

AMAPÁ PREVIDÊNCIA



luan ei uflamato

ÍNDICE

1.	DEFINIÇÃO E OBJETIVO	2
2.	DA COMPOSIÇÃO	2
3.	DOS MEMBROS	2
3.1.	DA QUALIFICAÇÃO	2
3.2.	DO MANDATO	2
3.3.	DA PERDA DO MANDATO.....	3
4.	DA COMPETÊNCIA.....	3
5.	DAS RESPONSABILIDADES.....	4
6.	DO COORDENADOR	5
7.	DO SECRETÁRIO	6
8.	DAS REUNIÕES	6
9.	MANUTENÇÃO E MONITORAMENTO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS	7
10.	EXIGÊNCIAS PARA CREDENCIAMENTO E CADASTRO DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS	8
11.	DISPOSIÇÕES GERAIS	8

REGULAMENTO DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DA AMAPÁ PREVIDÊNCIA - AMPREV

1. DEFINIÇÃO E OBJETIVO:

O Comitê de Investimentos da Amapá Previdência - CIAP tem como finalidade assessorar o Conselho Estadual de Previdência - CEP no processo de Gestão de recursos, bem como ao Diretor-Presidente do ponto de vista técnico no que tange aos investimentos e distribuição dos fluxos de recursos financeiros administrados por terceiros, em conformidade com a Política de Investimentos.

2. DA COMPOSIÇÃO:

O Comitê de Investimentos será composto por 05 (cinco) membros assim distribuídos:

- 01 (um) membro da Diretoria Executiva da AMPREV;
- 01 (um) membro do quadro de servidores da AMPREV;
- 03 (três) membros do Conselho Estadual de Previdência.

3. DOS MEMBROS:

Os membros do CIAP serão investidos nos seus mandatos após indicação e aprovação dos seus respectivos nomes pelo Conselho Estadual de Previdência.

O Diretor-Presidente indicará o membro da Diretoria Executiva e o membro entre os servidores da AMPREV.

Os membros representantes do Conselho Estadual de Previdência serão escolhidos na primeira sessão ordinária pelos Conselheiros do CEP, por meio de votação aberta.

Os membros indicados deverão preencher os pré-requisitos definidos no subitem **3.1 - Da Qualificação**.

3.1. DA QUALIFICAÇÃO:

Os membros do CIAP deverão possuir qualificação em gestão financeira devidamente comprovada, tendo preferência os possuidores de formação nas áreas econômica, financeira, contábil, administrativa ou certificação compatível com o disposto no art. 2º, da Portaria MPS nº 155, de 15 de maio de 2008.

3.2. DO MANDATO:

Os membros do CIAP terão mandato de 02 (dois) anos, podendo ser reconduzidos por igual período, desde que aprovado pelo Conselho Estadual de Previdência.

3.3. DA PERDA DO MANDATO:

Perderá o mandato o membro do CIAP que deixar de comparecer a 03 (três) reuniões consecutivas, ou a 05 (cinco) reuniões alternadas, sem motivo justificado.

4. DA COMPETÊNCIA:

- a) Elaborar e submeter ao Conselho Estadual de Previdência, mensalmente, relatório circunstanciado de todas as operações efetuadas no mês anterior, relatório este que subsidiará o Relatório de Gestão da AMPREV;
- b) Elaborar e aperfeiçoar o Plano de Aplicações e Investimentos da AMPREV, para cada exercício, encaminhando para conhecimento do Conselho Estadual de Previdência;
- c) Assessorar a Diretoria Executiva quanto às Aplicações dos Recursos Previdenciários, de acordo com a Política de Investimentos;
- d) Analisar os cenários macroeconômicos, político e as avaliações de especialistas acerca dos principais mercados, propondo ao Diretor Presidente as estratégias de investimentos e quaisquer movimentações de recursos para um determinado período e reavaliando-as em decorrência da previsão ou ocorrência de fatos conjunturais relevantes que venham, direta ou indiretamente, influenciar os mercados financeiros e de capitais;
- e) Monitorar os investimentos, em consonância com as regras do Ministério da Previdência Social, Comissão de Valores Mobiliários e Banco Central do Brasil, cuidando para o efetivo cumprimento dos prazos estabelecidos;
- f) Analisar os resultados da carteira de investimentos da AMPREV;
- g) Identificar, por meio de seus membros, as divergências porventura existentes na operacionalização dos investimentos previdenciários, registrando o assunto em ata e sinalizando o Diretor-Presidente, imediatamente;
- h) Sugerir, quando necessário, alterações na Política de Investimentos para os procedimentos quer sejam inclusões ou exclusões, para maior segurança dos

