



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

1 **ATA Nº 35/2020 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS de 21/10/2020** – Ata de Reunião
2 Ordinária do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência Social do Município de
3 Macaé – Macaeprev, inscrito no CNPJ sob o n.º 03.567.964/0001-04, sediado à Rua
4 Tenente Rui Lopes Ribeiro, duzentos e noventa e três, Centro, Macaé, Rio de Janeiro,
5 realizada às nove horas e trinta minutos do dia vinte e um de outubro de dois mil e vinte,
6 estando presentes, via plataforma de reunião *Google Hangouts Meet*, conforme pode ser
7 comprovado através do *print* da foto em anexo, os membros do Comitê de Investimentos
8 instituídos através da portaria de nomeação nº 127/2020: **Alfredo Tanos Filho, Augusto**
9 **Rômulo Fauaz de Andrade, Erenildo Motta da Silva Júnior, Isabella Felix Viana, José**
10 **Eduardo da Silva Guinâncio, Maria Auxiliadora de Moura Ferreira, Patric Alves de**
11 **Vasconcellos e Rose Mary Gomes**. Aberta a reunião, foram tratados os seguintes temas: I
12 – **PLATAFORMA DE REUNIÃO GOOGLE HANGOUTS MEET**: Pelo membro **Erenildo** foi
13 feito o convite aos demais membros do Comitê de Investimentos para a participação na
14 presente reunião, após decisão prévia por unanimidade, da necessidade de mesma, que
15 acontece via plataforma de reunião *Google Hangouts Meet*, em virtude do Decreto Municipal
16 nº 176 de 17 de outubro de 2020 ter prorrogado até o dia 25 de outubro de 2020 a
17 suspensão das atividades laborais no âmbito público e privado do Município de Macaé,
18 suspensão essa prevista inicialmente através do Decreto nº 39 de 22 de março de 2020, em
19 razão do estabelecimento pela Organização Mundial de Saúde – OMS do estado de
20 pandemia pelo coronavírus. II – **CARTEIRA DO MACAEPREV DE SETEMBRO DE 2020**:
21 Iniciada a reunião, pelo membro e gestor de investimentos **Augusto** foi informado que a
22 Carteira do Macaeprev de setembro de 2020, teve uma **média ponderada** negativa de -
23 0,59%, enquanto a **meta atuarial** foi de +1,13%, devido ao IPCA de +0,64%. Foi o segundo
24 pior resultado da Carteira de investimentos no ano, devido principalmente, aos fundos de
25 renda variável (Ações), que apresentaram, assim como no mês anterior, as piores
26 rentabilidades. Além disso, tiveram rentabilidades negativas, os fundos atrelados ao: IMAB5,
27 IRFM1+, IRFM, IMA Geral, IMAB, Multimercado e CEF 2024I V. Já os fundos de baixo risco
28 atrelados ao: DI, IRFM1, IDKA2, não apresentaram rentabilidades negativas. Também citou
29 com rentabilidade positiva, o CEF 2022 I. Com isso, o resultado da **média ponderada total**
30 de janeiro a setembro da carteira de investimentos, ficou em +2,81%, enquanto a **meta**
31 **atuarial** foi de +5,87%. Em vista disso, no acumulado dos primeiros 09 (nove) meses do
32 ano, o resultado é que a Carteira piorou seu resultado, tendo atingido 47,95%, em vista do

