

136ª ATA ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV

Aos vinte e três dias do mês de junho 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. 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) Atualização referente a certificação SPREV; e, 2) Prestação de contas Maio/2022. A Presidente do Comitê passou a palavra ao servidor Natanael Norões, que tratou sobre o primeiro item da pauta, que trata Atualização referente a certificação SPREV. Informou que o CaraguaPrev conseguiu com a sua Consultoria Previdenciária ABCprev, em sua plataforma on-line curso com vídeo aulas, para certificação do Conselho Deliberativo, sendo disponibilizado login de acesso do curso, enviado por e-mail aos membros do Conselho, lembrando que o prazo para certificação é até o mês de março de 2023. Em seguida, o Presidente do CaraguaPrev passou a palavra à Diretora Financeira, com o segundo item da pauta que trata da prestação da Prestação de Contas do mês de MAIO de dois mil e vinte e dois, que está disponibilizada no site do Instituto, sendo enviado o link para os Conselheiros 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 maio, os ativos apresentaram performances positivas no mês, especialmente a renda fixa e renda variável, a ponta negativa se deu entre os investimentos estruturados e BDR. A Diretora Financeira pontuou que conforme aprovações do Comitê de Investimentos e do Conselho Deliberativo, o Instituto desde o dezembro de 2021 até hoje vem fazendo alocações em Títulos Públicos Federais, comprados a taxa acima da meta atuarial,

tirando os recursos de fundos voláteis, o que garante a rentabilidade acima da meta em quase 50% (cinquenta por cento) do patrimônio do Instituto. Exemplificou ainda que a última aplicação em títulos públicos foi comprada com taxa de IPCA+10,251%, uma excelente aquisição, o que supera a meta que é de IPCA+4,99%. As operações registradas no período foram: 1) Resgate de R\$ 9.999.060,05 (nove milhões novecentos e noventa e nove mil, sessenta reais e cinco centavos) do Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97, Caixa econômica Federal, em 02/05/2022, para compra de Títulos Públicos Federais NTN-B – 15/05/2055, a taxa de 5,8520%, valor de R\$ 9.999.060,05, em 03/05/2022. A operação de resgate do Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, que obteve rentabilidade positiva acumulada, mas conforme aprovação do Comitê de Investimentos e do Conselho Deliberativo, para a compra de Títulos Públicos Federais NTN-B – 05/2055, a taxa de juros de 5,852%, se deu pois apresentam rendimento superior ao fundo de investimento resgatado e superior a meta atuarial do Instituto. 2) Resgate de R\$ 6.000.000,00 (seis milhões de reais) do Fundo de Investimento ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO FIC FI, CNPJ: 05.073.656/0001-58, Banco Itaú, em 11/05/2022 e resgate de R\$ 3.998.829,59 (três milhões e novecentos e noventa e oito mil e oitocentos e vinte e nove reais e cinquenta e nove centavos) do Fundo de Investimento Previdenciário Renda Fixa referenciado DI Longo Prazo Perfil, CNPJ: 13.077.418/0001-49, Banco do Brasil, em 11/05/2022, para compra de R\$ 9.998.829,58 (nove milhões e novecentos e noventa e oito mil e oitocentos e vinte e nove reais e cinquenta e oito centavos) em Títulos Públicos Federais NTN-B – 15/08/2050, taxa 5,922%, em 12/05/2022. A operação de resgate dos Fundos de Investimentos ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO FIC FI e CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, que obtiveram rentabilidade positiva acumulada, mas conforme aprovação do Comitê de Investimentos e do Conselho Deliberativo, para a compra de Títulos Públicos Federais NTN-B – 15/08/2050, a taxa 5,922%, se deu pois apresentam rendimento superior ao fundo de investimento resgatado e superior a meta atuarial do Instituto. 3) Resgate de R\$ 5.999.379,06 (cinco milhões novecentos e noventa e nove mil e trezentos e setenta e nove reais e seis centavos) do Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97, Caixa econômica Federal, em 26/05/2022, RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO, para compra de R\$ 5.999.379,06 em Títulos Públicos Federais NTN-B – 15/08/2022, taxa 6,5520%, em 27/05/2022. A operação de resgate do Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA

REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97, que obteve rentabilidade positiva acumulada, mas em busca de uma maior rentabilidade, foi aprovado pelo Comitê de Investimentos e pelo Conselho Deliberativo a compra de títulos Públicos NTN-B, que é superior a meta atuarial do Instituto, e 4) Resgate de R\$ 4.000.000,00 (quatro milhões de reais) do Fundo de Investimento Previdenciário Renda Fixa referenciado DI Longo Prazo Perfil, CNPJ: 13.077.418/0001-49, Banco do Brasil, em 30/05/2022 e resgate de R\$ 8.093.654,50 (oito milhões e noventa e três mil e seiscentos e cinquenta e quatro reais e cinquenta centavos) do Fundo de Investimento CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, CNPJ: 03.737.206/0001-97, Caixa econômica Federal, em 30/05/2022, para a compra de R\$ 11.980.454,50 (onze milhões e novecentos e oitenta mil e quatrocentos e cinquenta e quatro reais e cinquenta centavos) em Títulos Públicos Federais NTN-B – 15/08/2022, taxa 7,406%, em 30/05/2022. A operação de resgate dos Fundos de Investimentos Previdenciário Renda Fixa referenciado DI Longo Prazo Perfil e CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO, que obtiveram rentabilidade positiva acumulada, mas conforme aprovação do Comitê de Investimentos e do Conselho Deliberativo, para a compra de Títulos Públicos Federais NTN-B, a taxa 7,406%, se deu pois apresentam rendimento superior ao fundo de investimento resgatado e superior a meta atuarial do Instituto. No mês o real e o Ibovespa se recuperaram das quedas registradas em abril. Neste quadro, o comportamento do Ibovespa foi corroborado, sobretudo, por uma favorável temporada de divulgação dos balanços das empresas referente ao primeiro trimestre, que vieram em linha com a expectativa de mercado, ratificando uma moderada resiliência de receita, baixo endividamento e forte geração de caixa. Além disso, o mercado seguiu otimista com o nível de preço das commodities vis-à-vis o choque de oferta provocado, sobretudo, pela manutenção do conflito geopolítico entre Rússia e Ucrânia. Ademais, a expectativa de uma possível reabertura da economia chinesa em função da suspensão das medidas severas de lockdowns e, um possível, embargo parcial do petróleo russo pela União Europeia também contribuíram positivamente para o índice. O seguinte cenário atual confirma o momento com maiores incertezas, tanto interna quanto externamente, além da percepção de uma inflação ainda com viés de alta, com a aceleração da alta da taxa de juros nos Estados Unidos e preocupações com a economia chinesa, com os lockdown. Ainda no campo de riscos e de atenção, agregando o risco internacional, 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. Explicou ainda que com relação a Avaliação da Rentabilidade de 2020, 2021 e 2022, diante da grande volatilidade nos investimentos, foi ocasionada pelo atual cenário econômico, pandêmico e político, do país e do mundo, sendo um risco sistemático, que são os que englobam a economia como um todo, ou seja, podem comprometer todo o mercado financeiro. Após a apresentação, a Presidente perguntou se algum membro do Comitê tem alguma dúvida ou consideração e com a negativa a Prestação de contas do mês foi aprovada por todos os presentes. Registre-se que o Certificado de Regularidade Previdenciária foi renovado e está vigente até o dia 21 de novembro de 2022. Nada mais havendo a tratar, encerrada a reunião pela Presidente do Comitê às 09h40min, 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

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

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

Ivone Cardoso Vicente Alfredo
Membro do Comitê de Investimento