



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

ATA Nº 11/2019 de 21/03/2019 - COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Ata de Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência Social do Município de Macaé inscrito no CNPJ sob o n.º 03.567.964/0001-04, sediado na Rua Tenente Rui Lopes Ribeiro, duzentos e noventa e três, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, às dezessete horas e trinta minutos do dia vinte e um de março de dois mil e dezenove, 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. I – **CARTEIRA DO MACAEPREV:** A Carteira do Macaeprev, em fevereiro, apresentou um resultado positivo da sua **média ponderada total**, ficando em +0,44%. Com isso atingiu apenas 47,83% da meta atuarial de fevereiro, pois a meta fechou em +0,92%, ficando a média ponderada da carteira no acumulado do ano de 2019 em +1,89%, enquanto a meta atuarial ficou em + 1,74%. Isso fez com que a carteira de investimentos do Instituto no acumulado do ano, superasse a meta atuarial, em +11,29%. O **melhor desempenho** no mês foi o Fidc Multisetorial Itália, que foi o único fundo que conseguiu superar a meta atuarial de fevereiro, com uma rentabilidade positiva de +165,98%. O segundo melhor desempenho foram os fundos de renda fixa, com carência, da CEF, Caixa FI Brasil 2020I e 2022I, ambos com rentabilidade de +0,75%. Já a **pior rentabilidade do mês** foi o ITAÚ FOF RPI Ações Ibovespa Ativo, com -1,60%. Em relação à **inflação** de fevereiro de 2019, o IPCA-IBGE apresentou uma inflação de +0,43%, pressionada por educação e alimentos. Em 12 (doze) meses o IPCA acumulado ficou em 3,89%, acima dos 3,785%, registrados nos 12 (doze) meses imediatamente anteriores. Já o acumulado do ano foi para 0,75%. Segundo o IBGE, o avanço dos custos da educação, reflete os reajustes praticados em todo o início de ano letivo, em especial nas mensalidades dos cursos regulares, cujos valores subiram, em média, 4,58%, gerando o mais elevado impacto individual sobre o índice do mês. No grupo alimentação, as maiores altas foram verificadas nos preços do feijão carioca (51,58%), da batata-inglesa (25,21%), das hortaliças (12,13%) e do Leite Longa Vida (2,41%). Com relação ao **FIDC Multisetorial Itália**, apresentou a melhor rentabilidade no mês, fechando em +165,98%. No acumulado dos últimos 12 meses, apresenta uma rentabilidade negativa de -77,65%. No acumulado do ano, apresenta uma rentabilidade positiva de +325,71%. Já foram resgatados do Fidc Multisetorial Itália até 28 de fevereiro de 2019 o montante total de R\$ 7.619.024,52 (sete milhões, seiscentos e dezenove mil, vinte e quatro reais e cinquenta e dois centavos), cerca de 76,19%, do valor principal investido de dez milhões de reais. O saldo em 28 de fevereiro de 2019 estava em R\$ 126.930,29 (cento e vinte e seis mil, novecentos e trinta reais e vinte e nove centavos). O Patrimônio Líquido do Fidc Multisetorial Itália, em 28 de fevereiro de 2019 estava em R\$ 3.482.815,36 (três milhões, quatrocentos e oitenta e dois mil, oitocentos e quinze reais e trinta e seis centavos). Além disso, em relação ao rendimento, foi positivo em fevereiro de 2019 de R\$ 88.544,58 (oitenta e oito mil, quinhentos e quarenta e quatro

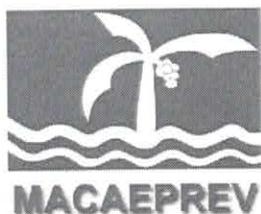
Erenildo

Augusto - Rose

1 Erenildo

Patric

Isabella



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

37 reais e cinquenta e oito centavos). Em relação ao **resultado dos rendimentos** da carteira de
38 investimentos do Macaeprev no mês de fevereiro de 2019, foi positivo em +R\$ 13.013.878,50 (treze
39 milhões, treze mil, oitocentos e setenta e oito reais e cinquenta centavos), sem o cupom de juros. Em
40 relação à **composição da carteira por classificação de risco**, ficou assim no mês de fevereiro de
41 2019: Baixo Risco 35,41%, Médio Risco 55,68% e 8,91% de Alto Risco. Com relação à **alocação de**
42 **recursos por Instituições Financeiras** em fevereiro de 2019 a carteira do Macaeprev ficou
43 composta da seguinte maneira: Caixa Econômica Federal com R\$ 1.422.360.958,62 (51,53%);
44 Banco do Brasil com R\$ 1.180.197.327,24 (42,76%); Itaú com R\$ 54.784.027,82 (1,98%); Bradesco
45 com R\$ 102.775.593,65 (3,72%); e BRL TRUST DTVM com R\$ 126.930,29 (0,00%). Com isso, os
46 recursos alocados em Bancos Oficiais Públicos são de: R\$ 2.602.558.285,86 (94,29%) e Instituições
47 Privadas de R\$ 157.686.551,76 (5,71%). Com relação à **alocação de recursos por índices de**
48 **referência**, em fevereiro de 2019, ficou da seguinte maneira: Marcação na curva e a mercado com
49 carência, com vértice do BB, CEF e FIDC: R\$ 389.501.212,44 (14,10%) e sem carência, R\$
50 2.370.743.625,18 (85,90%), distribuídos da seguinte forma: IRFM1: R\$ 171.946.057,67 (6,23%),
51 IMA-B: R\$ 222.503.862,69 (8,06%), IRF-M: R\$ 412.240.335,32 (14,93%), IMA GERAL: R\$
52 275.239.694,10 (9,97%), DI: R\$ 69.957.483,04 (2,53%), IMA-B5: R\$ 437.016.540,55 (15,83%),
53 IDKA2A: R\$ 498.719.638,80 (18,07%), IRFM1+:R\$ 260.363.907,89 (9,43%) e IBOVESPA ATIVO: R\$
54 22.756.105,12 (0,82%). O **Patrimônio Líquido** do Macaeprev, em 28/02/19, no qual, novamente
55 apresentou crescimento, foi de R\$ 2.760.244.837,62 (dois bilhões, setecentos e sessenta milhões,
56 duzentos e quarenta e quatro mil, oitocentos e trinta e sete reais e sessenta e dois centavos). II -
57 **PRÓXIMA REUNIÃO**: Ficou designada próxima reunião para o dia vinte e oito de março de dois mil
58 e dezenove, às quatorze horas, em conjunto com o Conselho Previdenciário, na agência da Caixa
59 Econômica Federal. IV – **ENCERRAMENTO**: Nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada,
60 tendo a ata sido lida e assinada por todos os membros presentes.


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


Rose Mary Gomes