

Ata nº 10/2021 – Comitê de Investimentos RECIPREV

Ata da Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos, realizada no dia 20 de outubro 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 vinte dias do mês de OUTUBRO 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**. 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**. 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 30.09.2021 e 18.10.2021. Com relação a posição de 30.09.2021, 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 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; % 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 + 5,41% 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 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/Deficit 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 18.10.2021, foi apresentado relatório com 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. O Sr. Manoel Carneiro informou que foi encaminhado a seguinte informação para o Conselho Fiscal, tendo em vista solicitação: Reiterando as informações enviadas a esse Conselho Fiscal no dia 17 de agosto passado, serve o presente para acrescentar que o Comitê de Investimentos ,na reunião ordinária daquele mês, foi cientificado sobre a solicitação de esclarecimentos sobre o contrato de prestação de serviços financeiros firmado em 2020 pelo Município do Recife e a Caixa Econômica Federal (documento apensado) , especialmente sobre os investimentos realizados naquela instituição pelo Fundo Previdenciário RECIPIREV. Acrescento, por oportuno, que na

reunião extraordinária do Comitê de Investimentos, realizada naquele mesmo mês, o Gerente de Investimentos apresentou estudos e atestados de compatibilidade a respeito da aquisição de títulos públicos do Tesouro Nacional, especialmente NTN-B, por parte do RECIPREV, com resgates nas aplicações na Renda Fixa, cuja indicação foi aprovada por unanimidade pelo Comitê de Investimentos haja vista a sua aderência à Política de Investimentos AMPASS 2021. Valendo salientar que esses assuntos foram abordados pela Diretoria Executiva da AMPASS no Conselho Municipal de Previdência nas reuniões de março e setembro do corrente ano.

De acordo com as expectativas de mercado do Relatório de Mercado do Banco Central de 18.10.2021, utilizadas como cenário base para tomadas de decisões de investimentos, do dia 20 de outubro de 2021, a expectativa para o IPCA de 2021 teve forte aumento, indo para 8,69%. Para 2022 o IPCA está em 4,18%. Com relação a Selic, a mediana do mercado para o ano corrente teve aumento significativo, indo para 8,25%, e para 2022 está em 8,75%. Para os anos de 2023 e 2024, de acordo com o relatório, as expectativas para o IPCA permanecem em 3,25% e 3,00%.

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 seguintes:

Resgatar os seguintes valores dos fundos de investimentos:

- a) Resgatar o valor de R\$ 11.635.159,97 (Onze milhões, seiscentos e trinta e cinco mil, cento e cinquenta e nove reais e noventa 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;
- b) Resgatar o valor de R\$ 1.782,11 (Um mil, setecentos e oitenta e dois reais e onze 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\$ 11.200.386,18 (Onze milhões, duzentos mil, trezentos e oitenta e seis reais e dezoito 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\$ 2.584.484,25 (Dois milhões, quinhentos e oitenta e quatro mil, quatrocentos e oitenta e quatro reais e vinte e cinco 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\$ 45.000,00 (Quarenta e cinco mil reais), do fundo BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII CNPJ: 20.716.161/0001-93;
- f) Resgatar o valor de R\$ 694.021,22 (Seiscentos e noventa e quatro mil, vinte e um reais e vinte e dois centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 15.486.093/0001-83;
- g) Resgatar o valor de R\$ 1.101.963,75 (Um milhão, cento e um mil, novecentos e sessenta e três reais e setenta e cinco centavos), do TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)- CÓDIGO: 10359219 (7604);
- h) Resgatar o valor de R\$ 1.101.963,75 (Um milhão, cento e um mil, novecentos e sessenta e três reais e setenta e cinco centavos), do TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)- CÓDIGO: 6650570 (7647);
- i) Resgatar o valor de R\$ 1.101.963,75 (Um milhão, cento e um mil, novecentos e sessenta e três reais e setenta e cinco centavos), do TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)- CÓDIGO: 6650571 (7632);
- j) Resgatar o valor de R\$ 1.101.963,75 (Um milhão, cento e um mil, novecentos e sessenta e três reais e setenta e cinco centavos), do TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759226);
- k) Resgatar o valor de R\$ 1.101.963,75 (Um milhão, cento e um mil, novecentos e sessenta e três reais e setenta e cinco centavos), do TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759225);
- l) Resgatar o valor de R\$ 1.101.963,75 (Um milhão, cento e um mil, novecentos e sessenta e três reais e setenta e cinco centavos), do TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15759224);
- m) Resgatar o valor de R\$ 2.369.222,06 (Dois milhões, trezentos e sessenta e nove mil, duzentos e vinte e dois reais e seis centavos), do TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (ANTIGA NTN-B 2045)- CÓDIGO: 10359220 (7608);
- n) Resgatar o valor de R\$ 2.203.927,50 (Dois milhões, duzentos e três mil, novecentos e vinte e sete reais e cinquenta centavos), do TESOURO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15786866);

- o) Resgatar o valor de R\$ 3.305.891,25 (Três milhões, trezentos e cinco mil, oitocentos e noventa e um reais e vinte e cinco centavos), do TESOIRO IPCA COM JUROS SEMESTRAIS (NTN-B 2045- CÓDIGO: 15786865).

Aplicar os seguintes valores nos fundos de investimentos:

- a) Aplicar o valor de R\$ 11.635.160,97 (Onze milhões, seis centos e trinta e cinco mil, cento e sessenta reais e noventa 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;
- b) Aplicar o valor de R\$ 1.091.769,90 (Um milhão, noventa e um mil, setecentos e sessenta e nove reais e noventa 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\$ 3.038.124,61 (Três milhões, trinta e oito mil, cento e vinte e quatro reais e sessenta 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;
- d) Aplicar o valor de R\$ 469.403,66 (Quatrocentos e sessenta e nove mil, quatrocentos e três reais e sessenta e seis 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\$ 14.169.622,54 (Quatorze milhões, cento e sessenta e nove mil, seiscentos e vinte e dois reais e cinquenta 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;
- f) Aplicar o valor de R\$ 112.320,87 (Cento e doze mil, trezentos e vinte reais e oitenta 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;
- g) Aplicar o valor de R\$ 739.021,22 (Setecentos e trinta e nove mil, vinte e um reais e vinte 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.

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	

CONVIDADOS - ASSINATURA

REBECA DE SOUZA ALVES MACHADO	
ELCIO RICARDO LEITE GUIMARÃES	