



159ª ATA ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO CARAGUAPREV

Aos vinte e cinco dias do mês de abril 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 Março/2024; 2) Prestação de Contas 1º Trimestre/2024; 3) Credenciamento Fundos de Investimentos: BB RF Referenciado DI Títulos Públicos FI Longo Prazo (CNPJ: 11.046.6450001-81), BB Institucional Fundo de Investimento Renda Fixa (CNPJ: 02.296.928/0001-90) e Santander RF Referenciado DI Institucional Premium (CNPJ: 02.224.354/0001-45); 4) Aplicações Financeiras entre fundos de Investimentos constantes em carteira e nos fundos a serem credenciados; e, 5) Credenciamento Instituição Financeira: XP Investimentos (CNPJ: 02.332.886/0001-04). O Presidente do Comitê comunicou como parte do processo de divulgação e orientação sobre o Censo Previdenciário e Funcional 2024, que o CaraguaPrev realizou treinamento com os 4 órgãos da Administração Pública Municipal, tendo como participantes os RHs da Prefeitura, da Fundacc, do CaraguaPrev e da Câmara Municipal, no dia 18 de abril de 2024, às 9h30, no auditório Maristela de Oliveira, na sede da Fundacc, onde foi distribuído o manual detalhado com o processo de cadastramento e cópia do decreto regulamentador, foi explicado que o motivo da redução de 5 para 3 anos para que o CaraguaPrev, em parceria com a Prefeitura, realize o recenseamento é devido ao CaraguaPrev estar certificado no Nível III do Programa Pró-Gestão, importante certificação concedida pelo Ministério da Previdência Social, que tem como objetivo, incentivar a adoção de melhores práticas de gestão pelos Regimes Próprios de Previdência Social, lembrando que o CaraguaPrev faz parte do grupo dos RPPS com esta certificação (nível III), que atualmente conta com cerca de 15 institutos com esta mesma certificação no Brasil. Desde o dia 22 de abril, o CaraguaPrev está entregando o material de divulgação do Censo (folders e cartazes) e passará por cerca dos 250 próprios públicos aproximadamente, divulgando e esclarecendo dúvidas sobre o censo previdenciário e funcional 2024. O Decreto Municipal n.º 1.947, de 15 de março de 2024 estabeleceu o período entre 01 de maio de 2024 e 05 de julho de 2024 para a realização do recenseamento previdenciário e funcional cadastral, sendo que a partir do dia 1 de maio, os links de acesso estarão disponíveis no site do CaraguaPrev para que os servidores ativos, aposentados e pensionistas possam realizar o censo.



Em seguida passou a palavra para a servidora Sra. Luana F. Guedes, da área de investimentos, para explanação dos itens da pauta, sendo o primeiro e segundo itens, que tratam da Prestação de Contas do mês de março de 2024 e da Prestação de Contas 1º Trimestre/2024, que estão disponibilizadas 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 2024, 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 março/24 a carteira de investimentos do CaraguaPrev em renda fixa, exterior BDR e investimentos estruturados, apresentaram performance positivas no mês, já a renda variável apresentou rentabilidade negativa. A rentabilidade geral da carteira no mês foi de 0,91%, sendo que no acumulado do ano a rentabilidade é de 2,68%, acima da meta atuarial anual que é de 2,63%. O IPCA apresentou a variação de 0,16% em março e a Taxa Selic reduziu para 10,75%, onde números de inflação e de atividade acima das expectativas fizeram com que o Banco Central apresentasse uma mensagem mais conservadora em sua última reunião do Copom, sinalizando apenas mais um corte de 0,5% na Selic e deixando os próximos passos em aberto, a depender dos dados. No Brasil as curvas de juros futuras aumentaram no mês, refletindo o aumento da incerteza sobre a condução da política econômica. Assim, o Ibovespa ficou em território negativo e o Real perdeu espaço frente ao dólar. O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo na direção oposta dos índices globais. Apresentando um retorno de -0,71% no mês. Dessa forma, o Ibovespa possui um comportamento negativo de -4,53% no ano, enquanto, nos últimos 12 meses acumulou a performance positiva de +25,74%. O cenário internacional foi marcado pelas discussões sobre a velocidade da redução da inflação nas economias desenvolvidas e a manutenção da taxa de juros básica nos EUA. Além disso, houve continuidade do avanço dos ativos de risco nos mercados globais. Esse movimento ocorreu à medida que as curvas de juros mantiveram-se relativamente estáveis, apesar das declarações dos principais banqueiros centrais indicando que o início dos ciclos de redução de juros poderá ocorrer um pouco mais tarde. 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 53,67% 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, além de novos recursos para compra de Títulos, desde que as taxas estejam acima da meta atuarial em até 70% da carteira. Registre-se que conforme pré-aprovado pelos Conselhos foi efetuada a compra de R\$ 39.987.230,73 em Títulos Públicos Federais no mês de abril de 2024, com taxa de 6,068%, com vencimento em 15/08/2032, aproveitando o movimento de abertura nas curvas de juros, com recursos oriundos dos aportes para cobertura do déficit atuarial, no fundo de investimento BB Previdenciário Renda Fixa Perfil, Banco do Brasil, vinculado a conta corrente dos aportes. O Vencimento dos Títulos Públicos para 2032 se deu, pois as taxas estavam acima de 6% e os recursos dos aportes para cobertura do déficit atuarial devem ser aplicados no mercado financeiro e de capitais em conformidade com as regras estabelecidas pelo Conselho Monetário Nacional - CMN por, no mínimo, 5 (cinco) anos, a contar da data do respectivo repasse à unidade gestora, conforme Portaria MTP n.º 3.803, de 16 de novembro de 2022; b) Fundos 100% Títulos Públicos que representam 16,03% da carteira do Instituto, apresentaram rentabilidade abaixo da meta atuarial no ano, com redução da posição atual no próximo mês; c) Fundos Renda Fixa que representam 16,82% da carteira do Instituto, apresentaram rentabilidade acima da meta atuarial no mês e abaixo no ano, com aprovação do Conselho para alocação de recursos oriundos de contribuições previdenciárias, aplicação dos resgates de fundos de investimento de renda variável, sendo ainda um investimento atrativo, com pouca volatilidade e rentabilidade acima da meta atuarial. Também foi aprovado pelo Conselho Deliberativo o desinvestimento desses fundos para compra de Títulos do Tesouro Nacional; 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 7,17% da carteira do Instituto, apresentaram rentabilidade abaixo da meta atuarial 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 3,79% 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, mas diante do cenário desafiador econômico e



