ATA Nº 42/2020 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS de 14/12/2020 – Ata de Reunião Ordinária 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 à Rua Tenente Rui Lopes Ribeiro, duzentos e noventa e três, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, realizada às nove horas e trinta minutos do dia catorze de dezembro de dois mil e vinte, estando presentes, via plataforma de reunião *Google Hangouts Meet,* conforme pode ser comprovado através do *print* da foto em anexo, os membros do Comitê de Investimentos instituídos através da portaria de nomeação nº 127/2020: ***Alfredo Tanos Filho, Augusto Rômulo Fauaz de Andrade, Erenildo Motta da Silva Júnior, Isabella Felix Viana, José Eduardo da Silva Guinâncio, Maria Auxiliadora de Moura Ferreira, Patric Alves de Vasconcellos*** e ***Rose Mary Gomes.*** Aberta a reunião, foram tratados os seguintes temas: **I – PLATAFORMA DE REUNIÃO GOOGLE HANGOUTS MEET**: Pelo membro ***Erenildo*** foi feito o convite aos demais membros do Comitê de Investimentos para a participação na presente reunião, após decisão prévia por unanimidade, da necessidade de mesma, que acontece via plataforma de reunião *Google Hangouts Meet*, em virtude do Decreto Municipal nº 208 de 04 de dezembro de 2020 ter prorrogado até o dia 31 de dezembro de 2020 a suspensão das atividades laborais no âmbito público e privado do Município de Macaé, suspensão essa prevista inicialmente através do Decreto nº 39 de 22 de março de 2020, em razão do estabelecimento pela Organização Mundial de Saúde – OMS do estado de pandemia pelo coronavírus. **II – CARTEIRA DO MACAEPREV DE NOVEMBRO DE 2020**: Iniciada a reunião, pelo membro e gestor de investimentos ***Augusto*** foi informado que a Carteira do Macaeprev de novembro de 2020 teve uma **média ponderada** positiva de +1,11%, enquanto a meta atuarial foi de +1,38%, devido ao IPCA de +0,89%, atingindo com isso, 80,43% da meta atuarial. Já o resultado da **média ponderada total** da carteira de investimentos de janeiro à novembro, ficou em **+3,75**%, enquanto a meta atuarial, para o mesmo período foi de **+8,78**%. Em vista disso, no acumulado dos primeiros 11 (onze) meses do ano, o resultado foi que a carteira melhorou o seu resultado, tendo atingido **42,76%** da meta atuarial. Contribuíram para essa melhora a boa performance dos fundos de renda variável (Ações e Multimercado), com maiores investimentos estrangeiros na Bolsa. O **IPCA (Índice de Preços ao Consumidor Amplo),** a inflação oficial no país, acelerou para 0,89% em novembro, após fechar em +0,86% em outubro. No acumulado em 2020, o IPCA registra alta de 3,13% e, em 12 meses, de 4,31%, acima dos 3,92% observados nos 12

(doze) meses imediatamente anteriores. Com o resultado, a inflação agora está bem acima do centro da meta de inflação do governo para este ano, que é de 4,00%. A inflação foi impulsionada pela alta de preços dos alimentos, que apresenta uma alta de 12,14% no ano. Em novembro, com exceção do FIDC Multisetorial Itália, todos os fundos da carteira do Macaeprev, apresentaram rentabilidades positivas. Todos os **fundos de renda variável** superaram a meta atuarial em novembro. Em relação aos **fundos de renda fixa**, somente os fundos atrelados ao IMAB e o CEF 2024 IV, conseguiram superar a meta atuarial. O fundo com o melhor desempenho em novembro foi o BB Ações Ibovespa Indexado I, com +15,81%. O segundo melhor desempenho foi o CEF Small Caps Ativo, com uma rentabilidade positiva de +15,73%. O Fundo com o pior desempenho no mês de novembro, foi o FIDC Multisetorial Itália, com uma rentabilidade negativa de -0,17%. Em relação ao fundo com o melhor desempenho, no período de janeiro a novembro de 2020, foi o FIDC Multisetorial Itália, com 1.037,58%. O segundo melhor desempenho nesse período, foi o Caixa 2022 I, com +8,57%. O pior fundo para esse período foi o fundo de renda variável, o BB Ações Retorno Total, com -10,60%. O segundo pior é o CEF Small Caps Ativo, com -10,06% (negativo). Em relação aos **fundos de renda variável,** o CEF Small Caps Ativo, apresentou rentabilidade positiva no mês de +15,73%%, ficando acima da meta atuarial que fechou em +1,38%. Acerca do fundo BB Ações Ibovespa Index I, apresentou uma rentabilidade positiva no mês de +15,81%, ficando bem acima da meta atuarial que foi de +1,38%. Também merece destaque, o fundo BB Ações Ibovespa Ativo, que teve uma rentabilidade positiva no mês de +14,66%, bem superior à meta atuarial que foi de +1,38%. O fundo Itaú FOF RPI Ações Ibovespa também apresentou rentabilidade positiva em novembro de +13,75%, muito superior à meta atuarial que fechou em +1,38%. Outro fundo de renda variável da carteira, o BB Ações Retorno Total também apresentou uma ótima rentabilidade positiva no mês, fechando em +11,70%, ficando acima da meta atuarial de +1,38%. Falando agora dos **fundos Multimercados da Carteira** do Instituto, todos eles ficaram acima da meta atuarial, com a rentabilidade média positiva de +3,43%; com as seguintes rentabilidades: Caixa FI Multimercado RV 30 LP com +4,02% e CAIXA Alocação Macro Multimercado, com +2,84%, enquanto a meta atuarial ficou em +1,38%. Em relação aos **fundos de renda fixa da carteira, de alto risco**, citou os fundos atrelados ao IMA-B, que tiverem uma rentabilidade média positiva em novembro de +1,96%, superando à meta atuarial no mês que foi de +1,38%. Em relação aos **fundos de renda fixa, médio risco,**

