



ATA DE REUNIÃO (nº 166)

Aos dezanove dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte e dois, 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 Rodrigue, e Patrícia Nato Toninato Bartolomei. O Sr. Mário José Piccarelli de Castro justificou sua ausência por motivo de férias. A reunião teve como pauta: **I - Abertura dos Trabalhos; II - Votação de Ata de Reunião Anterior; III - Deliberação sobre credenciamentos solicitados (XP Gestão de Recursos LTDA, XP Investidor Dividendos FIA 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 novembro/2022; V - Discussão e deliberações quanto aos novos investimentos (se houver); VI - Discussão e deliberação sobre 11ª chamada de integralização de capital do FIP Kinea IV.** A Sra. Patrícia Nato Toninato Bartolomei, coordenadora do Comitê de Investimentos, dá abertura aos trabalhos. Sobre o item II da pauta informa que não há atas no dia para votação. Em seguida, sobre o item III de credenciamentos, informou os processos que estavam disponíveis para análise, dando **ciência aos membros sobre a transferência dos recursos do fundo BB Prev RF Alocação Ativa FIC, CNPJ: 25.078.994/0001-90, para o BB Prev RF Alocação Ativa Retorno Total FIC, CNPJ: 35.292.588/0001-89, realizada pelo Banco do Brasil em 12/12/2022.** O montante de R\$ 11,57 milhões foi migrado após resultado de consulta formal feito aos cotistas encerrado em 28 de outubro de 2022, porém a Riopretoprev não tomou ciência dessa consulta e nem do seu resultado, fato que não possibilitou uma análise do fundo para credenciamento anterior a migração. Esse fundo já chegou a ser credenciado anteriormente pela Riopretoprev mas não recebeu aplicação, ele tinha uma classificação diferente antes da alteração na Resolução CMN 4963/2021, mas após sua publicação passaram a ser classificados no mesmo artigo por em sua composição conter apenas papéis atrelados a títulos públicos, e inclusive a mesma estratégia de gestão do fundo migrado. Em contato com o gerente do Banco do Brasil foi informado que receberão comunicado oficial sobre a mudança, porém a Sra. Patrícia Nato informou que houve uma falha do banco haja vistas que esse comunicado deveria ter sido enviado antes da mudança. Informou que solicitou análise do fundo à LDB e que ainda não está disponível, mas que já deixou o processo de credenciamento apto para análise do Comitê. Informou também que um resgate do fundo no momento poderia gerar prejuízo a carteira pelo fato das cotas terem desvalorizado após migração. Os membros verificaram gráficos comparativos de rentabilidade dos fundos envolvidos em diversas janelas de tempo e observaram que a rentabilidade dos fundos é muito próxima. Os membros fizeram então a análise dos documentos de credenciamentos, onde destacaram: o último regulamento do fundo é de 02 de março de 2020, está enquadrado no artigo 7º, I, “b” da Res. CMN nº 4.963/2021, com limites estabelecidos na Política de Investimentos do instituto, e tem como objetivo “proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em carteira diversificada de ativos financeiros de renda fixa, buscando superar a rentabilidade do Índice Nacional de Preços