geopolítico, os investimentos dessa categoria no mês de abril/2024 apresentaram rentabilidades negativas, sendo necessária a redução a fim de mitigar perdas; g) Fundos de Investimento no exterior representam 2,23% 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 do mês de março de 2024 e a Prestação de Contas 1º Trimestre/2024 passaram por deliberação dos membros do Comitê de Investimentos, sendo aprovadas por todos os presentes. Em seguida passou para o terceiro item da pauta, que trata do Credenciamento dos Fundos de Investimentos: BB RF Referenciado DI Títulos Públicos FI Longo Prazo (CNPJ: 11.046.6450001-81), BB Institucional Fundo de Investimento Renda Fixa (CNPJ: 02.296.928/0001-90) e Santander RF Referenciado DI Institucional Premium (CNPJ: 02.224.354/0001-45). O Comitê de Investimentos, após análise aprovou o credenciamento do Fundo de Investimento BB RF Referenciado DI Títulos Públicos FI Longo Prazo (CNPJ: 11.046.6450001-81), enquadrado na Renda Fixa - Artigo 7º, inciso I, alínea “b”; Fundo RENDA FIXA Pós que busca acompanhar as variações das taxas de juros praticadas no mercado de depósitos interbancários CDI; Administração e Gestão BB Gestão de Recursos DTVM S.A.; Fundo com resgate em D+0, Taxa de administração 0,10%; Rentabilidade de janeiro/23 a 18/04/2024 – 3,19%. Analisado pela consultoria financeira LDB empresas, que concluiu que fundo está apto a receber aplicações. O Comitê de Investimentos, após análise aprovou o credenciamento do Fundo de Investimento BB Institucional Fundo de Investimento Renda Fixa (CNPJ: 02.296.928/0001-90), enquadrado na Renda Fixa - Artigo 7º, inciso III, alínea “a”; Fundo RENDA FIXA Pós com o objetivo proporcionar a valorização de suas cotas mediante aplicação de seus recursos em ativos financeiros e/ ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro.; Administração e Gestão BB Gestão de Recursos DTVM S.A.; Fundo com resgate em D+0, Taxa de administração 0,20%; Rentabilidade de janeiro/23 a 18/04/2024 – 3,44%. Analisado pela consultoria financeira LDB empresas, que concluiu que fundo está apto a receber aplicações. O Comitê de Investimentos, após análise aprovou o credenciamento do Fundo de Investimento Santander RF Referenciado DI Institucional Premium (CNPJ: 02.224.354/0001-45), enquadrado na Renda Fixa - Artigo 7º, inciso III, alínea “a”; Fundo RENDA FIXA RENDA FIXA Pós que busca acompanhar as variações das taxas de juros praticadas no mercado de depósitos interbancários CDI; Gestor: Santander Brasil Gestão De Recursos LTDA e Administrador: Banco Santander (Brasil) S.A.; Fundo com resgate em D+0, Taxa de administração 0,20%; Rentabilidade de janeiro/23 a 18/04/2024 – 3,40%. Analisado pela consultoria financeira LDB empresas, que concluiu que fundo está apto a receber aplicações. Passado ao quarto item da pauta