atrelados ao IMA-B5, tiveram uma rentabilidade média positiva no mês de +1,30%, ficando abaixo da meta atuarial, que foi de +1,38%. Já em relação aos **fundos de renda fixa, médio risco atrelados ao IMA GERAL**, apresentaram rentabilidade média positivo no mês de +0,78%, ficando abaixo da meta atuarial, que foi de +1,38%. Com relação aos **fundos de renda fixa, médio risco, atrelados ao IRF-M,** apresentaram rentabilidade média positiva no mês de +0,34%, ficando abaixo da meta atuarial, que foi de +1,38%. Sobre os **fundos de renda fixa de médio risco** Caixa IRFM1+ e BB Previd IRFM1+, apresentaram rentabilidade média positiva no mês de +0,43%, ficando abaixo da meta atuarial, que foi de +1,38%. Falando dos **fundos de renda fixa, baixo risco, atrelados ao IDKA2,** apresentaram uma rentabilidade média positiva de +1,30%, ficando abaixo da meta atuarial, que foi de +1,38%. Já os **fundos de renda fixa, de baixo risco, atrelados ao IRF-M1**, ficaram abaixo da meta atuarial, pois tiveram rentabilidade média positiva de +0,21%, enquanto a meta atuarial ficou em +1,38%. Em relação aos **fundos de renda fixa, baixo risco, atrelados ao DI**, tiveram uma rentabilidade média no mês de +0,10%, ficando abaixo da meta atuarial, que foi de +1,38%. Acerca dos **fundos de vértice da Caixa Econômica Federal**, o CEF 2022 I, com rentabilidade de +1,27%, ficou abaixo da meta atuarial e o CEF 2024 IV, com +1,56%, ficou acima Já a meta atuarial de novembro, foi de +1,38%. Com relação ao **FIDC Multisetorial Itália**, apresentou rentabilidade negativa em novembro, ficando em -0,17%. No acumulado dos últimos 12 (doze) meses dezembro de 2019 à novembro de 2020), apresentou uma rentabilidade positiva de +1.055,97% e no acumulado do ano de +1.037,58%. Até 30 de novembro de 2010, haviam sido resgatados do FIDC Multisetorial Itália, o montante total de R$ 8.087.606,00 (oito milhões, oitenta e sete mil e seiscentos e seis reais), cerca de 80,88%, do valor principal investido (R$ 10.000.000,00). O saldo em 30 de novembro de 2020 era de R$ 2.025.392,69 (dois milhões, vinte e cinco mil, trezentos e noventa e dois reais e sessenta e nove centavos). O Patrimônio Líquido do FIDC Multisetorial Itália, estava em R$ 55.574.355,52 (cinquenta e cinco milhões, quinhentos e setenta e quatro mil, trezentos e cinquenta e cinco reais e cinquenta e dois centavos) em 30 de novembro de 2020. Além disso, em relação ao rendimento, foi negativo no mês de novembro de R$ 3.404,63 (três mil, quatrocentos e quatro reais e sessenta e três centavos). Em relação ao **resultado dos rendimentos** no mês de novembro de 2020 da carteira de investimentos do Macaeprev, foi positivo em RS 36.493.281,80 (trinta e seis milhões, quatrocentos e noventa e três mil, duzentos e oitenta e um reais e oitenta centavos). No acumulado do ano janeiro a novembro,

