



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

1 ATA Nº 19/2020 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS de 19/06/2020 – 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 do dia dezanove de junho de dois mil e vinte, estando presentes, via
6 plataforma de reunião *Google Hangouts Meet*, conforme pode ser comprovado através do
7 *print* da foto em anexo, os membros do Comitê de Investimentos instituídos através da
8 portaria de nomeação nº 127/2020: **Alfredo Tanos Filho, Augusto Rômulo Fauaz de**
9 **Andrade, Erenildo Motta da Silva Júnior, Isabella Felix Viana, José Eduardo da Silva**
10 **Guinâncio, Maria Auxiliadora de Moura Ferreira, Patric Alves de Vasconcellos e Rose**
11 **Mary Gomes**. Aberta a reunião, foram tratados os seguintes temas: I – PLATAFORMA DE
12 REUNIÃO GOOGLE HANGOUTS MEET: Pelo membro **Erenildo** foi feito o convite aos
13 demais membros do Comitê de Investimentos para a participação na presente reunião, após
14 decisão prévia por unanimidade, da necessidade de mesma, que acontece via plataforma de
15 reunião *Google Hangouts Meet*, em virtude do Decreto Municipal nº 084 de 12 de junho de
16 2020 ter prorrogado até o dia 21 de junho de 2020 a suspensão das atividades laborais no
17 âmbito público e privado do Município de Macaé, suspensão essa prevista inicialmente
18 através do Decreto nº 39 de 22 de março de 2020, em razão do estabelecimento pela
19 Organização Mundial de Saúde – OMS do estado de pandemia pelo coronavírus. II –
20 CERTIFICAÇÃO: Pelo membro **Augusto** foi noticiado que na data de ontem participou do
21 Curso de Atualização do CPA-20, ministrado pela Anbima, tendo sido aprovado, renovando
22 consequentemente, sua certificação por mais três anos. III – TAXA BÁSICA DE JUROS –
23 Pelo membro **Isabella** foi dito que apesar de saber que a pauta da reunião de hoje é sobre a
24 carteira, considera importante mencionar que em reunião na quarta-feira, dia dezessete de
25 junho, o Comitê de Política Monetária do Banco Central (Copom) reduziu, por decisão
26 unânime, a taxa básica de juros da economia brasileira de 3% para 2,25% ao ano. Que esta
27 foi a oitava redução consecutiva. E, o corte renovou o menor patamar histórico para a taxa
28 Selic desde 1999, quando entrou em vigor o regime de metas para a inflação. Que a decisão
29 do Copom foi tomada em um momento de forte redução do nível de atividade da economia
30 mundial em razão da pandemia do coronavírus, o que tem impactado os índices de inflação.
31 IV – RESULTADO DA REUNIÃO DO CONSELHO PREVIDENCIÁRIO DO MACAEPREV:
32 Foi informado que o Conselho Previdenciário se reuniu na terça-feira, dia dezesseis de junho

