ATA Nº 025/2016 de 13/10/2016 – 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 na Rua Visconde de Quissamã, setecentos e oitenta e sete, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, do dia treze de outubro de dois mil e dezesseis, 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, Maria Auxiliadora de Moura Ferreira, Patric Alves de Vasconcellos** e **Rose Mary Gomes,** instituídos através da portaria de nomeação nº 208/2016, que em conformidade com a Lei Complementar Municipal nº 246/2016, se reuniram após convocação, às dezesseis horas, na sede deste Instituto, para em conjunto analisarem e deliberarem sobre os temas apresentados. **I – Relatório da Carteira do Macaeprev – Setembro 2016:** Aberta a reunião, o membro do Comitê de Investimentos e Administrador do Fundo ***Augusto Fauaz*** apresentou o relatório a seguir, referente à **Carteira do Macaeprev no mês de Setembro de 2016**. Que apresentou melhoras em relação a agosto, já que sua **média ponderada** ficou em +1,28% e superou a meta atuarial de setembro, que ficou em +0,57%. Em relação ao **desempenho da carteira no acumulado do ano** (janeiro a setembro), apresentou média ponderada de +13,62%, enquanto a **meta atuarial acumulada** ficou em +10,23%. Com isso, a carteira do Instituto superou em +33,15% a meta atuarial, para o exercício de 2016 até esse período. Que a **melhor aplicação no ano de 2016** continuou sendo o fundo de renda variável Itaú FOF RPI Ações Ibovespa Ativo FI, com rentabilidade acumulada no ano de +28,10%, seguido pelo fundo de renda fixa BB PREVID. RF IMA-B TP, cujo *benchmark* é o IMA-B, com +21,80%. Que no mês de setembro, com a queda da inflação, medida pelo IBGE, através do IPCA, a não alteração da Taxa de Juros Americana, pelo FED e a Taxa Selic, pelo COPOM foram vetores determinantes para que os **fundos de renda fixa, sem carência, da carteira, atrelados ao IRF-M**, tivessem a melhor rentabilidade no mês, com uma rentabilidade média de +1,95%, superando com facilidade a meta atuarial. Também vale destacar o bom desempenho dos **fundos atrelados ao IMA-GERAL e IMA-B** que obtiveram rentabilidades médias respectivas de: +1,70% e +1,55%, também superando com larga margem a meta atuarial. Com relação aos **fundos de renda fixa, sem carência da carteira, cujos *benchmarks* são IMA-B5 e IDKA 2A**, também conseguiram superar a meta atuarial, com as rentabilidades médias respectivas de: +1,39 e +1,33%. Em relação aos **fundos de renda fixa, sem carência, mais conservadores, atrelados ao IRF-M1 e ao DI**, também

