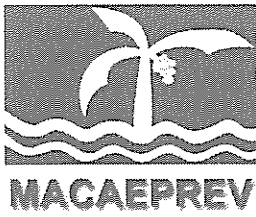


Estado do Rio de Janeiro  
Município de Macaé  
Instituto de Previdência Social  
Comitê de Investimentos

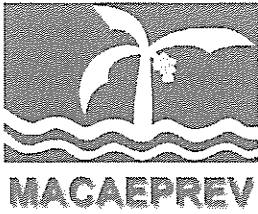
1 ATA Nº 034/2017 de 20/09/2017 – Ata de Reunião Extraordinária do Comitê de  
2 Investimentos do Instituto de Previdência Social do Município de Macaé – Macaeprev,  
3 inscrito no CNPJ sob o n.º 03.567.964/0001-04, sediado na Rua Visconde de Quissamã,  
4 setecentos e oitenta e sete, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, do dia vinte de setembro de dois  
5 mil e dezessete, estando presentes os membros do Comitê de Investimentos: Alfredo Tanos  
6 Filho, Augusto Rômulo Fauaz de Andrade, Erenildo Motta da Silva Júnior, José Eduardo da  
7 Silva Guinâncio, Maria Auxiliadora de Moura Ferreira, Patric Alves de Vasconcellos e Rose  
8 Mary Gomes, instituídos através da portaria de nomeação nº 208/2016, que em  
9 conformidade com a Lei Complementar Municipal nº 246/2015, se reuniram após  
10 convocação, às dezessete horas, na sede deste Instituto, onde em conjunto, analisar e  
11 deliberarem sobre os temas apresentados. I – **JUSTIFICATIVA**: Inicialmente, foi justificada a  
12 ausência do membro **Isabella Félix Viana**, por motivo de férias. II – **CRP**: Foi informado  
13 pelo membro **Erenildo Motta** a obtenção do **Certificado de Regularidade Previdenciária**  
14 (CRP), aproveitando para parabenizar o Poder Executivo, por meio do seu chefe, **Dr.**  
15 **Aluizio**, pelo sucesso em atingir mais essa meta. III - **CARTEIRA DO MACAEPREV**: Pelo  
16 Administrador do Fundo **Augusto Fauaz** foram prestadas as seguintes informações acerca  
17 da **Carteira de Investimentos de Agosto de 2017**: Que no mês de agosto a **Carteira do**  
18 **Macaeprev** teve a sua média ponderada total, que foi de **+1,00%**. Isso determinou que  
19 ficasse **47,06%, acima da meta atuarial**, de agosto, já que a meta foi de **+0,68%**. O **IPCA-**  
20 **IBGE** ficou em **+0,19%**, mostrando **desaceleração** da inflação. Em relação à média  
21 ponderada total acumulada no período de janeiro a agosto, a carteira apresentou um  
22 resultado de **+8,94%, superando a meta atuarial**, nesse período em **+57,65%**, já que a  
23 meta atuarial ficou em **+ 5,67%**, conforme planilha em anexo. A **melhor rentabilidade** de  
24 agosto, assim como já ocorrera em julho, foi o fundo de renda variável **ITAÚ FOF RPI**  
25 **IBOVESPA ATIVO**, que apresentou rentabilidade de **+6,69%**. Em agosto, com exceção dos  
26 fundos **FIDC MULTISSETORIAL ITÁLIA** e o fundo de renda fixa com carência, marcação a  
27 mercado **CAIXA 2018II**, todos os demais fundos da carteira atingiram e ou superaram a  
28 meta atuarial do mês, conforme planilha em anexo. Com relação ao **FIDC Multisetorial**  
29 **Itália**, apresentou a pior rentabilidade no mês de agosto, ficando em **+0,12%**. A rentabilidade  
30 acumulada nos últimos 12(doze) meses é de **-59,43%**. No **acumulado do ano** sua  
31 rentabilidade é de **+32,00%**. Já foram **resgatados** até 30/08/17, o montante total de **R\$**  
32 **6.395.391,67** (seis milhões, trezentos e noventa e cinco mil, trezentos e noventa e um reais  
33 e sessenta e sete centavos), cerca de **63,95%**. O saldo em 30/08/17, é de **R\$ 710.800,69**

