



Prefeitura de Goiânia
Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Goiânia
Comite de Investimentos

COMITÊ DE INVESTIMENTOS
2ª REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA/2024

Ata da **2ª Reunião Extraordinária do Comitê de Investimentos**, realizada aos 25 (vinte e cinco) dias do mês de abril de 2024, às 14h00, na Sala de Reuniões deste Instituto. **Pauta:** Apresentação do relatório com a avaliação e o desempenho das aplicações da carteira de investimentos do ano de 2023. Apresentação do relatório consolidado com a avaliação e o desempenho das aplicações da carteira de investimentos no mês de março/2024. **Participantes:** Sra. Fernanda Martins dos Santos, Sra. Isabel Alves do Nascimento, Sr. Luis Fernando Xavier de Souza, Sr. Paulo Roberto Carrion de Sousa e a Sr.a Walcrísia Cristina Ferreira Barbosa da Silva. **I – Aberta a reunião**, o presidente do Comitê, Luis Fernando Xavier de Souza, informa aos demais membros que a reunião foi convocada conforme o Regimento Interno do Comitê de Investimentos. **II – Apresentação do relatório com a avaliação e o desempenho das aplicações da carteira de investimentos do ano de 2023.** O relatório consolidado do ano de 2023 foi disponibilizado por via digital aos membros do Comitê de Investimentos por meio do Processo SEI nº 24.20.000001407-2. Foram analisados durante a reunião os principais dados do relatório, como os percentuais das classes de ativos da carteira, bem como dos artigos da Resolução CMN 4.963/21, posicionadas no ano em questão e feita a comparação em relação à política de investimentos vigente. Os membros analisaram o portfólio de fundos de investimentos do GOIANIAPREV, as performances, objetivos, características, composição de carteira, rentabilidades, riscos de investimentos dos fundos. O relatório consolidado aponta que o Instituto finalizou o ano com patrimônio líquido de R\$ 1.199.747.772,32 (um bilhão, cento e noventa e nove milhões, setecentos e quarenta e sete mil, setecentos e setenta e dois reais e trinta e dois centavos), dos quais 84,10% estão alocados no segmento de Renda Fixa, 3,69% em Renda Variável, 5,75% em Investimentos no Exterior, 5,38% em Investimentos Estruturados e 1,08% em Fundos Imobiliários. Observa-se que a Resolução CMN 4.963/2021 traz as regras a serem seguidas pelo RPPS para os limites de alocação de recursos nas diversas classes de ativos. Portanto, para a análise de enquadramento da carteira de investimentos, a referida Resolução é utilizada como referência em conjunto com a Política de Investimentos do GOIANIAPREV em vigência. Analisando a composição da carteira de investimentos, observamos que as aplicações em um mesmo fundo de investimento não atingem o percentual de 20% do total das aplicações dos recursos, conforme disciplina a Resolução CMN 4.963/2021, em seu artigo 18. É possível observar ainda que nenhum fundo de investimento excede o percentual de 15% de recurso investido em relação ao patrimônio líquido do fundo de investimento, conforme determina o artigo 19 da Resolução CMN 4.963/2021. Os percentuais de alocação da carteira de investimentos do GOIANIAPREV em comparação aos limites definidos na Política Anual de Investimentos seguem os limites estabelecidos na Resolução CMN 4.963/2021, considerando o nível I do Programa Pró-Gestão. É possível verificar que todos os segmentos de aplicação (Renda Fixa, Renda Variável, Investimentos no Exterior e Investimentos Estruturados) estão devidamente enquadrados entre os limites mínimos e máximos, tanto em relação à Política Anual de Investimentos quanto aos limites da Resolução CMN 4.963/2021, com exceção dos fundos estressados (CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES e ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO-FII). No ano de 2023, a carteira de ativos do GOIANIAPREV obteve rentabilidade superior à sua Taxa de Meta Atuarial (IPCA+4,86%), sendo que a carteira apresentou

rentabilidade de 12,57%, e a TMA registrou variação de 9,64%, o que resulta em uma diferença positiva de 2,93%. Sobre os principais indexadores do mercado, destaca-se que no ano o indicador IMA-B teve um resultado de 16,05%, o IRF-M1 13,25% e o CDI 13,05%. O montante investido em NTN-B ao final do mês de 2023 é de R\$ 634.477.054,68 (seiscentos e trinta e quatro milhões, quatrocentos e setenta e sete mil, cinquenta e quatro reais e sessenta e oito centavos), o que equivale a 52,88% da carteira. Entre os gestores de recursos da carteira, além do Tesouro Nacional, destacam-se a Caixa Econômica Federal (9,97%), BTG Pactual (9,79%) e Banco Itaú (9,66%). Os membros do Comitê, por unanimidade, reiteram a ressalva contida em Atas de reuniões anteriores, destacando que as alocações em Letras Financeiras não foram submetidas à análise prévia desse órgão colegiado. Observa-se no relatório de investimentos de 2023 que o total investido em Letras Financeiras (Art. 7º, IV) é de R\$ 195.339.284,12 (cento e noventa e cinco milhões, trezentos e trinta e nove mil, duzentos e oitenta e quatro reais e doze centavos), no total de 16,28% da carteira, percentual superior ao autorizado na Política de Investimentos vigente. Após a apresentação, **o comitê aprovou o relatório de investimentos das aplicações financeiras do ano de 2023, com a ressalva acima apresentada atinente às Letras Financeiras.**