Alfredo Tanos Filho

Rômulo Fauaz de Andrade

Augusto



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

33 cenário de desemprego alto, PIB negativo, impasse sobre a aprovação das reformas
34 tributária e administrativa e também cito a pandemia do coronavírus, pois ainda se encontra
35 na fase de testes em voluntários. O **Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA)**
36 ficou em 0,64%, acelerando em setembro, maior taxa desde 2003, puxada principalmente pela alta,
37 no preço dos alimentos e combustíveis. No acumulado dos doze meses a inflação está em 3,14%.
38 Em setembro, todos os fundos da carteira do Macaeprev, apresentaram **rentabilidades**
39 inferiores a meta atuarial no mês, que fechou em +1,13%. Em relação ao **desempenho** no
40 mês de setembro, o fundo com o melhor desempenho foi o CEF 2022 I, com rentabilidade
41 de +0,88%. O segundo melhor foi o FIDC Multisetorial Itália, com rentabilidade de +0,64%. O
42 Fundo com o pior desempenho foi o CEF Small Caps Ativo, com uma rentabilidade negativa
43 em setembro de -5,93%. Com relação ao fundo de **melhor desempenho no período de**
44 **janeiro a setembro de 2020**, foi o FIDC Multisetorial Itália, com +743,01%. O segundo
45 melhor desempenho nesse período, foi o CAIXA 2022 I, com +5,97%, superando a meta
46 atuarial para o mesmo período que é de +5,87%. O pior fundo para os primeiros nove meses
47 do ano, foi o CEF Small Caps Ativo, com -20,37%. O segundo pior foi o fundo de renda
48 variável, o BB Ações Retorno Total, com -19,80%. Acerca dos fundos de **Renda Variável**, o
49 fundo de renda variável, CEF Small Caps Ativo, apresentou rentabilidade negativa no mês
50 de -5,93%, ficando abaixo da meta atuarial que fechou em +1,13%. O fundo de renda
51 variável, BB Ações Ibovespa Index I, apresentou uma rentabilidade negativa de -4,88%,
52 ficando abaixo da meta atuarial que foi de +1,13%. Também merece destaque negativo, o
53 fundo de renda variável BB Ações Ibovespa Ativo, que teve uma rentabilidade negativa no
54 mês de -4,50%, inferior à meta atuarial que foi de +1,13%. Outro fundo de renda variável, o
55 Itaú FOF RPI Ações Ibovespa, também apresentou uma rentabilidade negativa em setembro
56 de -4,26%, inferior à meta atuarial que fechou em +1,13%. O fundo de renda variável da
57 carteira, o BB Ações Retorno Total, também apresentou rentabilidade negativa no mês,
58 fechando em -5,40%, ficando abaixo da meta atuarial que foi de +1,13%. Falando agora dos
59 **fundos Multimercados** da Carteira do Instituto, todos eles ficaram abaixo da meta atuarial,
60 com a rentabilidade média negativa de -1,48%; com as seguintes rentabilidades: Caixa FI
61 Multimercado RV 30 LP com -2,05% e Caixa Alocação Macro Multimercado, com -0,91%,
62 enquanto a meta atuarial ficou em +1,13%. Com relação aos fundos de **Renda Fixa da**
63 **Carteira**, tanto os de alto risco quanto os de médio risco, tiveram rentabilidade média
64 negativa em setembro, e inferior à meta atuarial que foi de +1,13%; os **fundos de Alto**

Handwritten signatures and initials at the bottom of the page, including names like 'Santana', 'Rômulo', 'N', 'D', and 'Grenillo'.



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

65 **Risco** atrelados ao IMA-B, tiveram uma rentabilidade média negativa de -1,55%, Com
66 relação aos **fundos de Médio Risco**, atrelados ao IMA-B5, a rentabilidade média negativa
67 foi de -0,15%. Os fundos RF, médio risco atrelados ao IMA Geral, apresentaram
68 rentabilidade média negativa de -0,56%. Os fundos de renda fixa, médio risco, atrelados ao
69 IRF-M, apresentaram rentabilidade média negativa de -0,65%. Em relação aos fundos de
70 renda fixa de médio risco Caixa IRFM1+ e BB Previd IRFM1+, apresentaram rentabilidade
71 média negativa de -1,07%. Sobre os fundos de Renda Fixa de **Baixo Risco**, temos: os
72 fundos atrelados ao IDKA2, que apresentaram uma rentabilidade média positiva de +0,09%,
73 mas ficando abaixo da meta atuarial, que foi de +1,13%. Os atrelados ao IRF-M1, também
74 ficaram abaixo da meta atuarial apesar de apresentarem rentabilidade média positiva de
75 +0,08%. Em relação aos fundos atrelados ao DI, tiveram uma rentabilidade média no mês de
76 +0,01%, ficando também abaixo da meta atuarial. Os **fundos de vértice da Caixa**
77 **Econômica Federal**, todos ficaram abaixo da meta atuarial, que foram: CEF 2022I, com
78 0,88% e CEF 2024IV, com -0,77%. Já a meta atuarial de setembro foi de +1,13%. Com
79 relação ao **FIDC Multisetorial Itália**, apresentou rentabilidade positiva em setembro, ficando
80 em +0,64%. No acumulado dos últimos 12 (doze) meses (outubro de 2019 à setembro de
81 2020), apresentou uma rentabilidade positiva de +576,33% e no acumulado do ano de
82 +743,01%. Já foram resgatados do FIDC Multisetorial Itália, até 30 de setembro de 2020, o
83 montante total de R\$ 8.063.188,03 (oito milhões, sessenta e três mil, cento e oitenta e oito
84 reais e três centavos), cerca de 80,63% do valor principal investido, que foi de R\$
85 10.000.000,00. O saldo em 30 de setembro de 2020 estava em R\$ 1.492.292,15 (um milhão,
86 quatrocentos e noventa e dois mil, duzentos e noventa e dois reais e quinze centavos). O
87 Patrimônio Líquido do FIDC Multisetorial Itália, em 30 de setembro de 2020, era de R\$
88 40.946.713,57 (quarenta milhões, novecentos e quarenta e seis mil, setecentos e treze reais
89 e cinquenta e sete centavos). Além disso, em relação ao rendimento, foi positivo em
90 setembro de 2020 de R\$ 9.794,39 (nove mil, setecentos e noventa e quatro reais e trinta e
91 nove centavos). Com relação ao **resultado dos rendimentos** da carteira de investimentos
92 do Macaeprev no mês de setembro de 2020, este foi negativo de - R\$ 19.242.603,94
93 (dezenove milhões, duzentos e quarenta e dois mil, seiscentos e três reais e noventa e
94 quatro centavos). Referente à **composição da carteira por classificação de risco**, ficou
95 assim no mês de setembro de 2020: Baixo Risco 40,63%, Médio Risco 44,02% e 15,35% de
96 Alto Risco. Com relação à **alocação de recursos por Instituições Financeiras** em