superaram a meta atuarial de setembro, com rentabilidades médias respectivas de: +1,16% e +1,06%. Falando do **fundo de renda variável, ativo do Banco Itaú atrelado ao IBOVESPA**, este apresentou a pior rentabilidade do mês, com a rentabilidade negativa de 0,22%. Mesmo assim, ainda é a melhor rentabilidade da carteira no ano de 2016. Em relação aos **fundos de renda fixa com carência, da CEF, cuja carteira é composta por NTN-B**, todos eles superaram a meta atuarial conforme descrição abaixo: **Marcação na curva com vencimentos em 2018, 2020 e 2022:** apresentaram rentabilidades respectivas de: +0,80%, +0,80% e +0,79%; **Marcação a mercado como os fundos 2018II, 2020IV e 2024IV**, também superaram a meta atuarial, com as rentabilidades respectivas de: +1,34%, +1,46% e +1,13%. Já os **fundos de renda fixa, com carência**, do Banco do Brasil, como os fundos BB PREVID. RF VIII TP, formados por LTN e BB PREVID. RF TP XII FI, **compostos por NTN-B**, superaram a meta atuarial e tiveram as rentabilidades respectivas de: +1,14% e +1,34%. Em relação ao **resultado dos rendimentos** no mês de setembro, o saldo mais uma vez, foi positivo, ficando em R$ 24.413.133,47 (vinte e quatro milhões, quatrocentos e treze mil, cento e trinta e três reais e quarenta e sete centavos), sem o pagamento do cupom de juros. Em relação ao **FIDC Multisetorial Itália**, apresentou rentabilidade positiva no mês de setembro de +0,87%, superando a meta atuarial. Nos últimos doze meses, apresentou rendimento acumulado de +22,68%. Em relação a esse fundo, já foram resgatados até o final de setembro, cerca de R$ 5.874.000,00 (cinco milhões, oitocentos e setenta e quatro mil reais), correspondendo a 58,74%. Quanto à **classificação referente à rentabilidade média acumulada dos últimos doze meses** (outubro de 2015 a setembro de 2016), **por *benchmark*, dos fundos de renda fixa e variável** da carteira do Macaeprev, sem carência ficou da seguinte forma: IMA-B com + 27,68%, IBOVESPA ATIVO com + 25,10%, IMA GERAL com +22,43%, IRF-M com +21,96%, IMA-B5 com +18,49%, IDKA2A com +18,28%, IRFM-1 com +14,95%, DI com +13,47%. Em relação à **composição da carteira por classificação de risco**, ficou assim no mês de setembro de 2016: Baixo Risco 65,04%, Médio Risco 23,50% e 11,46% de Alto Risco. Em 30 de setembro de 2016, tínhamos cerca de R$ 204.491.000,00 (duzentos e quatro milhões e quatrocentos e noventa e um mil reais) aplicados em fundos, que tem como *benchmark* o IMA-B, representando 10,57% da carteira, contra 65,04% de fundos de renda fixa conservadores. Com relação à **alocação de recursos por Instituições Financeiras**, a carteira do Macaeprev ficou composta da seguinte maneira: Caixa Econômica Federal 52,86%, Banco do Brasil 35,24%, Itaú 6,58%, Bradesco 5,16% e BRL TRUST DTVM 0,16%. Com isso, os recursos alocados em Bancos

Oficiais Públicos são de +88,10% e em Instituições Privadas de +11,90%. Acerca da **alocação de recursos por Índices de Referência**: Marcação na curva e a mercado com carência, com vértice do BB e CEF: 47,51%; sem carência: IRFM1: 6,05%, IMA-B: 10,57%, IRF-M: 4,62%, IMA GERAL: 5,16%, DI: 5,87%, IMA-B5: 6,96%, IDKA2A: 12,37% e IBOVESPA ATIVO 0,73% e com carência sem vértice: FIDC FECHADO 0,16%. O **Patrimônio Líquido** do Macaeprev em 30 de setembro de 2016 apresentou, mais uma vez, crescimento, fechando o mês em R$ 1.933.889.925,35 (um bilhão, novecentos e trinta e três milhões, oitocentos e oitenta e nove mil, novecentos e vinte e cinco reais e trinta e cinco centavos), continuando com boa probabilidade, de atingir R$ 2.000.000.000,00 (dois bilhões de reais) ao final do exercício de 2016, o que comprovaria, efetivamente, o acerto na alocação dos recursos, aliado a uma boa proteção da carteira. **II – PRÓXIMA REUNIÃO:** Foi designada próxima reunião para o dia 26 de outubro, às 16 horas. **III – ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 17 horas, tendo a ata sido lida e assinada por todos os membros presentes.

Membros:

Augusto Rômulo Fauaz de Andrade

Erenildo Motta da Silva Júnior

Maria Auxiliadora de Moura Ferreira

José Eduardo da Silva Guinâncio

Alfredo Tanos Filho

Patric Alves de Vasconcellos

Rose Mary Gomes

Isabella Felix Viana
membro interino