



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

1 **ATA Nº 23/2019 de 17/06/2019 - COMITÊ DE INVESTIMENTOS** – Ata de Reunião Extraordinária do
2 Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência Social do Município de Macaé inscrito no CNPJ
3 sob o n.º 03.567.964/0001-04, sediado na Rua Tenente Rui Lopes Ribeiro, duzentos e noventa e
4 três, Centro, Macaé, Rio de Janeiro, às dezessete horas e vinte minutos do dia dezessete de junho
5 de dois mil e dezenove, estando presentes os membros do Comitê de Investimentos: **Alfredo Tanos**
6 **Filho, Augusto Rômulo Fauaz de Andrade, Erenildo Motta da Silva Júnior, Isabella Felix Viana,**
7 **José Eduardo da Silva Guinâncio, Maria Auxiliadora de Moura Ferreira, Patric Alves de**
8 **Vasconcellos e Rose Mary Gomes,** instituídos através da portaria de nomeação nº 208/2016. I -
9 **CARTEIRA DO MACAEPREV:** Pelo membro **Augusto** foi informado que a Carteira do Macaeprev
10 referente ao mês de **maio** apresentou o seu melhor resultado no ano, com sua **média ponderada**
11 **total** ficando em +1,58%, bem superior ao mês anterior que foi de +0,92%, principalmente com a
12 expectativa positiva do mercado pela aprovação da reforma da Previdência, devido à melhora do
13 diálogo e a união entre os três poderes e também por ter passado na CCJ (Comissão de
14 Constituição e Justiça). Com o resultado, superou em 154,84% a meta atuarial, pois esta fechou
15 maio em +0,62%, devido à desaceleração da inflação. Com isso a **média ponderada total da**
16 **carteira no acumulado do ano** (janeiro a maio) de 2019 ficou em +5,45%, enquanto a meta atuarial
17 ficou em + 4,74%. Isso fez com que a carteira de investimentos do Instituto no acumulado do ano,
18 superasse a meta atuarial, em 14,79%, aumentando a probabilidade de ultrapassar a meta ao final
19 do exercício de 2019, mostrando a boa diversificação e estratégia dos investimentos. Os **melhores**
20 **desempenhos no mês** foram os fundos de renda fixa, atrelados ao IMA-B, do Banco do Brasil e do
21 Itaú, como o Itaú Inflação, BB Previd IMA-B e BB Previd. IMA-B TP, que tiveram uma rentabilidade
22 de +3,63% cada. O segundo melhor foi o fundo de renda fixa da CEF, também atrelado ao IMA-B,
23 que teve uma rentabilidade no mês de +3,58%, conforme relatórios em anexo. Todos os fundos de
24 renda fixa de médio e alto risco, sem carência e com carência, superaram a meta atuarial. Já os
25 fundos de renda fixa de baixo risco, somente os atrelados ao DI ficaram abaixo da meta atuarial, com
26 a rentabilidade média respectiva de +0,48%. Já os fundos atrelados ao IDKA2 e IRF-M1, que
27 também são de baixo risco, superaram a meta atuarial no mês, com as rentabilidades médias
28 respectivas de: +1,00% e +0,65%. Já os fundos de renda fixa de médio risco como os atrelados ao
29 IMA-B5, IRF-M, IMA GERAL, todos superaram a meta atuarial, apresentando as rentabilidades
30 médias respectivas de: +1,37%, +1,74% e +1,84%. Quanto ao fundo de renda fixa, de médio risco, o
31 CEF IRF-M1+, também superou a meta atuarial, com rentabilidade em maio de +2,12%. Em relação
32 aos fundos de renda fixa, com carência, vencimentos em 2020, 2022 e 2024, da CEF, apresentaram
33 uma boa rentabilidade, sendo que somente o CAIXA FI BRASIL 2020IV, não atingiu a meta atuarial,
34 pois teve rentabilidade de +0,54%, enquanto os outros como CEF FI BRASIL 2020I, 2022I e 2024IV,
35 superaram a meta atuarial, apresentando as seguintes rentabilidades respectivas: +0,91%, +0,91% e
36 +2,39%. Acerca dos fundos de renda variável, da carteira, o ITAÚ FOF RPI Ações Ibovespa Ativo e o

