

Regimento Interno do Comitê de Alocação de Ativos CAA

 
Fundação Eletrobrás de Seguridade Social - ELETROS

Rua Uruguaiana, 174 - 5º, 6º e 7º andares
Rio de Janeiro - Brasil - CEP 20050 092
Tel: (21) 2179 4700 - www.eletros.com.br

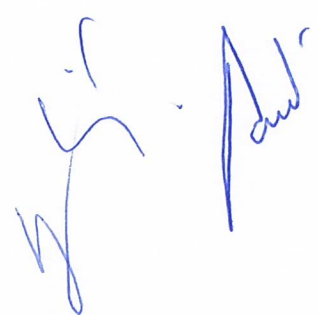
REGIMENTO INTERNO DO COMITÊ DE ALOCAÇÃO DE ATIVOS - CAA

EDIÇÃO: 2	DATA DA EDIÇÃO: 26/10/2017	VIGÊNCIA: 27/10/17 a 26/10/2019	APROVAÇÃO: 955ª Reunião da DEE	DATA DA APROVAÇÃO: 26/10/2017	REFERÊNCIA: NR-DF 9	CLASSIFICAÇÃO DA INFORMAÇÃO: PÚBLICA	PÁGINA 2 de 5
--------------	----------------------------------	---------------------------------------	--------------------------------------	-------------------------------------	------------------------	--	------------------

SUMÁRIO

1. OBJETO	3
2. ATUAÇÃO	3
3. COMPOSIÇÃO	3
4. FUNCIONAMENTO	3
5. SUBSTITUIÇÃO	4
6. COMPETÊNCIA.....	5
7 REFERÊNCIAS.....	5

jsmt



REGIMENTO INTERNO DO COMITÊ DE ALOCAÇÃO DE ATIVOS - CAA

EDIÇÃO: 2	DATA DA EDIÇÃO: 26/10/2017	VIGÊNCIA: 27/10/17 a 26/10/2019	APROVAÇÃO: 955ª Reunião da DEE	DATA DA APROVAÇÃO: 26/10/2017	REFERÊNCIA: NR-DF 9	CLASSIFICAÇÃO DA INFORMAÇÃO: PÚBLICA	PÁGINA 3 de 5
--------------	----------------------------------	---------------------------------------	--------------------------------------	-------------------------------------	------------------------	--	------------------

OBJETO

Art. 1º Este Regimento Interno disciplina o funcionamento do Comitê de Alocação de Ativos – CAA.

ATUAÇÃO

Art. 2º O CAA é um comitê de assessoramento da Diretoria Financeira, responsável por analisar, recomendar e submeter ao Comitê Executivo de Investimentos (CEI) as propostas de alocação entre os segmentos e modalidades de investimento, as quais devem estar em conformidade com a legislação e normativos internos.

Art. 3º O Código de Conduta Ética da ELETROS deve nortear os membros do CAA no exercício do direito de voto, de modo a assegurar a defesa dos interesses dos planos administrados pela ELETROS.

COMPOSIÇÃO

Art. 4º O CAA será composto por 5 (cinco) membros.

§ 1º O Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado - AETQ será membro permanente.

§ 2º Os demais membros serão propostos pelo Diretor Financeiro e designados, nominalmente, pela Diretoria Executiva da ELETROS – DEE, aprovados por unanimidade.

§ 3º A DEE poderá destituir qualquer um dos membros designados do CAA, a qualquer tempo.

Art. 5º Todos os membros designados do CAA devem possuir certificação em conformidade com a legislação.

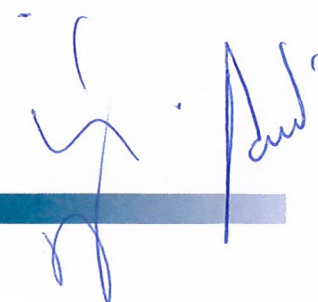
FUNCIONAMENTO

Art. 6º O Coordenador do CAA será o AETQ.

Art. 7º Participarão das reuniões, os membros do CAA e o Secretário da reunião.

§ 1º O Coordenador poderá convocar colaborador da ELETROS, exclusivamente, para prestar esclarecimentos ou informações sobre as matérias em apreciação.

§ 2º Poderão participar das reuniões, sem direito a voto, outros colaboradores da Gestão de Investimentos - GIN, Assessoria de Alocação de Ativos - AAL, Assessoria de Novos Negócios - ANN e Gestão de Controle de Investimentos - GCI.



