

Ata nº 11/2020 – Comitê de Investimentos RECIPREV

Ata da Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos, realizada no dia 17 de novembro de 2020; 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 novembro do ano de dois mil e vinte (2020), 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 de Investimentos, **José Marcos Alves de Barro**; O chefe de Divisão de Investimento, **Andreson Carlos Gomes de Oliveira**, o servidor da Gerência de Investimentos, **Gustavo Lins Dourado**, o representante titular da Secretaria de Finanças, **Rodrigo Chagas de Sá**; O representante titular da Secretaria Planejamento, Administração e Gestão de Pessoas, **Roberto Wagner Martins Mateus**. Como convidada a Gestora da Unidade de Controles Internos da AMPASS, **Juliana Cottard Giestosa**. 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 30.10.2020 e 13.11.2020. Com relação a posição de 30.10.2020, foram apresentados 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 + 5,00% x CDI x IMA-B x IBOVESPA do ano atual; Rendimento da Carteira (%) x IPCA + 5,00% 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+5,00% 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 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 13.11.2020, foram apresentados 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 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 13 de novembro de 2020, a expectativa para o IPCA de 2020 aumentou significativamente, saindo de 1,99%, no mês anterior, para 3,25% no atual. Para 2021 a

expectativa também aumentou, saindo de 3,01% para 3,22%. Com relação a Selic, a mediana do mercado para o ano corrente permanece em 2,00%. Já para 2021 a projeção teve aumento, saindo de 2,50% para 2,75%. Para os anos de 2022 e 2023, de acordo com o relatório, as expectativas para o IPCA permanecem em 3,50% e 3,25% respectivamente. Com relação a SELIC, a expectativa permanece em 4,50% em 2022 e aumentou de 5,63% para 6,00% em 2023.

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, ficou definido fazer, neste momento, as transferências dos fundos e títulos do BB para a Caixa Econômica Federal em decorrência do contrato de conta única firmado entre a Prefeitura e a Caixa Econômica Federal, registrando, no entanto, que os fundos apresentam retornos equivalentes. O Sr. José Marcos apresentou diversas outras movimentações envolvendo outros fundos, inclusive aqueles que estão com impacto no Patrimônio do fundo acima de 9%, sendo acompanhado pelo Sr. Roberto Wagner no que diz respeito somente aos fundos acima de 9%. Os demais membros do Comitê de Investimentos não concordaram em fazer as outras movimentações apresentadas na planilha de deliberações, no momento, ficando, se for houver alteração significativa no mercado de promover nova reunião. Ao final, foram aprovados por unanimidade as seguintes operações seguintes.

Resgatar os seguintes valores dos fundos de investimentos:

- a) Resgatar o valor de R\$ 87.552.933,03 (Oitenta e sete milhões, quinhentos e cinquenta e dois mil, novecentos e trinta e três reais e três centavos), do fundo BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO CNPJ: 17.413.636/0001-68;
- b) Resgatar o valor de R\$ 398.414.789,69 (Trezentos e noventa e oito milhões, quatrocentos e quatorze mil, setecentos e oitenta e nove reais e sessenta e nove centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO CNPJ: 25.078.994/0001-90;
- c) Resgatar o valor de R\$ 29.838.145,66 (Vinte e nove milhões, oitocentos e trinta e oito mil, cento e quarenta e cinco reais e sessenta e seis centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI CNPJ: 11.328.882/0001-35;

- d) Resgatar o valor de R\$ 29.826.000,00 (Vinte e nove milhões, oitocentos e vinte e seis mil reais), 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\$ 11.148.813,27 (Onze milhões, cento e quarenta e oito mil, oitocentos e treze reais e vinte 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;
- f) Resgatar o valor de R\$ 14.156,05 (Quatorze mil, cento e cinquenta e seis reais 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;
- g) Resgatar o valor de R\$ 8.595.330,96 (Oito milhões, quinhentos e noventa e cinco mil, trezentos e trinta reais e noventa e seis centavos), do FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO CNPJ: 13.397.466/0001-14;
- h) Resgatar o valor de R\$ 1.807.035,20 (Um milhão, oitocentos e sete mil, trinta e cinco reais e vinte centavos), do FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO CNPJ: 13.397.466/0001-14;
- i) Resgatar o valor de R\$ 9.676.188,16 (Nove milhões, seiscentos e setenta e seis mil, cento e oitenta e oito reais e dezesseis centavos), do FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO CNPJ: 13.397.466/0001-14;
- j) Resgatar o valor de R\$ 67.000.000,00 (Sessenta e sete milhões de reais), do fundo ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 21.838.150/0001-49;
- k) Resgate total do fundo ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 21.838.150/0001-49, correspondente a R\$ 93.329.462,67 (Noventa e três milhões, trezentos e vinte e nove mil, quatrocentos e sessenta e dois reais e sessenta e sete centavos);
- l) Resgate total do fundo SUL AMÉRICA INFLATIE FI RF LONGO PRAZO CNPJ: 09.326.708/0001-01, correspondente a R\$ 55.528.064,54 (Cinquenta e cinco milhões, quinhentos e vinte e oito mil, sessenta e quatro reais e cinquenta e quatro centavos);
- m) Resgate total do fundo XP INFLAÇÃO REFERENCIADO IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LP CNPJ: 14.146.491/0001-01, correspondente a R\$ 6.379.214,33 (Seis milhões, trezentos e setenta e nove mil, duzentos e quatorze reais e trinta e três centavos);