Handwritten signature in blue ink.

Handwritten signature in blue ink with the number 3 below it.

Handwritten signature in blue ink.



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

97 setembro de 2020, a carteira do Macaeprev ficou composta da seguinte maneira: Caixa
98 Econômica Federal com R\$ 1.590.778.605,77 (48,58%), Banco do Brasil com R\$
99 1.504.765.789,42 (45,96%), Bradesco com R\$ 116.356.658,21 (3,55%), Itaú com R\$
100 60.933.037,11 (1,86%), e BRL TRUST DTVM com R\$ 1.492.292,15 (0,05%). Com isso, os
101 recursos alocados em Bancos Oficiais Públicos são de: R\$ 3.095.544.395,19 (94,54%) e
102 Instituições Privadas de R\$ 178.781.987,47 (5,46%). Com relação à **alocação de recursos**
103 **por índices de referência**, em setembro de 2020, ficou da seguinte maneira: Marcação na
104 curva e a mercado com carência, com vértice da CEF e FIDC: R\$ 184.989.575,70 (5,66%) e
105 sem carência, R\$ 3.089.336.806,96 (94,34%), distribuído da seguinte forma: IRFM1: R\$
106 1.050.460.255,96 (32,08%), IRF-M: R\$ 478.023.950,47 (14,60%), IRFM1+: R\$
107 374.011.426,16 (11,42%), IMA-B: 292.679.002,77 (8,94%), IDKA2A: R\$ 259.113.427,28
108 (7,91%), IMA GERAL: R\$ 256.621.817,65 (7,84%), IMA-B5: R\$ 163.324.041,53 (4,99%),
109 MULTIMERCADO: R\$ 137.259.540,80 (4,19%), IBOVESPA: R\$ 51.929.903,93 (1,59%),
110 SMALL CAPS ATIVO: R\$ 14.693.761,98 (0,45%), DI: R\$ 7.041.806,38 (0,22%) e AÇÕES
111 RETORNO TOTAL R\$ 4.177.872,05 (0,13%). O **Patrimônio Líquido do Macaeprev**, em 30
112 de setembro de 2020 estava em R\$ R\$ 3.274.326.382,66 (três bilhões, duzentos e setenta e
113 quatro milhões, trezentos e vinte e seis mil, trezentos e oitenta e dois reais e sessenta e seis
114 centavos), apresentando uma retração em relação ao mês anterior. **III – RETIFICAÇÃO DA**
115 **ATA Nº 28 DE 26 DE AGOSTO DE 2020, ITEM III - RELATÓRIO DO GESTOR DE**
116 **INVESTIMENTOS:** Pelo membro e gestor de investimentos **Augusto**, foi dito que, após
117 demonstrado pelas Planilhas do servidor e membro do Conselho Previdenciário, Sr. **Junir**
118 **de Miranda Gomes** em reunião do Conselho Previdenciário no dia 14 de outubro e ainda, o
119 ofício resposta da Caixa Econômica Federal nº 0613/2020/AG Macaé/RJ, de 02 de Outubro
120 de 2020, onde seu ítem 4 informa: “...Contudo, em resposta aos itens 1 e 2 do ofício
121 116/2020, informamos que o investimento nos dias 18/08 e 19/08 respectivamente nos
122 fundos mencionados, gerariam uma quantidade de cotas inferior, dado que no dia seguinte
123 absorveria uma rentabilidade negativa conforme quadro abaixo...” , **constatou que não**
124 **houve perda para o Instituto**. Em virtude do equívoco ocorrido, a parte do relatório do
125 membro **Augusto** constante nas linhas 56, 57 e 58 da ata nº 28 de 26 de agosto de 2020
126 deve ser considerado suprimido, a saber: “Com isso teve que ser aplicado no BB PREVID
127 RF FLUXO, deixando o Macaeprev de ganhar, segundo meus cálculos, R\$ 618.407,00
128 (seiscentos e dezoito mil e quatrocentos e sete reais).” O correto seria, apesar da aplicação

Robson

Robson

[Handwritten mark]

[Handwritten signature]

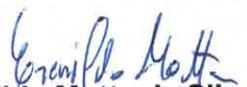
[Handwritten signature]

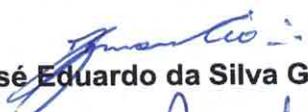


Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social
Comitê de Investimentos

129 ter ocorrido após às 15 horas, não houve qualquer prejuízo para o Macaeprev eis que a
130 rentabilidade foi negativa. **IV – ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, a reunião foi
131 encerrada e a presente ata será enviada para o e-mail e *whatsapp* de todos os membros,
132 para leitura, aprovação e posterior assinatura dos mesmos.


