

Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social - CEIPS

Ata da 35ª Reunião Ordinária do Comitê
Estadual de Investimentos da Previdência Social
- CEIPS, realizada no dia 29 de maio de 2024.

1 Dia vinte e nove (29) do mês de maio de 2024, às 14:30hs, no Ambiente Virtual fornecido pelo
2 software *Google Meet*, reuniram-se os membros do Comitê Estadual de Investimentos da
3 Previdência Social - CEIPS: **José Juarez** (Membro Titular - Presidente do CEIPS), **Paulo Sucupira**
4 (Membro Titular - Diretor de Gestão de Investimentos da Cearaprev), **Adriano Pinheiro**
5 (Membro Titular - Representante da Cearaprev), **Denilson de Oliveira** (Membro Titular - Servidor
6 Vinculado ao SUPSEC), **Takeshi Cardoso** (Membro Suplente - Servidor Vinculado a SEFAZ),
7 **Câmara Júnior** (Membro Suplente - Diretor de Gestão de Investimentos da Cearaprev) e **Andrea**
8 **Duarte** (Membro Suplente - Representante da Cearaprev). Como convidados, **Isaac Figueiredo**
9 (Diretor de Estudos Econômicos e Atuariais), **Oscar Saldanha** (Diretor Administrativo-
10 Financeiro), **Jeffson Holanda** (Diretor de Serviços e Qualidade de Vida), **Paula Thiers** (Assessora
11 Especial), **Ronialison Queiroz** (Diretoria de Gestão de Investimentos), **Pedro Silva** (Diretoria de
12 Gestão de Investimentos), **Silvino Vasconcelos** (Diretoria de Gestão de Investimentos), **Elayne**
13 **Naglle** (Assessoria de Comunicação) e **Robson Melo** (Assessoria de Comunicação). **A reunião foi**
14 **gravada pelo ambiente virtual e encontra-se mantida nos arquivos da Cearaprev que estão na**
15 **nuvem do Google Drive.** Verificada a existência de quórum, deu-se início aos trabalhos para
16 análise dos tópicos da pauta do dia: **1) Aprovação das atas da 13ª, 14ª e 15ª Reuniões**
17 **Extraordinárias; 2) Desempenho da carteira PREVID, referente ao 1º trimestre de 2024; 3)**
18 **Proposta de Alocação na Carteira PREVID; 4) Edital de Credenciamento de Instituições**
19 **Financeiras; 5) Encaminhamentos e Deliberações.** Os materiais anexos à pauta foram enviados
20 previamente aos membros deste Comitê via e-mail institucional. Fazendo uso da palavra, o
21 Presidente José Juarez cumprimentou os Conselheiros(as) presentes e deu abertura aos
22 trabalhos. Paula Thiers prosseguiu registrando a presença dos membros e convidados. Paulo
23 Sucupira iniciou sua apresentação (ANEXO I) abordando os tópicos da pauta do dia. **1)**

24 **Aprovação das atas da 13ª, 14ª e 15ª Reuniões Extraordinárias**, explicando o conteúdo de cada
25 uma delas e solicitando comentários dos presentes. Não havendo nenhum comentário, ele
26 avançou para o próximo ponto da pauta: **2) O desempenho da carteira no primeiro trimestre**
27 **de 2024**. Sucupira relatou que a carteira PREVID encerrou o trimestre com um valor de R\$
28 1.487.578.188,92. A rentabilidade da carteira no 1º trimestre e no ano foi de 2,63% e a
29 volatilidade 0,84%. Ele destacou os Títulos Públicos adquiridos e marcados a mercado, que
30 apresentaram rentabilidades negativas no período devido às flutuações do mercado durante o
31 trimestre. Destacou também, que os demais Títulos Públicos, que foram marcados na curva, não
32 sofrem variações negativas, permanecendo sempre positivas, já que a rentabilidade desses
33 fundos foi estabelecida previamente e não sofrem as variações da marcação a mercado. O 1º
34 trimestre terminou com um montante de R\$ 980.273.731,51 em Títulos do Tesouro Art. 7º I, a
35 com rentabilidade de 2,62% e volatilidade de 0,71% a.a., correspondendo a 65,90% da carteira.
36 Os fundos de investimentos compostos por 100% Títulos Públicos Art. 7º I, b tiveram uma
37 rentabilidade de 2,36% no trimestre, um volume de R\$ 345.087.744,42, correspondendo a
38 23,20% da carteira. O Sr. Paulo Sucupira prosseguiu sua apresentação abordando os fundos de
39 Renda Fixa vinculados ao CDI, mencionando três fundos específicos. Ressaltou que o Fundo do
40 Banco do Brasil BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC é transitório, pois nele são creditados os
41 cupons do Fundo de Vértice do Banco do Brasil. Os dois outros fundos são o BTG PACTUAL
42 TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI, utilizado para receber os cupons dos Títulos Públicos e
43 para futuras compras de mais Títulos Públicos Federais com o objetivo de manter a Taxa Interna
44 de Retorno - TIR, e por fim o BRADESCO REFERENCIADO DI PREMIUM, que apresentou uma
45 excelente performance desde sua aplicação inicial. Este artigo encerrou o trimestre com R\$
46 60.279.737,13, rentabilidade de 2,85 representando 4,05% da carteira. A Renda Fixa totalizou
47 R\$ 1.385.641.213,06, correspondendo a 93,15% da carteira, com uma rentabilidade de 2,54%.
48 Em seguida, o diretor Paulo Sucupira discutiu sobre os Fundos de Ações pertencentes ao art. 8º,
49 I, destacando que dois fundos, o **BB AÇÕES CONSUMO FIC** e o **FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO**,
50 **não vêm tendo um bom desempenho**. Ele ressaltou que a **Diretoria de Investimentos em**
51 **conjunto com a Consultoria Financeira e os Bancos parceiros, farão um estudo aprofundado**
52 **para analisar a permanência ou não nesses Fundos e que esses fundos vêm sendo analisados**
53 **constantemente, inclusive explicou que foi feito esse estudo no primeiro trimestre de 2024 e**
54 **apresentado na 13ª Reunião Extraordinária realizada no dia 21.03.2024 e posteriormente**

