Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social - CEIPS

Ata da 09ª Reunião Extraordinária do Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social - CEIPS, realizada no dia 07 de março de 2022.

Aos sete (07) dias do mês de março de 2022, às 10:00h, no Ambiente Virtual fornecido pelo *software* G*oogle Meet*, reuniram-se os membros do Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social - CEIPS: **João Marcos Maia** (Membro Titular - Presidente da Cearaprev), **Paulo Sucupira** (Membro Titular - Assessor de Gestão de Investimentos da Cearaprev), **Isaac Figueiredo Sousa** (Membro Titular - Assessor de Previdência e Atuária da Cearaprev), **Átila Einstein de Oliveira** (Membro Titular - Servidor Vinculado ao SUPSEC) e **Sérgio Bastos** (Membro Suplente do Presidente da Cearaprev). Como convidados, **Bruno Maia, Douglas Corrêa, Fábio Dias, Clécio Thomaz**, **Carlos Artur, Ronialison Fernandes, Izabel Cristina** e **Larissa Késia**. A reunião foi gravada pelo ambiente virtual e encontra-se mantida no servidor interno da Cearaprev. A pauta constou dos seguintes assuntos: **Item 1: Apresentação do ALM (Asset Liability Management); Item 2: Proposta de Alocação – Títulos Públicos; Item 3: Credenciamento da XP Investimentos como Distribuidora**. As principais deliberações da Ata foram: **1: O professor Fábio Dias apresentou o ALM (Asset Liability Management), que vem a ser mais uma funcionalidade a ser integrada ao sistema S-GOLD, com o objetivo de auxiliar a elaboração da Política de Investimentos, compatibilizando a relação entre ativos e passivos da carteira previdenciária; 2: Com a abertura contínua de prêmios das NTN-Bs, em especial aquelas com vencimento médio e longo, e ainda, considerando que, para o ano em curso a SPREV limitou a meta atuarial para uma taxa real de 5,04%, a estratégia de compra direta de NTN-Bs, respaldada por um estudo de ALM, para carregamento até o vencimento, pode auxiliar numa "ancoragem de**

rentabilidade" para o atingimento da meta atuarial do RPPS, bem como contribuir, proporcionalmente, para uma redução da volatilidade global da carteira de investimentos do Fundo PREVID (imunização da carteira), devido ao benefício da "marcação na curva" do preço desses ativos. Diante do exposto e buscando o atingimento da Meta Atuarial, o cumprimento da Política de Investimentos e de posse do estudo de ALM (Asset Liability Management), ficou estabelecido a destinação de 40% dos recursos da carteira do Fundo Previdenciário PREVID para a aquisição de Títulos Públicos Federais (NTN-Bs) marcados na curva, proposto pelo estudo de ALM, com os seguintes vencimentos: 2032 - 10 mil Títulos, 2035 - 20 mil Títulos, 2045 - 10 mil Títulos, 2050 - 20 mil Títulos, 2055 - 20 mil Título e 2060 - 20 mil Títulos. Também ficou estabelecido, que a compra seria realizada somente no mercado primário, ou seja, aquisição de Títulos nos leilões do Tesouro Nacional, programados para os dias 15, 22 e 29 de março, conforme calendário do Tesouro Nacional. Diante desse critério estabelecido, observou-se que os papéis com vencimento para os anos de 2050 e 2055 não estavam disponíveis nos leilões do referido mês. Sendo assim, o Membro Titular Isaac Figueiredo Sousa propôs alocar os volumes previstos em 2050 para 2045, bem como os volumes previstos em 2055 para 2060, proposta aceita pelos demais membros do Comitê, totalizando a aquisição de 100 mil NTN-Bs, configurada da seguinte forma: leilão 15/03/2022 - 20 mil NTN-Bs 2035 e 20 mil NTN-Bs 2060, leilão 22/03/2022 - 10 mil NTN-Bs 2032 e 30 mil NTN-Bs 2045 e por fim, o leilão do dia 29/03/2022 - 20 mil NTN-Bs 2060. Os recursos para a compra dos Títulos serão oriundos das aplicações em renda fixa, conforme proposta de alocação 01 apresentada pela Diretoria de Gestão de Investimentos, discutida e acatada pelo Comitê de Investimentos, com o resgate total dos Fundos BRADESCO FI RF IDKA PRE 2, BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI, BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2, BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI, CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF FIC FI e FI CAIXA BRASIL IRF-M TP RF LP, assim como o resgate parcial de R$ 85 milhões do Fundo CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP, R$ 22 milhões do Fundo CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP, R$ 28 milhões do Fundo FI BRASIL REFERENCIADO DI LP e por fim, a diferença para completar o montante de recursos necessários para a aquisição dos Títulos, será oriunda do Fundo FI BRASIL IRFM 1. Os resgates serão realizados em valores aproximados aos volumes dos Títulos Públicos a serem adquiridos nas três compras. Conforme havia sido aprovado pelo Comitê de Investimento na 7ª Reunião Extraordinária, realizada no dia 05 de novembro de 2021 e ratificada nesta reunião, os recursos aplicados no Fundo Bradesco FI RF IDKA PRÉ 2 foram resgatados para compra de Títulos Públicos, devido ao seu baixo desempenho. Ficou definido que para cada leilão previsto pelo Tesouro Nacional, cujas datas já foram citadas anteriormente, os recursos correspondentes, serão transferidos, previamente, para a entidade custodiante (BTG PACTUAL) responsável pela negociação dos títulos com o Tesouro Nacional, ficando aplicados no Fundo BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF

REF DI, com o objetivo de otimizar a operacionalização de compra dos Títulos Públicos; 3: Credenciamento da XP Investimentos aprovado por unanimidade.

Fortaleza, 07 de março de 2022.

JOAO MARCOS MAIA:06096468349
Assinado de forma digital por JOAO MARCOS MAIA:06096468349
Dados: 2022.05.11 10:39:24 -03'00'

JOÃO MARCOS MAIA
Membro Titular - Presidente da Cearaprev

PAULO AMILCAR PROENCA SUCUPIRA:10246398353
Assinado de forma digital por PAULO AMILCAR PROENCA SUCUPIRA:10246398353
Dados: 2022.04.13 15:35:51 -03'00'

PAULO AMILCAR SUCUPIRA
Membro Titular - Assessor de Gestão de Investimentos da CEARAPREV

ISAAC FIGUEIREDO DE SOUSA:78362938315
Assinado de forma digital por ISAAC FIGUEIREDO DE SOUSA:78362938315
Dados: 2022.04.18 13:57:37 -03'00'

ISAAC FIGUEIREDO SOUSA
Membro Titular - Assessor de Previdência e Atuária da Cearaprev

ATILA EINSTEIN DE OLIVEIRA:42264413387
Assinado de forma digital por ATILA EINSTEIN DE OLIVEIRA:42264413387
Dados: 2022.04.18 12:49:15 -03'00'

ÁTILA EINSTEIN DE OLIVEIRA
Membro Titular - Servidor Vinculado ao SUPSEC