Alfredo

Romos

N

Augusto

1

Erenildo

Mary



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

33 e decidiu por unanimidade resgatar 80% do fundo Caixa FI brasil IMAB5 LP, CNPJ
34 11.060.913/0001-10, que perfaz um total de R\$ 116.700.000,00 (cento e dezesseis milhões
35 e setecentos mil reais), da ag. 0184, conta 000740-5 e aplicar esse mesmo montante no
36 Caixa FI Brasil IRFM1 TP RF, CNPJ 10.740.670/0001-06, na ag. 0184, conta 000740-5.
37 Além dessa movimentação, decidiu-se também, por unanimidade: Resgatar 80% do
38 montante total do fundo de renda fixa médio risco BB PREVID. RF IMAB5 LP,
39 CNPJ 03.543.447/0001-03, da conta 10.610-0, ag.0051-5, no valor de R\$ 238.400.000,00
40 (duzentos e trinta e oito milhões e quatrocentos mil reais) e aplicar esse mesmo montante na
41 conta 10610-0, ag. 0051-5, no fundo de renda fixa baixo risco BB PREVID. RF IRFM1 TP,
42 CNPJ 11.328.882/0001-35, e Resgatar 80% do montante total do fundo de renda fixa médio
43 risco BB PREVID. RF IMAB5 LP, CNPJ 03.543.447/0001-03, da conta 67.650-0, ag.0051-5,
44 no valor de R\$ 55.100.000,00 (cinquenta e cinco milhões e cem mil reais) e aplicar esse
45 mesmo montante na conta 67.650-0, ag. 0051-5, no fundo de renda fixa baixo risco BB
46 PREVID. RF IRFM1 TP, CNPJ 11.328.882/0001-35. Além dessas movimentações, o
47 Conselho Previdenciário decidiu também que o gestor de investimentos, Sr. **Augusto**
48 **Rômulo**, deverá acompanhar o comportamento diário do mercado, devendo noticiar aos
49 membros do Conselho Previdenciário tão logo surja uma informação relevante. Pelo membro
50 **Isabella** foi dito que no próprio dia dezesseis de junho já foram resgatados R\$
51 116.700.000,00 (cento e dezesseis milhões e setecentos mil reais) do Fundo Caixa FI Brasil
52 IMA-B5 TP RF LP e aplicados no Fundo Caixa FI Brasil IRFM 1 TP RF e, no dia dezessete
53 de junho foram aplicados R\$ 293.500.000,00 (duzentos e noventa e três milhões e
54 quinhentos mil reais) no BB Previd. RF IRF-M1 Tit. Pub., tendo sido R\$ 238.400.000,00
55 (duzentos e trinta e oito milhões e quatrocentos mil reais) resgatados do BB Previd. RF IMA
56 B5 e R\$ 55.100.000,00 (cinquenta e cinco milhões e cem mil reais) da Taxa de Reserva. **V –**
57 **CARTEIRA DO MACAEPREV:** Pelo membro e administrador dos fundos de investimentos
58 do Macaeprev, Sr. **Augusto**, foi apresentado relatório sobre a carteira do RPPS de Macaé,
59 conforme segue. A Carteira do Macaeprev do mês de maio de 2020 apresentou seu melhor
60 **resultado** no ano, puxado principalmente pelos fundos de renda variável e multimercado,
61 com uma média ponderada positiva de +1,81%, refletindo um otimismo global, com uma
62 melhora gradual das economias europeias, com medidas de flexibilização em relação ao
63 coronavírus, enquanto a **meta atuarial** foi de +0,10%, devido ao IPCA negativo de -0,38%.
64 Mostrando um resultado, que a **média ponderada** de maio, da carteira de investimentos,



