

133ª ATA ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV

Aos trinta dias do mês de março de dois mil e vinte e dois, às 09h, o Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba – CaraguaPrev realizou reunião ordinária online por meio da plataforma digital Google Meet, devido ao contexto da pandemia do COVID-19 (Novo Coronavírus). Presentes à reunião a Presidente Luana Moussalli Forcioni Guedes e os membros Pedro Ivo de Sousa Tau, Adriana Zambotto, Ivone Cardoso Vicente Alfredo e Rosemeire Maria de Jesus. Declarada aberta a reunião, a Presidente do Comitê agradeceu a presença de todos principalmente nesse momento de crise sanitária e elencou os itens da pauta sendo: 1) Prestação de Contas fevereiro/22; 2) Abertura Fundo de Investimento BB e Aplicação COMPREV; 3) Renovação de Credenciamentos Instituições; 4) Pagamento de Precatórios. Inicialmente a Presidente do Comitê informou sobre a Certificação profissional dos dirigentes, membros do conselho deliberativo, membros do conselho fiscal, responsáveis pela gestão de recursos e membros do comitê de investimentos dos RPPS da união, dos estados, do distrito federal e dos municípios, terão como condição para o exercício dos respectivos cargos ou funções e informou que o CaraguaPrev já está buscando uma capacitação para os membros do conselhos e diretoria executiva, de forma presencial e on-line. Passado ao primeiro item da pauta que trata da prestação da Prestação de Contas do mês de FEVEREIRO de dois mil e vinte e dois, que está disponibilizada no site do Instituto, sendo enviado o link para os membros do Comitê no ato da convocação da reunião, assim como o relatório mensal dos investimentos, que foi analisado e aprovado, também aprovadas as demonstrações financeiras, os relatórios e balanços contábeis das receitas e despesas, as conciliações bancárias, apresentada a evolução da execução do orçamento do RPPS e as contribuições previdenciárias, a rentabilidade, o enquadramento dos investimentos com a Política de Investimentos do CaraguaPrev e atendimento a Resolução do Conselho Monetário Nacional. Após foi apresentado o Gráfico da evolução patrimonial e rentabilidade mensal do ano de 2022 e os dados atualizados dos fluxos de caixa e dos investimentos, com visão de curto, médio e longo prazo, conforme relatório da análise dos investimentos e balanços contábeis disponibilizado a todos os conselheiros e segurados do CaraguaPrev no site do Instituto. Explicou ainda que o mês de fevereiro de 2022 acabou sendo levemente positivo para a renda fixa, com exceção aos fundos de investimentos compostos por vencimentos mais longos, levemente positivo para renda variável e negativo para investimentos estruturados e investimentos no

exterior. GERAL: De forma positiva e considerando dados consolidados, no mês de fevereiro continuamos observando um declínio mundial do número de contágio e de mortes por Covid-19. No front dos mercados, o Fed continuou mantendo um posicionamento mais duro em relação à elevação de juros no mercado americano, cada vez mais próxima, em que o mercado espera uma alta de 0,25% já na próxima reunião. No entanto, após a invasão da Ucrânia pela Rússia, as atenções dos mercados ficaram mais concentradas nos eventos e desdobramentos negativos trazidos pela guerra. BRASIL: Ainda que agregando o risco internacional, agora em especial em relação aos desdobramentos negativos trazidos pela guerra, a atenção com a dinâmica inflacionária e dúvidas fiscais mais acentuadas em ano eleitoral, além do constante ruído político entre os três poderes, continuam sendo fatores relevantes para explicação dos movimentos nos mercados locais. COPOM: SELIC em 10,75 % a.a.(02/02/2022). GLOBAL: A eclosão do conflito entre Rússia e Ucrânia elevou substancialmente a instabilidade global, derrubando as principais bolsas de valores mundiais e impulsionando para máximas históricas os preços do petróleo. Em resposta à invasão, diversas economias impuseram sanções contra à Rússia, incluindo remoção de vários bancos russos do sistema de pagamento internacional (Swift), congelamento de ativos russos, restrições comerciais e fechamento do espaço aéreo. Apesar de algumas tentativas de negociações diplomáticas, ainda não houve avanço para o término do confronto. Com relação aos investimentos no exterior, diante deste cenário, estão oscilando negativamente na carteira do Instituto, apesar de no acumulado estarem positivos, a orientação do consultor financeiro da LDB empresas é aguardar a estabilização desses fundos de investimento. Após a apresentação, a Presidente perguntou se algum membro do Comitê tem alguma dúvida ou consideração e com a negativa a Prestação de Contas foi aprovada por todos os presentes. Em seguida, o segundo item da pauta trata da Abertura Fundo de Investimento do Banco do Brasil e aplicação dos recebimentos do COMPREV. Diante do cenário econômico os fundos de investimentos compostos por títulos públicos pré-fixados longos (IRFM-1 e IRFM-1+), e os fundos de investimentos compostos por títulos públicos pós-fixados mais longos (IMA B 5+ e IMA B) terão maior volatilidade ao longo de 2022, assim é necessário a redução da exposição nestes fundos, passando para fundos mais curtos, como o IMA-B 5, IDKA 2 e DI, além de compra direta de Títulos Públicos do Governo Federal, desde que as taxas estejam acima da meta atuarial do Instituto. Inicialmente tratou do credenciamento do Fundo de Investimento BB Previdenciário Renda Fixa

