Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social - CEIPS

Ata da 11ª Reunião Extraordinária do Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social - CEIPS, realizada no dia 11 de dezembro de 2023.

Dia onze (11) do mês de dezembro de 2023, às 15:00h, no Ambiente Virtual fornecido pelo *software Google Meet*, reuniram-se os membros do Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social - CEIPS: **Sérgio Bastos de Castro** (Membro Suplente do Presidente da Cearaprev), **Paulo Amilcar Proença Sucupira** (Membro Titular - Diretor de Gestão de Investimentos da Cearaprev), **Andréa Kelly Silva Duarte** (Membra Suplente do Representante da Cearaprev), **Takeshi Cardoso Koshima** (Membro Suplente do Representante da Sefaz) e **Denilson de Oliveira Adriano** (Membro Titular Representante do SUPSEC). Como convidados, **Adriano Pinheiro dos Santos** (Diretor de Desenvolvimento Institucional e Governança da Cearaprev), **Oscar Saldanha do Nascimento** (Diretor Administrativo-Financeiro da Cearaprev), **Ronialison Fernandes Queiroz** (Diretoria de Gestão de Investimentos), **Larissa Késia Pontes Mendonça** (Diretoria de Gestão de Investimentos) e **Silvino Rhaynne Ferreira de Vasconcelos** (Diretoria de Gestão de Investimentos). **A reunião foi gravada pelo ambiente virtual e encontra-se mantida nos arquivos da Cearaprev que estão na nuvem do Google Drive**. Devido à ausência justificada do membro Titular e Presidente da Cearaprev, Sr. José Juarez, os trabalhos foram iniciados pelo Suplente da Presidência da Cearaprev, Sr. Sérgio Bastos. Ele cumprimentou os participantes e expressou agradecimento pela presença de todos. Em seguida, passou a palavra ao Diretor de Gestão de Investimentos, Sr. Paulo Sucupira, que deu início à sua apresentação, explanando os assuntos que compunham a Pauta da Reunião: **Item 1:** Aprovação da ata da 33ª Reunião Ordinária; **Item 2:** Renovação do credenciamento da instituição financeira Caixa Econômica Federal; **Item 3:** Política de Investimentos 2024. O **1º item** da pauta da reunião foi a aprovação da ata da 33ª Reunião Ordinária, que foi previamente compartilhada para a apreciação de todos os participantes. O Sr. Sucupira gentilmente solicitou aos conselheiros que

apresentassem eventuais adições ou correções à Ata, visando encaminhá-la posteriormente para as devidas assinaturas. Importante destacar que nenhum conselheiro levantou objeções. Em continuidade, o **2º item** tratou da renovação do credenciamento da instituição financeira Caixa Econômica Federal, que tem sido parceira da Cearaprev desde 2018. Durante esse período, as renovações eram realizadas semestralmente, passando, posteriormente, para uma frequência anual. Contudo, de acordo com a Portaria nº 1.467, vigente desde 2022, essa renovação passou a ocorrer a cada dois anos. O Sr. Sucupira solicitou a aprovação do Comitê para a renovação do credenciamento da Caixa Econômica Federal (na função de administrador), Caixa Asset (como gestor) e Caixa Econômica Federal (atuando como distribuidor). Além disso, buscou a aprovação para a renovação do credenciamento dos Fundos de Investimento, englobando Fundos de Renda Fixa, Fundos de Renda Variável, Fundos de Investimentos no Exterior e Fundos Estruturados. O Diretor de Investimentos verificou se todos os presentes concordavam com a renovação do credenciamento da Caixa e de seus respectivos fundos, obtendo a confirmação unânime dos membros do Comitê. Posteriormente, no **3º item,** abordou-se a Política de Investimentos para o ano de 2024, destacando uma meta de retorno esperado de IPCA + 4,94%, classificada na categoria geral. No âmbito da Gestão Previdenciária, o objetivo é incentivar a implementação de práticas de gestão previdenciária que proporcionem maior controle dos ativos e passivos, bem como maior transparência nas relações com segurados e sociedade. No que diz respeito ao Comitê de Investimentos, o Comitê é composto por membros vinculados ao Estado do Ceará, ocupando cargos efetivos ou de livre nomeação e exoneração, e possui caráter consultivo. A presença de membros tecnicamente capacitados no comitê permite que este zele pela implementação da Política de Investimentos e faça recomendações à Diretoria Executiva e ao Conselho Estadual de Políticas de Previdência Social - CEPPS. Em situações mais complexas ou envolvendo volumes mais representativos, o colegiado pode contar ainda com a participação de especialistas externos para auxílio nas decisões. Conforme estabelecido pela Portaria nº 048/2023, datada de 01 de setembro de 2023, que trata da nomeação dos membros do CEIPS, a composição é formado por 5 membros titulares e 5 membros suplentes: José Juarez Diógenes Tavares, Membro Titular - Presidente da Cearaprev; Sérgio Bastos de Castro, Membro Suplente do Presidente da Cearaprev; Paulo Amilcar Proença Sucupira, Membro Titular da Cearaprev - Diretor de Gestão de Investimentos; Andréa Kelly Silva Duarte, Membra Suplente do Representante da Diretoria de Estudos Econômicos e Atuariais;