*Alfredo Tanos Filho* *Augusto Rômulo Fauaz de Andrade* *Erenildo Motta* *José Eduardo da Silva Guinâncio* *Maria Auxiliadora de Moura Ferreira* *Patric Alves de Vasconcellos* *Rose Mary Gomes*



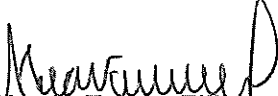
Estado do Rio de Janeiro  
Município de Macaé  
Instituto de Previdência Social  
Comitê de Investimentos

34 (setecentos e dez mil, oitocentos reais e sessenta e nove centavos). O **Patrimônio Líquido**  
35 do fundo em 30/08/17 é de R\$ **19.503.521,58** (dezenove milhões, quinhentos e três mil,  
36 quinhentos e vinte e um reais e cinquenta e oito centavos). Além disso, apresentou  
37 rendimento positivo no mês de R\$ 902,64 (novecentos e dois reais e sessenta e quatro  
38 centavos). Em relação ao **resultado dos rendimentos** no mês de agosto/17, foi de R\$  
39 **22.734.923,69** (vinte e dois milhões, setecentos e trinta e quatro mil, novecentos e vinte e  
40 três reais e sessenta e nove centavos), sem incluir o pagamento do cupom de juros. No  
41 acumulado do ano (janeiro a agosto), apresenta um montante de **R\$ 188.313.044,50** (cento  
42 e oitenta e oito milhões, trezentos e treze mil, quarenta e quatro reais e cinquenta centavos).  
43 Em relação à classificação, referente à rentabilidade média acumulada dos últimos 12  
44 meses (setembro/16 a agosto/17), por benchmark, dos fundos de renda fixa e variável da  
45 carteira do Macaeprev, sem carência, ficou assim, sendo os dois melhores conforme  
46 demonstrado: **1º IBOVESPA ATIVO** com + 20,43%; **2º IRF-M** com +17,67%. Em relação  
47 à **composição da carteira** por classificação de **risco**, no mês de agosto/17, mostra a  
48 estratégia de investimentos para o exercício de 2017, sendo uma carteira **diversificada**,  
49 porém, **conservadora**, composta da seguinte forma: **Baixo Risco 70,20%, Médio Risco**  
50 **23,29% e 6,51% de alto risco**. Com relação à alocação de recursos por Instituições  
51 Financeiras em agosto/17, a carteira do Macaeprev, mostra uma maior alocação de recursos  
52 na **Caixa Econômica Federal**, com R\$ **1.381.382.025,03** (60,51%), seguida pelo **Banco do**  
53 **Brasil**, com R\$ **743.159.086,93** (32,55%). O **Banco Itaú**, com R\$ **44.011.107,37** (1,93%),  
54 **Bradesco** com R\$ **113.583.650,96** (4,98%) e **BRL TRUST DTVM**, com R\$ **710.800,69**  
55 (0,03%). Com isso os recursos alocados em **Bancos Oficiais Públicos** são de R\$  
56 **2.124.541.111,96 (93,06%)**. Com relação à alocação de recursos por **índices de referência**,  
57 em agosto/17, mostra a seguinte composição: Marcação na curva e a mercado com  
58 carência, com vértice do BB e CEF: 54,61%, sem carência: IRFM1: 14,16%, IMA-B: 5,73%,  
59 IRF-M: 7,66%, IMA GERAL: 4,98%, DI: 2,33%, IMA-B5: 4,46%, IDKA2A: 5,29%, IBOVESPA  
60 ATIVO 0,75% e com carência sem vértice: FIDC FECHADO 0,03%. O Patrimônio Líquido do  
61 Instituto de Previdência em 30/08/17, continua em crescimento constante, fechando o mês,  
62 em R\$ 2.282.846.670,98 (dois bilhões, duzentos e oitenta e dois milhões, oitocentos e  
63 quarenta e seis mil, seiscentos e setenta reais e noventa e oito centavos). **IV – PRÓXIMA**  
64 **REUNIÃO:** Ficou designada a próxima reunião para o dia 25 de setembro, às 16 horas. **V –**  
65 **ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às dezessete horas  
66 e dez minutos, tendo a ata sido lida e assinada por todos os membros presentes.