- n) Resgatar o valor de R\$ 357.593,93 (Trezentos e cinquenta e sete mil, quinhentos e noventa e três reais e noventa e três centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- o) Resgatar o valor de R\$ 300.000.000,00 (Trezentos milhões de reais), do fundo CAIXA BRASIL IDkA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 14.386.926/0001-71;
- p) Resgatar o valor de R\$ 6.003,84 (Seis mil, três reais e oitenta e quatro centavos), do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CNPJ: 13.077.415/0001-05;
- q) Resgatar o valor de R\$ 24.000,00 (Vinte e quatro mil reais), do fundo BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO. FII CNPJ:20.716.161/0001-93.

Aplicar os seguintes valores nos fundos de investimentos:

- a) Aplicar o valor de \$ 4.000.000,00 (Quatro milhões de reais), 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\$ 25.838.145,66 (Vinte e cinco milhões, oitocentos e trinta e oito mil, cento e quarenta e cinco 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;
- c) Aplicar o valor de R\$ 20.000.000,00 (Vinte milhões de reais), no FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR CNPJ: 30.068.224/0001-04;
- d) Aplicar o valor de R\$ 9.826.000,00 (Nove milhões, oitocentos e vinte e seis mil reais), no FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO CNPJ: 13.397.466/0001-14;
- e) Aplicar o valor de R\$ 387.265.976,42 (Trezentos e oitenta e sete milhões, duzentos e sessenta e cinco mil, novecentos e setenta e seis reais e quarenta e dois centavos), no fundo CAIXA BRASIL IDkA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 14.386.926/0001-71;
- f) Aplicar o valor de R\$ 87.552.933,03 (Oitenta e sete milhões, quinhentos e cinquenta e dois mil, novecentos e trinta e três reais e três centavos), no fundo CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I CNPJ: 17.502.937/0001-68;

- g) Aplicar o valor de R\$ 11.148.813,27 (Onze milhões, cento e quarenta e oito mil, oitocentos e treze reais e vinte 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;
- h) Aplicar o valor de R\$ 11.148.813,27 (Onze milhões, cento e quarenta e oito mil, oitocentos e treze reais e vinte e sete centavos), no fundo CAIXA BRASIL IDkA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 14.386.926/0001-71;
- i) Aplicar o valor de R\$ 389.448,56 (Trezentos e oitenta e nove mil, quatrocentos e quarenta e oito reais e cinquenta 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;
- j) Aplicar o valor de R\$ 1.094,64 (Um mil, noventa e quatro reais e sessenta 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;
- k) Aplicar o valor de R\$ 67.000.000,00 (Sessenta e sete milhões de reais), no fundo CAIXA BRASIL IDkA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 14.386.926/0001-71;
- l) Aplicar o valor de R\$ 148.857.527,21 (Cento e quarenta e oito milhões, oitocentos e cinquenta e sete mil, quinhentos e vinte e sete reais e vinte e um centavos), no fundo CAIXA BRASIL IDkA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO CNPJ: 14.386.926/0001-71;
- m) Aplicar o valor de R\$ 1.094,64 (Um mil, noventa e quatro reais e sessenta 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;
- n) Aplicar o valor de R\$ 309.647,23 (Trezentos e nove mil, seiscentos e quarenta e sete reais e vinte 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;
- o) Aplicar o valor de R\$ 306.379.214,33 (Trezentos e seis milhões, trezentos e setenta e nove mil, duzentos e quatorze reais e trinta e três centavos), no FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA CNPJ: 23.215.097/0001-55;
- p) Aplicar o valor de R\$ 23.498,75 (Vinte e três mil, quatrocentos e noventa e oito reais e setenta 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;

- q) Aplicar o valor de R\$ 5.300.000,00 (Cinco milhões e trezentos mil reais), no FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CURTO PRAZO PODER PÚBLICO CNPJ: 13.397.466/0001-14;
- r) Aplicar o valor de R\$ 2.051.488,24 (Dois milhões, cinquenta e um mil, quatrocentos e oitenta e oito 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.

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

MANOEL CARNEIRO SOARES CARDOSO

FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JÚNIOR

JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS

ANDRESON CARLOS GOMES DE OLIVEIRA

GUSTAVO LINS DOURADO

RODRIGO CHAGAS DE SÁ

ROBERTO WAGNER MARTINS MATEUS

JULIANA COTTARD GIESTOSA