

Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social - CEIPS

Ata da 34ª Reunião Ordinária do Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social - CEIPS, realizada no dia 22 de fevereiro de 2024.

Dia vinte e dois (22) do mês de fevereiro de 2024, às 15:00hs, no Ambiente Virtual fornecido pelo software Google Meet, reuniram-se os membros do Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social - CEIPS: **Sérgio Castro** (Membro Suplente do Presidente da Cearaprev), **Paulo Sucupira** (Membro Titular - Diretor de Gestão de Investimentos da Cearaprev), **Isaac Figueiredo** (Membro Titular - Representante Cearaprev) e **Denílson de Oliveira Adriano** (Membro Titular Representante do SUPSEC). Como convidados, **Sávio Guerra** (Diretor de Inteligência e Fiscalização Previdenciária), **Jeffson Holanda** (Diretor de Serviços e Qualidade de Vida), **Paula Thiers** (Assessora Especial), **Ronialison Queiroz** (Diretoria de Gestão de Investimentos), **Larissa Mendonça** (Diretoria de Gestão de Investimentos), **Silvino Vasconcelos** (Diretoria de Gestão de Investimentos) e **Pedro Silva** (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, explicando os assuntos que compunham a Pauta da Reunião: **Item 1:** Aprovação das atas da 11ª e 12ª Reuniões Extraordinárias; **Item 2:** Desempenho da Carteira PREVID, referente ao 4º trimestre de 2023; **Item 3:** Renovação do credenciamento da instituição financeira BTG Pactual; **Item 4:** Encaminhamentos e Deliberações. Iniciou o **1º item** explicando que as atas presentes na pauta já foram devidamente assinadas e publicadas no site da Cearaprev. Em seguida, no **item 2**, tratou do desempenho da Carteira PREVID, referente ao 4º trimestre de 2023, dos meses de outubro a dezembro de 2023. O Sr. Paulo Sucupira desenvolveu sua apresentação discutindo o desempenho da Carteira PREVID, conforme evidenciado no

relatório trimestral dos meses de outubro, novembro e dezembro de 2023. O total de investimentos é de R\$ 1.380.612.424,30, a rentabilidade do trimestre foi de 3,04% e no ano 12%. Os títulos públicos, enquadrados no art. 7º, I “a” da Res. CMN 4963/21, com diversos vencimentos, marcados na curva e a mercado, foram detalhados pelo Diretor Paulo Sucupira por data de vencimento, volumes aplicados e percentuais em relação ao Patrimônio Líquido da Carteira. No total, os títulos públicos tiveram uma rentabilidade de 2,87% no trimestre, 10,9% no ano, volume total de R\$ 850.131.331,98, correspondendo a 61,58% da carteira. Os fundos de investimentos compostos 100% de títulos públicos, enquadrados no art. 7º, I “b” da Res. CMN 4.963/21, renderam 2,75% no trimestre, 12,12% ao ano, volume de R\$ 422.247.118,38 e 30,58% de percentual na carteira. Outro item dentro da renda fixa é o artigo 7º III “a” da referida Resolução, que atingiu 3% no trimestre, 13,55% no ano, volume de R\$ 63.779.785,64 e 4,62% de percentual da carteira. O segmento de renda fixa, rendeu no trimestre 2,84%, no ano 11,50%, volume de R\$ 1.336.158.236,00 correspondendo a 96,78% da carteira. Os fundos de ações do artigo 8º I da Resolução 4.963/21, que correspondem ao segmento de Renda Variável, são dois: BB AÇÕES CONSUMO FIC e FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO. Esses dois fundos apresentaram uma volatilidade elevada desde a pandemia, com o BB AÇÕES CONSUMO FIC apresentando uma volatilidade de 24,26% e o FIA CAIXA SMALL CAPS 22,12%. A rentabilidade no trimestre foi de 12,11% para o BB AÇÕES CONSUMO FIC e de 11,06% para o FIA CAIXA SMALL CAPS. No ano, o BB AÇÕES CONSUMO FIC ficou em 5,86% e o FIA CAIXA SMALL CAPS em 16,46%, demonstrando a volatilidade desses fundos ao longo do tempo. Atualmente, a aplicação no BB AÇÕES CONSUMO FIC é de R\$ 12.125.484,80, representando 0,86% da carteira, e no FIA CAIXA SMALL CAPS R\$ 7.731.372,90, representando 0,56% da carteira. A renda variável rendeu 11,70% no trimestre, no ano 9,75% e volume total R\$ 19.856.857,70, correspondendo a 1,44% da carteira. Por último, o fundo de ações BDR NÍVEL I que corresponde aos investimentos no exterior, Art. 9º, III da Res. CMN 4963/21, com somente uma aplicação no FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I na Caixa Econômica, sua rentabilidade no trimestre foi de 7,65%, no ano foi de 24,92%, volume de R\$ 24.597.330,60, correspondendo a 1,78% da carteira. Em seguida, Paulo Sucupira discorreu sobre a composição da carteira do PREVID no 4º trimestre de 2023, detalhando os valores referentes a cada um dos meses do trimestre: em outubro, o volume foi de R\$ 1.292.834.349,00; em novembro, R\$ 1.309.504.603,52; e em dezembro, R\$ 1.380.612.424,30. A alocação por estratégia dos títulos públicos marcados na curva foi de 56,07%, IMA-B 17,79%,

