

Ata nº 03/2021 – Comitê de Investimentos RECIPREV

Ata da Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos, realizada no dia 17 de março 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 dezessete (17) dias do mês de março 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 Investimento, **Andreson Carlos Gomes de Oliveira**, o servidor da Gerência de Investimentos, **Gustavo Lins Dourado**; O representante titular da Secretário de Finanças, **André José Ferreira Nunes** ; O representante titular da Secretário de Planejamento, Gestão e Transformação Digital, **Sávio Tostes Barroso e o suplente Roberto Wagner Martins Mateus**. Como convidados: a Chefe da Área de Controles Internos, **Rebeca de Souza Alves Machado**, o aposentado pela PREVI, Sr. **Marco Aurélio Correia Pinheiro**. 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 28.02.2021 e 12.02.2021. Com relação a posição de 15.03.20221, 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 RECIPEV em relação ao Volume Consolidado por Grupo Econômico sob Administração ANBIMA; Percentual de participação dos investimentos da RECIPEV 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 RECIPEV por Benchmark – Ano Atual; Composição da Carteira de Investimentos RECIPEV – 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 RECIPEV – Ano Atual; Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECIPEV – Ano Atual; Rentabilidades na curva e à mercado mensal e anual da Carteira de Investimentos RECIPEV; Resumo do Patrimônio Líquido e Rentabilidade da Carteira de Investimentos - Fundo Previdenciário RECIPEV e Fundo Financeira RECIFIN Contendo os seguintes dados: Data; Saldo; Rendimento mês; % Rendimento Carteira e o resumo anual; Gráfico comparativo da carteira RECIPEV: 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 RECIPEV; 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 RECIPEV; Evolução da Carteira de Investimentos e Superávit/Deficit atuarial da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário RECIPEV; Rentabilidades anuais e acumulada de 2014 até posição atual da Carteira de Investimentos RECIPEV; Panorama Macroeconômico; Desempenho da Carteira de Investimentos RECIPEV; Parecer do Comitê de Investimentos da Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde do Servidores (RECIPEV). Com relação a posição de 15.03.2021, foi apresentado relatório com os seguintes dados da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário RECIPEV: 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 12 de março de 2021, a expectativa para o IPCA de 2021 teve forte aumento, saindo de 3,62%, no mês anterior, para 4,60% no atual. Para 2022 o IPCA saiu de 3,49% para 3,50%. Com relação a Selic, a mediana do mercado para o ano corrente teve aumento significativo, saindo de 3,75% para 4,50%, para 2022 sai de 5,00% para 5,50%. Para os anos de 2023 e 2024, de acordo com o relatório, as expectativas para o IPCA permanecem em

3,25%. Com relação a SELIC, a expectativa também não mudou, ficando em 6,00% para os dois anos.

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 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\$ 3.000.000,00 (Três 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;
- b) Resgatar o valor de R\$ 1.824,90 (Um mil, oitocentos e vinte e quatro reais e noventa 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\$ 1.816.234,59 (Um milhão, oitocentos e dezesseis mil, duzentos e trinta e quatro reais e cinquenta e nove centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- d) Resgatar o valor de R\$ 8.637.226,82 (Oito milhões, seiscentos e trinta e sete mil, duzentos e vinte e seis reais e oitenta 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;
- e) Resgatar o valor de R\$ 27.000.000,00 (Vinte e sete milhões de reais), do fundo SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO SELEÇÃO TOP AÇÕES CNPJ: 02.436.763/0001-05;
- f) Resgatar o valor de R\$ 300.000,00 (Trezentos mil reais), do FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO CNPJ: 13.397.466/0001-14;
- g) Resgatar o valor de R\$ 46.610,57 (Quarenta e seis mil, seiscentos e dez reais e cinquenta 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;

- h) Resgatar o valor de R\$ 25.000,00 (Vinte e cinco mil reais), do fundo BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII CNPJ: 20.716.161/0001-93;
- i) Resgatar o valor de R\$ 603.773,81 (Seiscentos e três mil, setecentos e setenta e três reais e oitenta e um centavos), do fundo SOCOPA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO CNPJ: 16.841.067/0001-99;
- j) Resgatar o valor de R\$ 8.390.000,00 (Oito milhões, trezentos e noventa mil reais), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05.

Aplicar os seguintes valores nos fundos de investimentos:

- a) Aplicar o valor de R\$ 3.000.000,009 (Três milhões de reais), no fundo MONGERAL AEGON INFLAÇÃO REFERENCIADO IMA-B FI RF LP CNPJ: 14.115.118/0001-70;
- b) Aplicar o valor de R\$ 966.998,81 (Novecentos e sessenta e seis mil, novecentos e noventa e oito reais e oitenta e um 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\$ 1.186,61 (Um mil, cento e oitenta e seis 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\$ 27.000.000,00 (Vinte e sete milhões de reais), no fundo SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF CNPJ: 13.455.117/0001-01;
- e) Aplicar o valor de R\$ 190.789,52 (Cento e noventa mil, setecentos e oitenta e nove reais e cinquenta e dois 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\$ 19.380.455,05 (Dezenove milhões, trezentos e oitenta mil, quatrocentos e cinquenta e cinco reais e cinco 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\$ 8.390.000,00 (Oito milhões, trezentos e noventa mil reais), 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,

Andreson Carlos Gomes de Oliveira, 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	
ANDRESON CARLOS GOMES DE OLIVEIRA	
GUSTAVO LINS DOURADO	
ROBERTO WAGNER MARTINS MATEUS	
SÁVIO TOSTES BARROSO	

ANDRÉ JOSÉ FERREIRA NUNES	
---------------------------	--

CONVIDADOS - ASSINATURA

REBECA DE SOUZA ALVES MACHADO	
----------------------------------	--