o rendimento está positivo em R$ 112.546.926,07 (cento e doze milhões, quinhentos e quarenta e seis mil, novecentos e vinte e seis reais e sete centavos). Em relação à **composição da carteira por classificação de risco**, ficou assim no mês de novembro de 2020: Baixo Risco 40,70%, Médio Risco 43,60% e 15,70% de Alto Risco. Com relação à **alocação de recursos por Instituições Financeiras** em novembro de 2020, a carteira do Macaeprev ficou composta da seguinte maneira: Caixa Econômica Federal com R$ 1.610.198.283,97 (48,48%), Banco do Brasil com R$ 1.527.370.720,49 (45,98%), Bradesco com R$ 117.447.090,93 (3,54%), Itaú com R$ 64.548.432,85 (1,94%), e BRL Trust DTVM, com R$ 2.025.392,69 (0,06%). Com isso, os recursos alocados em Bancos Oficiais Públicos são de: R$ 3.137.569.004,46 (94,46%) e em Instituições Privadas de R$ 184.020.916,47 (5,54%). Com relação à **alocação de recursos por índices de referência** em novembro de 2020 ficou da seguinte maneira: Marcação na curva e a mercado com carência, com vértice da CEF e FIDC: R$ 188.208.275,07 (5,66%) e sem carência, R$ 3.133.381.645,86 (94,34%), distribuído da seguinte forma: IRFM1: R$ 1.061.300.820,09 (31,95%), IRF-M: R$ 478.084.348,83 (14,39%), IRFM1+: R$ 373.537.182,33 (11,25%), IMA-B: 298.995.857,23 (9,00%), IDKA 2A: R$ 268.028.642,29 (8,07%), IMA Geral: R$ 258.727.147,95 (7,79%), IMA-B5: R$ 165.749.904,10 (4,99%), Multimercado: R$ 141.628.356,47 (4,26%), Ibovespa: R$ 58.873.179,36 (1,77%), Small Caps Ativo: R$ 16.596.082,82 (0,44%) DI: R$ 7.202.878,69 (0,22%) e Ações Retorno Total: R$ 4.657.245,70 (0,14%). O **Patrimônio Líquido do Macaeprev** apresentou aumento em novembro, fechando em R$ 3.321.589.920,93 (três bilhões, trezentos e vinte e um milhões, quinhentos e oitenta e nove mil, novecentos e vinte reais e noventa e três centavos). **III – <u>DECISÃO DO CONSELHO PREVIDENCIÁRIO</u>:** Pelo membro ***Augusto*** foi informado que, na reunião do Conselho Previdenciário realizada na quarta-feira. dia nove de dezembro de 2020, os membros do Conselho decidiram por resgatar R$ 15.000.000,00 (quinze milhões de reais) do fundo de renda fixa, médio risco Bradesco Ima Geral, pois esse fundo estava desenquadrado em relação ao limite máximo do Patrimônio Líquido do seu fundo (estava acima de 15,00%) e aplicar esse montante no fundo de renda fixa CEF IRFM1 TP, fundo esse de baixo risco, com *duration* de 1(um) ano e que tem a finalidade de preservar o Capital do Macaeprev. Com esse resgate, a posição desse fundo ficará enquadrado com 13,89% do seu PL do seu fundo. Acrescentou ainda, o gestor do fundo, que: supervisionou com o Sr. Carlos, do Bradesco, o resgate de R$ 15 milhões de reais do fundo de renda fixa Bradesco Ima Geral e que a transferência foi feita

com sucesso, no dia 10 de dezembro, nesse mesmo montante, antes das 17:00 horas, para a Caixa Econômica Federal, agência: 0184, conta: 000740-5. Após constatar a transferência, o Sr. Pablo, da CEF, realizou a aplicação para o fundo de renda fixa CEF RF IRFM1 TP, dentro do horário limite permitido, isto é, até às 17 horas desse mesmo dia, confirmando o êxito da operação financeira. **IV – <u>ENCERRAMENTO:</u>** Nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada e a presente ata será enviada para o e-mail e *whatsapp* de todos os membros, para leitura, aprovação e posterior assinatura dos mesmos.