IRF-M1 8,05%, títulos públicos marcados a mercado 5,51%, CDI 4,62%, IRFM-M 1,90%, IRF-M1+ 1,90%, Global BDRX 1,78%, IPCA 0,94%, ICON 0,88%, e SMALL 0,56%. Na alocação por gestor, o Tesouro Nacional se destacou com 61,57% representando os títulos públicos, seguido pela Caixa Econômica com 31,99%, Bradesco com 3,92%, Banco do Brasil com 1,82% e o BTG Pactual com 0,70%. Em relação à aderência à política anual de investimentos, posição em 29/12/2023, no Art. 7º, I, “a” dos títulos do tesouro nacional tinha uma alocação alvo de 57,40%, mas terminou o ano com 61,58%. O Art. 7º, I, “b”, referente aos fundos de renda fixa compostos por títulos públicos, tinha uma alocação alvo de 20,33%, mas terminou o ano com 30,58%. Já nos fundos de renda fixa do Art. 7º, III, “a”, a alocação prevista era de 22,27%, mas terminou o ano com 4,62%. Quanto à renda variável (Art. 8º, I), o objetivo era sair dela, porém, devido às cotas negativas dos dois fundos, permaneceu com 1,44%. O BDR NÍVEL I, que também previa saída, ficou com 1,78%, devido ao bom desempenho do produto. A rentabilidade da carteira ao longo do ano no primeiro trimestre teve a meta atuarial de 3,09%, a rentabilidade de 3,75% e atingiu 121,45%. No segundo trimestre, teve 1,72% de meta atuarial, 2,85% de rentabilidade e 171,53% de atingimento da meta. Terceiro trimestre, 1,62% de meta atuarial, 1,76% de rentabilidade e 108,73% de atingimento da meta. Por fim, no quarto trimestre, 2,04% de meta atuarial, 3,04% rendimento e 148,64% atingimento da meta. No ano como um todo, a meta atuarial ficou em 8,75%, a rentabilidade atingiu 12% que representa um atingimento de 137,14% da meta atuarial. Em relação à rentabilidade à Meta Atuarial, ao CDI e ao IPCA, a rentabilidade foi de 12%, o IPCA 4,62%, a Meta Atuarial 8,75% e o CDI 13,03%. Atingimento da meta 13,14%, atingimento do IPCA 259,68% e atingimento do CDI 92,11%. Em relação à rentabilidade histórica do PREVID de 2014 até os dias atuais, tem acumulado com a meta atuarial de 158,90%, a rentabilidade 148% e o atingimento da meta em 93,14%. Por fim, o rendimento das carteiras, explicada em valores. R\$ 146.237.637,36 que o PREVID rendeu para o estado e para o RPPS. O FUNAPREV que é outro fundo, porém deficitário, rendeu R\$ 30.628.606,14. O PREVMILITAR rendeu R\$ 7.693.881,89. No total, o RPPS, juntando os três fundos, rendeu para o Estado e para a Cearaprev R\$ 184.560.125,39. Em seguida, iniciou o **item 3**, sobre a renovação do credenciamento da instituição financeira BTG Pactual. Fazem parte da renovação do credenciamento do BTG: BTG Serviços Financeiros DTVM (Administrador), BTG Asset DTVM (Gestor), Banco BTG Pactual (Distribuidor) e o BTG Pactual (Custodiante). Com relação aos fundos de investimento que foram solicitados renovação, são 13 fundos de Renda Fixa, 3 fundos de Renda Variável e 1 fundo

Estruturado. Em seguida, Paulo Sucupira perguntou aos demais, se podiam continuar com a renovação do credenciamento da Instituição Financeira BTG Pactual. Os conselheiros, Isaac Figueredo, Denilson e Sérgio Bastos votaram sim para a renovação. O Dr. Ronialison Queiroz explicou que com a chegada do Presidente José Juarez na presidência da Cearaprev com sua visão do mercado financeiro, agregou novas metodologias de gestão dos investimentos. Em seguida, o Sr. Paulo Sucupira encerrou sua apresentação passando aos **Encaminhamentos e Deliberações: 1:** As atas foram aprovadas sem objeções. **2:** Não houve manifestações em contrário quanto à apresentação do desempenho da carteira PREVID no 4º trimestre de 2023; **3:** Aprovação por unanimidade da Renovação do credenciamento da instituição financeira Banco BTG Pactual e seus fundos. Para finalizar, Sérgio Bastos agradeceu a presença de todos. Nada mais havendo a tratar, foi lavrada por mim, Elayne Naglle Aguiar Oliveira, a presente Ata assinada pelos seguintes membros titulares presentes e/ou suplentes representando.

Fortaleza - CE, 14 de março de 2024.

SÉRGIO BASTOS DE CASTRO
Membro Suplente
Presidência da Cearaprev

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

ISAAC FIGUEIREDO DE SOUSA
Membro Titular
Representante da Cearaprev

DENILSON DE OLIVEIRA ADRIANO
Membro Titular
Servidor vinculado ao SUPSEC