

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

ATA Nº 009/2024	Data: 26/09/2024
Local: Virtual – Google Meet	
Membros Presentes: <ul style="list-style-type: none"> • Marconi Muzzio Pires de Paiva Filho – Diretor-Presidente da AMPASS • Andreson Carlos Gomes de Oliveira – Gerência de Investimentos da AMPASS • Mariana Trigueiro de Freitas – Gestora da Unidade Jurídica • José Ricardo Wanderley Dantas de Oliveira – Controladoria-Geral do Município • Roberto Wagner Martins Mateus - Secretaria de Planejamento, Gestão e Transformação Digital • Francisco Canindé Antunes Furtado Júnior – Vice-Diretor-Presidente da AMPASS 	
Membros Ausentes:	
Convidados Presentes: <ul style="list-style-type: none"> • Gutemberg Peixoto Calazans Filho – Chefe de Divisão de Investimentos da AMPASS • Gustavo Lins Dourado – Gerência de Investimentos da AMPASS 	
Presidente do Comitê: 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 agosto/2024. Dando continuidade, o Sr Andreson Oliveira apresentou os relatórios da carteira de investimentos RECI PREV, com posição em 30.08.2024. 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 RECI PREV 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 RECI PREV por Benchmark – Ano Atual; Composição da Carteira de Investimentos RECI PREV – 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 RECI PREV – Ano Atual; Rentabilidade Acumulada por Segmento da Carteira de Investimentos RECI PREV – Ano Atual; Rentabilidades na curva e à mercado mensal e anual da Carteira de Investimentos RECI PREV; Resumo do Patrimônio Líquido e Rentabilidade da Carteira de Investimentos - Fundo Previdenciário RECI PREV e Fundo Financeira RECIFIN Contendo os seguintes dados: Data; Saldo; Rendimento mês; % Rendimento Carteira e o resumo anual; Gráfico comparativo da carteira RECI PREV: 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 RECI PREV; 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 RECI PREV; Evolução da Carteira de Investimentos e Superávit/Deficit atuarial da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário RECI PREV; Rentabilidades anuais e acumulada de 2014 até posição atual da Carteira de Investimentos RECI PREV; Panorama Macroeconômico; Desempenho da Carteira de Investimentos RECI PREV; 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 RECI PREV: 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 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; Percentual de participação dos investimentos da RECI PREV 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 RECI PREV por Benchmark – Ano Atual; Composição da Carteira de Investimentos RECI PREV – 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 RECI PREV – 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. Foi apresentado relatório de análise de performance, detalhando os percentuais de alocação estratégica para cada tipo de ativo, os benchmarks da carteira, as projeções de retorno e os resultados alcançados pelo Fundo Previdenciário Reciprev até o momento em comparação com as projeções realizadas na elaboração da Política de Investimentos para o exercício. Além disso, foram analisadas as razões para os desvios observados entre essas métricas e discutidas as perspectivas para os próximos meses. 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 setembro de 2024, a expectativa para o IPCA de 2024, está em 4,37% de 4,25% no mês anterior. Para 2025 o IPCA está em 3,97%, antes 3,93%. Com relação a Selic, a mediana do mercado para o ano corrente saiu de 10,50% para 11,50% e de 10% para 10,50% em 2025. Para os anos seguintes, de acordo com o relatório, a expectativa para o IPCA de 2026 foi para 3,62% de 3,60% e permaneceu em 3,50% para 2027. Já a Selic permanece em 9,00% para 2027 e 9,5% em 2026.

<p>Deliberações</p>	<p>Na sequência, o Sr. Andreson Oliveira apresentou as sugestões de alocação para o próximo mês. 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 recebidos e 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 financeiras e fundos de investimentos, 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.</p> <p>Resgatar os seguintes valores dos fundos de investimentos:</p> <ul style="list-style-type: none"> a) R\$ 1.933.546,00 (Um milhão, novecentos e trinta e três mil, quinhentos e quarenta e seis reais) do fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55; b) R\$ 1.254.483,87 (Um milhão, duzentos e cinquenta e quatro mil, quatrocentos e oitenta e três reais e oitenta e sete centavos) do fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55; c) R\$ 21.900.000,00 (Vinte e um milhões, novecentos mil reais) do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO, CNPJ: 13.077.415/0001-05; d) R\$ 8.500.000,00 (Oito milhões e quinhentos mil reais) do fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55; e) R\$ 17.000,00 (Dezessete mil reais) do fundo BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII, CNPJ: 20.716.161/0001-93; f) R\$ 7.337,99 (Sete mil, trezentos e trinta e sete reais e noventa e nove centavos) do fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55; g) 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; h) R\$ 6.166,76 (Seis mil, cento e sessenta e seis reais e setenta e seis centavos) do fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55; i) R\$ 1.193,17 (Mil, centos e noventa e três reais e dezessete centavos) do fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55; j) R\$ 13.300.000,00 (Treze milhões e trezentos mil reais) do fundo FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97; k) R\$ 13.600.000,00 (Treze milhões e seiscentos mil reais) do fundo CAIXA BRASIL R\$
----------------------------	---

DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;

- l) R\$ 437.500,00 (Quatrocentos e trinta e sete mil e quinhentos reais) do fundo BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII, CNPJ: 20.716.161/0001-93
- m) R\$ 247.674,86 (Duzentos e quarenta e sete mil, seiscentos e setenta e quatro reais e oitenta e seis centavos) do fundo FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO, CNPJ: 13.397.466/0001-14;
- n) 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;
- o) R\$ 13.424.792,65 (Treze milhões, quatrocentos e vinte e quatro mil, setecentos e noventa e dois reais e sessenta e cinco 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\$ 1.500.000,00 (Um milhão e quinhentos mil reais) do fundo FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97

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\$ 21.900.000,00 (Vinte e um milhões, novecentos mil reais) no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO, CNPJ: 13.322.205/0001-35;
- c) R\$ 8.500.000,00 (Oito milhões e quinhentos mil reais) no fundo FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97;
- d) R\$ 1.941.088,31 (Um milhão, novecentos e quarenta e um mil, oitenta e oito reais e trinta e um centavos) no fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- e) R\$ 9.640,88 (Nove mil, seiscentos e quarenta reais e oitenta e oito centavos) no fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- f) R\$ 466.701,52 (Quatrocentos e sessenta e seis mil, setecentos e um reais e cinquenta e dois centavos) no fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- g) R\$ 22.329.442,41 (Vinte e dois milhões, trezentos e vinte e nove mil, quatrocentos e quarenta e dois reais e quarenta e um centavos) no fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- h) R\$ 1.453,03 (Mil, quatrocentos e cinquenta e três reais e três centavos) no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO, CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- i) R\$ 17.000,00 (Dezessete mil 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\$ 2.784.307,05 (Dois milhões, setecentos e oitenta e quatro mil, trezentos e sete reais e cinco 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\$ 13.300.000,00 (Treze milhões e trezentos mil reais) no fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- m) R\$ 13.600.000,00 (Treze milhões e seiscentos mil reais) no fundo FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO, CNPJ: 13.397.466/0001-14;
- n) R\$ 437.500,00 (Quatrocentos e trinta e sete mil, quinhentos reais) no fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO, CNPJ: 13.077.415/0001-05;

- o) R\$ 3.186.625,73 (Três milhões, cento e oitenta e seis mil, seiscentos e vinte e cinco reais e setenta e três centavos) no fundo CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA, CNPJ: 14.508.643/0001-55;
- p) 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	