

Ato oficial Ata Comitê de Investimentos - 008/2024

De: Jorge Z. - COMINV

Para: COMINV - Comitê de Investimento

Data: 30/04/2024 às 16:02:21

Setores (CC):

COMINV

Setores envolvidos:

COMINV

Reunião Comitê Investimentos Ata 08/2024

Aos vinte e nove dias do mês de abril do ano de dois mil e vinte e quatro, às nove horas, reuniram-se na sede do FUNPREVMMAR, os membros titulares do Comitê de Investimentos, Roseli Bauer, Jorge Lopes Zaatreh, Evandro Marciel Alves Bezerra, Eduardo Luiz Castrioto de Jesus e Alander Matheus Taube de Lima. **1- Análise dos Resultados dos Investimentos do mês de Março e 1º trimestre de 2024; 2- Análise do Parecer Mensal dos investimentos mês de Março/2024.** Ítem 1- Inicialmente foi informado aos membros do comitê, pela Sra Roseli, que o contrato da consultoria de investimentos Crédito e Mercado se encerrou nesse mês de abril, e que o processo para contratação de outra consultoria de investimentos está em fase de finalização. Logo após passou-se a discutir o Relatório Analítico dos Investimentos com fechamento em 28 de março e primeiro trimestre de 2024, elaborado pela consultoria de investimentos contratada. Foi pontuado pelo Sr Jorge que foi enviado antecipadamente aos membros do comitê os relatórios a serem analisados na reunião. Conforme relatório mensal dos investimentos, a carteira fechou o mês de março com patrimônio líquido de R\$ 123.481.438,09, já considerados os recursos previdenciários, taxa de administração e reserva de administração; os recursos disponíveis em conta corrente do instituto totalizaram R\$ 11.708,25; sendo o total dos recursos no período analisado de R\$ 123.493.146,34. O retorno dos investimentos, após aplicações e resgates, no segmento de Renda Fixa foi de 0,64% no mês; no segmento de Renda Variável o retorno foi de 0,75%. A rentabilidade da carteira de investimentos, apresentou rentabilidade positiva de 0,66% no mês de março, enquanto a meta atuarial para o período foi de 0,58%. Na análise do 1º trimestre a carteira de investimentos do instituto obteve retorno positivo de 1,78% no segmento de Renda Fixa e retorno negativo de -0,15% no segmento de Renda Variável. A rentabilidade acumulada na carteira no trimestre, foi de 1,52%, enquanto a meta atuarial apurada para o período foi de 2,78%. Após, os membros passaram a discutir sobre pontos do mercado que impactaram os investimentos no trimestre, conforme dados do relatório Panorama Econômico da consultoria de investimentos. No segmento de renda fixa os fundos mais conservadores como IRFM1 e CDI performaram bem no trimestre, acompanhando seus índices de referência, assim como os fundos moderados, como IDKA2 e IMA B5, contribuindo para o resultado positivo da carteira no período. Já os fundos mais longos como o IMAB sofreram mais com a volatilidade no trimestre, com ambiente fiscal conturbado e variação na curva de juros, entregando resultados em torno de 0,12% no período. Já na renda variável, o índice Ibovespa fechou o mês de março com variação negativa de -0,71% e no acumulado do trimestre, a variação negativa foi de -4,06%. A queda do principal índice de ações negociadas na bolsa brasileira impactou o resultado dos fundos da carteira do instituto, sendo que a maioria dos fundos fechou no campo