ao Consumidor Amplo – IPCA”. Destina-se a receber recursos dos Regimes Próprios de Previdência Social instituídos pela União, pelos Estados, pelo Distrito Federal ou por Municípios, sejam eles aplicados pelos Regimes Próprios ou pela União, pelos Governos Estaduais, pelo Distrito Federal ou por Prefeituras e EFPCs - Entidades Fechadas de Previdência Complementar. O fundo é administrado e gerido pela BB Gestão de Recursos DTVM S.A., CNPJ: 30.822.936/0001-69, que consta da lista da SPREV que atende ao previsto Resolução CMN nº 4.963/2021 (inciso I, do § 2º e § 8º, ambos do art. 21 da Resolução CMN nº 4.963/2021) e já credenciada pela RIOPRETOPREV em obediência aos requisitos da Portaria MTP nº 1.467/2022, artigo 103, e considerados aptos pelo órgão colegiado competente do RPPS. Teve início em 16/03/2020 e em 30/11/2022 contava com patrimônio de R\$ 3.152.916.297,20 e 508 cotistas. A custódia é do Banco do Brasil SA. A taxa de administração varia de 0,3% a 0,5% a.a., compatível com os demais fundos do mercado no segmento. O FUNDO não possui taxa de performance. O fundo não cobra taxa de ingresso e de saída. Na aplicação, o número de cotas compradas será calculado de acordo com o valor das cotas no fechamento do dia da aplicação dos recursos (D+0) e no resgate, o número de cotas será calculado de acordo com o valor das cotas no fechamento do 3º dia contado da data do pedido de resgate (D+3) e o efetivo pagamento dos resgates também é no terceiro dia da solicitação do resgate (D+3). O FUNDO não tem prazo de carência. O fundo está sujeito aos seguintes principais fatores de riscos: Risco de taxa de juros; risco de investimentos em títulos indexados à inflação; risco proveniente de uso de derivativos; risco de liquidez; risco de juros posfixados; risco de não obtenção do tratamento tributário; risco de conjuntura; risco sistêmico; risco regulatório. Não consta fato relevante sobre o fundo. A rentabilidade do fundo é compatível com seu benchmark. A carteira de ativos do fundo de investimento se refere a posição consolidada no último dia útil de novembro/2022 e está alocada em 03 fundos de investimentos de títulos públicos. A aplicação de recursos no fundo, no entender do Comitê de Investimentos, é compatível com o fluxo financeiro da RIOPRETOPREV, e atende à Política de Investimentos e à Política de Riscos vigente. Tendo em vista as circunstâncias que motivaram a análise do fundo e após análise do processo, **os membros do Comitê deliberaram, por unanimidade, pelo credenciamento do fundo BB Prev RF Alocação Ativa Retorno Total FIC FI, CNPJ: 35.292.588/0001-89, com efeitos retroativos a 12/12/2022, com encaminhamento para referendo do CMP.** Os membros irão acompanhar a rentabilidade e evolução do fundo e caso não satisfaça os objetivos o RPPS irão estudar propostas para alteração na carteira. Após, os membros analisaram os documentos das instituições e fundos que estavam disponíveis e já fazem parte da carteira da Riopretoprev e **deliberaram, por unanimidade, pela atualização dos credenciamentos da gestora XP Gestão de Recursos Ltda, CNPJ: 07.625.200/0001-89 e fundo XP Investor Dividendos FIA, CNPJ: 16.575.255/0001-12, com encaminhamento para referendo pelo CMP,** fizeram as observações pertinentes nos termos de credenciamentos e as informações serão encaminhadas para referendo pelo Conselho Municipal de Previdência. Em seguida, adentrando ao **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 o Relatório Macroeconômico da LDB Consultoria de Dezembro/2022 e também um resumo diário feito pela R3

