



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

1 **ATA Nº 02/2019 de 15/01/2019 - COMITÊ DE INVESTIMENTOS** – Ata de Reunião
2 Extraordinária do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência Social do Município de
3 Macaé inscrito no CNPJ sob o n.º 03.567.964/0001-04, sediado na Rua Tenente Rui Lopes
4 Ribeiro, duzentos e noventa e três, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, às dezessete horas e
5 quinze minutos do dia quinze de janeiro de dois mil e dezenove, estando presentes os
6 membros do Comitê de Investimentos: **Alfredo Tanus Filho, Augusto Rômulo Fauaz de**
7 **Andrade, Erenildo Motta da Silva Júnior, Isabella Felix Viana, José Eduardo da Silva**
8 **Guinâncio, Maria Auxiliadora de Moura Ferreira, Patric Alves de Vasconcellos e Rose**
9 **Mary Gomes** instituídos através da portaria de nomeação nº 208/2016. Iniciada a reunião,
10 foi justificada a antecipação da mesma em virtude de alguns membros do Comitê de
11 Investimentos estarem assoberbados para o dia da reunião agendada anteriormente. Em
12 seguida, os membros trataram acerca da Carteira do Macaeprev. I – **CARTEIRA DO**
13 **MACAEPREV:** O membro **Augusto** e gestor dos fundos de investimentos apresentou o
14 relatório a seguir. Que a Carteira do Macaeprev, em dezembro de 2018, apresentou um
15 resultado positivo da sua **média ponderada total**, ficando em +1,15%. Com isso ficou
16 79,69% acima da meta atuarial de dezembro, pois a meta fechou em +0,64%. Assim, a
17 **média ponderada da carteira no acumulado dos 12 (doze) meses** de 2018, ficou em
18 +9,65%, enquanto a meta atuarial, para o mesmo período ficou em +9,98%. Isso fez com
19 que a carteira de investimentos do Instituto no período de janeiro a dezembro, quase
20 atingisse a meta, já que a média ponderada total da carteira no exercício de 2018 atingiu
21 96,67%. Mesmo com um cenário de turbulências e incertezas nos campos econômico e
22 político, a carteira apresentou boa *performance*, com gerenciamento eficaz, através de boa
23 governança do Presidente do Macaeprev, do Gestor, do Comitê de Investimentos e do
24 Conselho Previdenciário, que ocasionou num bom resultado da carteira. No acumulado de
25 2011 a 2018, a meta atuarial fechou em +96,72%, enquanto o resultado da carteira de
26 investimentos foi de +93,25%, atingindo com isso 96,41% da meta, conforme planilhas em
27 anexo. Que o melhor desempenho no mês, foi o fundo de renda fixa sem carência da CEF, o
28 Caixa FI Brasil IRF-M1+, que teve uma rentabilidade de +1,85%. O segundo melhor
29 desempenho foi do fundo de renda fixa, com carência, da CEF, o CEF FI Brasil 2024IV TP
30 RF, com rentabilidade no mês de +1,80%, conforme planilha em anexo. Em relação ao
31 desempenho no exercício de 2018, o melhor foi o fundo de renda variável, Itaú FOF RPI
32 Ações Ibovespa Ativo FI, com uma rentabilidade acumulada de +16,10%. O destaque
33 negativo no ano de 2018 ficou com o FIDC Multisetorial Itália, com uma rentabilidade

(Handwritten signatures and initials at the bottom of the page)



