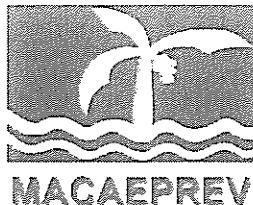


Estado do Rio de Janeiro  
Município de Macaé  
Instituto de Previdência Social  
Conselho Previdenciário

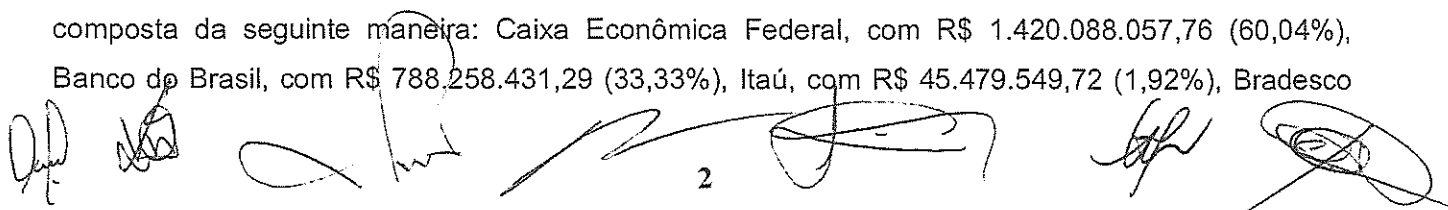
ATA Nº 02/2018 de 24/01/2018 – Ata de Reunião Ordinária do Conselho Previdenciário do Instituto de Previdência Social do Município de Macaé – Macaeprev, inscrito no CNPJ sob o n.º 03.567.964/0001-04, na Rua Tenente Rui Lopes Ribeiro, 293, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, do dia vinte e quatro de outubro de dois mil e dezoito, estando presentes os membros: **Julio Cesar Marques de Carvalho, Rui de Vasconcellos, Lívia Mussi de Oliveira Sant'Ana, Surama Roberto Soutinho de Oliveira, Flávio Mancebo de Azevedo, Juciara da Silva Sobrinho de Oliveira, Junir de Miranda Gomes, Alexander Ferreira Gonçalves**, e o presidente do Macaeprev **Rodolfo Tanus Madeira**, além do membro do Comitê de Investimentos do Macaeprev **Augusto Fauaz de Andrade**, que compareceram após convocação, às dezesseis horas, na sede deste Instituto, para em conjunto analisarem e deliberarem sobre os temas apresentados. Iniciada a reunião, foi apresentado relatório relativo ao mês de dezembro/17 informando que a Carteira do Macaeprev, apresentou em dezembro a sua média ponderada total, que foi de +0,72%, porém ficou abaixo da meta atuarial do mês, que foi de +0,93%. Devido a isso houve uma queda no resultado final, que mesmo assim, devido a boa diversificação dos investimentos, terminou o exercício de 2017, superando a meta atuarial em + 25,75%, já que o resultado da carteira em 2017 (janeiro à dezembro), apresentou sua média ponderada total de +11,47%, enquanto a meta atuarial de 2017, ficou +9,12%. Foi o segundo ano consecutivo que a carteira do Macaeprev, supera a meta atuarial, solidificando a pratica da boa governança na gestão dos seus recursos, mesmo a economia em recessão profunda. O fundo que apresentou a melhor rentabilidade, da carteira tanto em dezembro, como no ano de 2017, foi o FIDC MULTISSETORIAL ITÁLIA, com as rentabilidades respectivas de: +45,03% e +92,31%, seguido pelo fundo de renda variável, ITÁU FOF RPI AÇÕES IBOVSPA ATIVO FI, com as rentabilidades mensal e anual, de: + 5,79% e + 26,70%. Os fundos que ficaram abaixo da meta atuarial em 2017 foram os fundos de renda fixa, com carência, marcação na curva da Cef 2018I, 2020I e 2022I, bem como os fundos atrelados ao DI, que foram : CAIXA DISPONIBILIDADE RF e BB PREVID. RF FLUXO. As rentabilidades respectivas desses fundos foram as seguintes: +8,68%, +8,62%, +8,53%, +9,05% e +8,87%. Em relação aos fundos de renda fixa, mais conservadores da carteira, que são o Caixa IRF-M1, BB Previd RF IRF-M1 e BB PREVID. RF PERFIL, todos superaram a meta atuarial em 2017, apresentando as seguintes rentabilidades: +10,93%, +10,86% e +10,08%. Em relação ao fundo de renda fixa, que tem duration de 2(dois) anos, que é o CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A, superou a meta atuarial em 2017, apresentando rentabilidade de +12,34%. Em relação aos fundos que tem duration de 5(cinco) anos, como: BB PREVID IMA-B5 e CAIXA BRASIL IMA B5, também superaram a meta atuarial em 2017, apresentando as rentabilidades respectivas de: +12,42% e +12,38%. Falando dos fundos da carteira atrelados ao IRF-M, como: ITÁU PRÉFIXADO E BB PREVID. RF IRF-M, apresentaram a melhor rentabilidade média, dos fundos de renda fixa, sem carência, superando a meta atuarial, em 2017, com as rentabilidades respectivas de: +14,70% e +14,91%.

