

ATA DA 7ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS E RISCOS REALIZADA EM 04 DE MARÇO DE 2015

DATA, HORA E LOCAL: Às dez horas e trinta e cinco minutos dos quatro dias do mês de março do ano de dois mil e quinze, na sala de reuniões da sede da Funpresp-Exe.

PRESENCAS: Sr. Ricardo Pena Pinheiro, Presidente do Comitê de Investimentos e Riscos, Sr. Tiago Nunes de Freitas Dahdah, Gerente de Análise e Operações Financeiras. Registra-se, na oportunidade, a desvinculação do Sr. Walmir de Almeida Rodrigues da Funpresp-Exe, assumindo a Gerência de Planejamento e Controle de Investimentos, o Sr. Decio Magno Andrade Stochiero, que passa a integrar a partir desta data, o Comitê de Investimentos e Riscos da Fundação. Presentes também na reunião a Sra. Ana Lúcia Ferreira dos Santos, Chefe de Gabinete, a Sra. Regina Célia Dias, Coordenadora de Operações Financeiras, o Sr. Bruno Eurípedes de Moura, o Sr. Saulo Medeiros e o Sr. Alessandro Cocchieri Leite Chaves, Analista 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 definição de rentabilidade bruta e líquida para compor o Relatório Anual; **Assuntos Informativos:** 2) Apresentação das ações pela Funpresp-Exe para executar as transferências dos ativos/recursos entre a gestão terceirizada e a gestão própria após a homologação do resultado da Concorrência nº 001/2014; 3) Apresentação das alterações necessárias à minuta de proposta de Regulamento a ser apresentada aos gestores selecionados pela Concorrência nº 001/2014. 4) Informes.

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

DELIBERAÇÕES: Item 1) O Sr. Decio Magno Andrade Stochiero, Gerente de Planejamento e Controle de Investimentos, apresenta proposta de definição de rentabilidade líquida e bruta alinhada aos conceitos do Sistema de Cotas dos Planos de Benefícios, para compor o Relatório Anual relativo ao exercício de 2014.

RECOMENDAÇÃO Nº 07: O COMITÊ DE INVESTIMENTOS E RISCOS DA FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA COMPLEMENTAR DO SERVIDOR PÚBLICO FEDERAL DO PODER EXECUTIVO - FUNPRES P-EXE, no uso de suas atribuições e nos termos do artigo 57, inciso XI do Regimento Interno da Fundação, e conforme previsto na Instrução Normativa nº 13/2014 e Resolução CGPC nº 18/2006, sugere à Diretoria Executiva a apreciação e aprovação da proposta de definição de rentabilidade líquida e bruta alinhada aos conceitos do Sistema de Cotas dos Planos de Benefícios, para composição do Relatório Anual relativo ao exercício de 2014, conforme documento anexo. **Item 2)** O Sr. Tiago Nunes de Freitas Dahdah, Gerente de Análise e Operações Financeiras, apresenta as ações a serem adotadas pela Funpresp-Exe para execução das transferências dos ativos/recursos entre a gestão terceirizada e a gestão própria após a homologação do resultado da Concorrência nº 001/2014, tendo sido definida a data de 04 de maio de 2015 como marco final para a transição das carteiras. **Item 3)** O Sr. Tiago Nunes de Freitas Dahdah, Gerente de Análise e Operações Financeiras e o Sr. Decio Magno Andrade Stochiero, Gerente de Planejamento e Controle de Investimentos,

ATA DA 7ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS E RISCOS REALIZADA EM 04 DE MARÇO DE 2015

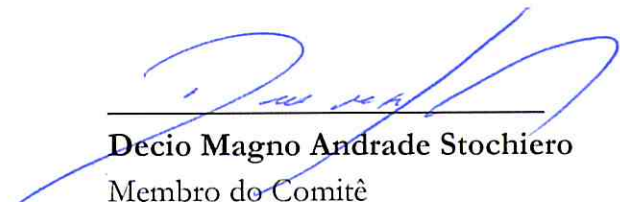
relatam ao Comitê as alterações necessárias à minuta de proposta de Regulamento a ser apresentada aos gestores selecionados pela Concorrência nº 001/2014: a) inclusão de dispositivo que trate da política de controle e operações com derivativos; b) inclusão de dispositivo que trate da política de direitos de subscrição; c) inclusão de cláusula do foro; d) inclusão da fórmula do cálculo da taxa de administração. **Item 4)** Os seguintes informes foram apresentados: **4.1)** O Sr. Ricardo Pena Pinheiro, Presidente do Comitê de Investimentos e Riscos, informa sobre a renúncia do Diretor de Investimentos, Sr. Lício da Costa Raimundo na data de 28 de fevereiro de 2014 e a distribuição das atividades da diretoria de Investimentos até que seja designado pelo Conselho Deliberativo o novo diretor de investimentos. Na oportunidade, foram delineadas, juntamente com a equipe de investimentos, os principais trabalhos da diretoria de investimentos para o ano de 2015: análise de perfis de investimentos, análise de *Asset Liability Management - ALM*, análise e estudo do portfólio de investimentos e análise do mercado de investimentos externos e sua aplicabilidade na Funpresp-Exe. **4.2)** O Sr. Bruno Eurípedes de Moura, Analista de Investimentos, 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 27 de fevereiro de 2015, totalizando o montante de R\$ 127.241.953,30 (cento e vinte e sete milhões, duzentos e quarenta e um mil, novecentos e cinquenta e três reais e trinta centavos), dos quais: 5,4% estão investidos em títulos públicos MtM; 66,4% em títulos públicos HtM; 5,5% em títulos privados de renda fixa e 22,8% em ativos de liquidez imediata. **ENCERRAMENTO:** Nada mais havendo a tratar, o Sr. Ricardo Pena Pinheiro, Presidente do Comitê de Investimentos e Riscos, considera encerrados os trabalhos, às 12h17min 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.



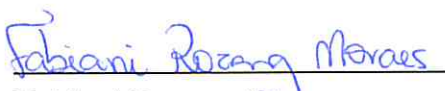
Ricardo Pena Pinheiro
Presidente



Tiago Nunes de Freitas Dahdah
Membro do Comitê



Decio Magno Andrade Stochiero
Membro do Comitê



Fabiani Rozeng Moraes
Secretária da Reunião