Investimentos e recebido pelos membros através de aplicativo de mensagens: “Juros altos e recessão, receita do tom pessimista. A sexta-feira e a semana chegam ao fim com o mesmo tom negativo que tem prevalecido para o mercado acionário. O Ibovespa cedeu na sexta -0,85%, aos 102.855,70 pontos, acumulando perda de -4,34% na semana e, até aqui, de -8,56% em dezembro. A caminho, por enquanto, de seu pior desempenho mensal desde os -11,5% de junho passado. Toda essa volatilidade e peso desfavorável, aqui e lá fora, é resultante, de forma abrangente, da subida dos juros nas principais economias do planeta para lidar com a inflação. Internamente nós temos pressões políticas e fiscais que podem modular para maior ou menor esta oscilação. Olhando para frente, a correção em curso nas maiores bolsas dos EUA e da Europa reflete a percepção de que esteja a caminho ao menos uma leve recessão global em 2023. A perda de dinamismo no ritmo de atividade mundial, o abre e fecha na China devido a política de Covid Zero (em relaxamento), juntam-se à persistente guerra na Ucrânia e as incertezas sobre o rumo dos preços de energia. Nos EUA as bolsas fecharam em baixa pressionadas por todo este clima. O índice Dow Jones fechou em queda -0,85%, o S&P 500 caiu -1,11% e o Nasdaq Composite recuou -0,97%. Na semana, houve queda de -1,66%, -2,08% e -2,72%, respectivamente. Os dirigentes do Federal Reserve (FED – Banco Central Americano) reforçaram as mensagens de que a prioridade é a redução na inflação para a meta de 2%. Neste cenário, com juros altos por mais tempo (previsões de 5% a 5,5% ao ano para 2023), avançam os temores de uma recessão na economia americana, o que já vem impactando algumas empresas. Os ingressos de recursos estrangeiros no Brasil levaram a cotação do dólar para baixo na sexta-feira. A moeda americana terminou o dia cotada a R\$ 5,294, com queda de -0,41%. Novas especulações de que a PEC da Transição, que autoriza uma expansão fiscal de ao menos R\$ 168 bilhões por dois anos, não prospere na Câmara e seja descartada pelo novo governo também ajudou a frear a desvalorização do real. E o mercado de juros? Os juros futuros fecharam o pregão de sexta em alta firme, mais acentuada nos vencimentos de médio e longo prazos. Na semana, todas as taxas subiram, também com mais força na ponta longa. A receita para a adição de prêmios (altas), vem de um cenário de contas públicas incerto, preocupações sobre o impacto fiscal da PEC da Transição, o futuro da Lei das Estatais e as nomeações para ministérios. O juro para 2027 saltou para 13,66% ao ano, de 13,38%”. Na sequência, os membros verificaram o último Boletim Focus, de 16 de dezembro de 2022, divulgado no dia, que trouxe: para o IPCA (Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo), a projeção em 2022 caiu de 5,79% para 5,63%, pela 2ª semana consecutiva; subiu de 5,08 para 5,17% em 2023, se manteve em 3,50% para 2024, e subiu de 3,02% para 3,10 em 2025. A projeção para o PIB (Produto Interno Bruto) em 2022 se manteve em 3,05%, se elevou de 0,75% para 0,79% em 2023, caiu de 1,70% para 1,67% em 2024 e se manteve em 2025 em 2,00%. A taxa de câmbio se manteve em R\$ 5,25 para 2022, subiu de R\$ 5,25 para R\$ 5,26 em 2023, e de R\$ 5,24 para R\$ 5,25 em 2024, e de R\$ 5,23 para R\$ 5,30 em 2025. Para a taxa Selic o ano de 2022 fechou em 13,75%. Para 2023, a projeção se manteve em 11,75%, subiu de 8,5% para 9,00% em 2024 e se manteve para 2025 em 8,00%. Para os próximos meses a projeção de IPCA é de 0,60% para dezembro, 0,55% para janeiro e de 0,66 para fevereiro de 2023. Em seguida, sobre o item **b) Evolução do Orçamento e fluxo de caixa:** o Sr. Adriano Antonio Pazianoto, que também é o Diretor Executivo da instituição, apresentou o balancete de outubro e novembro. **Outubro/2022:** No período, as receitas financeiras totalizaram R\$ 21.454.119,17, sendo: a) contribuições dos 5.115 servidores ativos – R\$ 4.094.836,39; Contribuições dos Aposentados e Pensionistas R\$ 549.635,88; Contribuição Patronal Normal – R\$ 8.508.492,70; Contribuição Patronal Suplementar – R\$ 6.111.026,53; Parcelamentos – R\$ 387.848,71; COMPREV – R\$ 494.701,30; Receita Patrimonial – R\$ 51.456,71; Restituições