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

34 negativa de -96,62%. Os fundos que superaram a meta atuarial em 2018, foram os fundos
35 de renda fixa, atrelados ao IMA GERAL, IRF-M1+, IMA-B, IRF-M, além do fundo com
36 carência da CEF; o 2024IV e o fundo de renda variável (ações), atrelado ao IBOVESPA. Em
37 relação à **inflação de dezembro**, o IPCA-IBGE apresentou uma inflação de +0,15%, menor
38 taxa para o mês desde 1994, fazendo com que a meta atuarial em dezembro, fosse de
39 +0,64%. A inflação oficial fechou 2018 em +3,75%, resultado que veio dentro do esperado
40 pelo mercado para o ano e cumpriu com folga a meta central do Governo, que era de
41 +4,50%. Em 2017, o índice ficou em +2,95%. Com relação ao **Fidc Multisetorial Itália**,
42 apresentou assim como no mês anterior, rentabilidade negativa, em dez/18, fechando em -
43 51,05%. Já foram resgatados do Fidc Multisetorial Itália, até 31 de dezembro de 2018, o
44 montante total de R\$ 7.609.688,16, cerca de 76,10%, do valor principal investido (R\$
45 10.000.000,00). O saldo em 31 de dezembro de 2018 estava em R\$ 29.815,89 (vinte e nove
46 mil, oitocentos e quinze reais e oitenta e nove centavos). O Patrimônio Líquido do Fidc
47 Multisetorial Itália, em 31 de dezembro de 2018, estava em R\$ 818.112,37 (oitocentos e
48 dezoito mil, cento e doze reais e trinta e sete centavos). Além disso, em relação ao
49 rendimento, foi negativo em dezembro de R\$ 2.481,26 (dois mil, quatrocentos e oitenta e um
50 reais e vinte e seis centavos). Em relação ao resultado, dos **rendimentos no mês de**
51 **dezembro de 2018** da carteira de investimentos do Macaeprev, foi positivo em +R\$
52 30.256.595,20 (trinta milhões, duzentos e cinquenta e seis mil, quinhentos e noventa e cinco
53 mil e vinte centavos), sem o cupom de juros. O **rendimento acumulado nos doze meses**
54 de 2018 foi de R\$ 265.805.359,63 (duzentos e sessenta e cinco milhões, oitocentos e cinco
55 mil, trezentos e cinquenta e nove reais e sessenta e três centavos). Em relação à
56 **composição da carteira por classificação de risco**, ficou assim no mês de dezembro de
57 2018: Baixo Risco 52,56%, Médio Risco 41,07% e 6,37% de Alto Risco. Com relação à
58 **alocação de recursos por Instituições Financeiras** em dezembro de 2018, a carteira do
59 Macaeprev ficou composta da seguinte maneira: Caixa Econômica Federal, com R\$
60 1.389.101.560,88 (51,83%), Banco do Brasil, com R\$ 1.138.883.615,49 (42,49%), Itaú, com
61 R\$ 51.723.504,50 (1,93%), Bradesco com R\$ 100.327.363,58 (3,74%) e BRL TRUST DTVM,
62 com R\$ 29.815,89 (0,00%). Com isso os recursos alocados em Bancos Oficiais Públicos são
63 de: R\$ 2.527.985.176,37(94,32%) e Instituições Privadas de R\$ 152.080.683,97 (5,68%).
64 Com relação à **alocação de recursos por índices de referência**, em dezembro de 2018,
65 ficou da seguinte maneira: Marcação na curva e a mercado com carência, com vértice do
66 BB, CEF e FIDC: R\$ 391.412.777,40 (14,61%) e sem carência, R\$ 2.288.653.082,94



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

67 (85,39%), distribuído da seguinte forma: IRFM1: R\$ 411.608.714,21 (15,36%), IMA-B: R\$
68 149.532.281,38 (5,58%), IRF-M: R\$ 233.367.863,48 (8,71%), IMA Geral: R\$ 150.935.667,37
69 (10,15%), DI: R\$ 267.448.943,35 (9,98%), IMA-B5: R\$ 309.381.752,42 (11,54%), IDKA2A:
70 R\$ 489.756.696,17 (18,27%), IRFM1+: R\$ 255.574.274,65 (9,54%) e Ibovespa Ativo: R\$
71 21.046.889,91 (0,79%). O **Patrimônio Líquido do Macaeprev**, em 31 de dezembro de
72 2018, na qual apresentou bom crescimento, em 2018, foi de R\$ 2.680.065.860,34 (dois
73 bilhões, seiscentos e oitenta milhões, sessenta e cinco mil, oitocentos e sessenta reais e
74 trinta e quatro centavos). **II – FIDC MULTISSETORIAL ITÁLIA:** Em Assembleia Geral de
75 Cotistas realizada no dia oito de janeiro, foi aprovado: a extensão do prazo de duração do
76 Fundo para 48 (quarenta e oito) meses, contados do término do prazo vigente; a eleição do
77 Thiago Freitas Rodrigues e Flávio Rodrigues de Castro como membros do Comitê, sendo o
78 primeiro pela Fundação Petrobras de Seguridade Social – PETROS e o segundo pela
79 Manaus Previdência; a consolidação do Regulamento, tudo conforme ata em anexo. **III –**
80 **PRÓXIMA REUNIÃO:** Ficou designada próxima reunião para o dia 24 de janeiro de 2019, às
81 dezessete horas. **IV – ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, a reunião foi
82 encerrada às dezoito horas e vinte minutos, tendo a ata sido lida e assinada por todos os
83 membros presentes.


Alfredo Tanus Filho


Augusto Rômulo Fauaz de Andrade


Erenildo Motta da Silva Júnior


Isabella Félix Viana


José Eduardo da Silva Guinâncio


Maria Auxiliadora de Moura Ferreira


Patric Alves de Vasconcelos


Rose Mary Gomes