

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

ATA Nº 029/2017 de 19/09/2017 – Ata de Reunião Extraordinária 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 Visconde de Quissamã, setecentos e oitenta e sete, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, do dia dezoito de setembro de dois mil e dezessete, estando presentes os membros: Julio Cesar Marques de Carvalho, Rui de Vasconcellos, Livia Mussi de Oliveira Sant'Ana, Surama Roberto Soutinho de Oliveira, Flávio Mancebo de Azevedo, Juciara da Silva Sobrinho de Oliveira, Junir de Miranda Gomes e Alexander Ferreira Gonçalves, o presidente do Instituto Rodolfo Tanus Madeira, além do membro do Comitê de Investimentos do Macaeprev Augusto Fauaz de Andrade, que se reuniram após convocação, às dezesseis horas, na sede deste Instituto, para em conjunto analisarem e deliberarem sobre os temas apresentados. Iniciada a reunião, foi informado pelo Presidente do Instituto ao Conselho, a obtenção do Certificado de Regularidade Previdenciária, aproveitando para parabenizar o Poder Executivo, por meio do seu chefe, Dr. Aluísio, pelo sucesso em atingir mais essa meta. Passada a palavra para o membro do Comitê e Administrador do Fundo Augusto, que informou que a Carteira do Macaeprev, apresentou em agosto a sua média ponderada total, que foi de +1,00%. Isso resultou que ficasse 47,06%, acima da meta atuarial, de agosto, já que a meta foi de +0,68%. O IPCA-IBGE, apresentou uma desaceleração da inflação, que ficou em +0,19%, enquanto julho, teve 0,24%. Para os meses de agosto, foi a menor variação desde 2010. No ano o acumulado foi de +1,62%, bem abaixo dos 5,42% registrados em agosto de 2016. Este foi o menor acumulado no ano para um mês de agosto desde a implantação do Plano Real (1994). Em relação à média ponderada total acumulada no período de janeiro a agosto, a carteira apresentou um resultado de +8,94%, enquanto que a meta atuarial, para o mesmo período ficou em + 5,67%. Em vista disso, ao final de agosto de 2017, a carteira de investimentos do Macaeprev supera a meta atuarial em +57,65% e caso não ocorra nenhuma surpresa negativa de grande impacto no mercado financeiro, a tendência é assim como já ocorrera em 2016, de novamente superar a meta atuarial ao final do exercício de 2017. A melhor rentabilidade do mês foi o fundo de renda variável ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO, que apresentou rentabilidade de +6,69%. E o segundo melhor fundo da carteira foi o fundo de renda fixa, com carência, marcação à mercado, da Caixa Econômica Federal, com vencimento em 2024. Em agosto, com exceção dos fundos FIDC MULTISSETORIAL ITÁLIA e o fundo de renda fixa com carência, marcação a mercado CAIXA 2018II, todos os FI da carteira atingiram e ou superaram a meta atuarial do mês. Também merecem destaques os fundos da carteira, atrelados ao IRF-M, na qual apresentaram bom desempenho, com uma rentabilidade média em agosto de + 1,03%. O fundo de renda fixa, Bradesco Ima Geral, cujo benchmark é o IMA GERAL, também apresentou bom desempenho, pois sua rentabilidade foi de +1,08%. Os fundos de renda fixa, atrelados ao IMA-B, obtiveram uma ótima rentabilidade média em agosto, fechando em +1,32%. Também tiveram boa performance os fundos de renda fixa, atrelados ao IMA-B5 e IDKA 2A, que apresentaram rentabilidades médias respectivas de: +1,24% e +0,96%.