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

65 superou a meta atuarial em 1.810,00%. Com isso, no **acumulado do ano** (janeiro a maio), o
66 resultado da carteira está agora positivo em +1,03%, enquanto o resultado da meta atuarial
67 para o mesmo período ficou em + 2,29%. Com isso, a Carteira do Macaeprev atingiu nesse
68 período, 44,99% da meta. Em relação ao comportamento da **inflação oficial (IPCA)** em
69 maio, houve assim como já tinha ocorrido em abril, uma deflação, que ficou em -0,38%.
70 Trata-se de um IPCA no menor nível em 22 anos, pois os preços de combustíveis voltaram a
71 cair e a alta dos alimentos desacelerou, devido a pandemia do coronavírus. Com exceção
72 dos fundos com carência marcação na curva CEF 2020 I e CEF 2022 I, todos os outros
73 fundos da carteira, superaram a meta atuarial no mês de maio. O fundo com a **melhor**
74 **rentabilidade** em maio foi o FIDC Multisetorial Itália, com uma rentabilidade de +10,31%. O
75 segundo melhor foi o fundo de renda variável, atrelado ao Ibovespa, o BB Ações Ibovespa
76 Indexado I, com +8,41%. Em relação ao fundo com o **melhor desempenho**, no período de
77 janeiro a maio de 2020, também foi o FIDC Multisetorial Itália, com +10,93%. O segundo
78 melhor desempenho foi o Caixa IRFM 1+, com +4,81%, ambos superando a meta atuarial
79 para o mesmo período que é de +2,29%. Também **merece destaque** a performance do
80 fundo de renda variável, CEF Small Caps Ativo, em maio, que teve uma rentabilidade de
81 +4,76%. Vale também ressaltar as excelentes performances dos **fundos de renda variável,**
82 **atrelados ao Ibovespa**, em maio: BB Ações Ibovespa Indexado I, com rentabilidade de
83 +8,41%, o BB Ações Ibovespa Ativo, com +8,16% e Itaú FOF RPI Ações Ibovespa Ativo,
84 com +7,94%, todos eles, bem superiores à meta atuarial de maio, que ficou em +0,10%.
85 Outro fundo de renda variável da carteira que também teve ótima rentabilidade, fechando o
86 mês em +6,89% foi o BB Ações Retorno Total. Quanto aos **fundos Multimercados** da
87 Carteira do Instituto, todos eles superaram a meta atuarial com facilidade, com as seguintes
88 rentabilidades: Caixa FI Multimercado RV 30 LP com +2,49% e Caixa Alocação Macro
89 Multimercado, com +1,43%. Em relação aos **fundos de renda fixa** da carteira, seguem suas
90 rentabilidades: **alto risco atrelados ao IMA-B**, tiveram uma rentabilidade média em maio de
91 +1,50%, superior à meta atuarial no mês; **médio risco atrelados ao IMA-B5**, tiveram uma
92 rentabilidade média no mês de maio de +2,11%, ficando acima da meta atuarial; **médio**
93 **risco atrelados ao IMA Geral**, apresentaram rentabilidade média no mês de maio, de
94 +1,05%, ficando acima da meta atuarial; **médio risco atrelados ao IRF-M**, apresentaram
95 rentabilidade média no mês de maio, de +1,39%, ficando acima da meta atuarial; **médio**
96 **risco Caixa IRFM 1+**, apresentou rentabilidade positiva no mês de maio, de +1,89%, ficando

Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom of the page.



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

97 acima da meta atuarial; **baixo risco atrelados ao IDKA2**, apresentaram uma rentabilidade
98 média de +1,96%, em maio, ficando acima da meta atuarial; **baixo risco atrelados ao IRF-**
99 **M1**, ficaram acima da meta atuarial, pois tiveram rentabilidade média de +0,39%; **baixo**
100 **risco atrelados ao DI**, tiveram uma rentabilidade média no mês de maio de +0,21%, ficando
101 acima da meta atuarial. Em relação aos **fundos de vértice da Caixa Econômica Federal**,
102 todos ficaram acima da meta atuarial, com exceção dos fundos marcação na curva CEF
103 2020 I e 2022 I, que apresentaram rentabilidade cada um de +0,04% e os que superaram a
104 meta atuarial foram os marcação à mercado 2020 IV e 2024 IV, que tiveram as
105 rentabilidades respectivas de +0,80% e +3,16%. Com relação ao **FIDC Multisetorial Itália**,
106 apresentou rentabilidade positiva no mês, de maio de +10,93%. No acumulado dos últimos
107 doze meses (junho de 19 a maio de 20), apresentou uma rentabilidade negativa de -16,01%.
108 Já foram resgatados do FIDC Multisetorial Itália até 31 de maio de 2020, o montante total de
109 R\$ 8.026.743,29 (oito milhões, vinte e seis mil, setecentos e quarenta e três reais e vinte e
110 nove centavos), cerca de 80,27%, do valor principal investido (R\$ 10.000.000,00). O saldo
111 em 31 de maio de 2020, estava em R\$ 134.690,66 (cento e trinta e quatro mil, seiscentos e
112 noventa reais e sessenta e seis centavos). O Patrimônio Líquido do FIDC Multisetorial Itália
113 em 31 de maio de 2020 estava em R\$ 3.695.750,71 (três milhões, seiscentos e noventa e
114 cinco mil, setecentos e cinquenta reais e setenta e um centavos). Além disso, em relação ao
115 rendimento, foi positivo em maio de 2020 de R\$ 12.589,72 (doze mil, quinhentos e oitenta e
116 nove reais e setenta e dois centavos). Com relação ao **resultado dos rendimentos** no mês
117 de maio de 20 da carteira de investimentos do Macaeprev, foi o melhor no ano, ficando em
118 R\$ 56.780.731,52 (cinquenta e seis milhões, setecentos e oitenta mil, setecentos e trinta e
119 um reais e cinquenta e dois centavos), sem o cupom de juros. Em relação à **composição da**
120 **carteira por classificação de risco**, ficou assim no mês de maio de 2020: Baixo Risco
121 31,36%, Médio Risco 53,55% e 15,09% de Alto Risco. Com relação à **alocação de**
122 **recursos por Instituições Financeiras** em maio de 2020, a carteira do Macaeprev ficou
123 composta da seguinte maneira: Caixa Econômica Federal com 1.674.654.432,31 (52,29%),
124 Banco do Brasil com R\$ 1.355.721.208,85 (42,33%), Bradesco com R\$ 114.320.238,78
125 (3,57%), Itaú com R\$ 57.948.985,82 (1,81%), e BRL TRUST DTVM, com R\$ 134.690,66
126 (0,00%). Com isso, os recursos alocados em Bancos Oficiais Públicos são de: R\$
127 3.030.375.641,16 (94,62%) e em Instituições Privadas de R\$ 172.403.915,26 (5,38%). Com
128 relação à alocação de **recursos por índices de referência**, em maio de 2020, ficou da

