

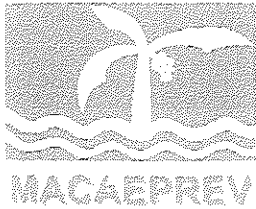
Estado do Rio de Janeiro
Município de Macaé
Instituto de Previdência Social
Conselho Previdenciário

ATA Nº 032/2017 de 25/10/2017 – 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 Visconde de Quissamã, setecentos e oitenta e sete, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, do dia vinte e cinco de outubro 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, 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 justificada a reunião estar acontecendo hoje, apesar de ter sido convocada para a data de ontem, em virtude do Chefe do Executivo ter agendado reuniões com seus Secretários que deverão ocorrer toda terça-feira. Dando prosseguimento à reunião, o administrador do fundo e membro do Comitê, Augusto, apresentou o relatório a seguir: A Carteira do Macaeprev, apresentou em setembro a sua média ponderada total, que foi de +0,91%. Isso resultou que ficasse 40,00%, acima da meta atuarial, de setembro, já que a meta foi de +0,65%, conforme relatório em anexo. O IPCA-IBGE, em setembro, foi de +0,16% e com isso acumula a menor inflação no ano desde 1998, pois o índice acumulou 1,78%, bem abaixo dos 5,51% em igual período do ano passado. Foi a menor inflação acumulada até setembro, desde 1998, quando a inflação ficou em 1,42%. A inflação foi menor que agosto, no qual o IPCA variou em +0,19%. Em relação à média ponderada total acumulada no período de janeiro à setembro, a carteira apresentou um resultado de +9,94%, enquanto que a meta atuarial, para o mesmo período ficou em + 6,36%. Em vista disso, ao final de setembro de 2017, a carteira de investimentos do Macaeprev supera a meta atuarial em +56,27%, conforme relatório em anexo e faltando 3 (três) meses para encerrar o exercício; a meta atuarial, já foi atingida; caso não ocorra nenhuma surpresa negativa de grande impacto no mercado financeiro. Esse resultado mostra a boa diversificação dos investimentos e o acerto na estratégia da montagem da carteira para 2017. A melhor rentabilidade do mês, foi novamente, o fundo de renda variável ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO, que apresentou rentabilidade de +4,93%. E o segundo melhor fundo da carteira foi o fundo de renda fixa, sem carência, marcação à mercado, BB PREVID. RF IMA-B LP, atrelado ao IMA-B, do Banco do Brasil. O FIDC MULTISSETORIAL ITALIA, apresentou a pior rentabilidade do mês, fechando em +0,42%. Também merecem destaques os fundos da carteira, atrelados ao IMA-B, na qual apresentaram bom desempenho, com uma rentabilidade média em setembro de + 1,79%, superando a meta atuarial. Os fundos de renda fixa, atrelados ao IRF-M, obtiveram uma ótima rentabilidade média em setembro, fechando em + 1,45%, superando a meta atuarial. O fundo de renda fixa, Bradesco Ima Geral, cujo benchmark é o IMA GERAL, também apresentou bom desempenho, pois sua rentabilidade foi de +1,37%, superando a meta atuarial.



