

1 2

3

4

5

6

7

8

9

10

11

12

13 14

15

16

17

18

19

20

21

22

23 24

25

26

27

28

29

30

31

32

33

34

35

36-

Estado do Rio de Janeiro Município de Macaé Instituto de Previdência Social Comitê de Investimentos

ATA Nº 037/2017 de 19/10/2017 - Ata de Reunião Extraordinária do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência Social do Município de Macaé - Macaeprev, inscrito no CNPJ sob o n.º 03.567.964/0001-04, sediado na Rua Visconde de Quissamã, setecentos e oitenta e sete, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, do dia dezenove de outubro de dois mil e dezessete, estando presentes os membros do Comitê de Investimentos: Alfredo Tanos Filho, Augusto Rômulo Fauaz de Andrade, Erenildo Motta da Silva Júnior, Isabella Felix Viana, José Eduardo da Silva Guinâncio e Patric Alves de Vasconcellos, instituídos através da portaria de nomeação nº 208/2016, que em conformidade com a Lei Complementar Municipal nº 246/2015, se reuniram após convocação, às dezesseis horas, na sede deste Instituto, onde em conjunto, analisaram e deliberaram sobre os temas apresentados. I - JUSTIFICATIVA: Iniciada a reunião, foi justificada a ausência do membro Maria Auxiliadora e Rose Mary Gomes por motivos particulares. II - CARTEIRA DO MACAEPREV: Pelo membro Augusto, foi apresentado o relatório que se segue: A Carteira do Macaeprev apresentou em setembro a sua média ponderada total, que foi de +0,91%. Isso resultou que ficasse 40,00% acima da meta atuarial de setembro, já que a meta foi de +0,65%, conforme relatório em anexo. O IPCA-IBGE de setembro foi de +0,16%, com isso, acumulou a menor inflação no ano desde 1998, pois o índice acumulou 1,78%, bem abaixo dos 5,51% em igual período do ano passado. Foi a menor inflação acumulada até setembro, desde 1998, quando a inflação ficou em 1,42%. A inflação foi menor que agosto, no qual o IPCA variou em +0,19%. Em relação à média ponderada total acumulada no período de janeiro a setembro, a carteira apresentou um resultado de +9,94%, enquanto que a meta atuarial, para o mesmo período ficou em +6,36%. Em vista disso, ao final de setembro de 2017, a carteira de investimentos do Macaeprev superou a meta atuarial em +56,27%. conforme relatório em anexo e, faltando apenas 3 (três) meses para encerrar o exercício já considera a meta atuarial atingida, caso não ocorra nenhuma surpresa negativa de grande impacto no mercado financeiro (risco político), inclusive, em virtude do novo julgamento do presidente Temer. Esse resultado mostra a boa diversificação dos investimentos e o acerto na estratégia da montagem da carteira para 2017. A melhor rentabilidade do mês foi, novamente, o fundo de renda variável ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO que apresentou rentabilidade de +4,93%. E o segundo melhor fundo da carteira foi o fundo de renda fixa, sem carência, marcação à mercado, BB PREVID. RF IMA-B LP, atrelado ao IMA-B, do Banco do Brasil. O Fidc Multisetorial Italia apresentou a pior rentabilidade do mês, fechando em +0,42%. Também merecem destaques os fundos da carteira atrelados ao IMA-B, pois apresentaram bom desempenho, com uma rentabilidade média em setembro de +1,79%, superando a meta atuarial. Os fundos de renda fixa, atrelados ao IRF-M, obtiveram uma ótima rentabilidade média em setembro, fechando em +1,45%, superando a meta atuarial. O fundo de renda fixa, Bradesco Ima Geral, cujo benchmark é o IMA GERAL, também apresentou bom desempenho, pois sua rentabilidade foi de +1,37%, superando a meta atuarial. Também tiveram boa *pertormance* os fundos de renda fixa, atrelados ao IMA-B5 e IDKA 2A, que apresentara*t*m

murder Grenills

1 Jamouliu:

dimi



3738

39

40

41 42

43 44

45

46

47

48 49

50 51

52

53

54

55

56 57

58

59

60 61

62

63

64

65

66 67

68 69

70

71

72

Estado do Rio de Janeiro Município de Macaé Instituto de Previdência Social Comitê de Investimentos