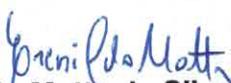
[Handwritten signatures and initials in blue ink]



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

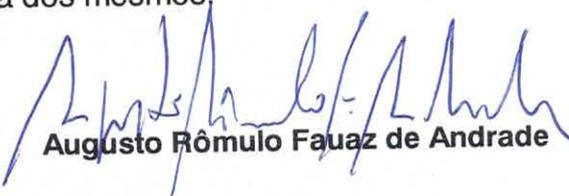
129 seguinte maneira: Marcação na curva e a mercado com carência, com vértice do BB, CEF e
130 FIDC: R\$ 411.839.974,73 (12,85%) e sem carência, R\$ 2.790.939.581,69 (87,15%),
131 distribuído da seguinte forma: IDKA 2A: R\$ 682.855.901,77 (21,32%), IMA-B5: R\$
132 511.222.804,64 (15,96%), IRF-M: R\$ 475.958.506,87 (14,86%), IRFM 1+: R\$
133 305.083.493,59 (9,53%), IMA-B: R\$ 284.384.021,65 (8,88%), IMA Geral: R\$ 252.924.757,94
134 (7,90%), Multimercado: R\$ 134.658.045,30 (4,20%), IRFM 1: R\$ 61.886.809,87 (1,93%),
135 Ibovespa: R\$ 47.771.301,44 (1,49%), DI: R\$ 17.377.397,77 (0,54%), Small Caps Ativo: R\$
136 12.839.159,84 (0,40%) e Ações Retorno Total: R\$ 3.977.381,01 (0,12%). O **Patrimônio**
137 **Líquido do Macaeprev**, em 31 de maio de 2020 estava em R\$ 3.202.779.556,42 (três
138 bilhões, duzentos e dois milhões, setecentos e setenta e nove mil, quinhentos e cinquenta e
139 seis reais e quarenta e dois centavos). **VI – ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar,
140 a reunião foi encerrada e a presente ata será enviada para o e-mail e *whatsapp* de todos os
141 membros, para leitura, aprovação e posterior assinatura dos mesmos.


Alfredo Tanos Filho


Erenildo Motta da Silva Júnior


José Eduardo da Silva Guinâncio


Patric Alves de Vasconcellos


Augusto Rômulo Fauaz de Andrade


Isabella Felix Viana


Maria Auxiliadora de Moura Ferreira


Rose Mary Gomes



Videochamada do Hangouts x Caixa de entrada (10.755) - bello x M Entrada (441) - visabellafelix@gmail.com x +

hangouts.google.com/call/6..._zb8k2bSyg98LDeIUACEE

UOL G1 YouTube Lista Áries O Dia Detran Azarado JTB JB Receita IRPF Importado do IE

Pausada
Outros favoritos

Alfredo

Romeo

Alfredo

Alfredo

Alfredo

Digite aqui para pesquisar

Hi

POR 09:14
PTB 19/06/2020