Takeshi Cardoso Koshima, Membro Suplente do Representante da Sefaz; Denílson de Oliveira Adriano, Membro Titular Representante do SUPSEC; Isaac Figueiredo de Sousa, Membro Titular da Cearaprev - Diretor de Estudos Econômicos e Atuariais; Antônio Câmara Júnior, Membro Suplente do Representante da Diretoria de Gestão de Investimentos; Márcio Cardeal Queiroz da Silva, Membro Titular da Sefaz; Wandermon Corrêa Silva, Membro Suplente da Seplag. Quanto à consultoria de investimentos LDB, cuja contratação ocorreu em 17.07.2020, com o terceiro aditivo ao contrato em 05.06.2023, ela está devidamente registrada junto à CVM exclusivamente como consultora de valores mobiliários. Seu papel é auxiliar a Cearaprev no acompanhamento e monitoramento do desempenho do risco de mercado, no enquadramento das aplicações dos recursos e na avaliação do retorno observado em relação ao retorno esperado. O Sr. Sucupira apresenta os objetivos de alocação e os limites de aplicação em cada um dos segmentos delineados pela Resolução CMN nº 4.963/2021. Essa alocação visa estabelecer a direção estratégica a ser seguida ao longo da implementação desta Política de Investimento para o ano de 2024. No que diz respeito ao artigo 7º, I, a, destaca-se a relevância dos Títulos do Tesouro Nacional (SELIC) na composição da carteira, representando um montante expressivo de R$ 838.166.723,14, equivalente a 62,56%. Dentro da estratégia PREVID, o Limite Inferior para essa posição é fixado em 0,00%, enquanto a Estratégia Alvo estabelece uma alocação de 59,15%, com o Limite Superior definido em 100,00%. No âmbito do artigo 7º, I, b, os Fundos Renda Fixa 100% Títulos Públicos ocupam uma parcela relevante da carteira, totalizando R$ 396.044.470,08, substituindo 29,56%. Na estratégia PREVID, o Limite Inferior para essa posição é estabelecido em 0,00%, a Estratégia Alvo prevê uma alocação de 24,84%, e o Limite Superior é estipulado em 100,00%. No que concerne ao artigo 7º, III, a, encontram-se os Fundos de Renda Fixa (CVM), com a posição atual da carteira atingindo o valor de R$ 63.130.702,23, representando 4,71%. Na estratégia PREVID, o Limite Inferior para essa posição é definido em 0,00%, a Estratégia Alvo estabelece uma alocação de 5,93%, e o Limite Superior é fixado em 60,00%. Considerando o panorama geral da Renda Fixa, a posição atual da carteira totaliza R$ 1.297.341.895,45, correspondendo a expressivos 96,83%, alinhados com a Estratégia Alvo da PREVID, estabelecida em 89,92%. No cenário de Renda Variável, mais precisamente no Fundo de Ações - Art. 8ºI, a posição vigente na carteira é de R$ 18.657.408,13, equivalendo a 1,39%, ao passo que a Estratégia Alvo para este segmento é de 5,08%. Quanto ao âmbito de Investimento no Exterior, nos Fundos de Ações - BDR Nível I - Art. 9º, III, a posição atual na