da Folha de Pagamento – R\$ 119,02; Outras Receitas – R\$ 1.256.001,93. No período, as despesas equivaleram a R\$ 15.500.771,70 1, sendo: a) Despesa com benefícios previdenciários: i) com 1.602 aposentadorias: R\$ 13.784.958,92; ii) com 230 pensões: R\$ 1.202.701,25; iii) com pagamento de benefícios em decorrência de ordem judicial: R\$ 0,00; iv) despesas administrativas – R\$ 511.196,51; v) despesas com compensação previdenciária RGPS – R\$ 1.915,02. Conclui-se, com análise da peça, um resultado orçamentário superavitário de R\$ 5.953.347,47. O Patrimônio da RIOPRETOPREV, no dia 31/10/2022, era o seguinte: Fund. Invest. (ativo circulante) – Prev. – R\$ 283.593.378,27; Fund. Invest. (ativo não circulante) – Prev. – R\$ 150.364.101,25; Fund. Invest. (ativo circulante) – Adm. – R\$ 2.779.466,10; Conta Movimento (ativo circulante) – R\$0; Créditos a Curto Prazo – Venda Imóvel (Ativo circulante) – R\$ 1.563.030,00; Créditos Previdenciários- A Receber A Curto Prazo - Parcelamento (Ativo Circulante) – R\$ 1.313.989,64; Outros Créditos a Receber E Valores A Curto Prazo (Ativo Circulante) - R\$ 83.016,00; Imóveis (44 imóveis) (ativo não circulante)- R\$ 119.478.602,98; Imobilizado (ativo não circulante) – R\$ 75.219,10; Créditos e Valores a Longo Prazo - IPESP (ativo não circulante) – R\$ 256.925.699,86; Créditos a Longo Prazo - Parcelamento (Ativo não circulante) – R\$ 11.496.887,20; Créditos a Longo Prazo – Venda Imóvel (Ativo não circulante)- R\$ 9.601.470,00; Total- R\$ 837.274.860,40. **Novembro/2022:** No período, as receitas financeiras totalizaram R\$ 35.143.437,77, sendo: a) contribuições dos 5.206 servidores ativos – R\$ 5.022.602,40 Contribuições dos Aposentados e Pensionistas R\$ 1.074.712,84; Contribuição Patronal Normal – R\$ 14.481.500,29; Contribuição Patronal Suplementar – R\$ 11.080.557,17; Parcelamentos – R\$ 393.445,09; COMPREV – R\$ 489.764,77; Receita Patrimonial – R\$ 2.362.311,39; Restituições da Folha de Pagamento – R\$ 1.404,66; Outras Receitas – R\$ 237.139,16. No período, as despesas equivaleram a R\$ 25.721.392,11, sendo: a) Despesa com benefícios previdenciários: i) com 1.618 aposentadorias: R\$ 20.932.183,49; ii) com 229 pensões: R\$ 1.828.055,80; iii) com pagamento de benefícios em decorrência de ordem judicial: R\$ 2.328.797,16; iv) despesas administrativas – R\$ 630.440,64; v) despesas com compensação previdenciária RGPS – R\$ 1.915,02. Conclui-se, com análise da peça, um resultado orçamentário superavitário de R\$ 9.422.045,66. O Patrimônio da RIOPRETOPREV, no dia 30/11/2022, era o seguinte: Fund. Invest. (ativo circulante) – Prev. – R\$ 275.915.667,75; Fund. Invest. (ativo não circulante) – Prev. – R\$ 164.838.769,59; Fund. Invest. (ativo circulante) – Adm. – R\$ 2.889.131,52; Imóveis (44 imóveis) (ativo não circulante)- R\$ 119.478.602,98; Imobilizado (ativo não circulante) – R\$ 73.937,92; Créditos e Valores a Longo Prazo - IPESP (ativo não circulante) – R\$ 256.925.699,86; Créditos a Longo Prazo (Ativo não circulante) – R\$ 21.098.357,20; Conta Movimento (ativo circulante) – R\$ 0,01; Adiantamento (Ativo circulante) R\$ 500,00; Créditos Previdenciários- A Receber A Curto Prazo - (Ativo Circulante) – R\$ R\$ 4.938.270,36; Outros Créditos a Receber E Valores A Curto Prazo (Ativo Circulante) - R\$ 84.740,00; Total R\$ 846.243.677,17. Após, os membros verificaram: **c) Desempenho dos investimentos no mês de Novembro de 2022:** Conforme relatórios internos da Riopretoprev e da LDB Consultoria, referentes ao mês de Novembro de 2022, 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 5,51%, que ocorre com o fundo BB PREV AÇÕES ALOCAÇÃO FLA. Os dois seguintes, o 2º e o 3º maiores são: CAIXA FI AÇÕES BRASIL ETF IBOVESPA com 5,32% do PL e BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI

MM com 4,94% 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 6,79% 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: BB PREV AÇÕES ALOCAÇÃO FIA com 4,94% do PL e CAIXA BRASIL RF Ref DI LP com 4,65% do PL (estes FI não tem em sua carteira aplicações em outros fundos por nós adquiridos). Segue descrição detalhada: Pela Resolução CMN n.º 4963/2021 temos em Renda Fixa Art. 7º, I, a => % PL 31,31% Limite 100%; Art. 7º, I, b => % PL 18,69% Limite 100%; Art. 7º, III, a => % PL 17,96% Limite 75%; Art. 7º, IV => % PL 1,15% Limite 20%; Art. 7º, V, b => % PL 0,60% Limite 10%; TOTAL RENDA FIXA 69,71% (Limite 100%). Renda Variável: Art. 8º, I => % PL 15,17% (limite 45%); TOTAL RENDA VARIÁVEL 15,17% (LIMITE 45%). Investimentos no Exterior: Art. 9º, II => % PL 3,00% (Limite 10% no total de IE); Art. 9º, III => % PL 3,27% (Limite 10% no total de IE); TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 6,26% (Limite 10%). Investimentos Estruturados: Art. 10º, I => % PL 6,30% Limite 15%; Art. 10º, II => % PL 2,56% Limite 10%; TOTAL INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 8,86% (Limite 20%-Art. 10, § 2º). Adicionalmente: Art. 14=> Art 8º + Art 10º + Art. 11º = 24,03% 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 => % PL 31,31% Limite entre 0% e 40%; Art. 7º, I, b => % PL 18,69% Limite entre 10% e 70%; Art. 7º, III, a => % PL 17,96% Limite entre 0% e 70%; Art. 7º, IV => % PL 1,15% Limite entre 0% e 20%; Art. 7º, V, b => % PL 0,6% Limite entre 0% e 5%; Renda Variável: Art. 8º, I => % PL 15,17% Limite entre 0% e 40%; Investimentos no Exterior: Art. 9º, II => % PL 3% Limite entre 0% e 10%; Art. 9º, III => % PL 3,27% Limite entre 0% e 10%; Investimentos Estruturados: Art. 10º, I => % PL 6,30% Limite entre 0% e 10%; Art. 10º, II => % PL 2,56% Limite 0% e 5%. Distribuição dos recursos entre instituições e benchmarks, diversificação de gestores e produtos, e de níveis de risco: (i) O Banco do Brasil tem 11 fundos (R\$ 62,557 milhões; 14,10% 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 06 de renda fixa: 2 IPCA com carência até o vencimento dos títulos, 1 IPCA CRED PRIV, 1 IMA-B, 1 ALOCAÇÃO ATIVA e o fundo BB Prev RF Fluxo FIC, fundo DI de aplicações e resgates automáticos que teve movimentações nesse mês; (ii) A Caixa tem 14 fundos (R\$ 117,881 milhões; 26,57% do PL) sendo 4 de renda variável: 1 Ações ETF Ibovespa, 1 Multimercado com índice de Bolsa Americana, 1 de Ações Livres e 1 de Ações Valor; 1 de investimentos no exterior em ações BDR; e 10 de renda fixa: 4 fundos DI (sendo 1 fundo Disponibilidade - fundo de resgate e aplicação automático vinculado a conta 0631/006/71060-1, 2 fundos vinculado a conta 0631/006/440-5 e o fundo Cx Br Matriz RF 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), 2 IMAs (sendo 1 referenciado IMA-B e 1 IMA-B5), 1 IPCA Título Público (este último com carência até o vencimento dos títulos, com vencimento único para 2024), 1 IDKA IPCA 2A, 1 GESTÃO