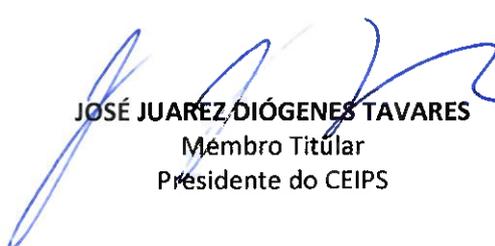
55 anexada na ata. A Renda Variável terminou o trimestre com uma rentabilidade negativa de -
56 6,13% e um volume aplicado de R\$ 73.654.720,63, com 4,95% da carteira. No final de março,
57 em linha com a Política de Investimentos, foram alocados recursos em mais três fundos: BB
58 AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI, BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA e o SANTANDER FIC FI
59 DIVIDENDOS VIP AÇÕES. O próximo Segmento apresentado foi o Investimento no Exterior art.
60 9º, III composto pelo fundo da Caixa Econômica, o FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I. Este
61 fundo está apresentando um excelente desempenho, com uma rentabilidade de 14,98% no
62 trimestre e um volume aplicado de R\$ 28.282.255,23, correspondendo a 1,90% da carteira. Em
63 seguida, Paulo Sucupira discorreu sobre a composição da carteira do PREVID no 1º trimestre de
64 2024, detalhando os valores referentes a cada um dos meses do trimestre: em janeiro, o volume
65 foi de R\$ 1.370.320.953,85; em fevereiro, R\$ 1.429.382.474,17; e em março, R\$
66 1.487.578.188,92. Esse crescimento se deve às aplicações realizadas e aos rendimentos dos
67 ativos. Ainda comentando sobre a composição da carteira, destacou mais uma vez o
68 desempenho insatisfatório do Fundo BB AÇÕES CONSUMO FIC, com aporte inicial de R\$
69 20.160.122,00, finalizando o mês de março com R\$ 11.275.713,62, e do Fundo FIA CAIXA SMALL
70 CAPS ATIVO, com aporte inicial de R\$ 8.000.000,00, finalizando o mês de março com R\$
71 7.401.328,44. Continuou demonstrando que em março, três novos fundos foram adquiridos: BB
72 AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI (R\$ 20.000.000,00), BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA (R\$
73 20.000.000,00) e o SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP AÇÕES (R\$ 15.000.000,00). Paulo
74 Sucupira seguiu expondo as alocações por estratégia e por gestor. Na alocação por estratégia,
75 os Títulos Públicos marcados na curva representam 61,03%, IMA-B TOTAL 16,45%, Títulos
76 Públicos marcados a mercado 4,87%, CDI 4,05%, IBOV 2,35%, IRF-M1 2,30%, BDRX 1,90%, IRF-
77 M 1,79%, IRF-M1+ 1,79%, IDIV 1,34%, IPCA 0,87%, ICON 0,76% e SMALL 0,50%. Na alocação por
78 gestor, o Tesouro Nacional se destacou com 65,89%, seguido pela Caixa Econômica com 24,73%,
79 Banco do Brasil com 4,32%, Bradesco com 3,75%, Santander com 1,01% e o BTG Pactual com
80 0,30%. Quanto à aderência das aplicações à Política de Investimentos, os Títulos Públicos (Art.
81 7º, I, a) tem uma alocação alvo de 59,15% e em março representavam 65,90% da carteira; os
82 Fundos de Renda Fixa compostos por 100% Títulos Públicos (Art. 7º, I, b) tem uma alocação alvo
83 de 24,84%, encerrando março com 23,20%. Os Fundos de Renda Fixa - CVM (Art. 7º, III, a) tem
84 uma alocação alvo de 5,93% e terminaram março com 4,05%. A alocação alvo total da Renda
85 Fixa é de 89,92%, e finalizou março com 93,15%. Na Renda Variável em Fundos de Ações (Art.