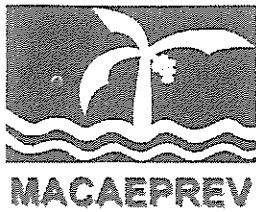
1



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

Com relação aos fundos atrelados ao IMA-B, todos superaram a meta atuarial, em 2017, que são: CAIXA NOVO BRASIL, ITAÚ INFLAÇÃO, ITAÚ INFLAÇÃO CÂMARA, BB PREVID RF IMA-B TP e BB PREVID. RF IMA-B, que tiveram as seguintes rentabilidades: +12,36%, +16,48%, +12,29%, +12,52% e +12,80%. Em relação ao fundo atrelado ao IMA GERAL, o BRADESCO IMA GERAL, também superou a meta atuarial em 2017, apresentando a rentabilidade de +13,07%. Em relação aos fundos de renda fixa, com carência, marcação à mercado da Caixa Econômica Federal, que são: CAIXA FI BRASIL 2018II, CAIXA FI BRASIL 2020IV e CAIXA FI BRASIL 2024 IV, todos superaram a meta atuarial em 2017, apresentando as respectivas rentabilidades: +9,91%, +13,13% e +13,02%. Já o fundo de renda fixa, com carência, marcação à mercado do Banco do Brasil, o BB PREVID. RF TP XII FI, com vencimento em agosto de 2018, também superou a meta atuarial em 2017, apresentando rentabilidade de +10,21%. Com relação ao FIDC Multisetorial Itália, apresentou uma rentabilidade no mês de dezembro, ficando em +45,02%. A rentabilidade acumulada no ano é de +92,31%. Já foram resgatados até 31/12/17, o montante total de R\$ 6.500.959,87 (seis milhões, quinhentos mil, novecentos e cinquenta e nove reais e oitenta e sete centavos), cerca de 65,01%. O saldo em 31/12/17, é de R\$ 882.359,75 (oitocentos e oitenta e dois mil, trezentos e cinquenta e nove reais e setenta e cinco centavos). O Patrimônio Líquido do fundo em 31/12/17, é de R\$ 24.210.897,25 (vinte e quatro milhões, duzentos e dez mil, oitocentos e noventa e sete reais e vinte e cinco centavos). Além disso, em relação ao rendimento, o fundo apresentou saldo positivo no mês de R\$ 273.981,88 (duzentos e setenta e três mil, novecentos e oitenta e um reais e oitenta e oito centavos). Em relação ao resultado, dos rendimentos no mês de dezembro/17, foi de R\$ 16.947.622,81 (dezesseis milhões, novecentos e quarenta e sete mil, seiscentos e vinte e dois reais e oitenta e um centavos), sem incluir o pagamento do cupom de juros. No exercício de 2017 (janeiro à dezembro), apresentou resultado de R\$ 242.666.831,26 (duzentos e quarenta e dois milhões, seiscentos e sessenta e seis mil, oitocentos e trinta e um reais e vinte e seis centavos). Em relação a classificação, referente a rentabilidade média acumulada dos últimos 12 meses (janeiro/17 à dezembro/17), por benchmark, dos fundos de renda fixa e variável da carteira do Macaeprev, sem carência, ficou conforme demonstrado: 1º IBOVESPA ATIVO com + 26,70%; 2º IRF-M com + 14,86%; 3º IMA-B com + 13,29%; 4º IMA GERAL com + 13,07%; 5º IMA B5 com + 12,40%; 6º IDKA 2A com + 12,34 %; 7º IRF-M1 com + 10,89 % e 8º DI com + 9,33 %. Em relação à composição da carteira por classificação de risco, foi apresentado o seguinte percentual: Baixo Risco 70,54%, Médio Risco 23,04% e 6,42% de alto risco. Existe em 31/12/2017, cerca de R\$ 132.609.746,72 (cento e trinta e dois milhões, seiscentos e nove mil, setecentos e quarenta e seis reais e setenta e dois centavos), aplicados em fundos, que tem como benchmark, o IMA-B, representando 5,61% da carteira. Com relação à alocação de recursos por Instituições Financeiras em dezembro/17, a carteira do Macaeprev ficou composta da seguinte maneira: Caixa Econômica Federal, com R\$ 1.420.088.057,76 (60,04%), Banco do Brasil, com R\$ 788.258.431,29 (33,33%), Itaú, com R\$ 45.479.549,72 (1,92%), Bradesco

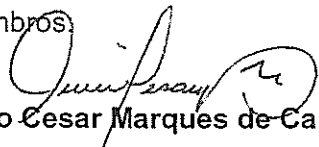
  
2



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

(4,91%) e BRL TRUST DTVM, com R\$ 636.511,02 (0,03%). Com isso os recursos alocados em Bancos Oficiais Públicos são de R\$ 2.183.168.523,28 (93,17%) e Instituições Privadas de R\$ 160.017.796,32 (6,83%). Com relação à alocação de recursos por índices de referência, em novembro/17, ficou da seguinte maneira: Marcação na curva e a mercado com carência, com vértice do BB, CEF e FIDC: R\$ 1.268.280.856,89 (54,13%) e sem carência, R\$ 1.074.905.462,71 (45,87%), distribuído da seguinte forma: IRFM1: 14,74%, IMA-B: 5,61%, IRF-M: 7,89%, IMA GERAL: 4,914%, DI: 2,32%, IMA-B5: 4,42%, IDKA2A: 5,25%, IBOVESPA ATIVO 0,73%. O Patrimônio Líquido do Macaeprev, em 30/11/17 apresentou mais uma vez, crescimento, fechando o mês, em R\$ 2.343.186.319,60 (dois bilhões, trezentos e quarenta e três milhões, cento e oitenta e seis mil, trezentos e dezenove reais e sessenta centavos). Nada mais havendo a tratar, foi encerrada a reunião, tendo a ata sido lida e assinada por todos os membros presentes.

Membros:

  
Julio Cesar Marques de Carvalho

  
Livia Mussi de Oliveira Sant'Ana

  
Alexander Ferreira Gonçalves


  
Flávio Mancebo de Azevedo

  
Rui de Vasconcelos

  
Surama Roberto Soutinho de Oliveira

  
Juciara da Silva Sobrinho de Oliveira

  
Junir de Miranda Gomes

  
Rodolfo Tanus Madeira