221 *ESTRATÉGICA, onde o gestor faz as alterações na alocação conforme o cenário econômico; (iii) O*
222 *Bradesco tem 3 fundos (R\$ 41,478 milhões; 9,35% do PL), sendo 2 de renda fixa: 1 IMA-B5 e 1*
223 *IMA-B (o fundo DI de aplicações e resgates automáticos NÃO teve movimentação nesse mês), e 1 fundo*
224 *de renda variável em ações: 1 Mid Small Cap; (iv) A XP Investimentos tem 2 fundos (R\$ 7,076 milhões;*
225 *1,6% do PL), 1 de renda variável de Ações Dividendos e 1 de Investimento no Exterior Global e também*
226 *tem a custódia das NTN-Bs, títulos públicos do Tesouro Nacional, adquiridas pela Riopretoprev, no valor*
227 *de R\$ 138,920 milhões, 31,31% do PL, sendo que nesse mês foram feitas 2 novas aquisições de títulos.*
228 *A XP Investimentos tem ainda a custódia da Letra Financeira Subordinada de 10 anos adquirida junto*
229 *ao Banco BTG Pactual SA, no valor de R\$ 5,103 milhões (1,15% do PL); (v) O Santander tem 2*
230 *fundos (R\$ 14,377 milhões; 3,24% do PL, sendo 1 IMA B5 e 1 Exterior Global ESG que não tem*
231 *variação cambial; (vi) A Western Asset tem 3 fundos (R\$ 21,860 milhões; 4,93% do PL), sendo 1*
232 *IMA-B ATIVO, 1 IMA-B5 ATIVO e 1 fundo de investimentos no exterior em AÇÕES BDR, que*
233 *busca resultados com a valorização da bolsa americana, sofrendo também influência da cotação do dólar;*
234 *(vii) Kinea/Lions tem 1 fundo (FIP) (R\$ 10,643 milhões; 2,4% do PL), adquirido no final de 2017 e*
235 *em fase final de captação de recursos e investimentos iniciais nas empresas adquiridas, porém já iniciado o*
236 *processo de desinvestimento parcial; (viii) Kinea/Intrag tem 1 fundo (FIP) (0,705 milhões; 0,16% do*
237 *PL), fundo de investimentos em participação em fase inicial de captação de recursos para investimentos nas*
238 *empresas; (ix) a Rio Bravo tem o fundo multimercado de capital protegido (R\$ 1,022 milhões; 0,23% do*
239 *PL) e o (x) BTG Pactual tem uma aplicação no fundo multimercado S&P 500 (R\$ 22,017 milhões,*
240 *4,96% do PL). Descrição detalhada: a meta atuarial do mês foi de 0,79% e o rendimento da*
241 *carteira foi de -0,03%. I) Renda Fixa: Neste mês, 69,71% (R\$309,262 milhões) dos recursos*
242 *ficaram em Renda Fixa (art. 7º Res. 4963/2021). O segmento fechou com uma valorização de 0,28%,*
243 *abaixo da meta atuarial do mês que registrou 0,79%, porém amparado pela boa rentabilidade apresentada*
244 *com a marcação na curva dos títulos públicos federais. Dos 20 fundos de RF que tiveram movimentação, 5*
245 *deles são lastreados em ativos de curto prazo, representados por fundos DI e somam 5,65% da carteira e*
246 *renderam, em média, 0,8% no mês. No segmento de médio prazo, os fundos de alocação ativa tiveram*
247 *rendimento médio de -0,01%, e representam 4,72% da carteira. O fundo IDKA2 teve rendimento de -*
248 *0,71%, e representa 0,38% da carteira. Os fundos IMA-B5, lastreados em geral por ativos de médio*
249 *prazo, tiveram rendimento médio de -0,59% e representam 9,11% do PL. Assim, os fundos de médio*
250 *prazo, que representam 14,2% da carteira, fecharam com rendimento médio de -0,4%. Nos fundos de*
251 *longo prazo, os ativos lastreados em IMA-B, que representam cerca de 15,26% do PL, fecharam com*
252 *desvalorização média de -0,94%. Dessa forma vimos que os ativos de média e longo prazo sofreram*
253 *considerável desvalorização no mês, ficando bem abaixo da meta atuarial. A classe de fundos IPCA TP e*
254 *IPCA CRED PRIV, que tem como índice de referência IPCA + 6%, se valorizou no mês, em média,*
255 *0,23%, e representa apenas 2,13% da carteira. Com relação aos títulos públicos federais nesse mês foram*
256 *feitas duas novas aquisições, sendo aproximadamente R\$ 10 milhões no vértice 2050 e R\$ 5 milhões no*
257 *vértice 2035, seguindo indicações do estudo de ALM, e com rentabilidade superior a IPCA+6% a.a. o*
258 *que significa garantia de rentabilidade acima do previsto neste período e o segmento fechou com 31,31% do*
259 *PL da carteira e rentabilidade média de 1,06%. A Letra Financeira Subordinada do Banco BTG*
260 *Pactual SA com vencimento em 10 anos e remuneração de IPCA+8,46%a.a. com marcação na curva,*
261 *teve rentabilidade no mês de 1,27% e representa 1,15% do PL da carteira. O destaque do mês foram os*
262 *papéis marcados na curva conforme mencionado anteriormente. No geral, a RF fechou o mês com*
263 *valorização de R\$ 823.832,59, rendimento médio de 0,28%. II) Renda Variável: No mês, 15,17%*
264 *(R\$ 67,286 milhões) dos recursos fecharam aplicados em Renda Variável (art. 8º Res. 4963/2021). Em*



