



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



ATA Nº 004/2017 de 26/01/2017

– Ata de Reunião Extraordinária 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 vinte e seis de janeiro de dois mil e dezessete, 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 246/2015, se reuniram após convocação, às dezesseis horas, na sede deste Instituto, para em conjunto analisarem e deliberarem sobre os temas apresentados. I – **REPASSES em JANEIRO**: Aberta a reunião, pelo membro **Augusto** foi apresentado o relatório acerca dos Repasses do mês de Janeiro de 2017, o qual relatamos a seguir. Pela Prefeitura foi feito o repasse na conta 10.610-0 da agência 0051-5, do Banco do Brasil e posteriormente realizada a conciliação bancária pela tesouraria, tendo sobrado disponível para aplicação o montante de aproximadamente R\$ 6.900.000,00 (seis milhões e novecentos mil reais). Com isso, sugerimos alocar esse montante no fundo CAIXA FI BRASIL IRF-M1 TP RF, CNPJ 10.740.670/0001-06, conta 000740-5 da agência 184, da Caixa Econômica Federal. Que a aplicação total mencionada acima não implicará em desenquadramento, visto que o FI está classificado como: FI 100% Títulos TN – Art. 7º, I, “b”, da Resolução Bacen 3922/10. Que o motivo da aplicação é por se tratar de um fundo de renda fixa, sem carência, baixo risco de crédito, com sua carteira composta por até 100% de títulos públicos federais, com prazo médio de 1 (um) ano, que tem a finalidade de fazer caixa e *hedge* para o Macaeprev. Como o VaR (*value at risk*) médio, o acumulado dos últimos 12 meses desse fundo gira em torno de 0,35%, mostrando como esse fundo apresenta baixa discrepância no cálculo de seu risco. O desvio padrão desse fundo, conseqüentemente, também apresentará valor muito baixo. No ano de 2016, os fundos atrelados ao IRF-M1, superaram a meta atuarial, em 18,23%, com uma rentabilidade média anual de +14,53%, enquanto a meta atuarial ficou em +12,29%. Para 2017, com queda da inflação estimada para +4,71%, segundo o último Boletim Focus, de 20 de janeiro de 2017, projeta uma meta atuarial de +10,71% e aumenta a probabilidade de novamente, superar a meta atuarial, visto que a rentabilidade média desse *benchmark* nos últimos 24 meses foi de +29,02%. Que o

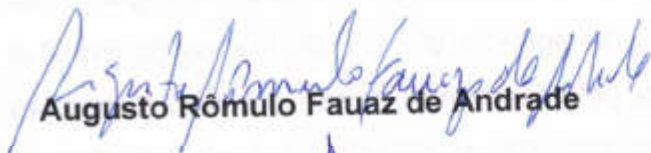
1



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

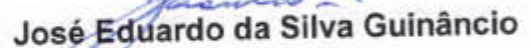
33 saldo na CEF desse Produto (título IRFM1) com posição em 25 de janeiro de 2017 é de R\$  
34 4.704.565,38 (quatro milhões, setecentos e quatro mil, quinhentos e sessenta e cinco reais e  
35 trinta e oito centavos). Que o Patrimônio Líquido desse fundo, com posição em 24 de janeiro  
36 de 2017, é de aproximadamente R\$ 12.200.000.000,00 (doze bilhões e duzentos milhões de  
37 reais), com 1346 cotistas, demonstrando o quanto esse fundo é procurado e valorizado pelo  
38 mercado. II – **PRÓXIMA REUNIÃO:** Ficou designada próxima reunião para o dia 09 de  
39 fevereiro de 2017, às 16 horas. III – **ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, a  
40 reunião foi encerrada às dezessete horas, tendo a ata sido lida e assinada por todos os  
41 membros presentes.

Membros:

  
Augusto Rômulo Fauaz de Andrade

  
Erenildo Motta da Silva Júnior

  
Maria Auxiliadora de Moura Ferreira

  
José Eduardo da Silva Guinâncio

  
Patric Alves de Vasconcellos

  
Alfredo Tanos Filho

  
Rose Mary Gomes

  
Isabella Felix Viana  
membro interino