentações regulares necessárias para o cumprimento das obrigações financeiras deste instituto de previdência, como aplicações e resgates automáticos, com o intuito de evitar que recursos permaneçam em conta corrente sem remuneração. Também foi aprovada a alocação em fundos DI já existentes na carteira, previamente aprovados e credenciados, dos recursos que deverão ser realocados de acordo com as operações estratégicas. Após as análises e discussões técnicas pelo Comitê de Investimento, todas as sugestões de alocação, bem como o credenciamento das instituições prestadoras de serviço dos fundos, foram aprovadas por unanimidade. O Sr. Andreson informou ainda que as alocações ocorrerão conforme as janelas de oportunidade do mercado. Caso o cenário de curtíssimo prazo se altere e as operações sugeridas deixem de ser viáveis, essas serão canceladas, e novas sugestões serão apresentadas para deliberação.

**Resgatar os seguintes valores dos fundos de investimentos:**

**Deliberações**

- a) R\$ 3.208.202,24 (três milhões, duzentos e oito mil, duzentos e dois reais e vinte e quatro centavos) do fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- b) R\$ 12.347,16 (doze mil, trezentos e quarenta e sete reais e dezesseis centavos) do fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- c) R\$ 1.046.352,34 (um milhão e quarenta e seis mil, trezentos e cinquenta e dois reais e trinta e quatro centavos) do fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- d) R\$ 2.500,00 (dois mil e quinhentos reais) do fundo BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO, CNPJ: 20.716.161/0001-93;
- e) R\$ 18.153.476,28 (dezoito milhões, cento e cinquenta e três mil, quatrocentos e setenta e seis reais e vinte e oito centavos) do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FUNDO DE INVESTIMENTO, CNPJ: 19.303.795/0001-35;
- f) R\$ 29.228.730,45 (vinte e nove milhões, duzentos e vinte e oito mil, setecentos e trinta reais e quarenta e cinco centavos) do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA, CNPJ: 18.598.288/0001-03;
- g) R\$ 35.203.127,60 (trinta e cinco milhões, duzentos e três mil, cento e vinte e sete reais e sessenta centavos) do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA, CNPJ: 20.139.595/0001-78;
- h) R\$ 29.000.000,00 (vinte e nove milhões de reais) do fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- i) R\$ 221.924,94 (duzentos e vinte e um mil, novecentos e vinte e quatro reais e noventa e quatro centavos) do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA, CNPJ: 19.769.046/0001-06;

- j) R\$ 338.710,35 (trezentos e trinta e oito mil, setecentos e dez reais e trinta e cinco centavos) do FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA, CNPJ: 20.139.534/0001-00;
- k) R\$ 30.000.000,00 (trinta milhões de reais) do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO, CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- l) R\$ 40.000.000,00 (quarenta milhões de reais) do CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- m) R\$ 2.194,91 (dois mil, cento e noventa e quatro reais e noventa e um centavos) do CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- n) R\$ 13.792.088,75 (treze milhões, setecentos e noventa e dois mil e oitenta e oito reais e setenta e cinco centavos) do CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- o) R\$ 216.118,71 (duzentos e dezesseis mil, cento e dezoito reais e setenta e um centavos) do FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO, CNPJ: 13.397.466/0001-14;
- p) R\$ 1.377,78 (mil trezentos e setenta e sete reais e setenta e oito centavos) do FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO, CNPJ: 13.397.466/0001-14;
- q) R\$ 13.562.959,37 (treze milhões, quinhentos e sessenta e dois mil, novecentos e cinquenta e nove reais e trinta e sete centavos) do FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO, CNPJ: 13.397.466/0001-14;

**Aplicar os seguintes valores nos fundos de investimentos:**

- a) R\$ 1.518,79 (mil quinhentos e dezoito reais e setenta e nove centavos) no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO, CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- b) R\$ 8.721,79 (oito mil, setecentos e vinte e um reais e setenta e nove centavos) fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- c) R\$ 1.369,24 (mil trezentos e sessenta e nove reais e vinte e quatro centavos) no FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO, CNPJ 13.397.466/0001-14;
- d) R\$ 4.878.078,14 (quatro milhões, oitocentos e setenta e oito mil e setenta e oito reais e quatorze centavos) no fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- e) R\$ 3.971.564,11 (três milhões, novecentos e setenta e um mil, quinhentos e sessenta e quatro reais e onze centavos) no fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- f) R\$ 6.182.446,23 (seis milhões, cento e oitenta e dois mil, quatrocentos e quarenta e seis reais e vinte e três centavos), no fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- g) R\$ 2.500,00 (dois mil e quinhentos reais), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO, CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- h) R\$ 14.651.433,99 (quatorze milhões, seiscentos e cinquenta e um mil, quatrocentos e trinta e três reais e noventa e nove centavos), no fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- i) R\$ 51.262.987,00 (cinquenta e um milhões, duzentos e sessenta e dois mil, novecentos e oitenta e sete reais) no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO, CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- j) R\$ 161.995,08 (cento e sessenta e um mil, novecentos e noventa e cinco reais e oito centavos), no CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- k) R\$ 29.000.000,00 (vinte e nove milhões de reais), no FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97;

- l) R\$ 64.992.493,34 (sessenta e quatro milhões, novecentos e noventa e dois mil, quatrocentos e noventa e três reais e trinta e quatro centavos), no fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- m) R\$ 40.000.000,00 (quarenta milhões de reais), no fundo TREND PÓS-FIXADO FIC RENDA FIXA SIMPLES, CNPJ: 26.559.284/0001-44;
- n) R\$ 15.000.000,00 (quinze milhões de reais), no fundo RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO II RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO, CNPJ: 55.771.625/0001-49;
- o) R\$ 15.000.000,00 (quinze milhões de reais), no fundo BTG PACTUAL OPORTUNIDADES LISTADAS I FI AÇÕES, CNPJ: 46.300.375/0001-78;
- p) R\$ 13.792.088,75 (treze milhões, setecentos e noventa e dois mil e oitenta e oito reais e setenta e cinco centavos), no FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO, CNPJ: 13.397.466/0001-14;
- q) R\$ 27.029,04 (vinte e sete mil e vinte e nove reais e quatro centavos), no BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO, CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- r) R\$ 1.672.731,68 (um milhão, seiscentos e setenta e dois mil, setecentos e trinta e um reais e sessenta e oito centavos), no CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- s) R\$ 1.369,24 (mil trezentos e sessenta e nove reais e vinte e quatro centavos), no FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO, CNPJ: 13.397.466/0001-14.

**Responsável pela elaboração da ata: Andreson Carlos Gomes de Oliveira**

**MEMBROS DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS PRESENTES**

Marconi Muzzio Pires de Paiva Filho	
Francisco Canindé Antunes Furtado Júnior	
Andreson Carlos Gomes de Oliveira	
Mariana Trigueiro de Freitas	

Roberto Wagner Martins Mateus	
José Ricardo Wanderley Dantas de Oliveira	