



157ª ATA ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV

Aos vinte e nove dias do mês de fevereiro dois mil e vinte e quatro, 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 o Presidente Anderson Franco Boytchuk do Nascimento e os membros Pedro Ivo de Sousa Tau, Adriana Zambotto Fernandes, Ivone Cardoso Vicente Alfredo e Rosemeire Maria de Jesus. Declarada aberta a reunião, o Presidente do Comitê agradeceu a presença de todos e elencou os itens da pauta sendo: 1) Prestação de Contas Janeiro/2024; 2) Relatório Semestral de Diligências 2º semestre 2023; 3) Pagamento de Precatórios / Ordem Judicial. Em seguida passou a palavra para a Sra. Luana F. Guedes, Assessora de Investimentos, para explanação dos itens da pauta, sendo o primeiro item, que trata da Prestação de Contas do mês de Janeiro de 2024, que está disponibilizada no site do Instituto, sendo enviado o link para os Conselheiros no ato da convocação da reunião, 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, o relatório mensal dos investimentos 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 2023, com 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 no mês de janeiro/24 a carteira de investimentos do CaraguaPrev em renda fixa, exterior BDR e investimentos estruturados, apresentaram performance positivas no mês, já a renda variável obteve performance negativa. A rentabilidade geral da carteira foi de 0,63%, sendo que no acumulado do ano a rentabilidade é de 0,63%, abaixo da meta atuarial anual de 0,85%. O IPCA apresentou a variação de 0,41% em janeiro e a Taxa Selic recuou para 11,25%, alinhado com as perspectivas do mercado. No Brasil as curvas de juros futuras aumentaram no mês, acompanhando o movimento observado dos juros globais, além de terem sido impactadas negativamente. O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo na direção oposta dos índices globais e sendo impactada pela curva de juros, apresentando um retorno negativo de -4,79% no mês. No cenário internacional, embora em janeiro os índices de ações globais tenham apresentado retornos positivos, o mês foi marcado pela resiliência da economia norte-americana e pelas discussões sobre o início do ciclo de corte de juros



nos EUA. O que resultou na alta dos juros futuros e, conseqüentemente, no ganho de força do dólar em relação às demais moedas. Já na China, a deterioração do setor imobiliário prossegue, limitando a efetividade dos estímulos adotados pelo governo. Foi apresentado o relatório com todos os investimentos do CaraguaPrev pelo sistema financeiro da LDB empresas, com a seguinte posição dos investimentos: a) Títulos do Tesouro Nacional, que representam 52,13% da carteira do Instituto, apresentaram rentabilidade acima da meta atuarial no ano, sendo que a estratégia de compra direta de NTN-Bs, para carregamento até o vencimento, auxilia numa “ancoragem de rentabilidade” acima da meta atuarial e contribui para uma redução da volatilidade global da carteira de investimentos do instituto, devido ao benefício da “marcação na curva” do preço desse ativo e risco soberano, conforme aprovação nas atas anteriores, permanece a decisão do Conselho de realocação dos recursos dos vencimentos dos títulos e dos seus cupons de juros semestrais em recompra de Títulos, desde que as taxas estejam acima da meta atuarial; b) Fundos 100% Títulos Públicos que representam 16,25% da carteira do Instituto, apresentaram rentabilidade acima da meta atuarial no ano, com manutenção da posição atual e aumento gradativo, desde que os fundos de investimento atrelados a títulos públicos federais apresentem rentabilidades positivas acima da meta atuarial; c) Fundos Renda Fixa que representam 18,25% da carteira do Instituto, apresentaram rentabilidade acima da meta atuarial no mês e no ano, com aprovação do Conselho para alocação de recursos oriundos de contribuições previdenciárias, aplicação dos resgates de fundos de investimento de renda variável, uma vez que a taxa Selic é de 11,25%, sendo ainda um investimento atrativo, com pouca volatilidade e rentabilidade acima da meta atuarial. Também foi aprovado pelo Comitê de Investimentos o desinvestimento desses fundos para compra de Títulos do Tesouro Nacional e resgate para aplicação em Fundos 100% Títulos Públicos; d) FIDC Cota Sênior que representa 0,21% da carteira do Instituto, apresentou rentabilidade abaixo da meta atuarial no mês, com manutenção da posição atual desses ativos; e) Fundos de Ações que representam 7,27% da carteira do Instituto, apresentaram rentabilidade abaixo da meta atuarial do mês e do ano, diante do cenário econômico a renda variável ainda apresentará volatilidade, com aprovação de manutenção e desinvestimento gradativo; f) Fundos de Investimento Estruturados representam 3,75% da carteira do Instituto e apresentaram rentabilidade acima da meta atuarial no mês e no ano, com aprovação de aumento gradativo das aplicações nestes ativos; g) Fundos de Investimento no exterior representam 2,07% da carteira do Instituto e apresentaram rentabilidade acima da meta atuarial no mês e no ano, com aumento gradativo das aplicações nestes ativos. Após apresentação, a Prestação de Contas mensal passou por deliberação dos membros do Comitê de Investimentos, sendo aprovadas por todos os presentes. Passado ao segundo item da pauta que trata



da emissão do Relatório Semestral de Diligências de verificação dos lastros relativos aos títulos públicos e demais papéis incluídos nas carteiras de ativos dos fundos de investimentos aplicados pelo RPPS do 2º semestre de 2023, em atendimento as obrigações legais cabíveis vigentes no manual do Pró-Gestão, a fim de conferir maior transparência ao processo, e permitindo o monitoramento dos interessados, o CaraguaPrev, apresenta semestralmente o relatório de diligência de verificação de lastros aos títulos públicos e demais papéis incluídos nas carteiras de ativos dos fundos de investimentos, que tem o intuito de informar à sociedade os dados quantitativos e qualitativos da carteira de investimentos do Plano Previdenciário, detalhando os ativos financeiros que o compõe. Após análise e deliberação, o Comitê aprovou o relatório e constatou que no decorrer do semestre avaliado o CaraguaPrev apresentou diligência dos atores envolvidos no processo de investimentos, não encontrando situação que envolvesse riscos ao patrimônio investido. Após passado ao terceiro item da pauta que trata sobre o Pagamento de Precatórios. Os precatórios de 2024 são requisições de pagamento expedidas pelo Judiciário para cobrar o pagamento de valores devidos após condenação judicial definitiva, no valor de R\$ 920.555,82, 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. Registre-se que o Certificado de Regularidade Previdenciária foi renovado e está vigente até o dia 14 de maio de 2024. Nada mais havendo a tratar, encerrada a reunião pelo Presidente do Comitê às 09h20min, lavrada a competente Ata, que segue, para aprovação pelos membros do Comitê de Investimentos.

Anderson Franco B. do Nascimento
Diretor Financeiro
Presidente do Comitê de Investimentos



Pedro Ivo de Sousa Tau
Presidente do CaraguaPrev
Certificado ANBIMA CPA-10



Rosemeire Maria de Jesus
Membro do Comitê
Certificado ANBIMA CPA-10



Adriana Zambotto Fernandes
Membro do Comitê
Certificado ANBIMA CPA-10



Ivone Cardoso Vicente Alfredo
Membro do Comitê