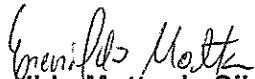


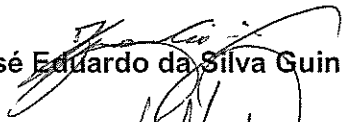
Estado do Rio de Janeiro  
Município de Macaé  
Instituto de Previdência Social  
Comitê de Investimentos

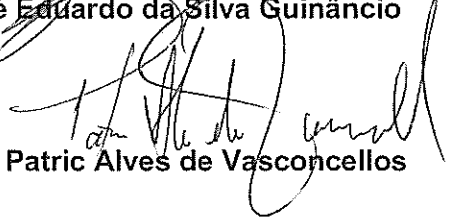
Membros do Comitê de Investimentos:

  
Alfredo Tanos Filho

  
Augusto Romulo Fauaz de Andrade

  
Erenildo Motta da Silva Júnior

  
José Eduardo da Silva Guinâncio

  
Patric Alves de Vasconcellos

  
Maria Auxiliadora de Moura Ferreira

  
Rose Mary Gomes



Posição dos FI em 31/08/2017

Investimentos X Meta Atuarial

IPCA = 0,19%

Nome dos Fundos	Aplicação em 31/07/17	Rentabilidade	Meta-Previsão	% Meta	
Bradesco IMA Geral	112.364.964,69	1,08%	0,68%	158,82	1.213.541,62
Caixa Novo Brasil (IMA-B)	2.650.929,94	1,36%	0,68%	200,00	36.052,65
BB Previd.RF IMA-B LP	99.395.971,74	1,33%	0,68%	195,59	1.321.966,42
Itaú Pré-Fixado (IRF-M)	3.555.715,29	1,02%	0,68%	150,00	36.268,30
Itaú Inflação (IMA-B)	11.791.784,84	1,30%	0,68%	191,18	153.293,20
Itaú Inflação (IMA-B) - Câmara	11.253.917,69	1,30%	0,68%	191,18	146.300,93
BB Previd.RF IMA-B TP	3.907.197,72	1,32%	0,68%	194,12	51.575,01
Itaú RPI Ações Ibov. Ativo FI	16.004.648,33	6,69%	0,68%	983,82	1.070.710,97
Caixa FI Brasil IRF-M1 TP RF	71.789.420,89	0,89%	0,68%	130,88	638.925,85
Caixa FI Brasil 2018 I TP RF	235.065.420,00	0,94%	0,68%	138,24	2.209.614,95
Caixa FI Brasil 2018 II TP RF	549.150.350,23	0,67%	0,68%	98,53	3.679.307,35
Caixa FI Brasil 2020 I TP RF	32.027.800,00	0,94%	0,68%	138,24	301.061,32
Caixa FI Brasil 2022 I TP RF	12.966.000,00	0,93%	0,68%	136,76	120.583,80
Caixa FI Brasil 2020 IV TP RF	184.114.548,93	1,04%	0,68%	152,94	1.914.791,31
Caixa FI Brasil 2024 IV TP RF	142.724.062,92	1,70%	0,68%	250,00	2.426.309,07
Caixa Brasil IMA-B5 TP RF LP	34.680.820,41	1,24%	0,68%	182,35	430.042,17
Caixa Brasil IDKA IPCA 2A TP RF LP	109.651.457,84	0,96%	0,68%	141,18	1.052.654,00
CAIXA DISPONIBILIDADE RF	16,80	0,72%	0,68%	105,88	0,12
BB PREVID. RF TP XII FI	113.784.971,62	0,68%	0,68%	100,00	773.737,81
BB Previd. RF IRF-M1 TP	225.634.692,17	0,88%	0,68%	129,41	1.985.585,29
BB Previd. RF IMA-B5 FIC de FI	65.979.285,74	1,24%	0,68%	182,35	818.143,14
BB Previd. RF IRFM TP FI	48.837.007,00	1,04%	0,68%	152,94	507.904,87
BB Previd. RF IRFM TP FI -Taxa	32.984.742,69	1,04%	0,68%	152,94	343.041,32
BB Previd. RF IRFM TP FI -Reserva	78.586.003,23	1,04%	0,68%	152,94	817.294,43
BB Previd. RF Fluxo FICFI	323.404,47	0,70%	0,68%	102,94	2.263,83
BB Previd. RF Perfil	52.684.468,97	0,79%	0,68%	116,18	416.207,30
Fidc Multisetorial Itália	734.535,50	0,12%	0,68%	17,65	881,44
Total/Média Ponderada	2.252.644.139,65	1,00%	0,68%	147,06	22.468.058,48
					1,00

