

ATA 09/2022

Data: 08/09/2022

Participantes: Antonio Sérgio Toniello, Patrícia Zappeloni Ramos e João Henrique Mendes Pinheiro.

Convidados: Eliana Regina Casadei.

Às dezessete horas do dia oito de setembro de dois mil e vinte e dois, atendendo a convocação formalizada, que fará parte integrante desta ata como anexo, reuniram-se na sede do Pitanprev, sito à Rua Santos Dumont 77, os membros do Comitê de Investimentos abaixo assinados para deliberarem o que segue. Dando início aos trabalhos, o Presidente agradeceu a presença de todos, e passando adiante à secretária, a mesma procedeu à leitura da ordem do dia, constante da convocação, que passou a ser objeto de análise pelos presentes: **1) Expectativa do Mercado Financeiro, Análise do Cenário Macroeconômico de Curto, Médio e Longo Prazo**; Foi feita a leitura e discutido o panorama econômico do mês de agosto de 2022, elaborado pela empresa de consultoria do Pitanprev, que passa a fazer parte integrante desta ata como anexo, que após análise ficou decidido que devido a tendência da alta de juros, os fundos atrelados ao CDI, estão tendo um bom desempenho, e sendo assim continuarmos moderadamente analisando mudanças de estratégias na carteira, visando o curto prazo. **2) Avaliação e Análise da Carteira de Investimentos**; Iniciou-se a análise da carteira com os investimentos do PITANPREV, constatando as movimentações efetuadas no mês de agosto de 2022, sendo: **Resgate** no valor de R\$ 770.000,00, no dia 04/08/2022 do fundo Caixa Brasil Ima B5 Títulos Públicos FI Renda Fixa LP, para efetivação da folha de pagamento dos aposentados e pensionistas da competência julho de 2022, cuja característica da movimentação encontra-se na apr 067/2022; **Crédito** no valor de R\$ 261.293,13 no dia 15/08/2022, efetuado pelo do fundo BB Títulos Públicos XXI FI Renda Fixa Previdenciário a título de pagamento de cupom de juros semestrais e reinvestido no mesmo fundo, na mesma data, cuja característica da movimentação encontra-se na APR 071/2022; **Crédito** efetuado no valor de R\$ 1.650,00 no dia 10/08/2022 pelo fundo Caixa Rio Bravo Fundo de Fundos FII-CXRI11 a título de pagamento de juros do mês, cuja característica da movimentação encontra-se na apr 070/2022; **Aplicação** no valor de R\$ 500.000,00 no dia 09/08/2022, no fundo Caixa Brasil IDKA IPCA 2A Títulos Públicos FI Renda Fixa LP, com recursos relativos a parte do repasse efetuados pelo ente da competência julho 2022, cuja característica da movimentação encontra-se na apr 069/2022; **Aplicação** no valor de R\$ 665.000,00 no dia 09/08/2022, no fundo Caixa Brasil Ima B 5 Títulos Públicos FI Renda Fixa LP, com recursos de parte dos repasses efetuado pelo ente da competência julho 2022, cuja característica da movimentação encontra-se na apr 068/2022; **Aplicação** no valor de R\$ 52.686,71 no dia 03/08/2022, no fundo Bradesco IRFM1 Títulos Públicos FI Renda Fixa, com recursos do pagamento da parcela de nº 188 relativa ao parcelamento nº 20/2007 efetuado entre o rpps e o Ente Federativo, cuja característica da movimentação encontra-se na apr 066/2022; **Aplicação** no valor de R\$ 96.162,76 no dia 26/08/2022, no fundo Bradesco Alocação Dinâmica FIC Renda Fixa, com recursos de pagamento de parcela do parcelamento 234/2022 realizado entre o rpps e o ente federativo, cuja característica da movimentação encontra-se na apr 073/2022; Aplicação no valor de R\$ 14.932,22 no dia 15/08/2022, no fundo BB IDKA 2 Títulos Públicos FI Renda Fixa Previdenciário, com recursos relativos ao pagamento de compensação previdenciária, cuja característica da movimentação se encontra na apr 072/2022. Na sequência passamos a analisar a carteira de RV do Pitanprev, que no mês de agosto de 2022 onde, no artigo 8º, 10 e 11, que tratam da renda variável nossa posição era a seguinte; estratégia inferior 12,00%, a estratégia alvo 21,20%, limite superior 41,00% e o total investido era de 24,14%, estando assim bem próximos às nossas expectativas de alocação com relação à política de investimentos 2022. A carteira de RV no mês de agosto devido as altas volatilidades alguns poucos fundos apresentaram rentabilidade negativa,

sendo que no fechamento do mês a rentabilidade foi positiva na ordem de 4,60%, em meio a sessões de volatilidade. Na carteira de fundos no exterior a mesma apresentou uma rentabilidade negativa de (-3,92%). Na carteira de renda fixa, a estratégia alvo estipulada na política de investimentos está fixada em 74,20%, porém devido às expectativas do mercado no segmento, estamos acima desse alvo, ou seja, a carteira no mês de agosto estava com 75,22% do patrimônio do rpps, permanecendo dentro do limite superior estipulado na PI 2022. A carteira de RF apresentou rentabilidade positiva na ordem de 0,36% no mês de agosto. Após analisado, ficou decidido por todos os membros do comitê que se mantenha os valores aplicados nos devidos fundos, não realizando resgates. Na renda variável como todos ativos da bolsa ainda estão com altas volatilidades, estaremos no decorrer deste mês e nos próximos, acompanhando a evolução do mercado, para novos aportes, e na Renda Fixa, ir aumentando moderadamente os aportes nos fundos de vértices e fundos de curto prazo atrelados ao CDI devido as oportunidades de rentabilidade acima da meta atuarial, podendo os recursos serem novos ou vindo de resgates de fundos de médio a longo prazo da própria carteira do Pitáprev. Diante dos resultados apresentados e em comparação com a métrica atuarial, no mês de agosto, a carteira geral apresentou uma rentabilidade positiva na ordem de 1,32%, contra 0,07% de métrica atuarial, acumulando nos oito meses do ano, 5,05% de retorno contra 7,75% de métrica acumulada, sendo esse um resultado abaixo do esperado, porém esta ocorrendo devido as instabilidades do mercado e as altas volatilidades. Diante desse cenário a carteira no geral apresentou um resultado positivo em reais, na ordem de R\$ 1.571.564,46, fechando o mês de agosto de 2022 com o valor total de R\$ 120.203.895,39. **3) Análise do fluxo de caixa;** foi apresentado pela Diretora Administrativa e Financeira o fluxo de caixa para o mês corrente, onde se observa que não haverá disponibilidade em caixa para o pagamento total das despesas com a folha de pagamento dos aposentados e pensionistas, haja visto que os recursos estão investidos em fundos. A totalidade dos membros presentes decidiram que os recursos para fazer frente aos compromissos deverão ser resgatados de fundos da Caixa Econômica Federal, que não estejam apresentando rentabilidade negativa. **Assuntos gerais).** Não havendo mais a ser discutido, o Presidente deu-se por encerrada a reunião, e solicitou a mim Eliana Regina Casadei _____ que lavrasse a presente ata, que lida e aprovada vai assinada por todos os presentes.

Antônio Sergio Toniello

Patrícia Zapelloni Ramos

João Henrique Mendes Pinheiro