

Ato oficial Ata Comitê de Investimentos - (Nota interna 02/08/2024 11:11) 014/2024

De: Jorge Z. - COMINV

Para: Envolvidos internos acompanhando

Data: 02/08/2024 às 11:11:10

Setores envolvidos:

COMINV

Ata Comitê de Investimentos - 14/2024

Aos vinte e nove dias do mês de julho 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 Jorge Lopes Zaatreh, Evandro Marciel Alves Bezerra, Alander Matheus Taube de Lima e a membro suplente e diretora presidente Bruna Ferreira Figueró. **1- Análise dos Resultados dos Investimentos Junho, 2º trimestre de 2024; 2- Aplicações/Resgates mensais. 3- Outros assuntos. Ítem 1** - Iniciada a reunião foi colocado para análise e discussão dos membros do comitê os relatórios de fechamento do mês de junho, segundo trimestre e primeiro semestre do ano de 2024 através do acesso à plataforma UNO, da consultoria de investimentos contratada. Conforme relatório apresentado a carteira de investimentos fechou o mês de junho com saldo consolidado de R\$ 129.250.182,21; o retorno no mês foi de 0,30% e meta atuarial foi de 0,66%. No fechamento do 2º trimestre do ano, compreendendo os meses de abril, maio e junho, a carteira de investimento obteve retorno de positivo de 0,30% e meta de 2,32% no trimestre. No fechamento do primeiro semestre de 2024 a carteira de investimentos do instituto apresentou retorno positivo de 1,84%, ficando abaixo da meta atuarial de 5,21% acumulada no mesmo período. Também foram analisados os dados do relatório de risco na plataforma de gestão dos investimentos, com análise dos índices de volatilidade da carteira e dos fundos de investimentos, conformidade dos enquadramentos dos ativos, gestores e administradores conforme Resolução 4963/2021, aderência dos fundos de investimentos aos benchmarks e aderência das aplicações à política de investimentos. Tendo por base os relatórios e no acompanhamento dos resultados dos fundos de investimentos foi discutido solicitar à consultoria de investimentos uma análise do segmento de renda variável, uma vez que fundos como o Itaú Momento 30 II vem apresentando resultado negativo não aderente ao seu benchmark, analisando a possibilidade de realocação de alguns fundos dentro do segmento. Foi discutido ainda alguns eventos de mercado que impactaram o resultado da carteira no primeiro semestre, especialmente os fundos de renda variável e os fundos de renda fixa mais longos., destacando-se a taxa de juros dos EUA, que manteve os juros altos por mais tempo e não iniciou o ciclo de cortes, como previsto no final do ano de 2023, com previsão de cortes apenas no último trimestre de 2024; a taxa de juros no Brasil que parou o ciclo de cortes e mantém a taxa Selic nos atuais 10,50 a.a, ante uma previsão em torno de 9%,

conforme indicava boletim focus no início do ano; aumento do risco fiscal do país com governo mostrando que poderia não cumprir as metas fiscais do arcabouço fiscal dentre outros eventos que aumentaram a percepção de risco e aumentaram a volatilidade dos mercados globais. Todo esse cenário de juros em patamares altos, risco fiscal no Brasil aumentando, valorização do dólar, riscos geopolíticos e outros fatores acabaram trazendo muita volatilidade ao mercado e impactou os resultados dos investimentos no primeiro semestre, trazendo rentabilidade negativa aos fundos de renda variável na carteira, e afetando também os fundos de renda fixa mais longos, resultando num retorno da carteira de investimentos abaixo da meta atuarial estabelecida para o semestre. Os fundos mais curtos como os de índices CDI e IRFM1 tiveram resultados compatíveis com a meta atuarial, sendo viável a exposição nesses fundos, que traz proteção e diminui os riscos da carteira em momentos de incertezas no mercado. **Ítem 2** - Quanto aos recursos que serão recebidos de repasses de contribuições previdenciárias no mês de Agosto/2024, após ponderações dos membros do comitê, fica decidido, as seguintes aplicações/resgates: - 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, podendo ser feitas realocações posteriores; - os recursos da Taxa de Administração serão aplicados no fundo Caixa FIC 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; Quanto aos resgates para custeio da folha de benefícios previdenciários base Julho/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 recebidas, 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 e poderão ser realocados conforme análise e decisões posteriores. **Ítem 3** - Foi informado ainda aos membros do comitê que foi solicitado à consultoria de investimentos a atualização dos dados na plataforma UNO para credenciamento de instituições financeiras para prosseguir no andamento da aquisição de títulos públicos, e que em breve será solicitada reunião para análise da documentação. Foi informado ainda que na reunião do Conselho Administrativo, no dia 30/07/2024, às 9hs, será apresentado o resultado da carteira de investimentos do mês de junho, segundo trimestre e fechamento do primeiro semestre de 2024, com a participação do Sr Felipe Mafuz, analista da consultoria LEMA. 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: 48EB-0211-C93B-BB26

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

- ✓ JORGE LOPES ZAATREH (CPF 582.XXX.XXX-15) em 02/08/2024 10:11:51 (GMT-04:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

- ✓ ALANDER MATHEUS TAUBE DE LIMA (CPF 015.XXX.XXX-70) em 02/08/2024 10:49:48 (GMT-04:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

- ✓ EVANDRO M. A. BEZERRA (CPF 849.XXX.XXX-87) em 02/08/2024 11:56:48 (GMT-04:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

- ✓ BRUNA FERREIRA FIGUERÓ (CPF 011.XXX.XXX-67) em 02/08/2024 11:58:48 (GMT-04:00)
Papel: Parte
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/48EB-0211-C93B-BB26>