

ATA 06/2023

Data: 12/06/2023

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

Convidados: Eliana Regina Casadei.

Às dezessete horas do dia doze de junho de dois mil e vinte e três, atendendo a convocação formalizada, que fará parte integrante desta ata como anexo, reuniram-se na sede do Pitáprev, 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 maio de 2023, elaborado pela empresa de consultoria do Pitáprev, que passa a fazer parte integrante desta ata como anexo, que após análise ficou decidido em manter as expectativas anteriores de estar analisando aportes em fundos atrelados ao CDI, fundos de vértices, fundos pré fixados, devido estarem tendo um bom desempenho. **2) Comunicação de Fato relevante do Fundo de Investimento em Direitos Creditórios – Fidic Premium:** Foi dada ciência a todos os presentes do Fato Relevante apresentado pela Administradora do fundo, o qual vai anexo a esta ata. **3) 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 maio de 2023, sendo: **Resgate** no valor de R\$ 877.000,00, no dia 04/05/2023 do fundo Caixa Brasil IRFM1 Títulos Públicos FI Renda Fixa, para efetivação da folha de pagamento dos aposentados e pensionistas da competência abril de 2023, cuja característica da movimentação encontra-se na apr 026/2023; **Aplicação** no valor de R\$ 1.350.000,00, no dia 08/05/2023, no fundo Caixa Brasil IMA B Títulos Públicos FI Renda Fixa LP, com recursos dos repasses efetuado pelo Ente na competência abril 2023, cuja característica da operação se encontra na apr 027/2023; **Aplicação** no valor de R\$ 7.908,81, no dia 09/05/2023, no fundo BB IDKA 2 Títulos Públicos FI Renda Fixa Previdenciário, com recursos recebidos de compensação previdenciária, cuja característica da operação se encontra na APR 028/2023; **Crédito** efetuado no valor de R\$ 1.680,00 no dia 11/05/2023 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 029/2022; **Resgate** no valor de R\$ 15.555.138,68, no dia 16/05/2023, do fundo Caixa Brasil 2023 Títulos Públicos FI Renda Fixa, devido ao seu vencimento, cuja característica da operação, se encontra na apr 030/2023; **Aplicação** no valor de R\$ 1.974.676,31 no dia 16/05/2023, no fundo BB Títulos Públicos Vértice 2024 FI Renda Fixa Previdenciário, com recursos de resgate de outro fundo da carteira, devido ao seu vencimento, cuja característica da operação se encontra na apr 031/2023; **Resgate** no valor de R\$ 2.139.912,91, no dia 16/05/2023, do fundo BB Títulos Públicos IPCA FI Renda Fixa Previdenciário, devido ao seu prazo de vencimento pré estipulado, cuja característica da operação se encontra na apr 032/2023; **Aplicação** no valor de R\$ 2.560.000,00 no dia 17/05/2023, no Caixa Brasil IRFM Títulos Públicos FI Renda Fixa LP, com recursos do resgate do fundo constante na apr 030/2023, cuja característica da operação se encontra na apr 033/2023; **Aplicação** no valor de R\$ 3.000.000,00, no dia 17/05/2023, no Fundo Caixa Brasil IDKA Pré 2A FIC Renda Fixa LP, com recursos vindo do resgate na apr 03/2023, cuja característica da operação se encontra na apr 034/2023; **Aplicação** no valor de R\$ 10.000.000,00, no dia 17/05/2023, no fundo Caixa Brasil 2024 X Títulos Públicos FI Renda Fixa, com recursos do resgate da apr 03/2023, cuja característica da operação se encontra na apr 035/2023; **Aplicação** no valor de R\$ 165.236,60, no dia 17/05/2023, no fundo BB Títulos Públicos Vértice 2024 FI Renda Fixa Previdenciário, com recursos de resgate

constante na apr 032/2023, cuja característica da operação se encontra na apr 036/2023. Na sequência passamos a analisar a carteira de RV do Pitanprev, de acordo com a Política da Investimentos aprovada para o exercício de 2023, que no mês de maio de 2023 onde, no artigo 8º, 10 e 11, que tratam da renda variável nossa posição era a seguinte; estratégia inferior 0,00%, a estratégia alvo 23,40%, limite superior 70,00% e o total investido era de 22,04%. A carteira de RV no mês de maio devido as altas volatilidades decorrentes de políticas interna, a maioria dos fundos voltaram a apresentar rentabilidade positiva, sendo que no fechamento do mês a rentabilidade foi em 4,41% em meio a sessões de altas volatilidade. A carteira de fundos no exterior apresentou uma rentabilidade positiva de 5,80%. Na carteira de renda fixa, a estratégia alvo estipulada na política de investimentos está fixada em 76,20%, porém devido às expectativas do mercado no segmento, estamos acima desse alvo, ou seja, a carteira no mês de maio estava com 77,34% do patrimônio do rpps, permanecendo dentro do limite superior estipulado na PI 2023. A carteira de RF apresentou rentabilidade positiva na ordem de 0,95% no mês em análise. Após analisado, ficou decidido por todos os membros do comitê que diante do cenário que vem apresentando o mercado tendendo para o CDI, e fundos mais longos, estaremos continuando a observar as movimentações do mercado visando possíveis mudanças de estratégias na carteira. 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, analisando viabilidades de novos aportes, e na Renda Fixa, ir acompanhando a movimentação do mercado, e moderadamente aumentando os aportes nos fundos de curto prazo atrelados ao CDI devido as oportunidades de rentabilidade acima da meta atuarial, e também devido as notícias de queda de Selic, já aumentarmos aportes nos fundos pré fixados, podendo os recursos serem novos ou vindo de resgates de outros fundos da carteira do Pitanprev. Diante dos resultados apresentados e em comparação com a méta atuarial, no mês de maio a carteira no geral apresentou uma rentabilidade positiva na ordem de 1,73%, contra 0,66% de méta atuarial, acumulando no quinto mês do ano, 4,86% de retorno contra 5,03% de méta de rentabilidade acumulada, sendo esse um resultado considerado razoável diante ao cenário, porém ainda mantendo as boas expectativas para os investimentos no ano em curso. Diante desse cenário a carteira no geral apresentou um resultado positivo em reais, na ordem de R\$ 2.303.085,70, encerrando o mês de maio com o valor total de R\$ 135.728.100,16. **4) 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. 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:** Diante dos resultados apresentados no quinto mês do ano, continuamos ainda com uma expectativa de termos um ano de bons retornos nos investimentos, devido ao cenário econômico e político, visando a queda da taxa de juros. Foi aberto para comentários e dúvidas, e não havendo mais nada 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

A ata com as devidas assinaturas, encontra-se arquivada em lugar próprio no PITANPREV.