negativo no trimestre, impactando a rentabilidade acumulada da carteira de investimentos no período. O comitê de investimentos vem monitorando o desempenho dos fundos de renda variável na carteira, sendo que o fundo Itaú Momento 30 II Fic Ações e o fundo Daycoval Ibovespa Ativo FI Ações tem apresentado desempenho inferior ao seu benchmark em algumas janelas de tempo, devendo o comitê ficar atento ao desempenho desses fundos no portfólio dos investimentos. Quanto ao enquadramento da política de investimentos foi observado que no mês de março houve um desenquadramento passivo no limite inferior do Artigo 10º, I, fundos multimercados. Conforme política de investimentos de 2024 o limite inferior é de no mínimo 3% da carteira no artigo e fechou o mês com 2,97%. Dessa forma, fica decidido que, se persistir o desenquadramento no mês subsequente, deverão ser feitos novos aportes no segmento do artigo para adequação da estratégia definida na política de investimentos. **Item 1.1** - Quanto aos recursos que serão recebidos de repasses de contribuições previdenciárias no mês de Maio/2024, fica decidido, as seguintes movimentações: - as contribuições recebidas no mês serão aplicadas de imediato no fundo BB Perfil Fic RF Ref DI Previd , CNPJ 13077418/0001-49, conta 18500-0, no Banco do Brasil; - os recursos da Taxa de Administração serão aplicados no fundo Caixa FI Brasil Referenciado DI - CNPJ 03737206/0001-97, conta 117-0, Ag 1312 - CEF; - os recursos recebidos da compensação previdenciária serão aplicados no fundo Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica – CNPJ 23.215.097/0001-55, conta nº 187-0, agência 1312 – CEF; - os recursos para custeio da folha de benefícios previdenciários base Abril/2024, serão resgatados do fundo BB Perfil Fic RF Ref DI Previd , CNPJ 13077418/0001-49, conta 18500-0, Banco do Brasil; - os resgates para despesas administrativas serão feitos do fundo Caixa Brasil Ref DI – CNPJ 03737206/0001-97, vinculado na conta 117-0, ag 1312, e conta 711080-4, Caixa Econômica Federal;. Segue as sugestões de movimentações de recursos para deliberação do Conselho Administrativo. Quanto à aplicação das contribuições previdenciárias, estas deverão ser aplicadas em fundo de curto prazo, no fundo BB Perfil Fic RF Ref DI Previd, e serão utilizados para pagamento das despesas de folha de benefícios do instituto. Esses valores poderão ser realocados em decisões futuras, sendo que o comitê decide aguardar a contratação da nova consultoria de investimentos para análise da carteira e eventuais realocações de recursos conforme política de investimentos. **Item 2-** Passou-se ao segundo item da pauta do dia, com Sr Jorge reforçando que foi disponibilizado antecipadamente aos membros do comitê, para análise prévia dos mesmos, a minuta do parecer do mês de referência para deliberação na reunião. Logo após, foi colocado para análise a minuta do parecer mensal dos investimentos referente ao mês de março para deliberação. Foram debatidas as informações de mercado, carteira de investimentos com percentuais de renda fixa e renda variável obtidos no período, enquadramentos da carteira e fundos, retorno dos investimentos no mês, assim como a rentabilidade da carteira mensal e acumulada e a meta atuarial correspondente, análise de risco da carteira de investimentos, APR,s emitidas no mês dentre outras análises constantes no parecer mensal. Após análise do texto do parecer, observando as pontuações feitas pelos membros do comitê, fica o parecer mensal dos investimentos do mês de março/2024 **aprovado** por todos os membros presentes na reunião. A versão final do parecer será enviada aos membros do comitê e para presidente do instituto pelo sistema 1Doc para assinatura digital. Encaminhe-se o parecer do comitê de investimentos para análise do Conselho Fiscal via sistema 1Doc. Finalizado todos os conteúdos pautados e nada mais tendo a tratar, deu-se por encerrada a presente reunião. Eu, Jorge Lopes Zaatreh, lavrei a presente ata no sistema 1DOC, que vai assinada digitalmente por mim e por todos os membros presentes na reunião.



VERIFICAÇÃO DAS ASSINATURAS



Código para verificação: 892C-086C-EBD7-7506

Este documento foi assinado digitalmente pelos seguintes signatários nas datas indicadas:

- ✓ JORGE LOPES ZAATREH (CPF 582.XXX.XXX-15) em 30/04/2024 15:02:55 (GMT-04:00)
Papel: Assinante
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

- ✓ ROSELI BAUER (CPF 653.XXX.XXX-68) em 30/04/2024 17:54:09 (GMT-04:00)
Papel: Assinante
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

- ✓ EVANDRO M. A. BEZERRA (CPF 849.XXX.XXX-87) em 02/05/2024 09:16:42 (GMT-04:00)
Papel: Assinante
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

Para verificar a validade das assinaturas, acesse a Central de Verificação por meio do link:

<https://prevmmar.1doc.com.br/verificacao/892C-086C-EBD7-7506>