que trata das aplicações Financeiras entre fundos de Investimentos constantes em carteira e nos fundos a serem credenciados. O Comitê de Investimentos avaliou e aprovou o resgate do valor de R\$ 10.000.000,00 (dez milhões de reais) aplicado no Banco Santander, Fundo de investimentos SANTANDER DI TITULOS PUBLICOS PREMIUM, CNPJ: 09.577.447/0001-00 (rentabilidade de janeiro a 18/04/24 de 3,17%), e resgate de R\$ 600.000,00 (seiscentos mil reais) do Fundo de investimentos SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA, CNPJ: 26.507.132/0001-06 (rentabilidade de janeiro a 18/04/24 de 0,92%) para aplicação do valor de R\$ 10.600.000,00 (dez milhões e seiscentos mil reais) no fundo de investimento SANTANDER RF REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM, CNPJ: 02.224.354/0001-45 (rentabilidade de janeiro a 18/04/24 de 3,40%), após análise ficou constatado que o fundo aprovado para aplicação possui rentabilidade no ano de 2024 acima dos fundos de investimentos resgatados, a alteração busca uma maior rentabilidade e menor volatilidade dos investimentos do Instituto no cenário econômico atual. O Comitê de Investimentos avaliou e aprovou o resgate do valor de R\$ 10.000.000,00 (dez milhões de reais) aplicado no Banco do Brasil, Fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI, CNPJ: 07.111.384/0001-69 (rentabilidade de janeiro a 18/04/24 de 0,80%), e resgate total da aplicação do Fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP, CNPJ: 11.328.882/0001-35 (rentabilidade de janeiro a 18/04/24 de 2,63%) vinculados a c/c 9999-6, para aplicação dos valores resgatados dos dois fundos no fundo de investimento BB INSTITUCIONAL FI RF, CNPJ: 02.296.928/0001-90 (rentabilidade de janeiro a 18/04/24 de 3,44%), após análise ficou constatado que o fundo aprovado para aplicação possui rentabilidade no ano de 2024 acima dos fundos de investimentos resgatados, a alteração busca uma maior rentabilidade e menor volatilidade dos investimentos do Instituto no cenário econômico atual. O Comitê de Investimentos avaliou e aprovou o resgate do valor total aplicado no Banco do Brasil, Fundo de investimentos BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TP, CNPJ: 11.328.882/0001-35, conta aportes 37299-4, (rentabilidade de janeiro a 18/04/24 de 2,63%), para aplicação do valor total resgatado no fundo de investimento BB RF REFERENCIADO DI TP FI LONGO PRAZO, CNPJ: 11.046.645/0001-81, conta aportes 37299-4, (rentabilidade de janeiro a 18/04/24 de 3,19%), após análise ficou constatado que o fundo aprovado para aplicação possui rentabilidade no ano de 2024 acima do fundo de investimento resgatado, a alteração busca uma maior rentabilidade e menor volatilidade dos investimentos do Instituto no cenário econômico atual. O Comitê de Investimentos avaliou e aprovou o resgate do valor de R\$ 7.000.000,00 (sete milhões de reais) aplicado na Caixa Econômica Federal, Fundo de investimentos CAIXA FIC BR GESTÃO ESTRATÉGICA, CNPJ: 23.215.097/0001-55,



CARAGUAPREV

Instituto de Previdência do Município de Caraguatatuba
Estado de São Paulo



CERTIFICADO
Pró-Gestão

ICO BRASIL RPPS
SPREV



(rentabilidade de janeiro a 18/04/24 de 1,13%), resgate do valor total aplicado no fundo de investimentos CAIXA FI JUROS E MOEDAS, CNPJ: 14.120.520/0001-42 (rentabilidade de janeiro a 18/04/24 de 2,50%), resgate do valor de R\$ 5.000.000,00 (cinco milhões de reais) aplicado na Caixa Econômica Federal, Fundo de investimentos FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP, CNPJ: 10.577.519/0001-90 (rentabilidade de janeiro a 18/04/24 de 0,07%) e resgate do valor de R\$ 8.000.000,00 (oito milhões de reais) aplicado na Caixa Econômica Federal, Fundo de investimentos CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP, CNPJ: 30.036.235/0001-02, (rentabilidade de janeiro a 18/04/24 de 6,18%, mas somente no mês de abril/24 a rentabilidade foi de -4,45%), para aplicação do valor dos fundos resgatados no fundo de investimento CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP, CNPJ: 03.737.206/0001-97 (rentabilidade de janeiro a 18/04/24 de 3,30%), após análise ficou constatado que o fundo aprovado para aplicação possui rentabilidade no ano de 2024 acima dos fundos de investimentos resgatados, a alteração busca uma maior rentabilidade e menor volatilidade dos investimentos do Instituto no cenário econômico atual. Em seguida passou para o quinto item da pauta que trata do Credenciamento Instituição Financeira: XP Investimentos (CNPJ: 02.332.886/0001-04), instituição já cadastrada no CaraguaPrev e custodiante dos Títulos Públicos Federais do Instituto. O processo de credenciamento de administrador e distribuidor foi analisado e possui toda a regularidade fiscal e documental, sendo aprovado pelos membros do Comitê de Investimentos. 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 09h30min, 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

