



ATA DE REUNIÃO (nº 183)

Aos vinte e um dias do mês de agosto do ano de dois mil e vinte e três, às nove horas, em cumprimento ao que estabelece a Lei Complementar nº 566, de 28 de junho de 2018 e alterações, reuniu-se ordinariamente o Comitê de Investimentos, através de videoconferência, composto pelos membros: Adriano Antônio Pazianoto, Daniel Henrique Martins Biot, Hélio Antunes Rodrigues, Mário José Piccarelli de Castro e Patrícia Nato Toninato Bartolomei. A reunião teve como pauta: **I - Abertura dos Trabalhos; II - Votação da Ata de Reunião Anterior; III - Deliberação sobre credenciamentos solicitados (se houver); IV - Avaliação da Carteira de Investimentos do mês anterior e análise da conjuntura econômica, na seguinte ordem: a) Análise do cenário macroeconômico; b) Evolução do orçamento e fluxo de caixa; c) Desempenho dos investimentos no mês de julho/2023; V - Análise do Relatório Analítico do 1º semestre/2023 dos Ativos da Carteira de Investimentos da Riopretoprev; VI - Deliberação sobre recursos recebidos de “Cupom de NTN-B”; VII - Discussão e deliberações quanto aos novos investimentos (se houver).** A Sra. Patrícia Nato Toninato Bartolomei, coordenadora do Comitê de Investimentos, dá abertura aos trabalhos, e dando andamento à pauta, pergunta aos membros se todos tiveram acesso as minutas de ata enviadas previamente, ao que todos respondem positivamente. Colocadas em votação, **as atas nº 179 de 23/06/2023 e nº 180 de 07/07/2023 foram aprovadas por unanimidade.** Dando sequência à pauta, item III, sobre credenciamentos a Sra. Patrícia Nato informou que, agora, como o prazo de vencimento é de dois anos, há mais tranquilidade para credenciar novas instituições e, revisando suas anotações, encontrou observação sobre credenciar a distribuidora BGC Liquidez DTVM Ltda., que é *dealer* do Tesouro Nacional e distribui títulos públicos, e do fundo Blue Trend distribuído pela XP Investimentos, mas antes de iniciar os processos gostaria da confirmação de interesse do Comitê. Com relação à distribuidora os membros julgaram interessante iniciar o processo para análise já que amplia o número de cotações e a concorrência para obtermos melhores taxas numa eventual compra de títulos que possa surgir, apesar de já ter atingido o objetivo da Política de Investimentos desse ano e as taxas estarem fechando. Quanto ao fundo Blue Trend, por se tratar de investimento no exterior, os membros compararam com outros fundos da carteira, entretanto eles têm desempenho bastante diversificado. Os membros notaram que apesar de que no comparativo desde fevereiro de 2021 o fundo apresentar o melhor desempenho, em meados de março deste ano ele teve uma queda de rentabilidade muito brusca, caindo 10,88% no mês, tendo uma característica bastante volátil, não possuindo um desempenho de destaque no ano. Os membros entraram em contato com o Sr. Eduardo Reichert, da XP Investimentos, que esclareceu que o fundo é um seguidor de tendência, ele tende a se remunerar quando o mercado tem tendência definida e tem mais dificuldades em inflexões, fato que aconteceu em março, porém, informa que fundo tende a se recuperar de forma rápida. Diante da volatilidade apresentada os membros optaram por não realizar o credenciamento no momento. Na sequência, sobre o **item IV da pauta, a fim de seguir o procedimento exposto no item 3.2.7 do Manual do Pró-Gestão RPPS, é feita a análise dos seguintes itens: a) Análise do Cenário Macroeconômico:** Foi verificado, além do Relatório Macroeconômico da LDB Consultoria de Agosto/2023,



as notícias mais recentes do mercado: Na sexta, o Ibovespa interrompeu a maior sequência de perdas da sua história, 13 sessões consecutivas, e fechou em alta de 0,37%, aos 115.408,52 pontos, porém com queda mensal de mais de 5%. As bolsas americanas fecharam mistas na sexta, acumulando perdas semanais consecutivas. Na economia global existe cautela diante da crise imobiliária na China que se acentuou nos últimos dias com a incorporadora chinesa Evergrande entrando com pedido de recuperação judicial nos EUA. O dólar ao final do pregão foi negociado a R\$ 4,968, em baixa moderada, de -0,27%, e encerrou a semana com ganhos de 1,30%, o que leva a valorização acumulada em agosto para 5,04%. Após subir nos últimos quatro pregões, os juros futuros tiveram um pequeno alívio na sexta-feira na esteira do recuo dos juros americanos. Os juros dos títulos de médio e longo prazo nos EUA cederam, permitindo algum respiro para nossa curva de juros futura. No Brasil, a movimentação em Brasília deu alguma esperança de que a pauta das reformas se desenrole, o que também contribuiu para o bom comportamento. A tendência é a tensão do lado político arrefecer nos próximos dias, com a negociação para a reforma ministerial. Verificando as projeções do Boletim Focus de 18 de agosto divulgado no dia, temos: para o IPCA (Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo), a projeção em 2023 se elevou de 4,84% para 4,9% em 2023, e se manteve em 2024, 2025 e 2026 respectivamente em 3,86%, 3,5% e 3,5. A projeção para o PIB (Produto Interno Bruto) se manteve em 2,29% para 2023, subiu de 1,3% para 1,33% em 2024, se manteve em 1,9% para 2025 e 2% em 2026. A taxa de câmbio subiu de R\$ 4,84 para R\$ 4,90 em 2023, se manteve em R\$ 5,00 em 2024, em R\$ 5,09 para 2025, e subiu de R\$ 5,10 para R\$ 5,15 em 2026. Para a taxa Selic a projeção para o ano de 2023 se manteve em 11,75%, e se manteve também nos demais anos em 9,00% para 2024, em 8,5% para 2025 e 2026. Para os próximos meses as projeções de IPCA ficaram em 0,25% para agosto, 0,37% para setembro e 0,39% para outubro de 2023. Em seguida, sobre o item **b) Evolução do Orçamento e fluxo de caixa:** o Sr. Adriano Antônio Pazianoto apresentou as informações de com os dados do Balancete Contábil de **julho/2023:** *No período, as receitas financeiras totalizaram R\$ 29.682.284,62, sendo: a) contribuições dos 5.219 servidores ativos – R\$ 4.546.495,05; Contribuições dos Aposentados e Pensionistas R\$ 691.449,77; Contribuição Patronal Normal – R\$ 8.189.825,31; Contribuição Patronal Suplementar – R\$ 8.870.512,43 Parcelamentos – R\$ 436.424,87; COMPREV – R\$ 531.244,89; Receita Patrimonial – R\$ 6.251.646,14; Restituições da Folha de Pagamento – R\$ 3.116,16; Outras Receitas – R\$ 161.570,00. No período, as despesas equivaleram a R\$ 18.437.415,28, sendo: a) Despesa com benefícios previdenciários: i) com 1.708 aposentadorias: R\$ 16.339.983,04; ii) com 235 pensões: R\$ 1.335.265,83; iii) com pagamento de benefícios em decorrência de ordem judicial: R\$ 173.065,14; iv) despesas administrativas – R\$ 562.503,91; v) indenizações e restituições trabalhistas – R\$ 0,00; vi) despesas com compensação previdenciária RGPS – R\$ 26.597,36. Conclui-se, com análise da peça, um resultado orçamentário superavitário de R\$ 11.244.869,34. O Patrimônio da RIOPRETOPREV, no dia 31/07/2023, era o seguinte: Fund. Invest. (ativo circulante) – Prev. – R\$ 323.208.520,18; Fund. Invest. (ativo não circulante) – Prev. – R\$ 204.593.608,48; Fund. Invest. (ativo circulante) – Adm. – R\$ 4.322.007,37; Imóveis (44 imóveis) (ativo não circulante) – R\$ 147.143.793,86; Imobilizado (ativo não circulante) – R\$ 65.083,47; Créditos e Valores a Longo Prazo - IPESP (ativo não circulante) – R\$ 256.925.699,86; Créditos a Longo Prazo (Ativo não circulante) – R\$ 17.611.471,84; Conta Movimento (ativo circulante) – R\$ 9.105,13; Adiantamento (Ativo circulante) R\$ 3.000,00; Créditos Previdenciários- A Receber A*



Curto Prazo - (Ativo Circulante) – R\$ 1.452.868,90; Outros Créditos a Receber E Valores A Curto Prazo (Ativo Circulante) - R\$ 639.865,00; Total- R\$ 955.975.024,09. Após, os membros verificaram: **c) Desempenho dos investimentos no mês de julho de 2023:** Conforme relatórios internos da Riopretoprev e da LDB Consultoria, referentes ao mês de julho de 2023, todos os fundos da carteira estão enquadrados nos limites da Resolução CMN nº 4963/2021. O maior percentual em relação ao PL de um fundo (limite é 15%, conforme Art. 19º da Res CMN nº 4963/2021, reduzido para 5% para fundos que tratam os incisos V do Art. 7º, e não aplicável aos fundos de investimento que apliquem seus recursos exclusivamente em títulos definidos na alínea "a" do inciso I do Art. 7º ou em compromissadas lastreadas nesses títulos), é de 7,01%, que ocorre com o fundo BB PREV AÇÕES ALOCAÇÃO FIA. Os dois seguintes, o 2º e o 3º maiores são: FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA com 5,54% do PL e BRADESCO INSTIT FIC FI RF IMA-B com 5,33% do PL e o 4º é o BTG PACTUAL S&P 500 BRL FIM com 4,92% do PL. Por outro lado, o maior percentual em relação ao PL da Riopretoprev (limite é 20%, direta ou indiretamente, conforme Art. 18º da Res CMN nº 4963/2021, excetuados os fundos de investimento que apliquem seus recursos exclusivamente em títulos definidos na alínea "a" do inciso I do Art. 7º ou em compromissadas lastreadas nesses títulos) é do fundo CAIXA BRASIL RF Ref DI LP com 7,07% do PL (este FIC não tem em sua carteira aplicações em outros fundos por nós adquiridos), sendo o 2º e o 3º os seguintes fundos: FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP com 6,43% do PL e BTG PACTUAL S&P 500 BRL FIM com 4,91% do PL (estes FI não tem em sua carteira aplicações em outros fundos por nós adquiridos). Segue descrição detalhada: Pela Resolução CMN nº 4963/2021 temos em Renda Fixa: Art. 7º, I, a => % PL 34,20% Limite 100%; Art. 7º, I, b => % PL 16,73% Limite 100%; Art. 7º, III, a => % PL 19,43% Limite 75%; Art. 7º, IV => % PL 1,05% Limite 20%; Art. 7º, V, b => % PL 0,54% Limite 10%; TOTAL RENDA FIXA 71,94% (Limite 100%). Renda Variável: Art. 8º, I => % PL 13,56% (limite 45%); TOTAL RENDA VARIÁVEL 13,56% (LIMITE 45%). Investimentos no Exterior: Art. 9º, II => % PL 2,84% (Limite 10% no total de IE); Art. 9º, III => % PL 3,07% (Limite 10% no total de IE); TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 5,92% (Limite 10%). Investimentos Estruturados: Art. 10º, I => % PL 6,21% Limite 15%; Art. 10º, II => % PL 2,36% Limite 10%; TOTAL INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 8,58% (Limite 20%-Art. 10, § 2º). Adicionalmente: Art. 14=> Art 8º + Art 10º + Art. 11º = 22,14% PL (Limite 50%); Art. 20=> o total das aplicações dos recursos do RPPS não excedem a 5% do volume total gerido de recursos de terceiros das Instituições Financeiras. Conforme relatório da Coordenadoria GCI e LDB Consultoria, todos os fundos de nossa carteira estão enquadrados na Política de Investimentos e próximos do Objetivo. Todos os segmentos representados por artigos, incisos e alíneas estão conforme a descrição a seguir: Renda Fixa: Art. 7º, I, a => % 34,20% Limite entre 0% e 65%; Art. 7º, I, b => % PL 16,73% Limite entre 10% e 70%; Art. 7º, III, a => % PL 19,43% Limite entre 0% e 70%; Art. 7º, IV => % PL 1,05% Limite entre 0% e 20%; Art. 7º, V, b => % PL 0,54% Limite entre 0% e 5%; Renda Variável: Art. 8º, I => % PL 13,56% Limite entre 0% e 40%; Investimentos no Exterior: Art. 9º, II => % PL 2,84% Limite entre 0% e 10%; Art. 9º, III => % PL 3,07% Limite entre 0% e 10%; Investimentos Estruturados: Art. 10º, I => % PL 6,21% Limite entre 0% e 15%; Art. 10º, II => % PL 2,36% Limite 0% e 10%. Distribuição dos recursos entre instituições e benchmarks, diversificação de gestores e produtos, e de níveis de risco: (i) O Banco do Brasil tem 10 fundos (R\$ 62,133 milhões; 11,68% do PL), sendo 2 de renda variável de ações livres, 3 de investimentos no exterior: 1 de

ações ESG Globais BDR, 1 de Ações no Exterior BB Nordea e BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY e 05 de renda fixa: 1 IPCA com carência até o vencimento dos títulos, 1 IPCA CRED PRIV, 1 IMA-B, 1 de gestão ativa e 1 fundo BB Prev RF Fluxo FIC, fundo DI de aplicações e resgates automáticos que teve aplicações nesse mês; (ii) A Caixa tem 16 fundos (R\$ 148,04 milhões, 27,93% do PL) sendo 3 de renda variável: 1 Ações ETF Ibovespa, 1 de Ações Livres e 1 de Ações Valor; 1 Multimercado com índice de Bolsa Americana e 1 de investimentos no exterior em ações BDR; e 11 de renda fixa: 4 fundos DI (sendo 1 fundo Disponibilidade - fundo de resgate e aplicação automático vinculado a conta 0631/006/71060-1; o fundo Cx Br Matriz RF, também vinculado a conta 0631/006/71060-1, que recebe o saldo residual dos recursos de taxa administrativa não utilizados no mês, disponíveis no CX BR Disponibilidades RF e que teve um resgate parcial no mês; e 2 fundos vinculado a conta 0631/006/440-5), 4 IMAs (sendo 2 referenciado IMA-B, 1 IMA-B5 que teve desinvestimento total no mês e 1 IMA-B5+ que recebeu aplicação inicial no mês), 1 IPCA Título Público (este último com carência até o vencimento dos títulos, com vencimento único para 2024), 1 IDKA IPCA 2A, que teve desinvestimento total no mês, 1 GESTÃO ESTRATÉGICA, onde o gestor faz as alterações na alocação conforme o cenário econômico; (iii) O Bradesco tem 3 fundos (R\$ 45,122 milhões; 8,48% do PL), sendo 2 de renda fixa: 1 IMA-B5 e 1 IMA-B, e 1 fundo DI de aplicações e resgates automáticos que não teve movimentação no mês, além de 1 fundo de renda variável em ações Mid Small Caps; (iv) A XP Investimentos tem 2 fundos (R\$ 8,172 milhões; 1,57% do PL): 1 de renda variável de Ações Dividendos e 1 de Investimento no Exterior Global, e também tem a custódia das NTN-Bs, títulos públicos do Tesouro Nacional, adquiridas pela Riopretoprev, no valor de R\$ 181,964 milhões, 34,2% do PL, sendo que nesse mês não foram feitas novas aquisições. A XP Investimentos tem ainda a custódia da Letra Financeira Subordinada de 10 anos adquirida junto ao Banco BTG Pactual SA, no valor de R\$ 5,594 milhões (1,05% do PL); (v) O Santander tem 2 fundos (R\$ 16,002 milhões, 3,01% do PL), sendo 1 IMA B5 e 1 Exterior Global ESG, que não tem variação cambial; (vi) A Western Asset tem 3 fundos (R\$ 24,514 milhões; 4,61% do PL), sendo 1 IMA-B ATIVO, 1 IMA-B5 ATIVO e 1 fundo de investimentos no exterior em AÇÕES BDR, que busca resultados com a valorização da bolsa americana, sofrendo também influência da cotação do dólar; (vii) Kinea/Lions tem 1 fundo FIP (R\$ 11,224 milhões, 2,11% do PL), adquirido no final de 2017 e em fase final de captação de recursos e investimentos nas empresas adquiridas, porém já iniciado o processo de desinvestimento parcial; (viii) Kinea/Intrag tem 1 fundo FIP (0,994 milhões; 0,19% do PL), fundo de investimentos em participação em fase inicial de captação de recursos para investimentos nas empresas; (ix) a Rio Bravo tem o fundo multimercado de capital protegido (R\$ 1,099 milhões; 0,21% do PL); (x) BTG Pactual tem 2 fundos (R\$ 26,494 milhões, 4,98% do PL), um multimercado S&P 500 e um FIP de Economia Real em fase inicial de captação de recursos. Descrição detalhada: a meta atuarial do mês foi de 0,53% e o rendimento da carteira foi de 1,30%. I) Renda Fixa: Neste mês, 71,94% (R\$ 382,832 milhões) dos recursos ficaram em Renda Fixa (art. 7º Res. 4963/2021). O segmento fechou com uma valorização de 0,74%, em continuidade com movimento iniciado no mês anterior de fechamento da curva de juros de médio e longo prazo, percentual que corresponde a 139,62% da meta atuarial do mês, que registrou 0,53%, sendo que todos os fundos e ativos do segmento fecharam o mês com desempenho positivo. A principal alteração de estratégia no segmento foi o alongamento da carteira de fundos de longo prazo em IMA-B e IMA-B5+, com saída parcial de recursos do IMA-B5 e saída do IDKA2, na tentativa de capturar melhor rentabilidade com cenário de projeção de queda Selic. A alteração da estratégia foi positiva para o desempenho da carteira no mês. Dos 21 fundos de RF que tiveram movimentação, 5 deles são lastreados em ativos de curto prazo, representados por fundos DI e somam 8,05% da carteira e renderam,

em média, 1% no mês. No segmento de médio prazo, os fundos de alocação ativa tiveram rendimento médio de 0,83%, e representam 4,35% da carteira. O fundo IDKA2 teve rendimento de 0,23%, porém teve desinvestimento total no dia 10/07/23 e fechou a carteira zerado. Os fundos IMA-B5, lastreados por ativos de médio prazo, tiveram rendimento médio de 0,66%, nesse segmento houve desinvestimento de aproximadamente R\$ 15,97 milhões (FI CAIXA BRASIL IMA B5 TP RF LP) e fechou o mês com 5,26% do PL. Assim, os fundos de médio prazo, que representam 9,6% da carteira, fecharam com rendimento médio de 0,7%. Nos fundos de longo prazo, os ativos lastreados em IMA-B, tivemos a migração de R\$ 2,5 milhões vinculados a conta administrativa de fundo DI para essa estratégia, e no fechamento o segmento representa cerca de 14,81% do PL, e fechou com valorização média de 0,81%. Houve investimento inicial no segmento de longuíssimo prazo IMA-B 5+ (índice Anbima que representa a evolução da carteira, a preços de mercado, da carteira de títulos públicos indexados ao IPCA (NTN-B) com prazos superiores a cinco anos), que recebeu recursos do IDKA2 e IMA-B5 no montante de R\$ 17,795 milhões e rendeu 1,6% no mês, fechando com 3,4% do PL da carteira. A classe de fundos IPCA TP e IPCA CRED PRIV, que tem como índice de referência IPCA + 6%, se valorizou no mês, em média, 1,01%, e representa 0,84% da carteira. Com relação aos títulos públicos federais nesse mês não foram feitas novas aquisições e o segmento fechou com 34,2% do PL da carteira e rentabilidade média de 0,47%. A Letra Financeira Subordinada do Banco BTG Pactual SA com vencimento em 10 anos e remuneração de IPCA+8,46% a.a. com marcação na curva, teve rentabilidade no mês de 0,61% e representa 1,05% do PL da carteira. O destaque do mês foi o FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP, que recebeu aplicação inicial no mês, e rendeu de 1,62%. No geral, a RF fechou o mês com valorização de R\$ 2.754.551,33 rendimento médio de 0,74%. No acumulado do ano a RF rendeu R\$ 27.711.067,38 que corresponde a 8,3%. II) Renda Variável: No mês, 13,56% (R\$ 72,164 milhões) dos recursos fecharam aplicados em Renda Variável (art. 8º Res. 4963/2021). Em fundos de ações (Art. 8º, I) ficaram R\$ 72,164 milhões, 13,56% do PL, que se valorizaram em média, 3,15%, muito próximo do principal índice do setor, o Ibovespa, que registrou 3,27% no mês. Os recursos ficaram distribuídos em vários segmentos de mercado como: ETF IBOVESPA, SMALL CAPS, DIVIDENDOS, ALOCAÇÃO EM SEGMENTOS DE MERCADO, FUNDOS DE "VALOR" e AÇÕES LIVRES. Não houve movimentações no segmento nesse mês. Todos os fundos do segmento tiveram rentabilidade positiva e o destaque foi o BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA que registrou valorização de 3,65%. No geral, a renda variável fechou o mês com valorização de R\$ 2.202.646,61 (3,15%) e o ano com R\$ 6.752.119,02 que corresponde a 10,32%. III) Investimentos no Exterior: No mês, 5,92% (R\$ 31,483 milhões) dos recursos fecharam aplicados em Investimentos no Exterior (art. 9º Res. 4963/2021) e tiveram valorização, registrando em média 2,11%. Nos fundos de Investimento no Exterior GLOBAL (Art. 9º, II da Res CMN 4963/2021) ficaram 2,84% do PL da Riopretoprev, R\$ 15,134 milhões, e fecharam o mês com rentabilidade média de 3%. Os fundos BDR (Art. 9º, III da Res CMN 4963/2021) somam R\$ 16,349 milhões, 3,07% do PL, e registraram rentabilidade média de 1,3%. Não foram feitas movimentações no mês nesse segmento. O destaque do segmento foi o fundo MS GLOBAL OPPORTUNITY ADV IE FIC AÇÕES, que se valorizou 3,57% no mês. No geral, o IE fechou o mês com valorização de R\$ 651.838,22. No acumulado do ano o segmento registra rendimento de R\$ 4.779.712,50, que corresponde a 17,9%. IV) Investimentos Estruturados: No mês, 8,58% (R\$ 45,643 milhões) dos recursos fecharam aplicados em Investimentos Estruturados. Em fundos Multimercados (art. 10º, I da Res. CMN 4963/2021) ficaram 6,21% do PL da Riopretoprev, R\$ 33,071 milhões, e tiveram valorização média de 3,61%. Em fundos de participação (art. 10º, II da Res. CMN 4963/2021) ficaram 2,36% do PL, R\$ 12,572 milhões, aplicados no FIP



Kinea IV, no FIP Kinea V e também no FIP BTG Pactual Economia Real II Multiestratégia, e se valorizaram em média 0,05%. Foi o único segmento que registrou fundos com rentabilidade negativa devido a sua estratégia de investimento inicial nas empresas. Não foram feitas aplicações no mês no segmento. O FIP Kinea IV efetuou amortização no valor de R\$ 19.310,74. No geral, o segmento de investimentos estruturados fechou o mês com valorização de 2,61%, R\$ 1.159.525,62, e no ano registra rentabilidade acumulada de R\$ 5.802.255,90 (14,77%). Principais Indicadores no mês: RENDIMENTO mês: (em R\$) 6.768.561,78; RENDIMENTO mês (em %): 1,3%; META ATUARIAL MÊS(%): 0,53%; META GERENCIAL (IMA-B) (%): 0,81%; CDI: 1,07%; IBOVESPA: 3,27%; IBX-50: 3,70%; IRF M1: 1,07%; S&P 500: 1,45%; MSCI ACWI: 1,88; RAZÃO: RENDIMENTO FINANCEIRO $\times$ META ATUARIAL (%) NO MÊS: 245,28%; RENDIMENTO ano (em R\$): 45.045.154,80; RENDIMENTO ano (em %): 9,62%; META ATUARIAL ano (%): 5,94%; NOS ÚLTIMOS 3 MESES: 373,86%; NOS ÚLTIMOS 6 MESES: 158,62%; NOS ÚLTIMOS 12 MESES: 130,15%; DO ANO EM CURSO: 161,95%; DESDE O INICIO ADM CARTEIRA: 60,65%; DESDE O INICIO DA RIOPRETOPREV: 86,07%. Os membros verificaram que a liquidez da carteira está com 57,81% resgatável em até 30 dias, superior ao limite mínimo previsto na Política de Investimentos, que é de 40%. Verificaram também as movimentações efetuadas no mês de julho e a análise de risco da carteira, onde verificaram os gráficos de dispersão em diversas janelas de tempo, estratégias de alocação de recursos e enquadramentos na Res. CMN 4963/2021, estando todos os fundos e ativos enquadrados nos limites previstos na Política de Riscos. A seguir, referente ao item **V - Análise do Relatório Analítico do 1º semestre/2023 dos Ativos da Carteira de Investimentos da RIOPRETOPREV**, os membros realizaram a abertura da carteira de fechamento do 1º semestre de 2023, e **fizeram a verificação detalhada dos ativos que compõem o patrimônio dos fundos de investimentos**, incluindo os títulos e valores mobiliários aplicados pelo RPPS, bem como a análise do Relatório analítico de *Rating* dos ativos no caso de Fundos de Renda Fixa (salvo aqueles que aplicam seus recursos exclusivamente em títulos públicos), Aplicações diretas em Ativos Financeiros de Renda Fixa e Fundos de Renda Fixa – Crédito Privado. Verificaram que o papel da empresa Americanas S.A. não está presente em nenhum fundo da carteira, fato que esteve no radar na última avaliação realizada pelo Comitê. Observaram também que o total dos ativos de crédito representam 2,8% da carteira da Riopretoprev. E, observaram ainda que o fundo de vértice enquadrado no artigo 7º, V, “b” da Res. CMN 4963/2021, Fundos Renda Fixa “Crédito Privado”, BB PREV RF IPCA III (CRED PRIV), tem um percentual pequeno alocado em crédito privado, estando a maior parte da carteira em títulos públicos. Dando sequência à pauta, **item VI**, quanto aos recursos recebidos de cupom de NTN-B, a Sra. Patrícia Nato Toninato Bartolomei informou que o valor recebido no dia 15 de agosto foi de R\$ 3.014.332,07, sendo aplicação no fundo BRADESCO INSTIT FIC FI RF IMA-B, conforme deliberação do Comitê do dia 07/08/2023, e ainda conforme deliberação do mesmo dia, os recursos do pagamento de cupom do fundo de vértice BB PREV RF TP IPCA III FI, juntamente com recursos disponíveis no fundo de aplicações e resgates automáticos BB PREVID FLUXO RF SIMPLES FIC FI, provenientes de processos judiciais, foram aplicados, no dia 16/08/2023, no fundo BB PREVID RF IMA-B TP FI, cujo montante total foi de R\$ 96.643,55. Mencionou que houve o pagamento do cupom do fundo de vértice CAIXA



BRASIL FI 2024 VI TP RF, também no dia 16/08/2023, no valor de R\$ 25.249,68 e como não havia deliberação anterior está disponível para aplicação. Já adentrando ao item **VII - Discussão e deliberações quanto aos novos investimentos (se houver)** abriu a reunião para as discussões sobre os investimentos. Já verificado o cenário macroeconômico, item IV-a da pauta, que embasa a tomada de decisões, os membros revisaram as decisões de alocação de novos recursos vigentes. Os membros mencionaram que nas atuais projeções de cenário, os fundos ligados ao benchmark CDI continuarão a entregar meta, e com perspectiva de queda de juros e inflação controlada, os fundos de IMA mais longos devem apresentar bom resultado. Mencionaram também a necessidade de ter um recurso de liquidez imediata para eventuais necessidades ou alterações de estratégia, o que fica garantido pelos recursos disponíveis no fundo CAIXA BRASIL RF Ref DI LP. Os membros mencionaram que o desempenho da bolsa local no mês não condiz com as previsões de cenário anteriores, e que a queda tem sido impulsionada principalmente pelo cenário exterior. Após o término das discussões, os membros, por unanimidade, fizeram as seguintes deliberações: **pela aplicação do cupom do fundo CAIXA BRASIL FI 2024 VI TP RF, CNPJ: 22.791.074/0001-26, no fundo CAIXA BRASIL RF Ref DI LP, CNPJ: 03.737.206/0001-97; pela aplicação do saldo residual remanescente do FUNDO CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF SIMPLES, CNPJ: 14.508.643/0001-55 (fundo de fluxo com aplicações e resgates automáticos vinculado a conta exclusiva para pagamento das despesas administrativas), após pagamento das despesas mensais, no fundo CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP, CNPJ: 10.740.658/0001-93, mantendo-se a decisão até nova deliberação; pela manutenção da deliberação pela aplicação dos recursos recebidos referentes ao Proc. Licitatório 02/2022 – LEILÃO PRESENCIAL 01/2022 - VENDA BEM IMÓVEL - Matrícula 66.674 - 2º CRI (ANTIGO "ALMOXARIFADO MUNICIPAL"), no fundo CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP, CNPJ: 05.164.356/0001-84; pela manutenção da deliberação de aplicação dos novos recursos de Compreve no fundo FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP, CNPJ: 10.646.895/0001-90; pela manutenção da deliberação de aplicação dos recursos remanescentes na conta 0631/006/440-5, da Caixa Econômica Federal, após pagamento das despesas com a folha de benefícios e os repasses pertinentes, no fundo CAIXA BRASIL RF REF DI LP, CNPJ: 03.737.206/0001-97; e pela manutenção da deliberação de resgate de recursos do fundo CAIXA BRASIL RF REF DI LP, CNPJ: 03.737.206/0001-97, se necessário, para pagamento das despesas relativas aos benefícios previdenciários. Sobre os recursos disponíveis no fundo de aplicações e resgates automáticos BB PREVID FLUXO RF SIMPLES FIC FI, provenientes de processos judiciais, levando em consideração que o fundo é de benchmark DI, que está entregando meta atuarial, e o saldo atual é de R\$ 1.364,39, os membros irão acompanhar os depósitos futuros para então definir possível realocação. Sobre manifestação de voto das demonstrações contábeis do fundo Kinea IV, que haviam ficado pendente na reunião anterior, os membros definiram pela ausência de envio de voto, sendo que, dessa forma, é considerada a anuência do RPPS. O Sr. Hélio Antunes Rodrigues mencionou que, devido a fixação de outdoor nos terrenos próximos da Receita Federal e da Coplan, informando sobre venda ou locação, está havendo uma demanda sobre consulta dos valores. Finalizados os assuntos previstos em**



308 pauta e não tendo mais a tratar, foram comunicadas as datas das reuniões de setembro e a
309 presente reunião foi finalizada. Para constar, eu, Patrícia Nato Toninato Bartolomei, lavrei
310 a presente ata, que depois de lida e achada conforme, vai por mim assinada e por todos os
311 presentes. Ata aprovada, por unanimidade, na reunião virtual de 22/09/2023 (segunda
312 reunião ordinária de setembro de 2023).

ADRIANO ANTÔNIO PAZIANOTO
ASSINADO DIGITALMENTE

DANIEL HENRIQUE MARTINS BIOT
ASSINADO DIGITALMENTE

HÉLIO ANTUNES RODRIGUES
ASSINADO DIGITALMENTE

MÁRIO JOSÉ PICCARELLI DE CASTRO
ASSINADO DIGITALMENTE

PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI
ASSINADO DIGITALMENTE

313



VERIFICAÇÃO DAS ASSINATURAS



Código para verificação: 95AA-0EE8-9A83-7C1E

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

- ✓ PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI (CPF 326.XXX.XXX-02) em 22/09/2023 15:35:49 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: AC VALID RFB v5 << AC Secretaria da Receita Federal do Brasil v4 << Autoridade Certificadora Raiz Brasileira v5 (Assinatura ICP-Brasil)
- ✓ ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO (CPF 327.XXX.XXX-48) em 22/09/2023 15:53:15 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ DANIEL HENRIQUE MARTINS BIOT (CPF 410.XXX.XXX-57) em 22/09/2023 16:29:02 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ MÁRIO JOSÉ PICCARELLI DE CASTRO (CPF 219.XXX.XXX-01) em 26/09/2023 08:21:57 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ HELIO ANTUNES RODRIGUES (CPF 974.XXX.XXX-04) em 29/09/2023 08:18:06 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: AC VALID RFB v5 << AC Secretaria da Receita Federal do Brasil v4 << Autoridade Certificadora Raiz Brasileira v5 (Assinatura ICP-Brasil)

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

<https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/95AA-0EE8-9A83-7C1E>