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

investimentos;

- i) Pronunciar-se sobre qualquer assunto referente às aplicações;
- j) Avaliar os critérios de operacionalização dos investimentos e de todas as atividades desenvolvidas, no sentido de identificar as falhas e apresentar proposições de melhorias buscando a excelência;
- k) Autorizar a presença nas reuniões de outros colaboradores que possam contribuir para análise dos assuntos em pauta, estando esses cientes da confidencialidade e sigilo dos assuntos tratados;
- l) Apresentar sugestões de investimentos balizadas em avaliações técnicas de produtos de investimentos no mercado financeiro;
- m) Compete ao CIAP normatizar tabela de pontuação dos itens que estabelecem a seleção e qualificação dos administradores/gestores;
- n) Executar outras atribuições no âmbito dos objetivos definidos para atuação do CIAP.

5. DAS RESPONSABILIDADES:

- a) Elaborar e coordenar o processo seletivo para credenciamento das Instituições Financeiras para gestão dos recursos do AMPREV;
- b) Exigir das Instituições Financeiras, no mínimo mensalmente, relatório detalhado contendo informações sobre rentabilidade e risco das aplicações;
- c) Realizar avaliação do desempenho das aplicações efetuadas por entidade credenciada, no mínimo trimestralmente, adotando, de forma tempestiva, medidas cabíveis, caso seja constatada desempenho insatisfatório;
- d) Zelar pela promoção de elevados padrões éticos na condução das operações relativas às aplicações dos recursos operados pelo Regime Próprio de Previdência Social, bem como pela eficiência dos procedimentos técnicos, operacionais e de controle de seus investimentos;
- e) Elaborar relatórios trimestrais detalhados, até 30 (trinta) dias da data base, demonstrando rentabilidade e risco das diversas modalidades de operações realizadas pelo Regime Próprio de Previdência Social com títulos, valores mobiliários e demais ativos alocados nos segmentos de renda fixa, renda variável e imóvel;

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

- f) Acompanhar e avaliar a performance das Instituições Financeiras credenciadas para realizar operações de compra e venda de títulos e valores mobiliários;
- g) Acompanhar o processo de contratação de agente custodiante registrado na Comissão de Valores Mobiliários para o exercício da atividade de custódia de valores mobiliários, para atuar como agente custodiante e responsável pelos fluxos de pagamentos e recebimentos relativos às operações realizadas no âmbito dos Segmentos de Renda Fixa e de Renda Variável;
- h) Organizar o arquivo físico e eletrônico das atas, relatórios e demais documentos do CIAP, mantendo-os sob guarda e segurança do Secretário do CIAP;
- i) Providenciar a encadernação das Atas do CIAP em livros padronizados, com termo de abertura e encerramento, mantendo-os sob guarda e segurança do Secretário do CIAP;
- j) Acompanhar e avaliar a performance dos fundos de investimentos nos Segmentos de Renda Fixa e de Renda Variável, com publicação dos 05 (cinco) melhores posicionados;
- k) Os membros do CIAP deverão manter confidencialidade e sigilo sobre os assuntos relativos às aplicações financeiras tratados nas reuniões.

6. DO COORDENADOR:

O coordenador do CIAP será eleito para o mandato de 01 (um) ano, em votação simples, direta e aberta pelos membros do CIAP, na primeira reunião ordinária, podendo ser reeleito por igual período.

