

ATA nº 010/2024
COMITÊ DE INVESTIMENTO
REUNIÃO ORDINÁRIA

Aos dezoito dias do mês de junho do ano de dois mil e vinte e quatro, às treze horas, nos termos do Regimento Interno do Comitê de Investimentos da Niterói Prev (parágrafo 4º do artigo 8º), nos termos da regulação do MINISTÉRIO DA ECONOMIA – SPREV (Art. 3ºA – MPS nº519/2011) análise e aprovação pelo Comitê de Investimentos, do relatório de atividades mensais de sua carteira de Investimentos, foram convocados pelo Presidente MOACIR LINHARES SOUTINHO DA CRUZ, através de mensagem eletrônica, os membros: LUIZ CLAUDIO PINTO FARIAS - Diretor de Finanças; MANOEL MOREIRA FILHO, Diretor de Gestão de Recursos Previdenciários; DANUSA MATTA DE SOUSA TINOCO, Membro indicado; ARTHUR MELLO CEZAR DA ROCHA, Membro indicado; ELIAS RIGUETE, Membro indicado; ANDERSON PEIXOTO DE FARIA, Controlador Geral do Município; CAROLINE RIBEIRO DE SOUZA, Representante da SEPLAG e LUIZ ANTÔNIO FRANCISCO VIEIRA, Secretário Municipal de Administração.

PAUTA:

A. Análise e aprovação eletrônica do Relatório Mensal referente ao mês de maio/2024:

Em análise apresentada sobre o cenário econômico, novamente, o cenário de juros globais, aliado à instabilidade fiscal brasileira, impactou negativamente os resultados dos investimentos no mês de maio. No entanto, os investimentos no exterior continuaram apresentando bons resultados, impulsionados pela valorização do dólar em relação ao real e pelo desempenho positivo dos índices globais de referência. Na renda fixa, os fundos atrelados ao CDI e títulos públicos e IMA, conseguiram amenizar o fraco desempenho dos ativos em comparação aos investimentos em renda variável local. De acordo com a análise da Mais Valia Consultoria sobre o retorno da Carteira de Investimentos: Os resultados no período continuam insatisfatórios. Como já dissemos, o cenário de juros globais, aliado à instabilidade fiscal brasileira, impactou negativamente os resultados dos investimentos no mês de maio. Resumidamente: os investimentos no exterior apresentaram bons resultados, impulsionados pela valorização do dólar em relação ao real e pelo desempenho positivo dos índices globais de referência. Na renda fixa, os fundos atrelados ao CDI, títulos públicos e fundos IMA, conseguiram amenizar o fraco desempenho dos ativos em comparação aos investimentos em renda variável local. No Relatório apresentado pelo Diretor de Gestão de Recursos Previdenciários, a Rentabilidade demonstrada foi, no Fundo Niterói Prev, no valor de **RS401.563,98** (quatrocentos e um mil e quinhentos e sessenta e três reais e noventa e oito centavos), no Fundo Financeiro, no valor de **RS493.522,88** (quatrocentos e noventa e três mil e quinhentos e vinte e dois reais e oitenta e oito centavos), no Fundo de Oscilação de Riscos, no valor de **RS1.791.614,72** (um milhão e setecentos e noventa e um mil e seiscentos e quatorze reais e setenta e dois centavos) e no Fundo Previdenciário, no valor de **RS10.809.560,07** (dez milhões e oitocentos e nove mil e quinhentos e sessenta reais e sete centavos), totalizando no mês a rentabilidade de **RS13.496.261,65** (treze milhões e quatrocentos e noventa e seis mil e duzentos e sessenta e um reais e sessenta e cinco centavos).

A alocação dos ativos está adequada à Resolução nº 4.963/2021. O Retorno da Carteira no mês de maio atingiu o percentual de **0,75%**, contra **0,46%** do IPCA e **0,88%** da meta atuarial. O aporte do mês de maio foi de **RS10.257.370,69** (dez milhões e duzentos e cinquenta e sete mil e trezentos e setenta reais e sessenta e nove centavos), totalizando em carteira o valor de **RS 1.804.436.623,33** (um bilhão e oitocentos e quatro milhões e quatrocentos e trinta e seis mil e seiscentos e vinte e três reais e trinta e três centavos).