fundos de ações (Art. 8º, I) ficaram R\$67,286 milhões, 15,17% do PL, que se desvalorizaram em média, -5,7%, queda superior ao principal índice do setor, o Ibovespa, que teve registro -3,06% no mês, e acumula rendimento de 7,31% no ano. O segmento foi afetado principalmente pela questão política local com grande preocupação quanto ao risco fiscal para o próximo ano. 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. Nenhum dos fundos registrou rentabilidade positiva, sendo o menos afetado o BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA com desvalorização de -2,18% e o mais impactado o fundo BRADESCO FIA MID SMALL CAP com -10,64%. No geral, a renda variável fechou o mês com desvalorização de R\$ 4.070.736,55; -5,7%. III) Investimentos no Exterior: No mês, 6,26% (R\$ 27,782 milhões) dos recursos fecharam aplicados em Investimentos no Exterior (art. 9º Res. 4963/2021) e tiveram valorização, registrando em média 6,3%. Nos fundos de Investimento no Exterior GLOBAL (Art. 9º, II da Res CMN 4963/2021) ficaram 3% do PL da Riopretoprev, R\$ 13,288 milhões, e fecharam o mês com rentabilidade média de 7,3%. Os fundos BDR (Art. 9º, III da Res CMN 4963/2021) somam R\$ 14,493 milhões, 3,27% do PL, e tiveram desempenho médio de 5,4%. Não foram feitas movimentações no mês nesse segmento. O destaque do segmento foi o fundo Santander Go Global Equity ESG Reais MM IE FI que teve rentabilidade de 7,68% no mês. No geral, o IE fechou o mês com valorização de R\$ 1.647.145,78. IV) Investimentos Estruturados: No mês, 8,86% (R\$ 39,311 milhões) dos recursos fecharam aplicados em Investimentos Estruturados. Em fundos Multimercados (art. 10º, I da Res. CMN 4963/2021) ficaram 6,3% do PL da Riopretoprev, R\$ 27,962 milhões, e tiveram valorização média de 5,9%. Em fundos de participação (art. 10º, II da Res. CMN 4963/2021) ficaram 2,56% do PL, R\$ 11,349 milhões, aplicados no FIP Kinea IV e no FIP Kinea V, e o segmento fechou com desvalorização de -0,81% no mês. Não houve movimentações nesse segmento no mês e o destaque foi o fundo BTG PACTUAL S&P 500 BRL FIM com valorização de 6,20%. No geral, o segmento de investimentos estruturados fechou o mês com valorização de R\$ 1.465.772,80, 3,87%. Principais Indicadores no mês: RENDIMENTO mês: (em R\$) -133.985,38; RENDIMENTO mês (em %): -0,03%; META ATUARIAL MÊS(%): 0,79%; META GERENCIAL (IMA-B) (%): -0,79%; CDI: 1,02%; IBOVESPA: -3,06%; IBX-50: -2,19%; IRF M1: 0,94%; S&P 500: 6,12%; MSCI ACWI: 8,36%; RAZÃO: RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL (%) NO MÊS: -3,80%; NOS ÚLTIMOS 3 MESES: 85,03%; NOS ÚLTIMOS 6 MESES: 73,36%; NOS ÚLTIMOS 12 MESES: 44,27%; DO ANO EM CURSO: 36,27%; DESDE O INÍCIO ADM CARTEIRA: 57,83%; DESDE O INÍCIO DA RIOPRETOPREV: 83,98%. RENDIMENTO no ano (em R\$): 14.484.966,62; RENDIMENTO no ano (em %): 3,54; META ATUARIAL ano (%): 2,76. Os membros verificaram o reenquadramento do fundo MS Global Opportunities Advisory FIC FIA IE com relação ao VAR em 19,79% abaixo do previsto na Política de Risco, apesar de patamar próximo ao limite de 20% e continuarão acompanhamento o fundo. Na sequência, a Sra. Patrícia Nato Toninato Bartolomei deu **ciência aos membros sobre fato relevante na aquisição de NTN-B no mês de novembro/2022**, sobre arredondamento da nota da operação. Antecipando o item VI da pauta, os membros verificaram documento referente a 11ª chamada de capital do FIP Kinea IV recebida em 15 de dezembro e que deve ser integralizado até 26 de dezembro. Concomitantemente com o item V da pauta os membros discutiram as possibilidades de resgate de recursos para realização da integralização e diante do prazo dado e sendo ponto facultativo nas