Alfredo Tanos Filho


Erenildo Motta da Silva Júnior


José Eduardo da Silva Guinâncio

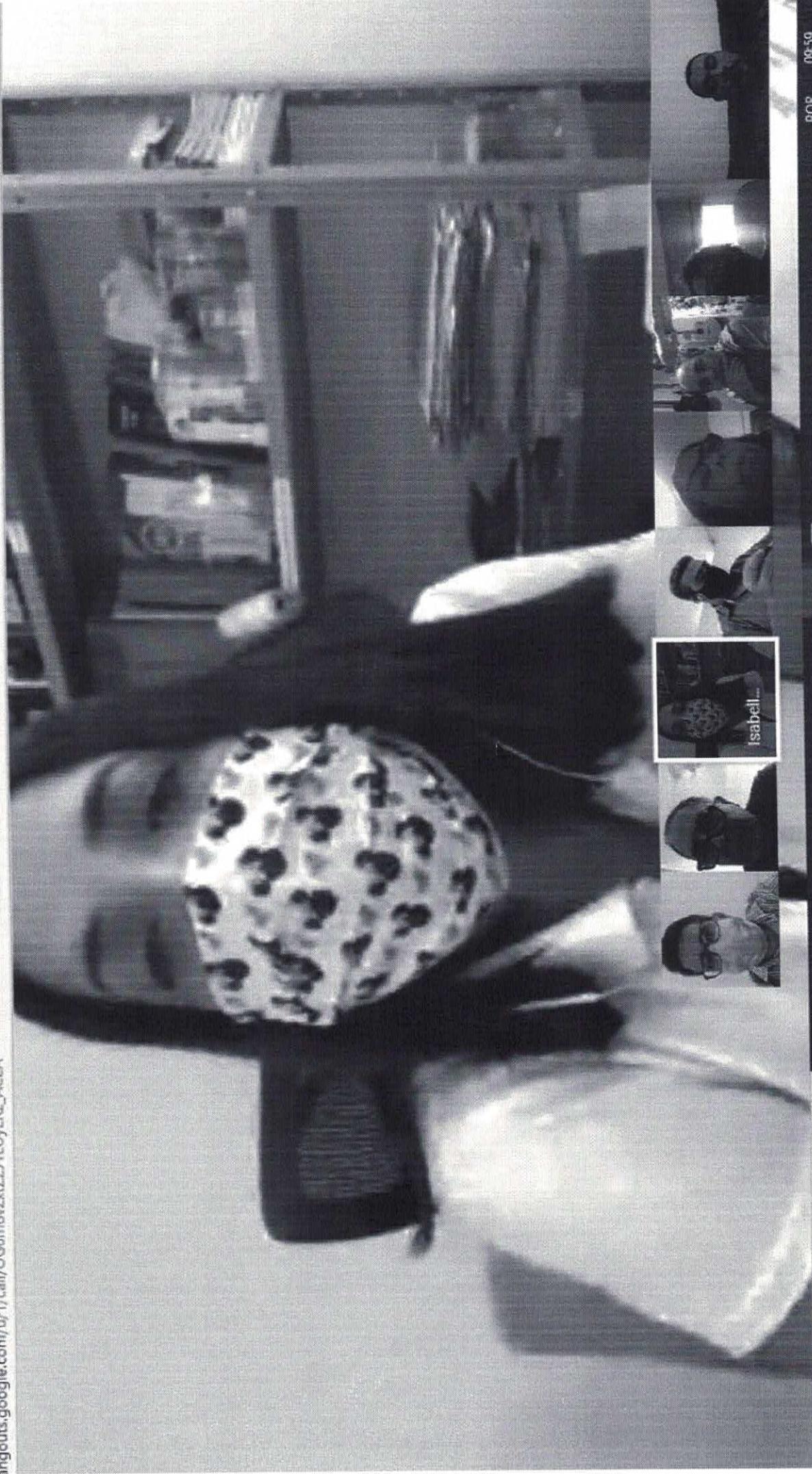

Patric Alves de Vasconcelos


Augusto Rômulo Fauaz de Andrade


Isabella Felix Viana


Maria Auxiliadora de Moura Ferreira


Rose Mary Gomes



Handwritten signatures and names:
- *Isabell...*
- *Ernife*
- *Rosmas*