
ATA DA 4ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS E RISCOS REALIZADA EM 31 DE OUTUBRO DE 2014

DATA, HORA E LOCAL: Às onze horas e quarenta e cinco minutos dos trinta e um dias do mês de outubro do ano de dois mil e catorze, na sala de reuniões da sede da Funpresp-Exe.

PRESENCAS: Presentes na reunião o Sr. Ricardo Pena Pinheiro, Presidente do Comitê de Investimentos e Riscos, e os demais membros do Comitê, Sr. Lício da Costa Raimundo, Sr. Tiago Nunes de Freitas Dahdah e Sr. Walmir Almeida Rodrigues. Presentes também na reunião a Sra. Eugênia Bossi Fraga, Diretora de Administração, os Srs. Felipe de Andrade Bezerra dos Santos Lima e Sr. Bruno Eurípedes de Moura, da Gerência de Análise e Operações Financeiras e a Sra. Fabiani Rozeng Moraes, do Gabinete da Presidência.

MESA: Presidiu a sessão o Presidente do Comitê de Investimentos e Riscos, Sr. Ricardo Pena Pinheiro, e o secretariou a Sra. Fabiani Rozeng Moraes.

ORDEM DO DIA: 1) Análise da carteira de Investimentos da Funpresp-Exe; 2) Propostas de alocação do fluxo de contribuições a serem recebidos em novembro/2014; 3) Informes: 3.1) Orientação ao gestor do BB Funpresp Fundo de Investimento Multimercado para venda de parte da sua carteira de renda variável.

INSTALAÇÃO: O Presidente instalou a reunião e declarou abertos os trabalhos do Comitê.

DELIBERAÇÕES: Item 1) O Sr. Tiago Nunes de Freitas Dahdah, Gerente de Análise e Operações Financeiras e o Sr. Walmir Almeida Rodrigues, Gerente de Planejamento e Controle de Investimentos, apresentam a posição consolidada, os enquadramentos, a composição, a rentabilidade e o nível de risco da carteira de investimentos, na posição de 29 de outubro de 2014, totalizando o montante de R\$ 105.059.195,52, dos quais: 8,2% estão investidos em títulos públicos MtM; 75,2 % em títulos públicos HtM; 6,5% em títulos privados de renda fixa; 6,2% em ações e 3,9% em ativos de liquidez imediata.


Item 2) O Sr. Tiago Nunes de Freitas Dahdah, Gerente de Análise e Operações Financeiras, apresenta ao Comitê proposta para alocação dos recursos de investimento do fluxo de contribuições a serem recebidos em novembro/2014.

RECOMENDAÇÃO Nº 02: O COMITÊ DE INVESTIMENTOS E RISCOS DA FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA COMPLEMENTAR DO SERVIDOR PÚBLICO FEDERAL DO PODER EXECUTIVO - FUNPESP-EXE, nos termos do artigo 57, incisos IV e XI do Regimento Interno da Fundação, recomenda à Diretoria Executiva que sugira aos gestores de cada um dos fundos de investimentos exclusivos da Funpresp-Exe que atinja R\$ 2.000.000,00 (dois milhões de reais) em ativos de liquidez imediata e com baixo risco de mercado.

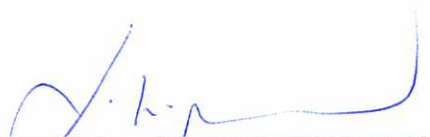
Item 3) 3.1) O Sr. Tiago Nunes de Freitas Dahdah, Gerente de Análise e Operações Financeiras, informa ao Comitê sobre a sugestão efetuada ao gestor do BB Funpresp Fundo de Investimento Multimercado (CNPJ.: 17.945.571/0001-00) para a liquidação de parte da carteira de renda

ATA DA 4ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS E RISCOS REALIZADA EM 31 DE OUTUBRO DE 2014

variável indexada ao índice IBrX. A análise financeira desenvolvida considerou o custo de oportunidade, o prêmio sobre risco e a meta atuarial, e demonstrou, ainda que temporalmente, a estratégia considerada adequada pela Entidade para a venda da carteira de renda variável desse fundo, especialmente em um contexto de curto prazo de contratação de novos gestores dos recursos garantidores. Sugere-se a recomendação ao gestor do BB Funpresp Fundo de Investimento Multimercado, o investimento de até R\$ 4.050.000,00 em Notas do Tesouro Nacional – série B com vencimentos igual ou superior a 2030, para classificação na categoria “títulos mantidos até o vencimento” (HtM) e conforme condições de mercado durante o leilão primário do dia 4 de novembro de 2014. **Extrapauta:** O Sr. Ricardo Pena Pinheiro, Presidente do Comitê de Investimentos e Riscos, solicita que seja incluída na pauta da próxima reunião do Comitê a proposta de procedimentos internos para análise e aprovação de projetos de investimentos em letra financeira (crédito privado) encaminhados pelos gestores dos fundos exclusivos dos quais a Funpresp-Exe é única cotista. **ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, o Sr. Ricardo Pena Pinheiro, Presidente do Comitê, considera encerrados os trabalhos, às 12h26min da qual é lavrada a presente ata, lida, discutida e assinada por todos os presentes. E, para constar, eu, Fabiani Rozeng Moraes, secretária da reunião, lavro e subscrevo esta Ata.



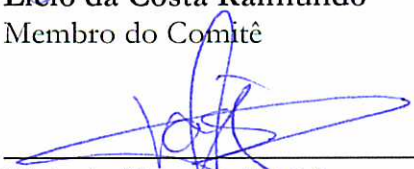
Ricardo Pena Pinheiro
Presidente



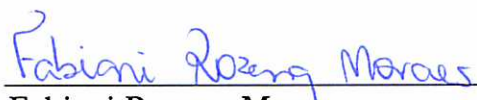
Lício da Costa Raimundo
Membro do Comitê



Tiago Nunes de Freitas Dahdah
Membro do Comitê



Walmir Almeida Rodrigues
Membro do Comitê



Fabiani Rozeng Moraes
Secretária da Reunião