As principais atribuições do Coordenador são:

- a) Representar o CIAP no que couber, atendo a Política de Investimentos e a este Regulamento;
- b) Coordenar a elaboração da Política de Investimentos;
- c) Coordenar o planejamento e a elaboração da pauta da reunião;
- d) Convocar, sempre que se fizer necessário os membros do CIAP para definir a estratégia de aplicações;
- e) Coordenar as atividades do CIAP, bem como convocar e presidir as reuniões ordinárias e

reuniões extraordinárias a qualquer data, marcadas pelo menos com 24 (vinte e quatro) horas de antecedência;

- f) Dirigir, orientar e encaminhar os debates relacionados aos assuntos submetidos ao CIAP garantindo que a discussão e decisão sobre os temas em pauta ocorram na forma dos objetivos organizacionais definidos neste Regulamento;
- g) Designar, se for o caso, relator para elaborar estudos em assunto submetido à apreciação do CIAP;
- h) Determinar ao secretário o registro de todos os assuntos discutidos e analisados pelo CIAP;
- i) Representar o CIAP quando assim se fizer necessário.

7. DO SECRETÁRIO:

O Secretário do CIAP será o mesmo do CEP, tendo como as principais atribuições:

- a) Auxiliar o Coordenador nas reuniões ordinárias e extraordinárias;
- b) Elaborar o calendário anual de reuniões do CIAP em conjunto com o Coordenador;
- c) Elaborar a pauta das reuniões em conjunto com o Coordenador;
- d) Elaborar a ata das reuniões ordinárias e extraordinárias, de forma tempestiva;
- e) Zelar pelo arquivo da documentação e processos que envolvem o Plano de Aplicações e Investimentos e outros que se relacionam com o CIAP;
- f) Coletar a justificativa do membro ausente.

8. DAS REUNIÕES:

O CIAP se reunirá:

- a) Ordinariamente, nos dias 15 (quinze) e 28 (vinte e oito) de cada mês, ou no primeiro dia útil anterior ao dia determinado, às 15h30m (quinze horas e trinta minutos), na sede da AMPREV, para analisar cenários e discutir proposta(s) de investimento(s) apresentada(s) pela Diretoria Financeira Atuarial ou pelos membros do CIAP.
- b) Extraordinariamente, quando convocado pela Presidência, Diretoria Financeira Atuarial ou

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

membros do CIAP, para analisar propostas apresentadas por representantes de Instituições Financeiras e situações inerentes ao mercado financeiro.

Os pareceres serão tomados por maioria simples de votos, fixado em 03 (três) o quorum mínimo para a realização das reuniões.

Os avisos de convocação serão feitos pelo Secretário do CIAP com distribuição da pauta dos assuntos a serem abordados na referida reunião;

Das reuniões do CIAP, serão obrigatoriamente, elaboradas Atas a serem encaminhadas para conhecimento do CEP, das quais deverão constar:

- Data, hora e local da realização da reunião;
- Registro nominal dos membros presentes e demais participantes, quando houver;
- Solicitação de informações e esclarecimentos;
- Registros das sugestões;
- Relatos dos assuntos discutidos, inclusive com as sugestões daqueles que não apresentaram entendimento único e dependem de estudo mais aprofundados;
- Outras matérias inseridas pelo coordenador do CIAP;
- Data de convocação da próxima reunião;
- Quando matéria de excepcional relevância exigir apreciação urgente, o Coordenador, ou os membros poderão propor a sua inclusão em pauta e, se aprovada a proposta, a matéria será apreciada na mesma reunião;
- As deliberações, respeitadas as alçadas do CIAP;
- Registrar os votos discordantes e, em havendo consenso, registrar a aprovação por unanimidade dos votos.