carteira totaliza R$ 23.822.240,40, representando 1,78%, enquanto a Estratégia Alvo é estipulada em 0,00%. Considerando o panorama geral da Carteira PREVID, a posição corrente atinge R$ 1.339.821.543,98, abarcando a totalidade de 100%, ao passo que a Estratégia Alvo se mantém em 10,00%. Igualmente importante, as instituições financeiras cadastradas na Cearaprev são: Banco BTG Pactual, Banco do Brasil, Banco do Nordeste do Brasil S.A., Banco Safra, Banco Santander, Banco Bradesco S.A., Caixa Econômica Federal e Itaú Unibanco S.A. Prosseguindo, no que diz respeito à consolidação dos segmentos, a supervisão dos riscos de mercado será efetuada mediante o cálculo do VaR (Value at Risk) por cota. Esse procedimento visa permitir que o SUPSEC/PREVID exerça controle sobre a volatilidade das cotas do plano de benefícios. Os limites para o controle de riscos (VaR) foram estabelecidos da seguinte maneira: Renda Fixa com um limite de 5%, Renda Variável com 20%, Investimento no Exterior com 20%, Investimento Estruturados com 20%, e Fundos Imobiliários com 20%. Quanto ao Risco Operacional, trata-se da possibilidade de incorrer em perdas decorrentes de falhas, deficiências ou inadequações nos processos internos, pessoas e sistemas, bem como de eventos externos. Continuando, o Plano de Contingência busca controlar os riscos, garantir o cumprimento das leis e da Política de Investimentos e determina medidas a serem adotadas pela Diretoria de Investimentos, pelos membros do Comitê de Investimentos e do Conselho Deliberativo do RPPS, quando forem identificadas inadequações, embora outras contingências possam vir a ocorrer, sem que tenham sido objeto de previsão para o ano de 2024, devendo ser tratadas conjuntamente pela Diretoria de Investimentos e pelos órgãos colegiados. Por último, o presente Plano de Investimento para o ano de 2024, um documento crucial, será divulgado oficialmente no site da Cearaprev, acessível a todos os servidores, participantes e demais interessados. Quaisquer situações não contempladas serão solucionadas pela Diretoria de Gestão de Investimentos da Cearaprev. Este Plano será monitorado por meio de relatórios periódicos, fornecidos pela Diretoria de Gestão de Investimentos, disponíveis para análise por parte dos órgãos de controle e acompanhamento, além da sociedade em geral. Em seguida, o Sr. Paulo Sucupira encerrou sua apresentação passando aos **Encaminhamentos e Deliberações: 1:** Atas foram aprovadas sem objeções; **2:** Aprovação por unanimidade da Renovação do credenciamento do Caixa Econômica Federal e seus fundos; **3:** Não houve manifestações em contrário quanto à apresentação da Política de Investimentos 2024. Nada mais havendo a tratar,

foi lavrada por mim, Gustavo Regis Lopes Martins Vieira, a presente Ata assinada pelos seguintes membros titulares presentes e/ou suplentes representando.

Fortaleza - CE, 11 de dezembro de 2023.

SERGIO BASTOS DE CASTRO:75869373387
Assinado de forma digital por SERGIO BASTOS DE CASTRO:75869373387
Dados: 2024.02.06 11:31:45 -03'00'

SÉRGIO BASTOS DE CASTRO
Membro Suplente
Presidência da Cearaprev

PAULO AMILCAR PROENCA SUCUPIRA:10246398353
Assinado de forma digital por PAULO AMILCAR PROENCA SUCUPIRA:10246398353
Dados: 2024.02.06 09:35:57 -03'00'

PAULO AMILCAR PROENÇA SUCUPIRA
Membro Titular
Diretor de Gestão de Investimentos da Cearaprev

DENILSON DE OLIVEIRA ADRIANO:62081772353
Assinado de forma digital por DENILSON DE OLIVEIRA ADRIANO:62081772353
Dados: 2024.02.06 16:39:41 -03'00'

DENILSON DE OLIVEIRA ADRIANO
Membro Titular
Servidor Vinculado ao SUPSEC

ANDREA KELLY SILVA DUARTE:73446173315
Assinado de forma digital por ANDREA KELLY SILVA DUARTE:73446173315
Dados: 2024.02.06 10:47:02 -03'00'

ANDRÉA KELLY SILVA DUARTE
Membra Suplente
Representante da Cearaprev

gov.br
Documento assinado digitalmente
TAKESHI CARDOSO KOSHIMA
Data: 08/02/2024 12:55:42-0300
Verifique em https://validar.iti.gov.br

TAKESHI CARDOSO KOSHIMA
Membro Suplente
Representante da Sefaz