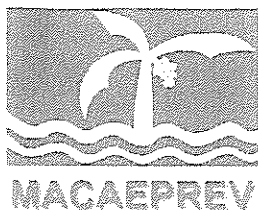
Spolera



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

Em relação aos fundos de renda fixa IRF-M1 e DI, que são os de menor risco e servem para fazer caixa para o Instituto, ambos superaram a meta atuarial de agosto, apresentando respectivamente as seguintes rentabilidades médias: +0,88% e + 0,74%. Em relação aos fundos de renda fixa, com carência, marcação a mercado, da CEF, com exceção do que vence em 2018, todos superaram a meta atuarial e apresentaram as seguintes rentabilidades respectivas: 2018II com +0,67%, 2020IV com +1,04% e 2024IV, com +1,70%. Em relação aos fundos de renda fixa, com carência, marcação na curva, da CEF, todos superaram a meta atuarial, com as seguintes rentabilidades respectivas: 2018I com +0,94%, 2020I com +0,94% e 2022I com +0,93%. Com relação ao FIDC Multisetorial Itália, apresentou a pior rentabilidade no mês de agosto, ficando em +0,12%. A rentabilidade acumulada nos últimos 12(doze) meses é de -59,43%. No acumulado do ano sua rentabilidade é de +32,00%. Já foram resgatados até 30/08/17, o montante total de R\$ 6.395.391,67(seis milhões, trezentos e noventa e cinco mil, trezentos e noventa e um reais e sessenta e sete centavos), cerca de 63,95%. O saldo em 30/08/17, é de R\$ 710.800,69(setecentos e dez mil, oitocentos reais e sessenta e nove centavos). O Patrimônio Líquido do fundo em 30/08/17, é de R\$ 19.503.521,58(dezenove milhões, quinhentos e três mil, quinhentos e vinte e um reais e cinquenta e oito centavos). Além disso, apresentou rendimento positivo no mês de R\$ 902,64 (novecentos e dois reais e sessenta e quatro centavos). Em relação ao resultado, dos rendimentos no mês de agosto/17, foi de R\$ 22.734.923,69(vinte e dois milhões, setecentos e trinta e quatro mil, novecentos e vinte e três reais e sessenta e nove centavos), sem incluir o pagamento do cupom de juros. Em relação a classificação, referente a rentabilidade média acumulada dos últimos 12 meses (setembro/16 à agosto/17), por benchmark, dos fundos de renda fixa e variável da carteira do Macaeprev, sem carência, ficou assim, conforme demonstrado a seguir: 1º IBOVESPA ATIVO com + 20,43%; 2º IRF-M com +17,67%; 3º IMA B com + 16,02%; 4º IMA GERAL com + 15,76%; 5º IMA B5 com + 13,73%; 6º IDKA 2A com +13,26 %; 7º IRF-M1 com + 12,92%; 8º DI com + 11,46%. Em relação à composição da carteira por classificação de risco, ficou assim no mês de agosto/17: Baixo Risco 70,20%, Médio Risco 23,29% e 6,51% de alto risco. Existe em 30/08/2017, cerca de R\$ 131.000.000,00 (cento e trinta e um milhões de reais), aplicados em fundos, que tem como benchmark, o IMA-B, representando 5,73% da carteira. Com relação à alocação de recursos por Instituições Financeiras em agosto/17, a carteira do Macaeprev ficou composta da seguinte maneira: Caixa Econômica Federal, com R\$1.381.382.025,03(60,51%), Banco do Brasil, com R\$ 743.159.086,93(32,55%), Itaú, com R\$ 44.011.107,37(1,93%), Bradesco com R\$ 113.583.650,96(4,98%) e BRL TRUST DTVM, com R\$ 710.800,69 (0,03%). Com isso os recursos alocados em Bancos Oficiais Públicos são de R\$ 2.124.541.111,96(93,06%) e Instituições Privadas de R\$ 158.305.559,02(6,94%). Com relação à alocação de recursos por índices de referência, em agosto/17, ficou da seguinte maneira: Marcação na curva e a mercado com carência, com vértice do BB e CEF: 54,61%, sem carência: IRFM1: 14,16%, IMA-B: 5,73%, IRF-M: 7,66%, IMA GERAL:

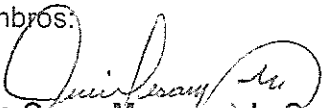
Handwritten signatures and initials at the bottom of the page.



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

4,98%, DI: 2,33%, IMA-B5: 4,46%, IDKA2A: 5,29%, IBOVESPA ATIVO 0,75% e com carência sem vértice: FIDC FECHADO 0,03%. O Patrimônio Líquido do Macaeprev, em 30/08/17 apresentou mais uma vez, crescimento, fechando o mês, em R\$ 2.282.846.670,98 (dois bilhões, duzentos e oitenta e dois milhões, oitocentos e quarenta e seis mil, seiscentos e setenta reais e noventa e oito centavos). Ao final, informou o presidente do Conselho que, de acordo com informações do Chefe da Divisão de acompanhamento de investimentos, coordenação geral de atuária, contabilidade e investimento SRPPS/SPREV/MF, Júlio Romeu, o prazo para o envio da política de investimentos/2018 é até 31 de outubro de 2017 e deverá ser executada de acordo com a Resolução nº 3922/2010. Assim, tendo em vista o curto espaço de tempo para análise e avaliação da política de investimento, fica a próxima reunião designada para o dia 26 de setembro para discussão e aprovação da referida política. 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


Alexandre Ferreira Goncalves


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