9. MANUTENÇÃO E MONITORAMENTO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS:

Compete ainda ao CIAP, na manutenção e monitoramento da Política de Investimentos:

- a) A alocação de recursos entre os segmentos de renda fixa, renda variável, imóveis, ou outra modalidade instituída;
- b) Aos objetivos específicos da gestão de cada limite estabelecido na Política de Investimentos da AMPREV;
- c) Aos limites utilizados para investimentos em títulos e valores mobiliários de emissão e/ou coobrigação de uma mesma pessoa jurídica;

- d) Aos limites de valor em risco (VaR) a serem praticados nas carteiras integrantes dos segmentos de renda fixa e renda variável, bem como, analisar a política de administração de risco de mercado (volatilidades, correlações, VaR, **backtest**, **stresstest**). Como é realizado o processo de atualização da base de dados;
- e) Analisar a metodologia de risco de crédito (créditos corporativos e Instituições Financeiras) e política de concentração de papéis (prazos, percentual de emissão, setores que não operam política de alçadas, membros do comitê, existência de *rating* interno, frequência da revisão dos limites e quem faz a verificação desses limites);
- f) Analisar a política de “**chinese wall**” (separação de recursos próprios das instituições financeiras e a administração de recursos de terceiros);
- g) Analisar a metodologia utilizada para a valorização dos ativos de renda fixa e variável (quem faz a precificação);

10. EXIGÊNCIAS PARA CREDENCIAMENTO E CADASTRO DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS:

O CIAP, para o credenciamento e cadastro, deverá analisar, dentre outros aspectos:

- Razão Social;
- Grupo Controlador (quando for o caso);
- Demonstrativos financeiros das instituições financeiras que administraram recursos de terceiros - 02 (dois) últimos exercícios;
- Serviços adicionais à gestão oferecidos pela instituição financeira;
- Breve histórico, contendo os principais eventos da **Asset Management** e instituição financeira;
- Qualificação do Administrador - Ato Declaratório CVM;
- Qualificação do Gestor - Ato Declaratório CVM;
- Relatórios de *rating* (**Asset Management** e da instituição financeira);
- Montante de recursos administrado pelo Gestor. Montante de recursos administrado por segmento (FIF, FAC, FIA, Carteiras, etc.);
- Estrutura Organizacional - Organograma interno da **Asset Management**,
- **Curriculum Vitae** (funcionários envolvidos diretamente no processo de decisões e na execução da estratégia);
- Existência de políticas e procedimentos internos formalizados (**compliance**);

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

→ Governança Corporativa.

O CIAP adotará procedimentos para credenciamento e normas para seleção de instituições financeiras gestoras, instrumento este que deverá ser encaminhado ao Conselho Estadual de Previdência para apreciação e aprovação, devendo ainda ser publicado no Diário Oficial do Estado e encaminhado as instituições financeiras.

11. DISPOSIÇÕES GERAIS:

Os limites para alocação de recursos nos diversos segmentos e por Instituição Financeira deverão ser analisados, propostos e revistos, sempre que necessário, em cada reunião do CIAP, obedecendo, dentre outros requisitos, as recomendações deste regulamento.

Por motivo de força maior o CIAP não poder se reunir, o Diretor-Presidente realizará as aplicações com base no Plano de Aplicação e o estabelecido na Política de Investimentos.

Os casos omissos serão apreciados e deliberados pelo CIAP, obedecendo as regras dispostas na Política de Investimentos.

Este Regulamento deverá ser encaminhado ao Conselho Estadual de Previdência para conhecimento e homologação.

Macapá-AP, 11 de março de 2009



JOSÉ BERNARDINO DIAS JÚNIOR
Coordenador

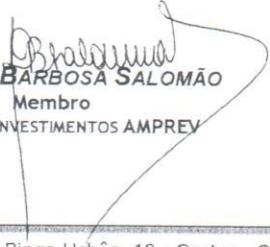
COMITÊ DE INVESTIMENTOS AMPREV



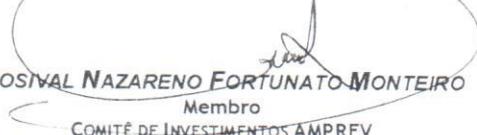
FRANCICLEIDE MARINHO LIMA
Membro
COMITÊ DE INVESTIMENTOS AMPREV



ANTÔNIO MÁRCIO DE SOUZA PELAES
Membro
COMITÊ DE INVESTIMENTOS AMPREV



DAMILTON BARBOSA SALOMÃO
Membro
COMITÊ DE INVESTIMENTOS AMPREV



ROSVIAL NAZARENO FORTUNATO MONTEIRO
Membro
COMITÊ DE INVESTIMENTOS AMPREV