ANO 2024

Retorno Carteira 3,72%

IPCA + Inflação 2,27%

Meta Atuarial 4,39%

Niterói Previdência
NITERÓI PREV

EXTRATO DE MOVIMENTAÇÕES NA CARTEIRA INVESTIMENTOS DA NITERÓI PREV

Período de: 01 de 2024 até 30 de 2024

DATA	BANCO	CONTA	Fundo SUBSTITUÍDO	FUNDO INVESTIMENTO	ATIVO				ANÁLISE/PARECER DO COMEN	
					ABRIMA	ARTIGO	HISTÓRICO	VALOR	DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO	DATA
25/08	BB	124.213.9	Niterói Prev	Fundo	85	71.0.4	Resgate	-	2.293,09	Pagamento de juros sobre investimentos em títulos públicos
08/08	ITAU	46.713.4	Niterói Prev	Administrado (F)	85	71.0.4	Aplicação	5.000.000,00	Aplicação em títulos públicos federais e estaduais	
11/08	BB	40.208.5	Niterói	Fundo	85	71.0.4	Aplicação	1.536,17	Pagamento de juros sobre investimentos em títulos públicos	
01/08	BB	40.408.5	Niterói	Fundo	85	71.0.4	Resgate	-38.842,63	Pagamento de juros sobre investimentos em títulos públicos	
02/08	ITAU	46.713.4	Niterói	Sobresano	85	71.0.4	Aplicação	200.000,00	Aplicação em títulos públicos federais e estaduais	
05/08	ITAU	46.713.4	Niterói	Sobresano	85	71.0.4	Resgate	-85.000,00	Pagamento de juros sobre investimentos em títulos públicos	
08/08	ITAU	46.713.4	Niterói	Sobresano	85	71.0.4	Aplicação	5.100.000,00	Aplicação em títulos públicos federais e estaduais	
14/08	ITAU	46.713.4	Niterói	Sobresano	85	71.0.4	Resgate	-1.450.000,00	Pagamento de juros sobre investimentos em títulos públicos	
01/08	ITAU	46.713.4	Niterói	Referenciado (F)	85	71.0.4	Aplicação	45.602.962,00	Aplicação em títulos públicos federais e estaduais	
02/08	BB	40.208.5	Niterói	Fundo	85	71.0.4	Aplicação	700.507,11	Pagamento de juros sobre investimentos em títulos públicos	
01/08	BB	40.208.5	Niterói	Fundo	85	71.0.4	Resgate	-201,18	Pagamento de juros sobre investimentos em títulos públicos	
15/08	ITAU	46.713.4	Niterói	Fundo	85	71.0.4	Aplicação	5.006.140,12	Aplicação em títulos públicos federais e estaduais	
11/08	ITAU	46.713.4	Niterói	Referenciado (F)	85	71.0.4	Resgate	-2.000.000,00	Pagamento de juros sobre investimentos em títulos públicos	
10/08	ITAU	46.713.4	Niterói	Referenciado (F)	85	71.0.4	Aplicação	4.000.000,00	Aplicação em títulos públicos federais e estaduais	
13/08	ITAU	46.713.4	Niterói	Referenciado (F)	85	71.0.4	Resgate	-20.000.000,00	Resgate para caixa em títulos públicos federais e estaduais	
10/08	ITAU	46.713.4	Niterói	Referenciado (F)	85	71.0.4	Resgate	-40.000.000,00	Resgate para caixa em títulos públicos federais e estaduais	
05/08	ITAU	46.713.4	Niterói	Sobresano	85	71.0.4	Aplicação	5.000.000,00	Aplicação em títulos públicos federais e estaduais	
14/08	ITAU	46.713.4	Niterói	Sobresano	85	71.0.4	Resgate	-100.000,00	Pagamento de juros sobre investimentos em títulos públicos	
25/08	ITAU	46.713.4	Niterói	Sobresano	85	71.0.4	Resgate	-1.900.000,00	Pagamento de juros sobre investimentos em títulos públicos	
12/08	ITAU	46.713.4	Niterói	Multigrado	85	71.0.4	Aplicação	20.000.000,00	Aplicação em títulos públicos federais e estaduais	
14/08	ITAU	46.713.4	Niterói	Referenciado (F)	85	71.0.4	Aplicação	20.000.000,00	Aplicação em títulos públicos federais e estaduais	
12/08	XP Inv	82.248.8	Niterói	Fund	85	71.0.4	Aplicação	2.010,00	Aplicação em títulos públicos federais e estaduais	
08/08	BRAS	15.104.9	Niterói	Fund	85	81	Aplicação	5.000.000,00	Aplicação em títulos públicos federais e estaduais	
11/08	BRAS	15.104.9	Niterói	Fund	85	81	Aplicação	20.000.000,00	Aplicação em títulos públicos federais e estaduais	