Alfredo Tanos Filho

Erenildo Motta da Silva Júnior

Augusto Rômulo Fauaz de Andrade

Isabella Felix Viana

Rose Mary Gomes



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

37 Caixa Alocação Macro Multimercado (Taxa de Administração), ambos superaram a meta atuarial de
38 maio, com as rentabilidades respectivas de; + 1,01% e +1,96%. Já em relação ao acumulado do ano
39 (janeiro à maio), o fundo de maior rentabilidade da carteira é o FIDC Multisetorial Itália com
40 +743,44% , seguido pelo fundo de renda fixa, atrelado ao IMA-B, o BB PREVID. RF IMA-B TP, com
41 uma rentabilidade acumulada de +10,92%. Com relação ao **FIDC Multisetorial Itália**, apresentou a
42 pior rentabilidade no mês, fechando em -7,27%. No acumulado dos últimos doze meses apresentou
43 uma rentabilidade negativa de -27,80%. No acumulado do ano, apresentou rentabilidade positiva de
44 +743,44%. Foi resgatado até 31 de maio de 2019 o montante total de R\$ 7.779.365,24, cerca de
45 77,79%, do valor principal investido (R\$ 10.000.000,00). O saldo em 31 de maio de 2019 é de R\$
46 251.480,39 (duzentos e cinquenta e um mil, quatrocentos e oitenta reais e trinta e nove centavos). O,
47 Patrimônio Líquido do FIDC Multisetorial Itália, em 31 de maio de 2019, é de R\$ 6.900.321,47 (seis
48 milhões, novecentos mil, trezentos e vinte e um reais e quarenta e sete centavos). Além disso, em
49 relação ao rendimento, foi positivo em maio de 2019 de R\$ 15.115,77 (quinze mil, cento e quinze
50 reais e setenta e sete centavos). Em relação ao resultado, dos rendimentos no mês de maio de 2019,
51 da carteira de investimentos do Macaeprev, foi o melhor no ano com 44.826.319,84 (quarenta e
52 quatro milhões, oitocentos e vinte e seis mil, trezentos e dezenove reais e oitenta e quatro centavos),
53 sem o cupom de juros. No acumulado do ano (janeiro à maio), o rendimento está em R\$
54 140.140.167,74 (cento e quarenta milhões, cento e quarenta mil, cento e sessenta e sete reais e
55 setenta e quatro centavos). Em relação à **composição da carteira por classificação de risco**, ficou
56 assim no mês de maio/19: Baixo Risco 35,08%, Médio Risco 55,59% e 9,33% de Alto Risco. Com
57 relação à **alocação de recursos por Instituições Financeiras** em maio de 2019, a carteira do
58 Macaeprev ficou composta da seguinte maneira: Caixa Econômica Federal com R\$ 1.494.272.433,13
59 (51,95%), Banco do Brasil com R\$ 1.219.050.543,98 (42,38%), Itaú com R\$ 56.779.733,63 (1,97%),
60 Bradesco com R\$ 106.146.362,70 (3,69%) e BRL TRUST DTVM com R\$ 251.480,39 (0,01%). Com
61 isso, os recursos alocados em Bancos Oficiais Públicos são de: R\$ 2.713.322.977,11 (94,33%) e
62 Instituições Privadas de R\$ 163.177.576,72 (5,67%). Com relação à **alocação de recursos por**
63 **índices de referência**, em maio de 2019 ficou da seguinte maneira: Marcação na curva e a mercado
64 com carência, com vértice do BB, CEF e FIDC: R\$ 402.031.113,33 (13,98%) e sem carência, R\$
65 2.474.469.454,48 (86,02%), distribuído da seguinte forma: IRFM1: R\$ 167.299.295,77 (5,82%), IMA-
66 B: R\$ 235.279.253,95 (8,18%), IRF-M: R\$ 424.239.657,09 (14,75%), IMA GERAL: R\$
67 291.210.431,43 (10,12%), DI: R\$ 71.168.915,63 (2,47%), IMA-B5: R\$ 455.218.548,34 (15,83%),
68 IDKA2A: R\$ 527.996.073,54 (18,36%), IRFM1+:R\$ 269.033.568,62 (9,35%) e IBOVESPA ATIVO: R\$
69 23.023.696,13 (0,80%). O **Patrimônio Líquido do Macaeprev**, em 31 de maio de 2019 apresentou
70 novamente crescimento e fechou em R\$ 2.876.500.553,83 (dois bilhões, oitocentos e setenta e seis
71 milhões, quinhentos mil, quinhentos e cinquenta e três reais e oitenta e três centavos). II -

[Handwritten signatures and initials in blue ink]




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

- 72 **ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada, tendo a ata sido lida e
73 assinada por todos os membros presentes.


Alfredo Tanos Filho


Erenildo Motta da Silva Júnior

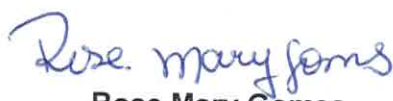

José Eduardo da Silva Guinâncio


Patric Alves de Vasconcellos


Augusto Rômulo Fauaz de Andrade


Isabella Felix Viana


Maria Auxiliadora de Moura Ferreira


Rose Mary Gomes