86 8º, I) tem uma alocação alvo de 5,08% e terminou março com 4,95%. No Investimento no
87 Exterior em Fundos de Ações - BDR Nível I (Art. 9º, III), com indicação de saída de todos os
88 recursos, tinha uma alocação alvo de 0,00%, mas terminou o trimestre com 1,90%. Os
89 Empréstimos Consignados (Art. 12, I), com uma alocação alvo de 5,00%, ainda está em fase de
90 implementação e de encaminhamento, não possuindo, portanto, nenhuma contratação
91 realizada até o momento. Paulo continuou abordando sobre a rentabilidade versus a meta
92 atuarial durante o trimestre. A meta atuarial foi de 2,61% e a rentabilidade do PREVID foi de
93 2,63%, portanto a meta atuarial foi atingida em 100,90%. Com relação aos indicadores, a
94 rentabilidade da carteira do PREVID ficou em 2,63%, IPCA 1,42%, meta atuarial 2,61%, CDI 2,62%
95 e a rentabilidade real da carteira 1,20%. Então o atingimento da meta atuarial ficou em 100,90%,
96 atingimento em relação ao IPCA 186,08% e o atingimento em relação ao CDI, 100,44%. Desde o
97 início do PREVID, em 2014, até março de 2024, a meta atuarial acumulada é de 165,63%, a
98 rentabilidade acumulada é de 154,65% e o percentual de atingimento em relação à meta
99 histórica é de 93,37%. A apresentação prosseguiu informando o rendimento das carteiras não
100 apenas do PREVID, mas também do FUNAPREV e do PREVMILITAR, detalhando o valor que cada
101 um dos três Fundos gerou para a Cearaprev no 1º trimestre de 2024. O PREVID gerou R\$
102 37.184.974,02, o FUNAPREV, que é o fundo deficitário dos servidores civis, rendeu R\$
103 7.495.938,97, e o PREVMILITAR, também deficitário e relacionado aos Militares, rendeu ao final
104 do trimestre R\$ 3.015.178,83. No total, os três Fundos acumularam R\$ 47.696.091,80 para a
105 Cearaprev no trimestre. A apresentação seguiu com uma análise de risco da carteira. Este é
106 considerado muito importante para garantir que todas as decisões estejam alinhadas com a
107 Política de Investimentos estabelecida. O "Value at Risk" (VaR) é um método para avaliar o risco
108 em operações financeiras. O VaR resume, em um número, o risco de um produto financeiro ou
109 o risco de uma carteira de investimentos. Esse número representa a pior perda esperada em um
110 dado horizonte de tempo e é associado a um intervalo de confiança. Essa técnica visa quantificar
111 o risco de mercado, ou seja, o risco de perdas monetárias decorrentes da variação de preços,
112 taxas de juros ou taxas de câmbio, explicou o diretor Paulo Sucupira. Diante do exposto, a pior
113 perda esperada para a carteira PREVID no período de 21 dias com 95% de confiança seria de R\$
114 6.631.582,40 (VaR PREVID = 0,45%). Continuou demonstrando que o VaR dos artigos 7º (0,20%),
115 8º (5,99%) e 9º (5,51%), permanecem dentro dos limites estabelecidos na Política de
116 Investimentos 2024, que são 5%, 20% e 20% respectivamente. Para o art. 7º, Paulo Sucupira

117 destacou os valores mais elevados, foram eles: os Títulos Públicos (NTN-Bs) marcados a mercado
118 com vencimentos para 2040 (2,26%) e 2060 (2,85%) e dois fundos o FI CAIXA BRASIL IRF-M1+ TP
119 RF LP (1,19%) e o FI CAIXA BRASIL 2030 III TP RF (1,25%). No artigo 8º o destaque foram os fundos
120 BB AÇÕES CONSUMO FIC (12,18%) e o FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO (9,03%). Paulo Sucupira
121 encerrou sua apresentação sobre o risco da carteira perguntando se alguém tinha alguma
122 dúvida. Como ninguém se manifestou, ele passou a palavra para o assessor da Diretoria de
123 Gestão de Investimentos Dr. Ronialison Queiroz, que iniciou sua apresentação sobre a **3)**
124 **Proposta de Alocação.** O Dr. Ronialison Queiroz destacou que o mercado brasileiro vive em
125 constante ebulição, com expectativas flutuantes e uma forte influência da economia americana.
126 Diante dessas mudanças, a gestão deve sempre buscar acompanhar essas variações e aproveitar
127 as melhores oportunidades para maximizar os rendimentos da carteira. Dentro das propostas
128 apresentadas, Ronialison mencionou: a) Utilizar os recursos provenientes do pagamento de
129 cupons para a aquisição de Títulos Públicos Federais (TPF), garantindo que a rentabilidade
130 desses ativos seja sempre superior à meta atuarial de longo prazo (IPCA + 4,94%), conforme
131 deliberado pelo Comitê na 26ª Reunião Ordinária de 12/08/2022; b) continuar comprando
132 Letras Financeiras, pois, embora os Títulos Públicos ofereçam bons retornos, as Letras
133 Financeiras apresentam rendimentos ainda superiores e as principais condições para as
134 instituições que emitem esses ativos de Renda Fixa incluem: estar na Lista Exaustiva do BACEN,
135 ser classificada pelo BACEN como Segmento S1 ou S2, e apresentar no mínimo, os ratings
136 atribuídos por agências classificadoras de risco de crédito atuantes no Brasil, como Standard &
137 Poor's (**brA-**), Moody's (**A3.br**), Fitch Ratings (**A-(bra)**), SR Ratings (**brA**) ou Austin Rating (**brAA**);
138 c) Alocar os recursos dos fundos FI CAIXA IRF-M1+ TP RF LP e FI CAIXA IRF-M TP RF LP para o
139 fundo BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM. Os recursos existentes nesses dois fundos
140 foram alocados em 04/08/2023 (R\$ 25.000.000,00 em cada Fundo) e que na posição do dia
141 22/05/2024 havia R\$ 26.420.965,42 no FI CAIXA IRF-M1+ TP RF LP e R\$ 26.614.629,20 FI CAIXA
142 IRF-M TP RF LP, estando os dois, com cota positiva. As principais justificativas para essa mudança
143 seria o tom mais duro do COPOM e do FOMC no que diz respeito aos juros brasileiros e
144 americanos. O Dr. Ronialison Queiroz seguiu a apresentação mostrando o relatório gerado no
145 Sistema SGOLD, que continha o comparativo entre os dois fundos da Caixa Econômica e do
146 Bradesco citados anteriormente. Finalizou mostrando que o fundo BRADESCO FI RF
147 REFERENCIADO DI PREMIUM foi melhor em todos os comparativos e em todas as janelas móveis.