80.480.438,35

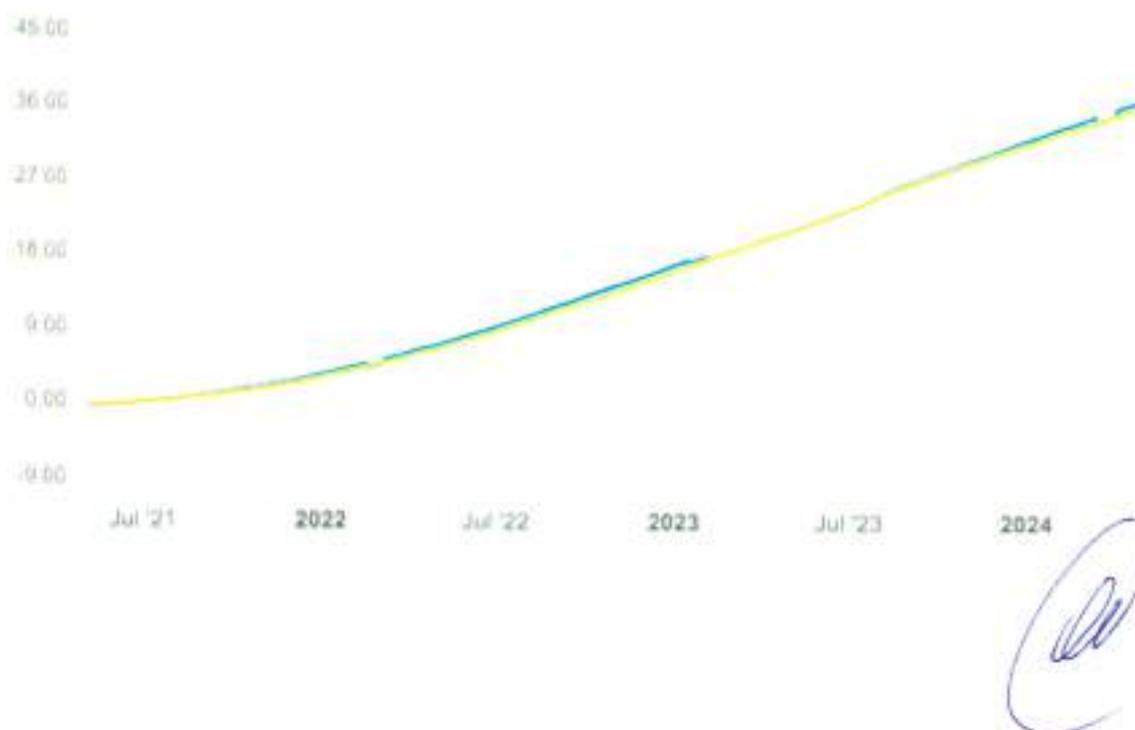
B. Análise e Aprovação do credenciamento dos Fundos:

BB Institucional FI Renda Fixa (02.296.938/0001-90), segundo informações de análise da Consultoria: trata-se de fundo enquadrado na Resolução 4.963/2021 no artigo 7º, III, a, onde estão os fundos com carteira formada por títulos públicos federais e títulos de emissores privados. O fundo tem como objetivo proporcionar a valorização de suas cotas mediante aplicação de seus

recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro. As aplicações do fundo deverão manter no mínimo 80% de seu patrimônio líquido representado por ativos financeiros relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, à taxa de juros doméstica e/ou índice de preços. Não serão admitidas estratégias que impliquem em exposição em renda variável. Dessa forma, o fundo alia baixo risco e alta liquidez.

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Gráfico	VaR - Mes
Fundo	0.85%	3.73%	2.67%	5.78%	12.94%	27.49%	37.26%	0.09%
Benchmark	0.89%	3.54%	2.54%	5.42%	12.33%	27.35%	36.57%	

De 03/05/2021 a 30/04/2024



Plural FI Ações BDR Nível I (37.322.098/0001-69), trata-se de fundo enquadrado na Resolução 4.963/2021 no artigo 9o, III onde estão os fundos de ações - BDR Nível I. O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas rentabilidades por meio das oportunidades oferecidas preponderantemente pelo mercado de renda variável, não obstante, o fundo poderá aproveitar oportunidades através de investimentos em outras classes de ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, cambial, derivativos e cotas de fundos de investimento, negociados nos mercados interno e externo.

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Grafico	VaR - Mês
Fundo	4.64%	22.70%	6.37%	25.34%	31.21%	45.75%	7.26%	4.80%
Benchmark	7.32%	25.07%	12.29%	28.62%	37.90%	58.29%	34.06%	
IBOVESPA	-3.04%	-9.01%	-5.37%	-4.11%	12.70%	9.65%	-1.95	

De 01/06/2021 a 31/05/2024



C. Análise e Aprovação da proposta de troca de posição:

C.1 - Resgate **TOTAL** do Fundo BB PREVID IRF-M1 FIC FI (11.328.882/0001-35) direcionando a mesma proporção para o Fundo BB INSTITUCIONAL FI RF (02.296.928/0001-90), o Diretor de Gestão de Recursos Previdenciários, em análise comparativa apresentada, informa que a expectativa do mercado, segundo a última Ata do Copom e o IPCA de maio e com leve aceleração. Os Títulos Pré-fixado são mais volátil no atual cenário Econômico. O Tesouro Selic tem a vantagem de ser um título de baixo risco no curto prazo, tendo no CDI o melhor resultado. Sugere então, zerar posição do Fundo BB Previd IRF-M1 FIC FI, direcionando na mesma proporção no Fundo BB Institucional FI RF.