repartições públicas municipais em 26 de dezembro, a transferência dos recursos deverá ser efetuada até o dia 23, mesma data de pagamento da folha e recebimento de recursos, fato pelo qual os membros deliberaram por unanimidade, pela utilização de recursos de benefícios previdenciários disponíveis na conta da CEF 0631/006/440-5 em 23/12/2022 ou resgate do fundo CAIXA BRASIL RF Ref DI LP, CNPJ: 03.737.206/0001-97, se necessário, para realização da integralização da 11ª chamada de capital do fundo KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTIT I FIP MULTISTRATÉGIA, CNPJ: 27.782.774/0001-78 no valor de R\$ 431.050,00. Em seguida, os membros verificaram que de acordo com estudo de ALM as alocações em títulos públicos federais, NTN-B, nos vértices de vencimentos mais curtos já estavam praticamente preenchidas ficando ainda para realizar as alocações mais longas. Verificaram também a rentabilidade oferecida pelos papéis no dia, sendo que nos mais longos, o vértice 2045 remunerava a IPCA+6,43%, e no vértice 2026 apesar de ser de prazo mais curto, a remuneração era superior, 6,56%. Os membros verificaram o saldo do fundo Caixa Brasil RF Ref DI LP, onde estavam sendo alocados novos recursos, e cujo valor era em torno de R\$ 24,5 milhões. Os membros julgaram que apesar de sair um pouco da indicação do ALM a oportunidade em papéis com vencimento 2026 era muito boa, garantindo rentabilidade superior a meta em 3 anos, e que por ser vencimento mais curto que a indicação do estudo não comprometeria o fluxo de caixa. Assim, os membros deliberaram, por unanimidade, pela aquisição de R\$ 5 milhões em títulos públicos federais, NTN-B com vencimento em 2045 e pela aquisição de R\$ 10 milhões em títulos públicos federais, NTN-B com vencimento em 2026, ambas deliberações com remuneração mínima de IPCA+6%a.a., acima da meta atuarial prevista para 2023, e com marcação dos títulos na curva, com recursos oriundos do fundo CAIXA BRASIL RF Ref DI LP, CNPJ: 03.737.206/0001-97. Essas alocações estarão dentro do previsto na Política de Investimentos e já deixando a carteira preparada para o início do próximo ano, onde em 2023 o Comitê acompanhará as taxas para verificar se ainda há boas oportunidades para novas aquisições. Sobre os papéis pré-fixados os membros verificaram que apesar de estar oferecendo boas taxas são menos atrativos pelo fato de não seguir o indicador da inflação, parte da meta do RPPS. Sobre renda variável os membros discutiram os possíveis patamares de queda no curto prazo e julgaram ainda estarem em um período de alta volatilidade para fazerem alterações na carteira. Finalizada a pauta do dia e não tendo mais assuntos a tratar, 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 17/02/2023 (segunda reunião ordinária de fevereiro de 2023).

ADRIANO ANTÔNIO PAZIANOTO
ASSINADO DIGITALMENTE

DANIEL HENRIQUE MARTINS BIOT
ASSINADO DIGITALMENTE



PREFEITURA DE
RIO PRETO



HÉLIO ANTUNES RODRIGUES
ASSINADO DIGITALMENTE

PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI
ASSINADO DIGITALMENTE

345



VERIFICAÇÃO DAS ASSINATURAS



Código para verificação: 7863-A6D5-D4B2-4538

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

- ✓ PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI (CPF 326.XXX.XXX-02) em 17/02/2023 11:30:50 (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)
- ✓ HELIO ANTUNES RODRIGUES (CPF 974.XXX.XXX-04) em 17/02/2023 12:03:37 (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 17/02/2023 12:30:21 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO (CPF 327.XXX.XXX-48) em 18/02/2023 21:50:07 (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/7863-A6D5-D4B2-4538>