
ATA DA 6ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS E RISCOS REALIZADA EM 27 DE JANEIRO DE 2015

DATA, HORA E LOCAL: Às dez horas e quarenta e nove minutos dos vinte e sete dias do mês de dezembro do ano de dois mil e quinze, na sala de reuniões da sede da Funpresp-Exe.

PRESENÇAS: Sr. Ricardo Pena Pinheiro, Presidente do Comitê de Investimentos e Riscos, e os demais membros do Comitê, Sr. Lício da Costa Raimundo e o Sr. Walmir Almeida Rodrigues. O Sr. Tiago Nunes de Freitas Dahdah, membro do Comitê de Investimentos e Riscos, encontra-se em férias. Presentes também na reunião a Sra. Ana Lúcia Ferreira dos Santos, Chefe de Gabinete, a Sra. Regina Célia Dias, Coordenadora de Análise e Operações Financeiras, os Srs. Felipe de Andrade Bezerra dos Santos Lima, Sr. Saulo Medeiros, e Sr. Alessandro Cocchieri Leite Chaves, da Gerência de Análise e Operações Financeiras, o Sr. Bruno Eurípedes de Moura, da Gerência de Planejamento e Controle de Investimentos 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: **Assuntos Deliberativos:** 1) Proposta de implementação da política de risco de mercado para a Funpresp-Exe; 2) Revisão da minuta de regulamento proposto aos prestadores de serviços de administração de carteiras de valores mobiliários e direitos – Concorrência 001/2014; 3) Alternativas de implantação da carteira (própria e terceirizada) de investimentos da Funpresp-Exe. **Assuntos Informativos:** 4) Análise da composição da carteira de investimentos da Funpresp-Exe; 5) Informes; **INSTALAÇÃO:** O Presidente instalou a reunião e declarou abertos os trabalhos do Comitê. **DELIBERAÇÕES:** **Assuntos Deliberativos:** Item 1) O Sr.

Walmir de Almeida Rodrigues, Gerente de Planejamento e Controle de Investimentos, apresenta ao Comitê de Investimentos e Riscos, proposta de segregação dos ativos financeiros, quando do cálculo de risco em títulos com marcação a mercado e mantidos até o vencimento, que possa subsidiar a ação da Gerência de Análise e Operações Financeiras, quando da extrapolação dos limites de risco de mercado consolidado, por segmento. **RECOMENDAÇÃO Nº 04:** O

COMITÊ DE INVESTIMENTOS E RISCOS DA FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA COMPLEMENTAR DO SERVIDOR PÚBLICO FEDERAL DO PODER EXECUTIVO - FUNPRESP-EXE, nos termos do artigo 57, incisos VII e X do Regimento Interno da Fundação, propõe à Diretoria Executiva que sejam segregados, para cálculo de risco, os ativos marcados a

ATA DA 6ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS E RISCOS REALIZADA EM 27 DE JANEIRO DE 2015

mercado dos ativos mantidos até o vencimento, nos termos da Resolução CGPC nº 04, de 30 de janeiro de 2002, e que apenas a métrica correspondente aos ativos marcados a mercado sejam computados para cumprimento do limite de risco a ser observado pela Entidade. **Item 2)** O Sr. Walmir Almeida Rodrigues, Gerente de Planejamento e Controle de Investimentos, apresenta ao Comitê de Investimentos e Riscos, a minuta do Regulamento do Fundo de Investimento Funpresp Multimercado. **RECOMENDAÇÃO Nº 05:** O COMITÊ DE INVESTIMENTOS E RISCOS DA FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA COMPLEMENTAR DO SERVIDOR PÚBLICO FEDERAL DO PODER EXECUTIVO - FUNPRESP-EXE, nos termos do artigo 57, incisos V e X do Regimento Interno da Fundação, aprova a minuta do Regulamento do Fundo de Investimento Funpresp Multimercado e recomenda que esta seja encaminhada à Diretoria Executiva para apreciação e deliberação. **Item 3)** O Sr. Walmir de Almeida Rodrigues, Gerente de Planejamento e Controle de Investimentos, apresenta ao Comitê de Investimentos e Riscos, alternativas de implantação da carteira de investimentos da Funpresp-Exe. **RECOMENDAÇÃO Nº 06:** O COMITÊ DE INVESTIMENTOS E RISCOS DA FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA COMPLEMENTAR DO SERVIDOR PÚBLICO FEDERAL DO PODER EXECUTIVO - FUNPRESP-EXE, nos termos do artigo 57, incisos IV e V do Regimento Interno da Fundação, aprova a proposta de alternativas de implementação da nova estrutura de fundos da Funpresp-Exe: **a)** Resgate dos valores financeiros, para a constituição de novos fundos; **b)** Resgate em Títulos e Valores Mobiliários para a constituição da carteira própria, com títulos mantidos até o vencimento; **c)** O resgate do Fundo de Investimento BB Funpresp não será total, pois as provisões de dividendos e Juros Sobre Capital Próprio não são líquidas, ficando neste fundo que seria incorporado a outro fundo de um dos gestores escolhidos pelo processo licitatório; e encaminha à Diretoria Executiva para apreciação e deliberação. **Assuntos Informativos: Item 4)** O Sr. Walmir Almeida Rodrigues, Gerente de Planejamento e Controle de Investimentos, e a Sra. Regina Célia Dias, Coordenadora de Operações Financeiras, apresenta a posição consolidada, os enquadramentos, a composição, a rentabilidade e o nível de risco da carteira de investimentos da Funpresp-Exe, na posição de 23 de janeiro de 2015, totalizando o montante de R\$ 121.402.089,82 (cento e vinte e um milhões,

ATA DA 6ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS E RISCOS REALIZADA EM 27 DE JANEIRO DE 2015

quatrocentos e dois mil, oitenta e nove reais e oitenta e dois centavos), dos quais: 5,59% estão investidos em títulos públicos MtM; 70,11 % em títulos públicos HtM; 5,7% em títulos privados de renda fixa; 5,1% em ações e 13,50% em ativos de liquidez imediata. **Item 5)** O Sr. Lício da Costa Raimundo, Diretor de Investimentos e Riscos, informa sobre o status da concorrência 0001/2014, o qual entrará na fase de abertura das propostas (preços), sendo que as instituições habilitadas tiveram a seguinte classificação na etapa técnica, em ordem decrescente: Banco do Brasil, Itaú, Bradesco, Caixa, Santander, BTG Pacutal, HSBC e Western Asset Management. **ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, o Sr. Ricardo Pena Pinheiro, Presidente do Comitê de Investimentos e Riscos, considera encerrados os trabalhos, às 12h57min 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



Walmir Almeida Rodrigues
Membro do Comitê



Fabiani Rozeng Moraes
Secretária da reunião