Fundo: BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA
CNPJ: 02.296.928/0001-90

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S.A
Gestor: BB Gestão de Recursos DTVM S.A
Distribuição: BB Gestão de Recursos DTVM S.A
Custodiante: Banco do Brasil S.A
Gestor Responsável: Pedro Mendes Rauber

Ano	Mês	Valor (R\$)	Performance (Anual)	Patrimônio Líquido (R\$)	Patrimônio Líquido (Investment %)	Nº Total de Cotistas
2023	29-06/23	12.186670948		1.953.987.796,21		101
2024	31-jan	12.292136754	1,02%	1.943.943.482,22	-0,51%	101
2024	29-fev	12.297977231	0,06%	2.681.791.032,88	7,09%	100
2024	28-mar	12.514579749	0,94%	2.116.014.477,97	-1,94%	100
2024	30-abr	12.629790086	0,96%	2.174.817.580,88	2,74%	100
2024	31-maio	12.728186320	0,88%	2.184.212.203,72	0,47%	100
2024	12-jun	12.759927494	0,26%	2.185.792.470,16	0,07%	100

ANO 2024 4,87%

Fundo: BB PREVID RF IRF-M1 TP FIC FI
CNPJ: 11.328.882/0001-35

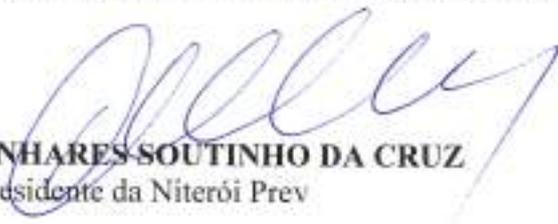
Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM S.A
Gestor: BB Gestão de Recursos DTVM S.A
Distribuição: Banco do Brasil S.A
Custodiante: Banco do Brasil S.A
Gestor Responsável: Marise Freitas

Ano	Mês	Valor (R\$)	Performance (Anual)	Patrimônio Líquido (R\$)	Patrimônio Líquido (Investment %)	Nº Total de Cotistas
2023	29-06/23	3.527942298		7.852.193.725,16		1.141
2024	31-jan	3.558342958	0,88%	7.961.364.534,06	1,39%	1.144
2024	29-fev	3.584707136	0,74%	8.089.813.404,09	1,61%	1.152
2024	28-mar	3.613505093	0,80%	8.304.571.205,30	2,68%	1.151
2024	30-abr	3.633862171	0,56%	8.334.907.355,54	0,36%	1.154
2024	31-maio	3.660918365	0,74%	8.483.707.239,73	1,79%	1.148
2024	10-jun	3.664307213	0,09%	8.315.734.924,42	-2,02%	1.144

ANO 2024 3,80%

C.2 - Resgate de **até R\$15.000.000,00** (quinze milhões de reais) do Fundo FINACAP MAURITSSTAD FIA (CNPJ: 05.964.067/0001-60) e aplicação de **até R\$15.000.000,00** no Fundo PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I (CNPJ: 37.322.098/0001-69). Em análise comparativa, o Diretor de Gestão de Recursos Previdenciários ressalta: a alta da bolsa americana foi impulsionada pelos bons resultados das empresas com maior peso no índice, principalmente de ações como Google, Apple, Meta, Microsoft e Nvidia. Além disso, o CPI de Maio desacelerou e o FOMC manteve a expectativa de que o ciclo de corte de juros em 2024, previsão que está em linha com as expectativas do mercado. Tanto a Gerência de Fundos de Investimento e Negócios Previdenciários (Banco Brasil) como a Gerência Nacional de Relacionamento e Distribuição (Caixa), em sua Carteira Sugerida, o Fundo BDR Nível I é indicado pelo seu desempenho histórico e perspectivas futuras no cenário econômico. O Fundo Plural apresenta rentabilidade superior no ano de 2024 e nos últimos 12 meses, nossa estratégia de balanceamento dos investimentos na Renda Variável, será resgate de até R\$15 MM no Fundo FINACAP e aplicação do mesmo valor no Fundo Plural BDR Nível I.

Todos os itens da Pauta foram aprovados por todos os membros do Comitê de Investimentos, conforme e-mails de resposta, contidos no processo eletrônico nº 9900005441/2024.



MOACIR LINHARES SOUTINHO DA CRUZ
Presidente da Niterói Prev