Referenciado DI Perfil FIC FI, CNPJ: 13.077.418/0001-49, gerido e administrado pela BB Gestão de Recursos DTVM S.A., analisado o regulamento do fundo, a sua lâmina e seu enquadramento quanto ao disposto no Artigo 7º, inciso III, “a”, da Resolução CMN nº 4.963/2021. Analisado também a solidez da Instituição Financeira previamente cadastrada no CaraguaPrev e o alto patrimônio líquido presente no fundo, também analisado pela consultoria financeira LDB empresas, que concluiu que fundo está apto a receber aplicações, sendo aprovado pelo Comitê de Investimentos. Assim, a fim de buscar uma maior rentabilidade, tendo em vista que o rendimento nos últimos 05 (cinco) anos foi positivo, foi aprovado por todos os membros do Comitê de Investimentos que o repasse mensal recebido a título de valores correspondentes à compensação previdenciária – COMPREV, deverão ser aplicados no Fundo de Investimento BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI Perfil FIC FI, que após análise ficou constatado que o referido fundo obteve rentabilidade superior ao Fundo de Investimento BB Previdenciário Renda Fixa IRF-M 1, buscando assim uma maior rentabilidade e proteção dos investimentos do Instituto. O Comitê avaliou e aprovou que o recebimento do repasse referente aos aportes recebidos do Plano de Amortização serão realizados no Fundo de Investimento BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI Perfil FIC FI, CNPJ: 13.077.418/0001-49, que após análise ficou constatado que o referido fundo obteve rentabilidade superior ao Fundo de Investimento BB Previdenciário Renda Fixa IRF-M 1, buscando assim uma maior rentabilidade e proteção dos investimentos do Instituto. O Comitê avaliou e aprovou o resgate do valor total aplicado no Fundo de Investimento BB Previdenciário RF IMA-B 5+, da conta corrente referente aos aportes recebidos do Plano de Amortização, para aplicação do valor total resgatado no Fundo de Investimento BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI Perfil FIC FI. Após análise ficou constatado que o FI BB Previdenciário RF IMA-B 5+ obteve rentabilidade em 2021 de -6,78% e até 25/03/2022 de 2,39%, com volatilidade a.a. de 8,82%, em contrapartida o Fundo de Investimento BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI Perfil FIC FI, obteve rentabilidade em 2021 de 4,62%, e até 25/03/2022 de 2,326%, com volatilidade a.a. de 0,21%, ou seja, saindo de um fundo muito volátil, buscando assim uma maior rentabilidade e proteção dos investimentos do Instituto no cenário econômico atual. O Comitê avaliou e aprovou o resgate do valor total aplicado no Banco do Brasil, Fundo de Investimento BB Previdenciário RF IMA-B 5+, da conta corrente previdenciária, para aplicação de R\$ 10.000.000,00 (dez milhões de reais) no Banco Santander,