148 Dando continuidade à reunião, o Dr. Ronialison Queiroz passou a palavra para o colega e
149 também assessor de Investimentos Pedro Silva, que iniciou sua apresentação sobre o **4) Edital**
150 **de Credenciamento** que servirá como critério para o credenciamento de administradores e
151 gestores de Fundos de Investimentos; distribuidores de produtos de investimentos;
152 custodiantes de ativos financeiros; Instituições Financeiras bancárias emissoras de ativo
153 financeiro de Renda Fixa; corretoras e distribuidoras de Títulos e valores imobiliários e Fundos
154 de Investimento. Ele apresentou o documento na íntegra (ANEXO II). Enfatizou que o objetivo
155 deste edital seria disciplinar o credenciamento das instituições financeiras que poderão operar
156 com a Cearaprev, conferindo critérios de segurança e transparência. Para concluir, o Sr. Pedro
157 Silva informou que o edital estará, em breve, disponível no site da Cearaprev e será atualizado
158 anualmente. Após concluir sua apresentação, passou a palavra para o Sr. Paulo Sucupira, que
159 tratou do último item da pauta: **5) Encaminhamentos e Deliberações**. Ele listou os itens a serem
160 aprovados, incluindo: as atas da 13ª, 14ª e 15ª Reuniões Extraordinárias; Aprovação do Relatório
161 Referente ao 1º Trimestre de 2024; Aprovação da Proposta de Alocação e Aprovação do Edital
162 de Credenciamento. **Todos os itens foram aprovados por unanimidade**. O Presidente José
163 Juarez agradeceu a presença de todos e deu por encerrada a reunião, às 15:50h, da qual eu,
164 Elayne Nagle Aguiar Oliveira, participei e lavrei a presente Ata assinada pelos Membros Titulares
165 presentes e/ou suplentes representando.

Fortaleza - CE, 03 de julho de 2024.


JOSÉ JUAREZ DIÓGENES TAVARES
Membro Titular
Presidente do CEIPS

PAULO AMILCAR PROENÇA
SUCUPIRA:10246398353
398353
PAULO AMILCAR PROENÇA SUCUPIRA
Membro Titular
Diretor de Gestão de Investimentos da Cearaprev

Assinado de forma digital
por PAULO AMILCAR
PROENÇA
SUCUPIRA:10246398353
Dados: 2024.08.23
15:12:05 -03'00'



**ADRIANO
PINHEIRO
DOS SANTOS**

Assinado de forma
digital por ADRIANO
PINHEIRO DOS SANTOS
Dados: 2024.08.27
09:16:03 -03'00'

ADRIANO PINHEIRO DOS SANTOS
Membro Titular
Representante da Cearaprev

**DENILSON DE
OLIVEIRA
ADRIANO:620
81772353**

Assinado de forma
digital por DENILSON DE
OLIVEIRA
ADRIANO:62081772353
Dados: 2024.08.29
10:14:47 -03'00'

DENILSON DE OLIVEIRA ADRIANO
Membro Titular
Servidor Vinculado ao SUPSEC

**TAKESHI
CARDOSO
KOSHIMA:782
12537587**

Assinado de forma
digital por TAKESHI
CARDOSO
KOSHIMA:78212537587
Dados: 2024.08.29
17:38:10 -03'00'

TAKESHI CARDOSO KOSHIMA
Membro Suplente
Representante da Sefaz

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social – CEIPS

35ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO CEIPS

Fortaleza - CE, 29/05/2024

PAUTA

1

Aprovação das atas da 13ª, 14ª e 15ª Reuniões Extraordinárias

2

Desempenho da Carteira PREVID, referente ao 1º trimestre de 2024

3

Proposta de Alocação

4

Edital de Credenciamento

5

Encaminhamentos e Deliberações

1. Aprovação das atas da 13^a, 14^a e 15^a R.E.

1. Aprovação das atas da 13ª, 14ª e 15ª R.E.



Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social - CEIPS

Ata da 13ª Reunião Extraordinária do Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social - CEIPS, realizada no dia 21 de março de 2024.