Parâmetros:

Aplicação: posição em 31/07/17

Rentabilidade: posição em 31/08/17

Meta atuarial: posição de agosto/17

*brasilis*

*Rjones*

*Francis*

*[Handwritten signature]*

*[Handwritten signature]*

*[Handwritten signature]*



Rentabilidade versus Meta Atuarial de Jan a dez/17

Instrumento	17/01	17/02	17/03	17/04	17/05	17/06	17/07	17/08	17/09	17/10	17/11	17/12	17/12
Bradesco IMA Geral	112.364.964,69	1,92%	2,42%	1,26%	0,27%	-0,13%	0,80%	2,51%	1,08%				186,42
Caixa Novo Brasil (IMA-B)	2.650.929,94	1,89%	3,78%	0,95%	-0,53%	-0,96%	0,12%	3,77%	1,36%				189,24
BB Previd. RF IMA-6	99.395.971,74	1,89%	3,89%	1,05%	-0,35%	-1,24%	0,19%	4,01%	1,33%				196,65
Itaú Pré-Fixado (IRF-IA)	3.555.715,29	2,25%	1,99%	1,46%	0,50%	0,25%	1,33%	2,27%	1,02%				204,41
Itaú Inflação (IMA-8)	11.791.284,84	1,83%	3,81%	1,01%	-0,35%	2,41%	0,16%	3,95%	1,30%				176,82
Itaú Inflação (IMA-B) - Câmbio	11.253.917,69	1,83%	3,81%	1,01%	-0,35%	-1,27%	0,16%	3,95%	1,30%				176,82
BB Previd. RF IMA-B TP	3.907.197,72	1,84%	3,85%	1,02%	0,34%	-1,21%	0,15%	3,96%	1,32%				193,47
Itaú FOF RPI Acôb. Ibov. Ativo FI	16.004.648,33	7,26%	3,38%	-1,36%	1,18%	-4,09%	0,87%	4,89%	6,69%				326,32
BB Previd. RF IRF-M1 TP	225.634.982,17	1,26%	0,99%	1,10%	0,86%	0,89%	0,87%	1,06%	0,88%				144,09
BB PREVID. IMA-85 FIC DE FI	65.979.385,74	1,14%	1,48%	1,38%	0,70%	0,09%	0,51%	2,85%	1,24%				172,13
Caixa RF RFA 1 TP RF	71.789.420,89	1,26%	0,99%	1,11%	0,86%	0,90%	0,87%	1,04%	0,89%				144,80
Caixa FI Brasil 2018 I TP RF	235.065.420,00	0,90%	0,73%	0,84%	0,62%	0,84%	0,48%	0,40%	0,94%				101,59
Caixa FI Brasil 2018 II TP RF	549.150.350,23	1,01%	0,96%	1,33%	0,73%	0,79%	0,71%	1,66%	0,67%				137,21
Caixa FI Brasil 2020 I TP RF	32.027.800,00	0,84%	0,73%	0,84%	0,62%	0,84%	0,48%	0,40%	0,94%				100,53
Caixa FI Brasil 2020 II TP RF	12.966.000,00	0,83%	0,72%	0,83%	0,61%	0,83%	0,47%	0,39%	0,93%				99,47