Fundo de Investimento Santander RF IMA-B5 PREMIUM FIC FI, CNPJ: 13.455.117/0001-01, já constante da carteira de investimentos do CaraguaPrev. O Fundo de Investimentos dentre os vértices de inflação, o B5 é o mais conservador, além de capturar parte da pressão inflacionária que vivemos atualmente, é uma estratégia durante o período atual da economia, o fundo apresenta melhor rentabilidade em todas as janelas e obteve rentabilidade superior ao fundo que será resgatado nos anos de 2021 e 2022. O Fundo de Investimento BB Previdenciário RF IMA-B 5+ obteve rentabilidade em 2021 de -6,78% e até 25/03/2022 de 2,39%, com volatilidade a.a. de 8,82%, em contrapartida o Fundo de Investimento Santander RF IMA-B5 PREMIUM FIC FI, obteve rentabilidade em 2021 de 4,35% e até 25/03/2022 de 4,07%, com volatilidade a.a. de 2,69%, ou seja, saindo de um fundo muito volátil, buscando assim uma maior rentabilidade e proteção dos investimentos do Instituto no cenário econômico atual. O Comitê avaliou e aprovou o resgate do valor restante do aplicado no Banco do Brasil, Fundo de Investimento BB Previdenciário RF IMA-B 5+, para aplicação do valor total resgatado no Fundo de Investimento BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI Perfil FIC FI. Após análise ficou constatado que o FI BB Previdenciário RF IMA-B 5+ obteve rentabilidade em 2021 de -6,78% e até 25/03/2022 de 2,39%, com volatilidade a.a. de 8,82%, em contrapartida o Fundo de Investimento BB Previdenciário Renda Fixa Referenciado DI Perfil FIC FI, obteve rentabilidade em 2021 de 4,62%, e até 25/03/2022 de 2,326%, com volatilidade a.a. de 0,21%, ou seja, saindo de um fundo muito volátil, buscando assim uma maior rentabilidade e proteção dos investimentos do Instituto no cenário econômico atual. O Comitê avaliou e aprovou o resgate do valor total aplicado na Caixa Econômica Federal, Fundo de Investimento Caixa FI Brasil IMAB 5+ LP, CNPJ: 10.577.503/0001-88, para aplicação de R\$ 25.000.000,00 (vinte e cinco milhões de reais) na Caixa econômica Federal, Fundo de Investimento Caixa Brasil IDKA 2 FI, CNPJ: 14.386.926/0001-71, já constante da carteira de investimentos do CaraguaPrev. Após análise ficou constatado que o Fundo de Investimento Caixa FI Brasil IMAB 5+ LP obteve rentabilidade em 2021 de -7,00% e até 25/03/2022 de 2,46%, com volatilidade a.a. de 8,76%, em contrapartida o Fundo de Investimento Caixa Brasil IDKA 2 FI, obteve rentabilidade em 2021 de 4,66%, e até 25/03/2022 de 4,15%, com volatilidade a.a. de 2,72%, ou seja, saindo de um fundo muito volátil, buscando assim uma maior rentabilidade e proteção dos investimentos do Instituto no cenário econômico atual. O Comitê avaliou e aprovou o resgate do valor restante do aplicado na Caixa Econômica

Federal, Fundo de Investimento Caixa FI Brasil IMAB 5+ LP, CNPJ: 10.577.503/0001-88, para aplicação do valor total resgatado no Fundo de Investimento Caixa FI Brasil Referenciado DI, CNPJ: 03.737.206/0001-97, já constante da carteira de investimentos do CaraguaPrev. Após análise ficou constatado que o Fundo de Investimento Caixa FI Brasil IMAB 5+ LP obteve rentabilidade em 2021 de -7,00% e até 25/03/2022 de 2,46%, com volatilidade a.a. de 8,76%, em contrapartida o Fundo de Investimento Caixa FI Brasil Referenciado DI, obteve rentabilidade em 2021 de 4,60% e até 25/03/2022 de 2,38%, com volatilidade a.a. de 0,21%, ou seja, saindo de um fundo muito volátil, buscando assim uma maior rentabilidade e proteção dos investimentos do Instituto no cenário econômico atual. Todas as aprovações do Comitê de Investimentos deverão ser levadas para análise a aprovação do Conselho Deliberativo. Em seguida passou para o terceiro item que trata da Renovação de Credenciamentos Instituições: Banco do Brasil, Caixa econômica Federal, Banco Santander, Banco Itau e BRL Trust, conforme Instrução Normativa do CaraguaPrev, que dispõe sobre o credenciamento de instituições financeiras e fundos de investimentos, autorizados pelo Banco Central e/ou Comissão de Valores Mobiliários, para receber recursos financeiros referentes aos ativos garantidores do plano de benefício do Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba/SP – CARAGUAPREV, em adequação a Resolução do Conselho Monetário Nacional n.º 4.963/21, sendo aprovadas pelo Comitê de Investimentos. Após passado ao quarto item da pauta sobre o Pagamento de Precatórios. Os precatórios de 2022, que são requisições de pagamento expedidas pelo Judiciário para cobrar o pagamento de valores devidos após condenação judicial definitiva, no valor de R\$ 571.769,19, devendo esse valor ser atualizado monetariamente na data de seu pagamento, sendo aprovado pelo Comitê de Investimentos o pagamento com recursos do Fundo de Investimento CEF Brasil Referenciado DI, que está com rentabilidade positiva em 2021 e 2022. Registre-se que o Certificado de Regularidade Previdenciária foi renovado e está vigente até o dia 24 de maio de 2022. Nada mais havendo a tratar, encerrada a reunião pela Presidente do Comitê às 09h50min, lavrada a competente Ata, que segue, para aprovação pelos membros do Comitê de Investimentos.

Luana M. Forcioni Guedes
Presidente do Comitê de Investimentos
Certificação: ANBIMA CPA-10

Pedro Ivo de Sousa Tau
Membro do Comitê de Investimentos
Certificação: ANBIMA CPA-10



Ivone Cardoso Vicente Alfredo
Membro do Comitê de Investimento

Adriana Zambotto
Membro do Comitê de Investimentos
Certificação: ANBIMA CPA-10

Rosemeire Maria de Jesus
Membro do Comitê de Investimentos
Certificação: ANBIMA CPA-10