ATA Nº 009/2013 de 16/04/2013 – Ata de Reunião do Conselho Previdenciário do Instituto de Previdência Social do Município de Macaé – MACAEPREV, inscrito no CNPJ sob o n.º 03.567.964/0001-04, na Rua Tenente Rui Lopes Ribeiro, duzentos e noventa e três, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, do dia dezesseis de abril de dois mil e treze, estando presente os membros **Surama Roberto Soutinho de Oliveira, Junir de Miranda Gomes, Juciara da Silva Sobrinho de Oliveira, Júlio César Marques de Carvalho, Flávio Mancebo de Azevedo, Lívia Mussi de Oliveira Sant'Ana, Rui de Vasconcellos**, **Alexander Ferreira Gonçalves,** o Administrador do Fundo Previdenciário **Augusto Rômulo Fauaz de Andrade,** o Consultor Jurídico **Adilson Gusmão dos Santos** e o Presidente do Instituto **Rodolfo Tanus Madeira**, que reuniram-se após convocação ordinária, às dezessete horas, na sede deste Instituto, para em conjunto analisarem e deliberarem sobre os temas apresentados. Inicialmente, pelo presidente do MACAEPREV foi apresentado pelo presidente do Instituto o processo n.º 506/2013, o qual cópia segue em anexo, onde a PROGEM encaminhou ofício de número 534 informando sobre a necessidade de suspender os pagamentos relativos às reuniões do Conselho Previdenciário e Fiscal. Quanto à Política Anual de Investimentos, ficou decidido que será acrescentada uma cláusula condicionante ao credenciamento para a Instituição Financeira: "Possuir um total de, no mínimo, 150 (cento e cinquenta) bilhões de reais de recursos administrados de terceiros, de acordo com o "Ranking Global de Administração de Recursos de Terceiros" elaborado mensalmente pela ANBIMA (Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais)." Pelo Administrador do Fundo Previdenciário, Sr. *Augusto Rômulo Fauaz de Andrade,* foram apresentados os relatórios referentes ao mês de março de 2013, nos quais informou que a carteira do MACAEPREV encontra-se distribuída da seguinte forma: IMA-B 57,4%, IMA Geral 10,88%, IRF-M1 21,10%, IRF-M 2,38% e IRF-MPRE 5,8%, FIDC Fechado 0,48%, Renda Fixa 0,63%, IBOVESPA 1,33%. Que em 30 de março, encontrávamos com um Patrimônio Líquido em torno de R$ 920.000.000,00 (novecentos e vinte milhões de reais). Que seguindo a tendência do mercado financeiro e demais RPPS, a carteira apresentou uma desvalorização de quotas no valor de R$ 10.450.420,84 (dez milhões, quatrocentos e cinquenta mil reais e oitenta e quatro centavos), sem contabilizar o FIDC Multisetorial Itália, e rentabilidade média ponderada da carteira ficou em – 1,11%; enquanto que a meta atuarial do mês ficou em +0,96%. Dados esses, devido principalmente ao mau desempenho dos fundos do IMA-B, que representam 57,40% da carteira, e à alta volatilidade para as NTN-B (Notas do Tesouro Nacional – B). As especulações em torno dos próximos passos do Copom frente a um cenário de alta inflação, aliado ao forte volume de vendas desses títulos do mercado secundário, motivados por resgates dos fundos atrelados a esse índice, levaram a uma pressão de alta nos cupons desses papéis, e, consequentemente, a mais perdas, principalmente nos vencimentos mais longos, que é o caso dos IMA-B. Com isso, os IMA-B

na média, encerrou com resultado negativo em 1,88%. O aumento das incertezas na Europa, ocasionadas principalmente pela ausência de definição quanto à uma solução no Chipre somada à indefinição em relação ao cenário político Italiano, marcou o cenário global no mês de março, sendo esse, fator macroeconômico externo responsável pelo mau desempenho dos IMA-B. Mesmo assim, vale ressaltar que se levarmos em consideração o desempenho dos IMA-B nos últimos doze meses, apresentou rentabilidade acumulada positiva em torno de 16,50%. Outro fator importante que deve ser mencionado é que os IMA-B obtiveram um rendimento positivo anual em torno de cento e vinte e dois milhões e quinhentos mil reais. Índices esses, de referência, que mesmo com desempenho negativo, são imprescindíveis para que a carteira do MACAEPREV consiga superar a meta atuarial. Acrescentou que existe uma "gordura" de cerca de sessenta milhões, isso é, valor que ainda pode ser perdido no acumulado de doze meses e sem realizar prejuízo. Com relação aos índices de referência IRF-M1 e CDI, provaram, mais uma vez, que são fundos úteis para fazer caixa para o Instituto e para encurtar a carteira, mostrando a importância de sua diversificação. Mesmo não atingindo a meta atuarial, esses índices de referência são necessários para o equilíbrio da carteira do RPPS. Diante de tal cenário, o Conselho Previdenciário e o presidente do Instituto têm procurado orientação das maiores Instituições Financeiras através de reunião com seus representantes ligados à área de investimentos. Reuniram-se com o Banco do Brasil BBDTVM em 02 de abril, Banco Bradesco em 10 de abril e Caixa Econômica Federal em 11 de abril. Reunir-se-ão com o Banco Itaú no dia 18 de abril de 2013. O Administrador do Fundo apresentou o processo 585/2013 onde relatou juntamente com o Consultor Jurídico Dr. Adilson Gusmão dos Santos que esteve em São Paulo em reunião com o interventor do Banco Central do Banco BVA Sr. Eduardo Félix Bianchini, que informou que o trabalho já está 100% concluído, faltando apenas a ata da última reunião da BRL com os quotistas, onde foi decidido substituir a Gestora Vitoria Asset pela própria BRL Trust para posteriormente, ser encaminhado ao Banco Central autorização de pagamento aos quotistas sêniores da rentabilidade do fundo que foi retida; informou ainda, que não possui poder para interferir nos depósitos judiciais. Nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às dezoito horas e quarenta minutos, tendo a ata sido lida, aprovada e assinada por todos.

Membros:

Surama Roberto Soutinho de Oliveira

Alexander Ferreira Gonçalves
Suplente

Junir de Miranda Gomes

Juciara da Silva Sobrinho de Oliveira

Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social
Conselho Previdenciário

Júlio César Marques de Carvalho

Flávio Mancebo de Azevedo

Rui de Vasconcellos

Lívia Mussi de Oliveira Sant'Ana

Rodolfo Tanus Madeira
Presidente do MACAEPREV

Convidados:

Augusto Rômulo Fauaz de Andrade
Administrador do Fundo Previdenciário

Adilson Gusmão dos Santos
Consultor Jurídico