REGIMENTO INTERNO DO COMITÊ DE ALOCAÇÃO DE ATIVOS - CAA

EDIÇÃO: 2	DATA DA EDIÇÃO: 26/10/2017	VIGÊNCIA: 27/10/17 a 26/10/2019	APROVAÇÃO: 955ª Reunião da DEE	DATA DA APROVAÇÃO: 26/10/2017	REFERÊNCIA: NR-DF 9	CLASSIFICAÇÃO DA INFORMAÇÃO: PÚBLICA	PÁGINA 4 de 5
--------------	----------------------------------	---------------------------------------	--------------------------------------	-------------------------------------	------------------------	--	------------------

Art. 8º As reuniões serão registradas em ata, que será assinada por todos os presentes da reunião. As atas registrarão, minimamente, todas as decisões, recomendações com responsáveis e prazos, registro do voto de cada membro e abstenção de votos por conflitos de interesses, se for o caso, bem como a natureza e a extensão de tal fato.

Parágrafo Único. As atas assinadas das reuniões do CAA devem ser tempestivamente apresentadas ao CEI pela GCI.

Art. 9º O Secretário da reunião será um colaborador da Gestão de Controle de Investimentos – GCI.

Art. 10º O quórum mínimo para a realização das reuniões é de 3 (três) membros.

Art. 11º As reuniões não serão realizadas sem a participação do Coordenador e do Secretário.

Art. 12º A periodicidade das reuniões será determinada de forma a garantir a efetividade da administração dos investimentos.

Parágrafo Único. As reuniões serão propostas pela GCI e aprovadas pelo Coordenador.

Art. 13º O membro que tenha efetivo ou potencial conflito de interesse em determinada matéria, abster-se-á de votar.

Art. 14º As propostas analisadas pelo CAA serão encaminhadas ao CEI por aprovação da maioria simples definida por votação, cabendo ao AETQ o voto de qualidade.

§ 1º As propostas serão encaminhadas pelos responsáveis à GCI, através de Nota Técnica, em tempo hábil para verificação da conformidade com a legislação e normativos internos.

§ 2º No caso de Nota Técnica de autoria de técnicos das áreas de investimentos, esta deve ser revisada pelo responsável pela área, só sendo encaminhada ao CEI após a sua concordância.

§ 3º No caso de Nota Técnica cujo autor é apenas o responsável pela área, esta deve ser revisada por profissional de mesmo nível hierárquico ou superior, compreendendo a conferência de valores, correções de texto, formatação, conformidade com este Regimento e outros aspectos, não significando concordância com o inteiro teor e/ou com a recomendação contida no documento.

SUBSTITUIÇÃO

Art. 15º Na ausência ou impedimento temporário do Coordenador, este deverá, formalmente, delegar poderes para um membro da DEE, por quem suas funções serão exercidas interinamente.

Art. 16º É vedada a substituição dos membros designados com direito a voto. Na hipótese de ausência ou impedimento temporário, o CAA deverá funcionar com os demais, desde que respeitado o número mínimo de membros.

REGIMENTO INTERNO DO COMITÊ DE ALOCAÇÃO DE ATIVOS - CAA

EDIÇÃO: 2	DATA DA EDIÇÃO: 26/10/2017	VIGÊNCIA: 27/10/17 a 26/10/2019	APROVAÇÃO: 955ª Reunião da DEE	DATA DA APROVAÇÃO: 26/10/2017	REFERÊNCIA: NR-DF 9	CLASSIFICAÇÃO DA INFORMAÇÃO: PÚBLICA	PÁGINA 5 de 5
--------------	----------------------------------	---------------------------------------	--------------------------------------	-------------------------------------	------------------------	--	------------------

COMPETÊNCIA

Art. 17 Compete ao CAA:

- I. Analisar o cenário macroeconômico elaborado pela AAL;
- II. Avaliar as projeções de retorno e de risco de mercado elaboradas pela AAL para o patrimônio, os segmentos e as modalidades de investimentos;
- III. Simular a rentabilidade dos planos da ELETROS e as respectivas probabilidades de atingimento de metas;
- IV. Analisar as propostas de alocação entre os segmentos e as modalidades de investimentos elaboradas pela AAL, incluindo as que integrarão a política de investimento;
- V. Analisar proposta da AAL de alocação dos investimentos com base na análise crítica das recomendações apresentadas no estudo *Asset Liability Management* – ALM.

REFERÊNCIAS

- I. Resolução CNPC nº 19, de 30 de março de 2015;
- II. Resolução CNPC nº 21, de 18 de junho de 2015;
- III. Código de Autorregulação em Governança de Investimentos da Abrapp;
- IV. Norma de Riscos de Investimentos;
- V. Regimento Interno do Comitê Executivo de Investimentos – CEI.
- VI. Regimento Interno do Comitê Gestor de Carteiras – CGC.