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

Também tiveram boa performance os fundos de renda fixa, atrelados ao IMA-B5 e IDKA 2A, que apresentaram rentabilidades médias respectivas de: +0,99% e +0,89%, superando a meta atuarial. 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, somente o IRF-M1, superou a meta atuarial de setembro, apresentando respectivamente as seguintes rentabilidades médias: +0,71% e + 0,59%. 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 +0,50%, 2020IV com +1,12% e 2024IV, com +1,46%. Em relação aos fundos de renda fixa, com carência, marcação na curva, da CEF, todos ficaram abaixo da meta atuarial, com as seguintes rentabilidades respectivas: 2018I com +0,50%, 2020I com +0,50% e 2022I com +0,49. Em relação ao FI, com carência, marcação à mercado, BB PREVID. RF TP XII FI, com vencimento em 2018, apresentou rentabilidade no mês de +0,50%, ficando abaixo da meta atuarial. Com relação ao FIDC Multisetorial Itália, apresentou novamente, a pior rentabilidade no mês de setembro, ficando em +0,42%. A rentabilidade acumulada no ano é de +32,56% e nos últimos 12 (doze) meses é de -41,18%. Já foram resgatados até 30/09/17, o montante total de R\$ 6.420.663,15 (seis milhões, quatrocentos e vinte mil, seiscentos e sessenta e três reais e quinze centavos), cerca de 64,21%. O saldo em 30/09/17, é de R\$ 688.445,32(seiscentos e oitenta e oito mil, quatrocentos e quarenta e cinco reais e trinta e dois centavos). O Patrimônio Líquido do fundo em 30/09/17, é de R\$ 18.890.116,71 (dezoito milhões, oitocentos e noventa mil, cento e dezesseis reais e setenta e um centavos). Além disso, em relação ao rendimento, o fundo apresentou saldo positivo no mês de R\$ 2.916,10 (dois mil, novecentos e dezesseis reais e dez centavos). Em relação ao resultado, dos rendimentos no mês de setembro/17, foi de R\$ 20.810.694,94(vinte milhões, oitocentos e dez mil, seiscentos e noventa e quatro reais e noventa e quatro centavos), sem incluir o pagamento do cupom de juros. No acumulado do ano (janeiro à setembro), apresenta resultado de R\$ 209.123.739,44 (duzentos e nove milhões, cento e vinte e três mil, setecentos e trinta e nove reais e quarenta e quatro centavos). Em relação a classificação, referente a rentabilidade média acumulada dos últimos 12 meses (outubro/16 à setembro/17), por benchmark, dos fundos de renda fixa e variável da carteira do Macaeprev, sem carência, ficou assim, conforme demonstrado abaixo: 1º IBOVESPA ATIVO com +26,95%, 2º IRF-M com +17,10%, 3º IMA B com +16,30%, 4º IMA GERAL com +15,38%, 5º IMA B5 com +13,27%, 6º IDKA 2A com +12,77%, 7º IRF-M1 com + 12,41%, 8º DI com + 10,94%. Em relação à composição da carteira por classificação de risco, ficou assim no mês de setembro/17: Baixo Risco 69,94%, Médio Risco 23,50% e 6,56% de alto risco. Existe em 30/09/2017, cerca de R\$ 133.000.000,00 (cento e trinta e três milhões de reais), aplicados em fundos, que tem como benchmark, o IMA-B, representando 5,76% da carteira. Com relação à alocação de recursos por Instituições Financeiras em setembro/17, a carteira do Macaeprev ficou composta da seguinte maneira: Caixa Econômica Federal, com R\$1.395.232.389,80 (60,33%),



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

Banco do Brasil, com R\$ 756.386.932,42 (32,70%), Itaú, com R\$ 45.320.069,99 (1,96%), Bradesco com R\$ 115.143.615,91 (4,98%) e BRL TRUST DTVM, com R\$ 688.445,31 (0,03%). Com isso os recursos alocados em Bancos Oficiais Públicos são de R\$ 2.151.619.322,22 (93,03%) e Instituições Privadas de R\$ 161.152.131,21 (6,97%). Com relação à alocação de recursos por índices de referência, em setembro/17, ficou da seguinte maneira: Marcação na curva e a mercado com carência, com vértice do BB, CEF e FIDC: R\$ 1.256.062.858,32 (54,31%) e sem carência, R\$ 1.056.708.595,11 (45,69%), distribuído da seguinte forma: IRFM1: 14,26%, IMA-B: 5,76%, IRF-M: 7,87%, IMA GERAL: 4,98%, DI: 2,33%, IMA-B5: 4,45%, IDKA2A: 5,27%, IBOVESPA ATIVO 0,77%. O Patrimônio Líquido do Macaeprev, em 30/09/17 apresentou mais uma vez, crescimento, fechando o mês, em R\$ 2.312.771.453,43 (dois bilhões, trezentos e doze milhões, setecentos e setenta e um mil, quatrocentos e cinquenta e três reais e quarenta e três centavos). O Banco Bradesco S.A. foi convidado pelo Macaeprev e aceitou promover uma palestra no dia 13 de novembro de 2017 as 14:00h, em local a ser definido em tempo hábil. 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 Goncalves


Flávio Mancebo de Azevedo


Rui de Vasconcellos


Surama Roberto Soutinho de Oliveira


Juciara da Silva Sobrinho de Oliveira


Junir de Miranda Gomes


Rodolfo Tanus Madeira