- 1 Dia onze (23) do mês de março de 2024, às 14:00h, no Ambiente Virtual fornecido pelo *software*
- 2 *Google Meet*, reuniram-se os membros do Comitê Estadual de Investimentos da Previdência
- 3 Social - CEIPS: **José Juarez Tavares** (Membro Titular - Presidente da Cearaprev), **Paulo Sucupira**
- 4 (Membro Titular - Diretor de Gestão de Investimentos da Cearaprev), **Andréa Duarte** (Membra
- 5 Suplente do Representante da Cearaprev) e **Câmara Junior** (Membro Suplente do Diretor de
- 6 Gestão de Investimentos da Cearaprev). Como convidados, **Adriano Pinheiro** (Diretor de
- 7 Desenvolvimento Institucional e Governança da Cearaprev), **Sérgio Bastos** (Assessor de Controle
- 8 Interno), **Isaac Figueiredo** (Diretor de Estudos Econômicos Atuariais), **Eugênia Camelo** (Diretora
- 9 de Gestão de Benefícios), **Jeffson Holanda** (Diretor de Serviços e Qualidade de Vida), **Savio**
- 10 **Guerra** (Diretor de Inteligência e Fiscalização Previdenciária), **Ronialison Queiroz** (Diretoria de
- 11 Gestão de Investimentos), **Larissa Mendonça** (Diretoria de Gestão de Investimentos), **Silvino**
- 12 **Vasconcelos** (Diretoria de Gestão de Investimentos), **Paula Thiers** (Assessora Especial da
- 13 Presidência) e **Thiago Matos** (Contador da Cearaprev). O presidente José Juarez abriu os



Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social - CEIPS

Ata da 14ª Reunião Extraordinária do Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social - CEIPS, realizada no dia 25 de abril de 2024.

- 1 Dia vinte e cinco (25) do mês de abril de 2024, às 09:00h, no Ambiente Virtual fornecido pelo
- 2 *software* Google Meet, reuniram-se os membros do Comitê Estadual de Investimentos da Pre-
- 3 vidência Social - CEIPS: **José Juarez** (Presidente da Cearaprev), **Paulo Sucupira** (Membro Titular
- 4 - Diretor de Gestão de Investimentos da Cearaprev), **Takeshi Cardoso** (Membro suplente- Servi-
- 5 dor vinculado a SEFAZ), **Isaac Figueiredo** (Membro Titular - Representante Cearaprev), **Andrea**
- 6 **Duarte** (Membro Suplente- Cearaprev), **Denilson de Oliveira Adriano** (Membro Titular- Servidor
- 7 vinculado ao SUPSEC) e **Sérgio Bastos de Castro** (Membro Suplente do Presidente da Cearaprev).
- 8 Como convidados, **Oscar Saldanha** (Diretor Administrativo-financeiro), **Adriano Pinheiro** (Dire-
- 9 tor de Desenvolvimento Institucional e Governança), **Jeffson Holanda** (Diretor de Serviços e
- 10 Qualidade de Vida), **Antônio Câmara Júnior** (Diretor de Governança e Análise de Dados), **Paula**
- 11 **Thiers** (Assessora Especial), **Ronialison Queiroz** (Diretoria de Gestão de Investimentos), **Larissa**
- 12 **Mendonça** (Diretoria de Gestão de Investimentos), **Elayne Nagle** (Assessoria de Comunicação)
- 13 e **Robson Melo** (Assessoria de Comunicação). A reunião foi gravada pelo ambiente virtual e



Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social - CEIPS

Ata da 15ª Reunião Extraordinária do Comitê Estadual de Investimentos da Previdência Social - CEIPS, realizada no dia 30 de abril de 2024.

- 1 Dia trinta (30) do mês de abril de 2024, às 14:00h, no Ambiente Virtual fornecido pelo *software*
- 2 *Google Meet*, reuniram-se os membros do Comitê Estadual de Investimentos da Previdência
- 3 Social - CEIPS: **José Juarez** (Presidente da Cearaprev), **Paulo Sucupira** (Membro Titular - Diretor
- 4 de Gestão de Investimentos da Cearaprev), **Takeshi Cardoso** (Membro suplente- Servidor
- 5 vinculado a SEFAZ), **Andrea Duarte** (Membro Suplente- Cearaprev) e **Denilson de Oliveira**
- 6 **Adriano** (Membro Titular- Servidor vinculado ao SUPSEC). Como convidados, **Adriano Pinheiro**
- 7 (Diretor de Desenvolvimento Institucional e Governança), **Jeffson Holanda** (Diretor de Serviços
- 8 e Qualidade de Vida), **Oscar Saldanha** (Diretor Administrativo-financeiro), **Antônio Câmara**
- 9 **Júnior** (Diretor de Governança e Análise de Dados), **Paula Thiers** (Assessora Especial), **Ronialison**
- 10 **Queiroz** (Diretoria de Gestão de Investimentos), **Pedro Silva** (Diretoria de Gestão de
- 11 Investimentos), **Sérgio Bastos de Castro** (Membro Suplente do Presidente da
- 12 Cearaprev), **Larissa Mendonça** (Diretoria de Gestão de Investimentos) e **Elayne Nagle**
- 13 (Assessoria de Comunicação). A reunião foi gravada pelo ambiente virtual e encontra-se

2. Desempenho da Carteira PREVID Relatório Trimestral (jan-mar/2024)

Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
		Mês	Trim.	Ano		
Total	0,84	0,88	2,63	2,63	1.487.578.188,92	100,00

Composição da Carteira PREVID em 28.03.2024 – R. F.