Alfredo Tanos Filho

Augusto Rômulo Fauaz de Andrade

Erenildo Motta da Silva Júnior

Isabella Felix Viana

José Eduardo da Silva Guinâncio

Maria Auxiliadora de Moura Ferreira

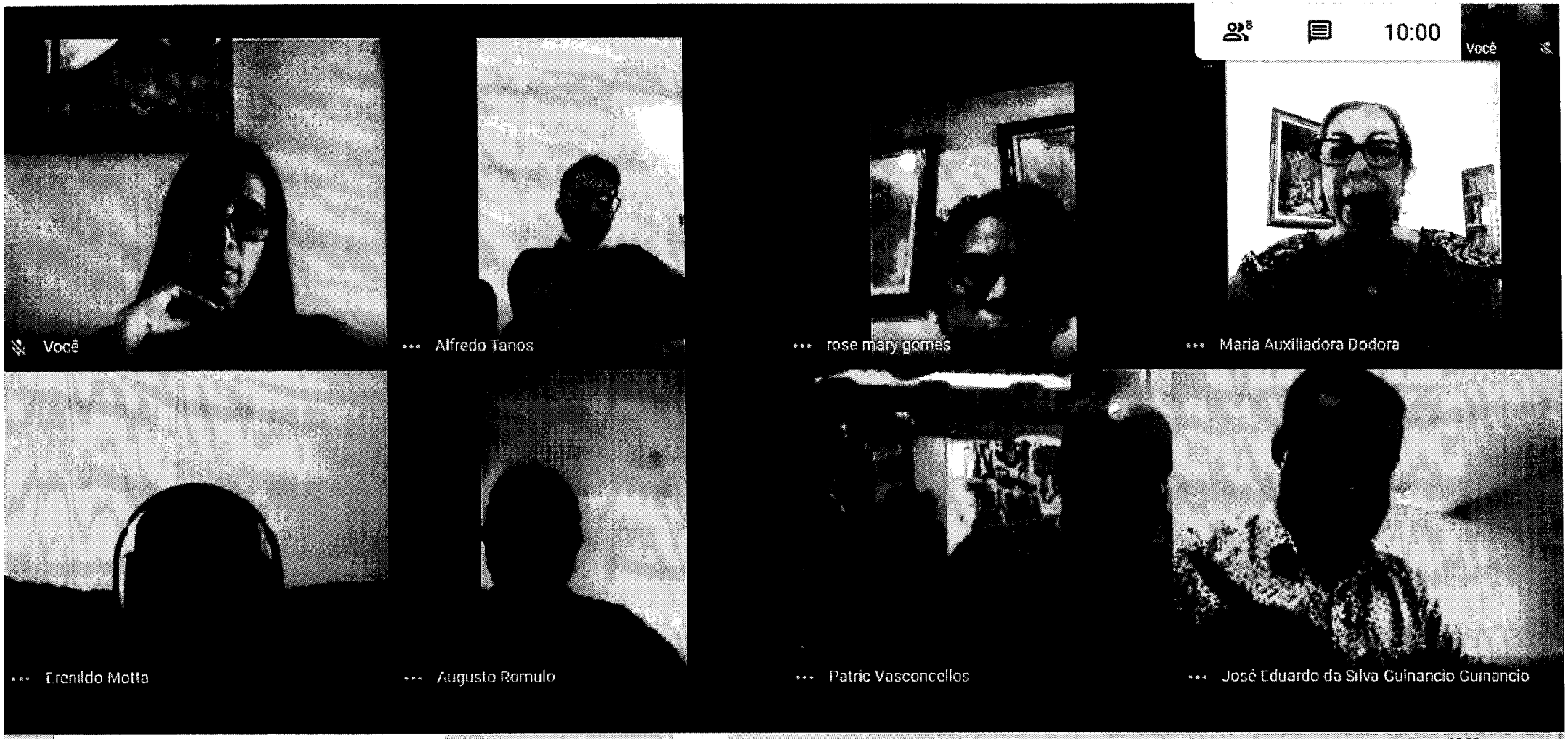
Patric Alves de Vasconcellos

Rose Mary Gomes

(55) WhatsApp | Meet eyn-attj-xsc

meet.google.com/eyn-attj-xsc

Apps | Bookmarks | BB | G1 | UOL | YouTube | Lista | Áries | O Dia | Detran | Azarado | JB | Receita IRPF | Importado do IE | Outros favoritos



Digite aqui para pesquisar

POR PTB 10:00 14/12/2020