III – Apresentação do relatório consolidado com a avaliação e o desempenho das aplicações da carteira de investimentos no mês de março/2024. O relatório consolidado de março/2024 foi disponibilizado digitalmente aos membros do Comitê de Investimentos por meio do Processo SEI nº 24.20.000001502-8. Foram analisados durante a reunião os principais dados do relatório, como os percentuais das classes de ativos da carteira, bem como dos artigos da Resolução CMN 4.963/21, posicionadas no mês em questão e feita a comparação em relação à política de investimentos vigente. Destaca-se que os fundos CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES e ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO-FII continuam em situação de desenquadramento passivo, situação que se prolonga pela presença dos fundos estressados na carteira. Em seguida, foram analisadas pelos membros o portfólio de fundos de investimentos do GOIANIAPREV, as performances, objetivos, características, composição de carteira, rentabilidades, riscos de investimentos dos fundos. O relatório consolidado aponta que o Instituto finalizou o mês com patrimônio líquido de R\$ 1.260.166.887,50 (um bilhão, duzentos e sessenta milhões, cento e sessenta e seis mil, oitocentos e oitenta e sete reais e cinquenta centavos). No mês de março/2024, a carteira de ativos do GOIANIAPREV obteve rentabilidade superior à sua Taxa de Meta Atuarial (IPCA + 5,01% a.a.), sendo que a carteira apresentou rentabilidade de 1,56%, e a TMA registrou variação de 0,55%, o que resulta em uma diferença positiva de 1,01%. Sobre os principais indexadores do mercado, destaca-se que o indicador IMA-B teve um resultado de 0,08%, o IRF-M1 0,84% e o CDI 0,83%. O montante investido em NTN-B ao final do mês de janeiro é de R\$ 647.777.108,20 (seiscentos e quarenta e sete milhões, setecentos e setenta e sete mil, cento e oito reais e vinte centavos), o que equivale a 51,40% da carteira, fazendo com que o Tesouro Nacional figure em primeiro lugar entre os gestores de ativos, seguido de BTG Pactual (12,46%), Caixa Econômica Federal (10,08%) e Banco Itaú (7,39%). Os membros do Comitê, por unanimidade, reiteram a ressalva contida em Atas de reuniões anteriores, destacando que as alocações em Letras Financeiras não foram submetidas à análise prévia desse órgão colegiado. Observa-se no relatório de investimentos de março/2024 que o total investido em Letras Financeiras (Art. 7º, IV) é de R\$ 237.667.803,98 (duzentos e trinta e sete milhões, seiscentos e sessenta e sete reais mil, oitocentos e três reais e noventa e oito centavos), no total de 18,86% da carteira, percentual superior ao autorizado na Política de Investimentos vigente. Após a apresentação, o comitê **aprovou o relatório de investimentos das aplicações financeiras do mês de março/2024, com a ressalva acima apresentada atinente às Letras Financeiras.**

IV – Nada mais havendo a tratar, o Presidente do Comitê Luis Fernando Xavier de Souza deu por encerrada a reunião, convocando a próxima Reunião Ordinária para o dia 06/05/2024, às 09:00 horas, na sede do GOIANIAPREV.

Documentos anexos que farão parte da presente Ata: 1) Boletins Focus - Relatório de Mercado do Banco Central; 2) Boletins econômicos, comprovando a situação econômica atual do país e do mundo nos últimos 30 dias; 3) Relatório com a avaliação e o desempenho das aplicações da carteira de investimentos no ano de 2023; 4) Relatório com a avaliação e o desempenho das aplicações da carteira de investimentos no mês de março/2024. Nada mais.

Fernanda Martins dos Santos, CGRPPS

Isabel Alves do Nascimento, CGRPPS

Luis Fernando Xavier de Souza, CGRPPS/TOTUM

Paulo Roberto Carrion de Sousa CGRPPS/TOTUM

Walcrisia Cristina Ferreira Barbosa da Silva, CP RPPS CGINV



Documento assinado eletronicamente por **Paulo Roberto Carrion de Sousa, Membro do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Goiânia**, em 26/04/2024, às 19:12, conforme art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006.



Documento assinado eletronicamente por **Fernanda Martins dos Santos, Membro do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Goiânia**, em 26/04/2024, às 19:16, conforme art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006.



Documento assinado eletronicamente por **Walcrisia Cristina Ferreira Barbosa da Silva, Membro do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Goiânia**, em 26/04/2024, às 19:18, conforme art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006.



Documento assinado eletronicamente por **Isabel Alves do Nascimento, Membro do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Goiânia**, em 26/04/2024, às 20:48, conforme art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006.



Documento assinado eletronicamente por **Luis Fernando Xavier de Souza, Presidente do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Goiânia**, em 29/04/2024, às 11:08, conforme art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006.



A autenticidade do documento pode ser conferida no site <https://www.goiania.go.gov.br/sei> informando o código verificador **4051240** e o código CRC **99D4E3CC**.

Avenida B, nº 155 -
- Bairro Setor Oeste
CEP Goiânia-GO