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Mês	Trim.	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,43	0,99	3,04	3,04	32.256.451,49	2,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,43	1,00	3,08	3,08	32.770.298,17	2,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,44	1,01	3,10	3,10	7.689.878,15	0,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,44	1,01	3,11	3,11	87.728.360,60	5,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	0,44	1,01	3,11	3,11	13.141.344,93	0,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	0,45	1,03	3,18	3,18	2.785.261,58	0,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,897300%)	4,09	0,05	0,05	0,05	123.556.293,53	8,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,56	1,01	3,11	3,11	132.333.526,11	8,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,41	1,00	3,07	3,07	43.534.867,73	2,93

R\$ 176.371.594,92
11,86%

R\$ 255.889.819,64
17,20%

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Mês	Trim.	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	6,28	-0,74	-1,80	-1,80	47.920.860,56	3,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	0,47	0,97	2,98	2,98	8.717.487,31	0,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	2,89	0,99	3,05	3,05	22.423.635,42	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	8,37	-0,69	-2,83	-2,83	24.476.578,96	1,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	0,65	0,98	3,00	3,00	19.615.182,91	1,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,65	0,99	3,04	3,04	91.224.388,86	6,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,66	1,00	3,08	3,08	75.415.684,33	5,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,67	1,01	3,11	3,11	18.044.772,02	1,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,67	1,01	3,12	3,12	73.666.292,58	4,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,67	1,01	3,12	3,12	86.549.128,20	5,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,67	1,02	3,13	3,13	30.172.783,45	2,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,68	1,04	3,18	3,18	6.250.654,62	0,42
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,71	0,85	2,62	2,62	980.273.731,51	65,90

R\$ 400.938.886,97
26,95%

2. Relatório Trimestral dos Investimentos

Composição da Carteira PREVID em 28.03.2024 – R. F. – Cont.

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Mês	Trim.	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,24	0,80	2,47	2,47	34.170.585,08	2,30	8.612.056.482,37	0,40
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,18	0,39	1,30	1,30	26.604.913,39	1,79	1.526.568.432,06	1,74
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,21	0,50	1,61	1,61	26.657.193,85	1,79	2.457.483.202,76	1,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,90	0,92	2,78	2,78	213.400.333,99	14,35	3.885.045.033,34	5,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,09	-0,00	0,25	0,25	31.314.879,51	2,11	236.822.555,91	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,90	0,92	2,78	2,78	12.939.838,60	0,87	3.594.188.246,07	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,92	0,77	2,36	2,36	345.087.744,42	23,20		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Mês	Trim.	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,06	0,83	2,60	2,60	4.525.752,66	0,30	19.188.952.756,40	0,02
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,61			0,00	0,00	4.354.660.093,34	0,00
BRAM	BRANDESCO	BRANDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,91	2,92	2,92	55.753.984,47	3,75	10.645.688.775,75	0,52
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,09	0,89	2,85	2,85	60.279.737,13	4,05		
Renda Fixa			0,64	0,82	2,54	2,54	1.385.641.213,06	93,15		

2. Relatório Trimestral dos Investimentos

Composição da Carteira PREVID em 28.03.2024 – R.V. e I.E.

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Mês	Trim.	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	21,95	1,31	-7,01	-7,01	11.275.713,62	0,76	103.482.387,77	10,90
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	14,70	-0,11	-0,11	-0,11	19.977.678,57	1,34	647.839.706,38	3,08
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	20,62	2,09	-4,27	-4,27	7.401.328,44	0,50	686.836.540,62	1,08
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	11,24	0,00	0,00	0,00	20.000.000,00	1,34	1.406.656.545,73	1,42
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	13,07	0,00	0,00	0,00	15.000.000,00	1,01	210.532.727,95	7,12
Sub-total Artigo 8º I			21,12	1,42	-6,13	-6,13	73.654.720,63	4,95		
Renda Variável			21,12	1,42	-6,13	-6,13	73.654.720,63	4,95		

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Mês	Trim.	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,00	3,48	14,98	14,98	28.282.255,23	1,90	2.280.222.056,45	1,24
Sub-total Artigo 9º III			14,00	3,48	14,98	14,98	28.282.255,23	1,90		
Investimentos no Exterior			14,00	3,48	14,98	14,98	28.282.255,23	1,90		

Fonte: Dginv e LDB Consultoria.

2. Relatório Trimestral dos Investimentos

Composição da Carteira do PREVID no 1º Trimestre - 2024

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDO (em Reais)			
	D 0	JAN	FEV	MAR
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	844.339.568,59	782.086.246,09	776.516.218,05	907.876.291,99
TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO	75.742.751,70	74.649.251,95	72.923.447,04	72.397.439,52
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF *	21.114,33	91.219.881,09	144.663.925,06	34.170.585,08
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	25.000.000,00	26.417.779,00	26.500.439,49	26.604.913,39
FI CAIXA BRASIL IRF-M TP RF LP	25.000.000,00	26.409.811,03	26.524.547,38	26.657.193,85
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP RF	160.399.411,08	215.918.811,65	211.460.843,17	213.400.333,99
FI CAIXA BRASIL 2030 III TP RF *	40.000.000,00	31.995.085,11	31.314.923,20	31.314.879,51
BB PREVIDENCIÁRIO XXI FI	12.003.778,42	13.092.465,86	12.822.200,38	12.939.838,60
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC *	22.000.000,00	9.700.016,19	25.326.799,18	4.525.752,66
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM *	104.548.163,97	54.760.280,31	55.250.953,15	55.753.984,47
BB PREV RF FLUXO FIC *	-	-	367.510,12	-
BB AÇÕES CONSUMO FIC	20.160.122,00	11.130.192,58	11.129.475,41	11.275.713,62
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	20.000.000,00	-	-	19.977.678,57
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	20.000.000,00	-	-	20.000.000,00
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	15.000.000,00	-	-	15.000.000,00
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	8.000.000,00	7.221.957,40	7.249.502,05	7.401.328,44
CAIXA INST. BDR I	24.000.000,00	25.719.175,59	27.331.690,49	28.282.255,23
TOTAL	-	1.370.320.953,85	1.429.382.474,17	1.487.578.188,92

Fonte: Dginv e LDB Consultoria.