rentabilidades médias respectivas de: +0,99% e +0,89%, superando a meta atuarial. Em relação aos fundos de renda fixa IRF-M1 e DI, que são os de menor risco e servem para fazer caixa para o Instituto, somente o IRF-M1, superou a meta atuarial de setembro, apresentando respectivamente as seguintes rentabilidades médias: +0,71% e +0,59%. Em relação aos fundos de renda fixa, com carência, marcação a mercado, da Caixa Econômica Federal, com exceção dos que vencem em 2018, todos superaram a meta atuarial e apresentaram as seguintes rentabilidades respectivas: 2018 II com +0,50%, 2020 IV com +1,12% e 2024 IV com +1,46%. Em relação aos fundos de renda fixa. com carência, marcação na curva, da CEF, todos ficaram abaixo da meta atuarial, com as seguintes rentabilidades respectivas: 2018 I com +0,50%, 2020 I com +0,50% e 2022 I com +0,49. Em relação ao Fundo de Investimentos com carência, marcação à mercado, BB PREVID. RF TP XII FI, com vencimento em 2018, apresentou rentabilidade no mês de +0,50%, ficando abaixo da meta atuarial. Com relação ao FIDC Multisetorial Itália apresentou, novamente, a pior rentabilidade no mês de setembro, ficando em +0,42%. A rentabilidade acumulada no ano é de +32,56% e nos últimos 12 (doze) meses é de -41.18%. Já foram resgatados até 30 de setembro de 2017, o montante total de R\$ 6.420.663,15 (seis milhões, quatrocentos e vinte mil, seiscentos e sessenta e três reais e quinze centavos), cerca de 64,21%. O saldo em 30 de setembro de 2017 estava em R\$ 688.445,31(seiscentos e oitenta e oito mil, quatrocentos e quarenta e cinco reais e trinta e um centavos). O Patrimônio Líquido do fundo em 30 de setembro de 2017 estava de R\$ 18.890.116,71 (dezoito milhões, oitocentos e noventa mil, cento e dezesseis reais e setenta e um centavos). Além disso, em relação ao rendimento, o fundo apresentou saldo positivo no mês de R\$ 2.916,10 (dois mil, novecentos e dezesseis reais e dez centavos). Em relação ao resultado dos rendimentos no mês de setembro/17, foi de R\$ 20.810.694,94(vinte milhões, oitocentos e dez mil, seiscentos e noventa e quatro reais e noventa e quatro centavos), sem incluir o pagamento do cupom de juros. No acumulado do ano (janeiro à setembro), apresenta resultado de R\$ 209.123.739,44 (duzentos e nove milhões, cento e vinte e três mil, setecentos e trinta e nove reais e quarenta e quatro centavos. Em relação à classificação, referente a rentabilidade média acumulada dos últimos 12 meses (outubro/2016 à setembro/2017), por benchmark, dos fundos de renda fixa e variável da carteira do Macaeprev, sem carência, ficou conforme demonstrado a seguir: 1º IBOVESPA ATIVO com +26,95%, 2° IRF-M com +17,10%, 3° IMA B com +16,30%, 4° IMA GERAL com +15,38%, 5° IMA B5 com +13,27%, 6° IDKA 2A com +12,77%, 7° IRF-M1 com +12,41%, 8° DI com +10,94%. Em relação à composição da carteira por classificação de risco, ficou da seguinte forma no mês de setembro de 2017: Baixo Risco 69,94%, Médio Risco 23,50% e 6,56% de Alto Risco. Em 30 de setembro de 2017 tínhamos cerca de R\$ 133.000.000,00 (cento e trinta e três milhões de reais), aplicados em fundos, que têm como benchmark o IMA-B, representando 5,76% da carteira. Com relação à alocação de recursos por Instituições Financeiras em setembro de 2017, a carteira do Maçaeprev ficou composta da seguinte maneira: Caixa Econômica Federal, com R\$1.395,232.389,80

Montion

Sievil

m R\$1.395.232



73

74

75

76 77

78

79

80

81

82

83

84

85

86 87

88 89

Estado do Rio de Janeiro Município de Macaé Instituto de Previdência Social Comitê de Investimentos

(60,33%), Banco do Brasil com R\$ 756.386.932,42 (32,70%), Itaú com R\$ 45.320.069,99 (1,96%), Bradesco com R\$ 115.143.615,91 (4,98%) e BRL TRUST DTVM com R\$ 688.445,31 (0,03%). Com isso os recursos alocados em Bancos Oficiais Públicos são de R\$ 2.151.619.322,22 (dois bilhões, cento e cinquenta e um milhões, seiscentos e dezenove mil, trezentos e vinte e dois reais e vinte e dois centavos) (93,03%) e em Instituições Privadas de R\$ 161.152.131,21 (6,97%) (cento e sessenta e um milhões, cento e cinquenta e dois mil, cento e trinta e um reais e vinte e um centavos). Com relação à alocação de recursos por Índices de Referência, em setembro de 2017, ficou da seguinte maneira: Marcação na curva e a mercado com carência, com vértice do BB, CEF e FIDC: R\$ 1.256.062.858,32 (54,31%) e sem carência, R\$ 1.056.708.595,11 (45,69%), distribuído da sequinte forma: IRFM1: 14,26%, IMA-B: 5,76%, IRF-M: 7,87%, IMA GERAL: 4,98%, DI: 2,33%, IMA-B5: 4,45%, IDKA2A: 5,27%, IBOVESPA ATIVO 0,77%. O Patrimônio Líquido do Macaeprev em 30 de setembro de 2017 apresentou, mais uma vez, crescimento, fechando o mês em R\$ 2.312,771,453,43 (dois bilhões, trezentos e doze milhões, setecentos e setenta e um mil, quatrocentos e cinquenta e três reais e quarenta e três centavos). III - PRÓXIMA REUNIÃO: Ficou designada próxima reunião para o dia 24 de outubro, às 16 horas. IV - ENCERRAMENTO: Nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às dezessete horas e vinte e cinco minutos, tendo a ata sido lida e assinada por todos os membros presentes.

Membros do Comitê de Investimentos:

Alfredo Tanos Filho

Erenildo Motta da Silva Júnior

José Edyardo da Silva Guinâncio

Augusto Rômulo Fauaz de Andrade

Isabella Felix Viana

Patric Alves de Vasconcellos