Caixa FI Brasil 2024 IV TP RF	184.114.548,93	1,23%	1,88%	1,64%	0,68%	0,04%	0,57%	2,95%	1,04%				180,78
Caixa FI Brasil IMA-85 TP RF LP	142.774.862,92	1,77%	3,22%	1,18%	0,08%	-0,39%	0,16%	3,82%	1,70%				209,52
Caixa Brasil IMA-85 TP RF LP	34.680.920,41	1,14%	1,48%	1,38%	0,70%	0,08%	0,51%	2,82%	1,24%				171,25
Caixa Brasil IDA IPCA ZA TP RF LP	109.651.457,84	1,06%	1,29%	1,42%	0,79%	0,41%	0,62%	2,41%	0,96%				164,37
CAIXA DISPONIBILIDADE RF	16,60	1,01%	0,81%	0,97%	0,73%	0,85%	0,74%	0,73%	0,72%				119,22
BB PREVID. RF TP XII FI	113.784.971,62	1,00%	0,97%	1,32%	0,79%	0,71%	0,56%	1,65%	0,68%				140,39
BB Previd. RF IRF-M TP FI	48.837.007,00	2,29%	2,01%	1,48%	0,50%	0,25%	1,32%	2,31%	1,04%				206,88
BB Previd. RF IRF-M TP - Taxa	32.984.747,69	2,29%	2,01%	1,48%	0,50%	0,25%	1,32%	2,31%	1,04%				206,88
BB. Previd. RF IRF-M TP - Reserva	78.586.003,23	2,29%	2,01%	1,48%	0,50%	0,25%	1,32%	2,31%	1,04%				206,88
BB Previd. RF Perfil	52.684.468,97	1,10%	0,89%	1,07%	0,78%	0,92%	0,81%	0,81%	0,79%				130,91
BB Previd. RF Fluxo FICFI	323.404,47	1,01%	0,80%	0,97%	0,73%	0,87%	0,73%	0,71%	0,70%				117,64
FICF Multisetorial Italia	734.331,50	0,03%	2,78%	0,10%	0,10%	1,43%	26,02%	0,12%	0,12%				564,37
<b>Total</b>	<b>2.253.644.339,65</b>	<b>1,33%</b>	<b>1,66%</b>	<b>1,22%</b>	<b>0,55%</b>	<b>0,26%</b>	<b>0,63%</b>	<b>1,97%</b>	<b>1,00%</b>				<b>57,65</b>

8,94

*Exemplos*

*Romey*

*Luiz*

*[Handwritten signature]*

*[Handwritten signature]*

11.876.976,77  
284.444,78  
11.082.650,85  
412.107,40  
1.760.513,48  
1.215.423,11  
428.619,59  
3.269.749,65  
18.434.354,35  
6.438.578,29  
5.693.911,46  
10.394.905.564,50  
23.879.661.714,29  
75.350.788.796,99  
42.723.897,25  
1.825.584,60  
731.282,40  
18.871.741,27  
16.955.618,67  
3.367.507,66  
10.219.515,87  
1,14  
2.002,96  
15.974.045.398,50  
10.103.317.321,16  
6.823.827.720,52  
16.257.739.292,56  
6.875.927.167,16  
38.044.229,54  
414.552.663,14  
355.135.155.334,26  
57,65

