

Ata nº 12/2021 – Comitê de Investimentos RECIPREV

Ata da Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos, realizada no dia 15 de dezembro de 2021; Presidência do Diretor Presidente da Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores o Excelentíssimo Sr. Manoel Carneiro Soares Cardoso;

Aos quinze dias do mês de DEZEMBRO do ano de dois mil e vinte e um (2021), às 9:00 horas, através do aplicativo Zoom foi realizada a reunião do Comitê de Investimentos por teleconferência 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 Geral de Investimentos; **José Marcos Alves de Barros**; O Chefe de Divisão de Investimentos; **Marco Aurélio Correia Pinheiro**; O servidor da área de investimentos **Gustavo Lins Dourado**; O representante titular da Controladoria Geral do Município, **José Ricardo Wanderley Dantas de Oliveira**; O representante titular da Secretário de Planejamento, Gestão e Transformação Digital, **Sávio Tostes Barroso**, e o representante suplente da Secretário de Planejamento, Gestão e Transformação Digital, **Roberto Wagner Martins Mateus**. Como convidados: a Chefe da Área de Controles Internos, **Rebeca de Souza Alves Machado** e o Gerente Administrativo e Financeiro da RECIPREV, **Élcio Ricardo Leite Guimarães**. Também participaram como convidados os servidores da AMPASS: **Messias e Américo**. 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 30.11.2021 e 13.12.2021. Com relação a posição de 30.11.2021, foi apresentado relatório contendo 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 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 + 5,41% x CDI x IMA-B x IBOVESPA do ano atual; Rendimento da Carteira (%) x IPCA + 5,41% 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+5,41% 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 (RECIPREV). Com relação a posição de 13.12.2021, foi apresentado

relatório com 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 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. Foram discutidas as perspectivas para o IPCA e a taxa SELIC, principais variáveis econômicas que afetam os investimentos do Fundo Previdenciário RECIPREV. O senhor Manoel Carneiro efetuou a apresentação em forma resumida de todas as realizações efetuadas pela AMPASS no ano de 2021, bem como as ações prioritárias a serem realizadas para o ano de 2022. Na sequência foi apresentado o credenciamento da Caixa DTVM, pelo senhor José Marcos, sendo convalidado o credenciamento pelo Comitê de Investimentos.

De acordo com as expectativas de mercado do Relatório de Mercado do Banco Central de 10.12.2021, utilizadas como cenário base para tomadas de decisões de investimentos, do dia 15 de dezembro de 2021, a expectativa para o IPCA de 2021 teve forte aumento, indo para 10,05%. Para 2022 o IPCA está em 5,02%. Com relação a Selic, a mediana do mercado para o ano corrente teve aumento significativo, indo para 10,25%, e para 2022 está em 11,25%. Para os anos de 2023 e 2024, de acordo com o relatório, as expectativas para o IPCA permanecem em 3,46% e 3,09%.

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 4.963/2021, para discussão e deliberação por parte de todos os Membros do Comitê de Investimentos do Fundo Previdenciário RECIPIREV. Após todas as análises e discussões técnicas pelo Comitê de Investimento sobre as propostas apresentadas, foram aprovados por unanimidade as seguintes operações seguintes:

Resgatar os seguintes valores dos fundos de investimentos:

- a) Resgatar o valor de R\$ 10.736.202,36 (Dez milhões, setecentos e trinta e seis mil, duzentos e dois reais e trinta e seis centavos), 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\$ 10.974.544,42 (Dez milhões, novecentos e setenta e quatro mil, quinhentos e quarenta e quatro reais e quarenta 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;
- c) Resgatar o valor de R\$ 523,69 (Quinhentos e vinte e três reais e sessenta e nove centavos), do FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO CNPJ: 13.397.466/0001-14;
- d) Resgatar o valor de R\$ 1.427.174,51 (Um milhão, quatrocentos e vinte e sete mil, cento e setenta e quatro reais e cinquenta e um 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\$ 4.108,39 (Quatro mil, cento e oito reais e trinta e nove 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\$ 4.206,88 (Quatro mil, duzentos e seis reais e oitenta e oito 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 o valor de R\$ 45.000,00 (Quarenta e cinco mil reais), do fundo BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII CNPJ: 20.716.161/0001-93;
- h) Resgatar o valor de R\$ 331.516,63 (Trezentos e trinta e um mil, quinhentos e dezesseis reais e sessenta e três centavos), do fundo SINGULARE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO CNPJ: 16.841.067/0001-00.

Aplicar os seguintes valores nos fundos de investimentos:

- a) Aplicar o valor de R\$ 977,10 (Novecentos e setenta e sete reais e dez centavos), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- b) Aplicar o valor de R\$ 10.841.068,54 (Dez milhões, oitocentos e quarenta e um mil, sessenta e oito reais e cinquenta 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;
- c) Aplicar o valor de R\$ 1.187,61 (Um mil, cento e oitenta e sete reais e sessenta e um centavos), 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\$ 1.741,10 (Um mil, setecentos e quarenta e um reais e dez 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 o valor de R\$ 7.524.025,29 (Sete milhões, quinhentos e vinte e quatro mil, vinte e cinco reais e vinte 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;
- f) Aplicar o valor de R\$ 7.588.337,24 (Sete milhões, quinhentos e oitenta e oito mil, trezentos e trinta e sete reais e vinte e quatro centavos), no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- g) Aplicar o valor de R\$ 3.795.124,59 (Três milhões, setecentos e noventa e cinco mil, cento e vinte e quatro reais e cinquenta e nove centavos), no FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE

INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO CNPJ:
13.397.466/0001-14.

Não havendo nada mais a tratar, o Diretor Presidente da Autarquia agradece a presença de todos e dá por encerrada a reunião; eu, José Marcos Alves de Barros, lavrei a presente ata que será assinada por mim e pelos demais representantes do Comitê.

MEMBROS DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS - ASSINATURA

MANOEL CARNEIRO SOARES CARDOSO	
FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JÚNIOR	
JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS	
MARCO AURÉLIO CORREIA PINHEIRO	

GUSTAVO LINS DOURADO	
SÁVIO TOSTES BARROSO	
JOSÉ RICARDO WANDERLEY DANTAS DE OLIVEIRA	
ROBERTO WAGNER MARTINS MATEUS	

CONVIDADOS - ASSINATURA

REBECA DE SOUZA ALVES MACHADO	
ELCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES	