



ATA DE REUNIÃO (nº 186)

Aos vinte e dois dias do mês de setembro 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, Mário José Piccarelli de Castro e Patrícia Nato Toninato Bartolomei. O Sr. Hélio Antunes Rodrigues justificou sua ausência por motivo de licença prêmio. A reunião teve como pauta: **I- Abertura dos Trabalhos; II- Votação da Ata da Reunião Anterior; III- Deliberação sobre credenciamentos solicitados (BGC Liquidez DTVM LTDA e outros 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 agosto/2023; V- 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 dá ciência aos membros sobre o relatório elaborado pelos Srs. Daniel Henrique Martins Biot e Mário José Piccarelli de Castro sobre as palestras da XP Expert 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 181 de 21/07/2023, nº 182 de 07/08/2023 e nº 183 de 21/08/2023 foram aprovadas por unanimidade.** Dando sequência à pauta, item III, sobre credenciamentos a Sra. Patrícia Nato informou que os documentos da distribuidora BGC Liquidez DTVM Ltda., que é *dealer* do Tesouro Nacional e distribui títulos públicos, estavam disponíveis para análise. Informou ainda que a instituição solicita um termo de aceite por parte do RPPS sobre a Política de Relacionamento com entidades integrantes do Regime Próprio de Previdência Social – RPPS. Os membros analisaram os documentos de credenciamento. A BGC Liquidez DTVM Ltda é uma das maiores corretoras independentes do mundo, Focada 100% no segmento institucional - Bancos e Fundos, Equipe de mesa títulos públicos c/+10 especialistas; 6 Calls diários de precificação títulos públicos; Mesa de títulos privados e derivativos (DAP); Relatórios diários de preços de títulos públicos; Workshop de Precificação de títulos públicos, Custódia de títulos públicos com custo zero, Corretagem ZERO nas operações do mercado secundário; Equipe Macroeconômica premiada Top5 BCB, Equipe de Análise Política em Brasília; Eventos exclusivos com políticos, economistas e autoridades. Possui política de segurança da informação contemplando matriz de segregação de função por área de negócio, requisitos de utilização e complexidade de senhas. A atualização dos sistemas, incluindo antivírus, é feita periodicamente seguindo as políticas globais e da BGC Partners. O uso de *webmail* também possui travas de segurança e bloqueios conforme política global da BGC Partners. Possui o novo selo do Programa de Qualificação Operacional (PQO) da B3, que substituiu os selos Execution Broker e o selo Nonresident Investor Broker da B3 e o selo Certifica da B3. Além de ser, atualmente, dealer do Tesouro Nacional e Top Broker da Cetip nos mercados de títulos pré-fixados e títulos públicos indexados. Adicionalmente, a Instituição utiliza ferramenta para a gestão de qualificação operacional, aferindo semestralmente o nível de



aderência da Corretora com as exigências regulatórias e de melhores práticas do mercado. Não foram encontradas restrições que desaconselhem investimentos e relacionamento seguro com a instituição. Apresentou as certidões de regularidade. Instituição aderente aos códigos Anbima: CÓDIGO DE ÉTICA, CÓDIGO DE NEGOCIAÇÃO DE INSTRUMENTOS FINANCEIROS, CÓDIGO DE OFERTAS PÚBLICAS, CÓDIGO DOS PROCESSOS DA REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS e CÓDIGO PARA SERVIÇOS QUALIFICADOS AO MERCADO DE CAPITAIS. Após análise dos documentos os membros deliberaram, por unanimidade, pelo credenciamento do distribuidor BGC LIQUIDEZ DTVM LTDA, CNPJ: 33.862.244/0001-32. 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 Setembro/2023, as notícias mais recentes do mercado: Apesar de Copom ter cortado juros no Brasil, decisão do banco central americano acabou mingando o otimismo, ao menos momentaneamente. Ontem o Ibovespa encerrou em forte queda, com desvalorização de -2,15%, aos 116.145,05 pontos, houve recuo de ações de grande peso, como Vale, Petrobras e Bradesco, além das empresas varejistas. O FED – Banco Central Americano – manteve os juros no intervalo entre 5,25% a 5,50% ao ano, mas sinalizou que as taxas podem ficar elevadas por mais tempo do que o previsto pelo mercado. Já o Copom reduziu a Selic em 0,50%, chegando a 12,75% ao ano, porém, reforçando a importância de perseguir a meta fiscal. Ontem o índice Dow Jones caiu -1,08%, enquanto o S&P 500 recuou -1,64% e o *Nasdaq Composite* perdeu -1,82%. O dólar encerrou o pregão em alta de 1,13%, cotado a R\$ 4,935. Juros altos nos EUA e Selic caindo no Brasil significa, em parte, uma menor entrada de dólares por aqui. Os juros futuros fecharam em alta firme ontem amparada nos ajustes do FED e do Copom. Verificando as projeções do Boletim Focus de 15 de setembro divulgado no dia 18, temos: para o IPCA (Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo), a projeção em 2023 se caiu de 4,93% para 4,86% em 2023, de 3,89% para 3,86% em 2024 e se manteve em 2025 e 2026 em 3,5%. A projeção para o PIB (Produto Interno Bruto) subiu de 2,64% para 2,89% em 2023, de 1,47% para 1,5% em 2024, caiu de 2,00% para 1,95% para 2025 e se manteve em 2% para 2026. A taxa de câmbio caiu de R\$ 5,00 para R\$ 4,95 em 2023, de R\$ 5,02 para R\$ 5,00 em 2024, e se manteve em R\$ 5,10 para 2025, e subiu de R\$ 5,15 para R\$ 5,18 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 0,38% para setembro, 0,39% para outubro e 0,3% para novembro 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 **agosto/2023:** *No período, as receitas financeiras totalizaram R\$ 19.048.837,36, sendo: a) contribuições dos 5.203 servidores ativos – R\$ 4.547.313,60; Contribuições dos Aposentados e Pensionistas R\$ 694.480,89; Contribuição Patronal Normal – R\$ 8.872.510,12; Contribuição Patronal Suplementar – R\$ 419.740,83; Parcelamentos – R\$ 440.390,88; COMPREV – R\$ 523.284,47; Receita Patrimonial – R\$ 3.368.148,33; Restituições da Folha de Pagamento – R\$ 1.228,95; Outras Receitas – R\$ 181.739,29. No período, as despesas equivaleram a R\$ 18.473.679,86, sendo: a) Despesa com benefícios previdenciários: i) com 1.717*



aposentadorias: R\$ 16.447.130,71; ii) com 237 pensões: R\$ 1.361.083,47; iii) com pagamento de benefícios em decorrência de ordem judicial: R\$ 46.538,11; iv) despesas administrativas – R\$ 615.141,90; v) indenizações e restituições trabalhistas – R\$ 0,00; vi) despesas com compensação previdenciária RGPS – R\$ 3.785,67. Conclui-se, com análise da peça, um resultado orçamentário superavitário de R\$ 575.157,50. O Patrimônio da RIOPRETOPREV, no dia 31/08/2023, era o seguinte: Fund. Invest. (ativo circulante) – Prev. – R\$ 319.894.003,48; Fund. Invest. (ativo não circulante) – Prev. – R\$ 203.013.263,36; Fund. Invest. (ativo circulante) – Adm. – R\$ 4.422.218,19; Imóveis (43 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\$ 85,69; Adiantamento (Ativo circulante) R\$ 1.568,14; Créditos Previdenciários- A Receber A Curto Prazo - (Ativo Circulante) – R\$ 1.162.295,12; Outros Créditos a Receber E Valores A Curto Prazo (Ativo Circulante) - R\$ 446.580,00; Total- R\$ 950.686.063,01. O Comitê também tomou ciência que referente a contribuição patronal suplementar da competência agosto/2023, apenas uma parte do encargo (R\$ 419.740,83), foi recolhido no prazo legal – que se encerrou no dia 20/09/2023 - sendo que existe um saldo a receber de R\$ 8.426.242,56 e que a Diretoria já adotou as providências administrativas iniciais para solicitar a quitação da contribuição atrasada mediante o envio de ofício. Após, os membros verificaram: **c) Desempenho dos investimentos no mês de agosto de 2023:** Conforme relatórios internos da Riopretoprev e da LDB Consultoria, referentes ao mês de agosto 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 n.º 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 7,07%, que ocorre com o fundo BB PREV AÇÕES ALOCAÇÃO FLA. Os dois seguintes, o 2º e o 3º maiores são: FLA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA com 5,56% do PL e BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO com 4,91% 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 n.º 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 FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP com 6,57% 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: CAIXA BRASIL RF Ref DI LP com 6,56% 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 34,19% Limite 100%; Art. 7º, I, b => % PL 16,93% Limite 100%; Art. 7º, III, a => % PL 19,68% Limite 75%; Art. 7º, IV => % PL 1,07% Limite 20%; Art. 7º, V, b => % PL 0,55% Limite 10%; TOTAL RENDA FIXA 72,41% (Limite 100%). Renda Variável: Art. 8º, I => % PL 12,91% (limite 45%); TOTAL RENDA VARIÁVEL 12,91% (LIMITE 45%). Investimentos no Exterior: Art. 9º, II => % PL 2,87% (Limite 10% no total de IE); Art. 9º, III => % PL 3,19% (Limite 10% no total de IE); TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 6,07% (Limite 10%). Investimentos Estruturados: Art. 10º, I => % PL 6,21% Limite 15%; Art. 10º, II => % PL 2,40% Limite 10%; TOTAL INVESTIMENTOS



ESTRUTURADOS 8,61% (Limite 20%-Art. 10, § 2º). Adicionalmente: Art. 14=> Art 8º + Art 10º + Art. 11º = 21,52% 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 => % 34,19% Limite entre 0% e 65%; Art. 7º, I, b => % PL 16,93% Limite entre 10% e 70%; Art. 7º, III, a => % PL 19,68% Limite entre 0% e 70%; Art. 7º, IV => % PL 1,07% Limite entre 0% e 20%; Art. 7º, V, b => % PL 0,55% Limite entre 0% e 5%; Renda Variável: Art. 8º, I => % PL 12,91% Limite entre 0% e 40%; Investimentos no Exterior: Art. 9º, II => % PL 2,87% Limite entre 0% e 10%; Art. 9º, III => % PL 3,19% Limite entre 0% e 10%; Investimentos Estruturados: Art. 10º, I => % PL 6,21% Limite entre 0% e 15%; Art. 10º, II => % PL 2,4% 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 e que efetuou pagamento de cupom nesse mês, 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 movimentação nesse mês; (ii) A Caixa tem 14 fundos (R\$ 144,85 milhões, 27,47% 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 09 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), 3 IMAs (sendo 2 referenciado em IMA-B e 1 IMA-B5+), 1 IPCA Título Público (este último com carência até o vencimento dos títulos, com vencimento único para 2024 e que efetuou pagamento de cupom nesse mês), e 1 GESTÃO ESTRATÉGICA, onde o gestor faz as alterações na alocação conforme o cenário econômico; (iii) O Bradesco tem 3 fundos (R\$ 46,471 milhões; 8,81% do PL), sendo 2 de renda fixa: 1 IMA-B5 e 1 IMA-B (que recebeu aplicação dos cupons de NTN-B pagos no mês); o 1 fundo DI de aplicações e resgates automáticos que não teve movimentação no mês; e 1 fundo de renda variável em Ações Mid Small Cap; (iv) A XP Investimentos tem 2 fundos (R\$ 8,343 milhões; 1,58% 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\$ 180,280 milhões, 34,19% do PL, sendo que nesse mês não foram feitas novas aquisições e houve pagamento de cupom dos papéis com vencimento em ano par. 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\$ 5,644 milhões (1,07% do PL); (v) O Santander tem 2 fundos (R\$ 15,987 milhões, 3,03% do PL), sendo 1 IMA B5 e 1 Exterior Global ESG, que não tem variação cambial; (vi) A Western Asset tem 3 fundos (R\$ 24,813 milhões; 4,71% 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\$ 11,297 milhões, 2,14% 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 (0,988 milhões; 0,19% do PL), fundo de investimentos em participação em fase inicial de captação de recursos para investimentos nas empresas; (vix) a Rio Bravo tem o fundo multimercado de capital protegido (R\$ 1,069 milhões; 0,21% do PL); (x) BTG Pactual tem 2 fundos (R\$ 26,251 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 0,68% e o rendimento da carteira foi de -0,4%. I) Renda Fixa: Neste mês, 72,41% (R\$ 381,862 milhões) dos recursos ficaram em Renda Fixa (art. 7º Res. 4963/2021). O segmento fechou com uma valorização de 0,44%, abaixo da meta atuarial do mês, que registrou 0,68%, pois apesar do início de corte de juros pelo Copom no início do mês, a curva de juros teve alta e o mercado passou a refletir expectativas de queda de juros em ritmo mais lento, o que impactou negativamente os fundos de IMA de mais longo prazo. Não foram feitas alterações de estratégia no segmento nesse mês. Dos 19 fundos de RF da carteira, 5 deles são lastreados em ativos de curto prazo, representados por fundos DI e somam 7,6% da carteira e renderam, em média, 1,19% no mês. No segmento de médio prazo, os fundos de alocação ativa tiveram rendimento médio de 0,86%, e representam 4,42% da carteira. Os fundos IMA-B5, lastreados por ativos de médio prazo, tiveram rendimento médio de 0,54% e fecharam o mês com 5,33% do PL. Assim, os fundos de médio prazo, que representam 9,75% da carteira, fecharam com rendimento médio de 0,69%. Nos fundos de longo prazo, os ativos lastreados em IMA-B, tivemos a alocação de R\$ 3,014 milhões recebidos de cupom das NTN-Bs de vencimento par da carteira no BRADESCO INSTIT FIC FI RF IMA-B, a alocação de R\$ 0,528 milhões de Comprev no FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP e R\$ 96,6 mil no BB PREVID RF IMA-B TP referente recurso de cupom de fundo de vértice e recursos previdenciários de processos judiciais, decisões tomadas em reuniões do Comitê de Investimentos, ficando com 15,6% do PL da carteira. Entretanto, devido oscilação na curva de juros o segmento não seguiu tendência do mês anterior e fechou com rentabilidade de -0,41%. O 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), também impactado negativamente teve rentabilidade de -1,26% no mês, fechando com 3,39% 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, 0,85%, e representa 0,85% da carteira. Com relação aos títulos públicos federais nesse mês não foram feitas novas aquisições, sendo efetuado o pagamento de cupom dos títulos de vencimento em ano par no total de R\$ 3, 014 milhões e o segmento fechou com 34,19% do PL da carteira e rentabilidade média de 0,74%. 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 0,90% e representa 1,07% do PL da carteira. O destaque do mês foi o CAIXA BRASIL RF Ref DI LP, que rendeu de 1,24%. No geral, a RF fechou o mês com valorização de R\$ 1.704.533,99 e rendimento médio de 0,44%. No acumulado do ano a RF rendeu R\$ 29.415.601,37 que corresponde a 8,78%, contra uma meta atuarial acumulada de 6,66%. II) Renda Variável: No mês, 12,91% (R\$ 68,077 milhões) dos recursos fecharam aplicados em Renda Variável (art. 8º Res. 4963/2021). Em fundos de ações (Art. 8º, I) ficaram R\$ 68,077 milhões, 12,91% do PL, que se desvalorizaram em média, -5,66%, muito próximo do principal índice do setor, o Ibovespa, que registrou -5,09% no mês e seguindo direção dos índices globais. 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 negativa e o

menos impactado foi o FIC FLA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE que registrou desvalorização de -3,4% e no ano acumula alta de 11,93%. No geral, a renda variável fechou o mês com desvalorização de R\$ -4.086.684,42 (-5,66%) e o ano com R\$ 2.665.434,60 que corresponde a 4,07%. III) Investimentos no Exterior: No mês, 6,07% (R\$ 32,005 milhões) dos recursos fecharam aplicados em Investimentos no Exterior (art. 9º Res. 4963/2021) e tiveram valorização, registrando em média 1,66%. Nos fundos de Investimento no Exterior GLOBAL (Art. 9º, II da Res CMN 4963/2021) ficaram 2,87% do PL da Riopretoprev, R\$ 15,158 milhões, e fecharam o mês com rentabilidade média de 0,16%. Os fundos BDR (Art. 9º, III da Res CMN 4963/2021) somam R\$ 16,846 milhões, 3,19% do PL, e registraram rentabilidade média de 3,04%. Não foram feitas movimentações no mês nesse segmento. O destaque do segmento foi o fundo WESTERN ASSET FLA BDR NÍVEL I, que se valorizou 3,2% no mês. No geral, o IE fechou o mês com valorização de R\$ 521.316,01. No acumulado do ano o segmento registra rendimento de R\$ 5.301.028,51, que corresponde a 19,85%. IV) Investimentos Estruturados: No mês, 8,61% (R\$ 45,384 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\$ 32,754 milhões, e tiveram desvalorização média de -0,96%. Em fundos de participação (art. 10º, II da Res. CMN 4963/2021) ficaram 2,4% do PL, R\$ 12,629 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 0,46%. Não foram feitas aplicações no mês no segmento. O destaque do segmento foi o fundo KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME, que rendeu 0,64%, único fundo com rentabilidade positiva no segmento. No geral, o segmento de investimentos estruturados fechou o mês com desvalorização de -0,57%, R\$ -259.584,19, e no ano registra rentabilidade acumulada de R\$ 5.542.671,71 (14,12%). Principais Indicadores no mês: RENDIMENTO mês (em R\$) - 2.120.418,61; RENDIMENTO mês (em %): -0,4%; META ATUARIAL MÊS(%): 0,68%; META GERENCIAL (IMA-B) (%): -0,38%; CDI: 1,14%; IBOVESPA: -5,09%; IBX-50: -4,76%; IRF M1: 1,15%; S&P 500: 1,97%; MSCI ACWI: 0,73; RAZÃO: RENDIMENTO FINANCEIRO $\times$ META ATUARIAL (%) NO MÊS: -58,82%; RENDIMENTO ano (em R\$): 42.924.736,19; RENDIMENTO ano (em %): 9,18%; META ATUARIAL ano (%): 6,66%; NOS ÚLTIMOS 3 MESES: 211,69%; NOS ÚLTIMOS 6 MESES: 175,68%; NOS ÚLTIMOS 12 MESES: 105,93%; DO ANO EM CURSO: 137,84%; DESDE O INICIO ADM CARTEIRA: 59,75%; DESDE O INICIO DA RIOPRETOPREV: 85,05%. Os membros mencionaram que o fundo de exterior BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IE FI tem tido um desempenho um pouco diferente dos demais fundos do segmento e foi o único a fechar o mês de agosto com rentabilidade anual negativa. Diante do fato, e como forma de diligência, os membros solicitaram a coordenadora do Comitê para tentar agendar videoconferência com o Banco do Brasil para entender melhor o motivo do desempenho, saber as perspectivas, e se for o caso, falar com o gestor do fundo. A Sra. Patrícia Nato irá verificar junto a instituição a possibilidade de agendamento na próxima reunião ordinária. Os membros verificaram que a liquidez da carteira está com 57,92% resgatável em até 30 dias, superior ao limite mínimo previsto na Política de Investimentos, que é de 40%. Verificaram também as APRs de movimentações efetuadas no mês de agosto, as alocações por estratégia 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-



Discussão e deliberações quanto aos novos investimentos (se houver), a Sra. Patrícia Nato deu ciência das demonstrações financeiras relativas aos exercícios sociais encerrados em 31/03/2023 do KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTIESTRATÉGIA, CNPJ nº 41.745.796/0001-99. Nos documentos enviados constatou-se que o parecer da auditoria foi que as demonstrações financeiras “apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do Kinea Private Equity V Feeder Institucional I Fundo de Investimento em Participações Multiestratégia em 31 de março de 2023, o desempenho de suas operações e os seus fluxos de caixa para o período de 22 de abril de 2022 (início das atividades) a 31 de março de 2023, de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil, aplicáveis aos fundos de investimento em participações”. A Sra. Patrícia Nato mencionou que após o envio do Código de ética às instituições financeiras credenciadas, várias delas aproveitaram a oportunidade para solicitar agenda com o instituto. Mencionou que o Itaú está distribuindo um fundo imobiliário do Kinea e gostaria de apresentar o produto. O Sr. Adriano Antonio Pazianoto comentou que com a busca pelo Pró-Gestão Nível IV alguns processos de diligências serão necessários para esse tipo de fundo a fim de analisar os imóveis que compõem o mesmo, sendo mencionado pelo Sr. Mário José Piccarelli de Castro que é importante para garantir a segurança do cotista, mas acredita que eles devam ter algum tipo de relatório com informações sobre os ativos do fundo. Mencionou ainda que na XP Expert assistiu palestra que mencionou que os fundos imobiliários têm boas perspectivas, principalmente os fundos de tijolos. Os membros optaram então por atender inicialmente as instituições que já tem relacionamento para atualizações e as que tenham produtos para apresentar, sendo que se necessário o agendamento de alguma instituição presencial poderá ser feito pela coordenadora do Comitê e os membros que puderem comparecer ao instituto e, havendo diferencial no produto apresentado será agendada apresentação junto a reunião do Comitê. Sobre alterações nas alocações da carteira, os membros julgaram estar bem diversificada e aderente ao cenário previsto de queda de juros, e irão aguardar agendamento com o Banco do Brasil para reavaliar o fundo de exterior que não está apresentando bom desempenho no ano. A Sra Patrícia Nato mencionou que irá enviar e-mail à XP Investimentos sobre a previsão de primeiro aporte no FIP Pátria VII em que o instituto fez compromisso de investimentos, pois de acordo com última informação recebida essa chamada já era para ter ocorrido. Finalizados os assuntos previstos em pauta e não tendo mais a tratar, foram comunicadas as datas das reuniões de outubro e a presente reunião foi finalizada. Para constar, eu, Patrícia Nato Toninato Bartolomei, lavrei a presente ata, que depois de lida e achada conforme, vai por mim assinada e por todos os presentes. Ata aprovada, por unanimidade, na reunião virtual de 06/11/2023 (primeira reunião ordinária de novembro de 2023).

ADRIANO ANTÔNIO PAZIANOTO
ASSINADO DIGITALMENTE

DANIEL HENRIQUE MARTINS BIOT
ASSINADO DIGITALMENTE



PREFEITURA DE
RIO PRETO



MÁRIO JOSÉ PICCARELLI DE CASTRO
ASSINADO DIGITALMENTE

PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI
ASSINADO DIGITALMENTE

301

8

RIOPRETOPREV – Regime Próprio de Previdência Social do Município de São José do Rio Preto

Rua General Glicério, 3553 – Centro - CEP 15015-400 - São José do Rio Preto - SP

Telefones (17) 3222 7445 - riopretoprev@riopreto.sp.gov.br - www.riopreto.sp.gov.br

Assinado por 4 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, DANIEL HENRIQUE MARTINS BIOT, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e MÁRIO JOSÉ PICCARELLI DE CASTRO
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/5043-E147-EBE0-27D1> e informe o código 5043-E147-EBE0-27D1





VERIFICAÇÃO DAS ASSINATURAS



Código para verificação: 5043-E147-EBE0-27D1

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

- ✓ PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI (CPF 326.XXX.XXX-02) em 07/11/2023 15:19:01 (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)
- ✓ DANIEL HENRIQUE MARTINS BIOT (CPF 410.XXX.XXX-57) em 07/11/2023 16:04:27 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO (CPF 327.XXX.XXX-48) em 08/11/2023 11:01:10 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ MÁRIO JOSÉ PICCARELLI DE CASTRO (CPF 219.XXX.XXX-01) em 09/11/2023 10:44:35 (GMT-03:00)
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://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/5043-E147-EBE0-27D1>