2. Relatório Trimestral dos Investimentos

Alocação por Estratégia – 28.03.2024

TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA

FI CAIXA BRASIL 2024 IV

FI CAIXA BRASIL 2030 III

TÍTULOS PÚBLICOS A MERCADO

BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM

BTG PACTUAL TESOUREO SELIC REF DI

BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI

BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA

FI CAIXA BRASIL IRF-M 1

CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I

FI CAIXA BRASIL IRF-M TP RF LP

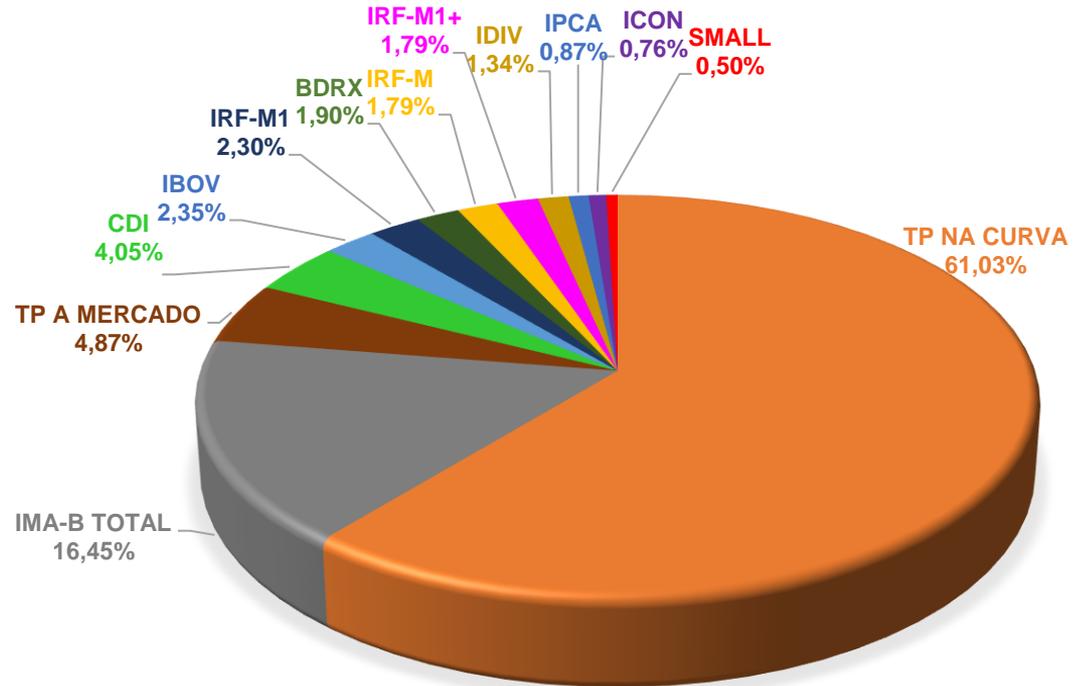
FI CAIXA BRASIL IRF-M1+ TP RF LP

SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP AÇÕES

BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI

BB AÇÕES CONSUMO

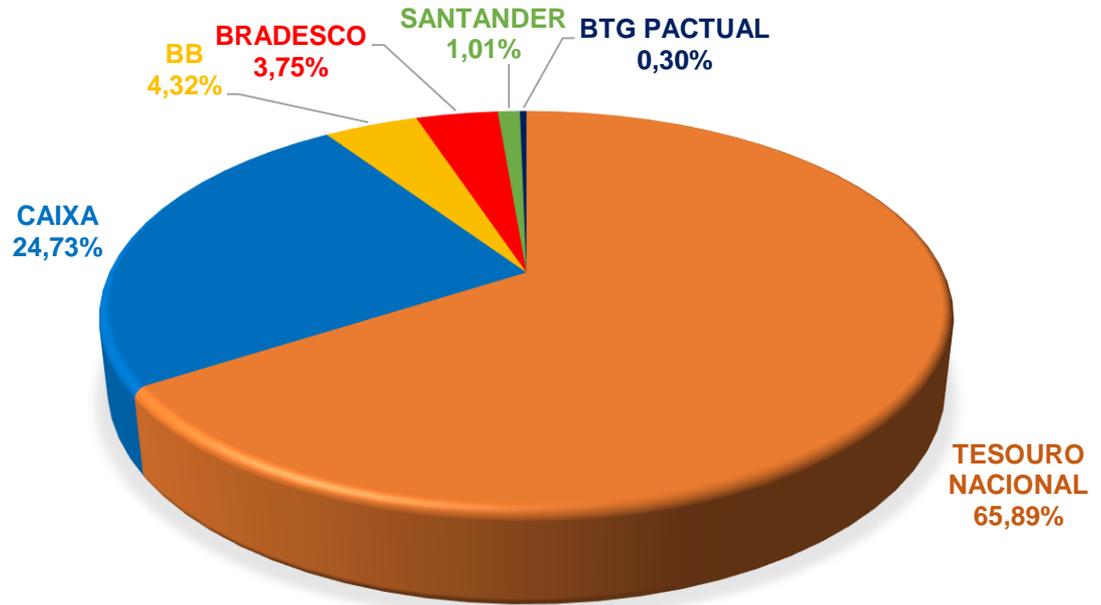
FIA CAIXA SMALL CAPS



Fonte: Dginv e LDB Consultoria.

2. Relatório Trimestral dos Investimentos

Alocação por Gestor - 28.03.2024



Fonte: Dginv e LDB Consultoria.

2. Relatório Trimestral dos Investimentos

Aderência à Política Anual de Investimentos – Posição 28.03.2024

SEGMENTO	ENQUADRAMENTO LEGAL (Resolução CMN nº 4.963/2021)	LIMITES DE APLICAÇÃO DEFINIDOS NA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS		ALOCÇÃO ALVO	ALOCÇÃO ATUAL
		Mínimo	Máximo		
Renda Fixa	Títulos do Tesouro Nacional (SELIC) - Art. Art. 7º, I, "a"	0,00%	100,00%	59,15%	65,90%
Renda Fixa	Fundos de Renda Fixa 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	0,00%	100,00%	24,84%	23,20%
Renda Fixa	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	0,00%	60,00%	5,93%	4,05%
TOTAL RENDA FIXA				89,92%	93,15%
Renda Variável	Fundo de Ações - Art. 8º, I	0,00%	30,00%	5,08%	4,95%
Inv. Exterior	Fundos de Ações - BDR Nível I - Art. 9º, III	0,00%	10,00%	0,00%	1,90%
Consignado	Empréstimos Consignados - Art. 12, I	0,00%	5,00%	5,00%	0,00%
TOTAL GERAL				100,00%	100,00%

2. Relatório Trimestral dos Investimentos

Rentabilidade versus Meta Atuarial da Carteira do PREVID – 2024

PERÍODO	META ATUARIAL (IPCA + 4,94% a.a.)	RENTABILIDADE PREVID	ATINGIMENTO DA META ATUARIAL
01/2024	0,84%	0,77%	91,23%
02/2024	1,20%	0,96%	80,00%
03/2024	0,54%	0,88%	161,76%
1º Trimestre	2,61%	2,63%	100,90%
Ano	2,61%	2,63%	100,90%

Fonte: Dginv e LDB Consultoria.

2. Relatório Trimestral dos Investimentos

Rentabilidade e Indicadores da Carteira do PREVID - 2024

Descrição	JAN	FEV	MAR	Acumulado no Ano
Rentabilidade da Carteira - PREVID	0,77%	0,96%	0,88%	2,63%
IPCA	0,42%	0,83%	0,16%	1,42%
Meta Atuarial (IPCA + 4,94% a.a.)	0,84%	1,20%	0,54%	2,61%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	2,62%
Rent. Carteira - PREVID (Real)	0,35%	0,13%	0,72%	1,20%
Atingimento da Meta (IPCA + 4,94% a.a.)	91,23%	80,00%	161,76%	100,90%
Atingimento do IPCA	183,33%	115,66%	550,00%	186,08%
Atingimento do CDI	79,38%	120,00%	106,02%	100,44%

Fonte: Dginv e LDB Consultoria.

2. Relatório Trimestral dos Investimentos

Rentabilidade Acumulada da Carteira do PREVID

Ano	Meta Atuarial ¹	Rentabilidade da Carteira do PREVID	Atingimento da Meta Atuarial
2014	8,81%	8,67%	98,41%
2015	16,28%	13,88%	85,26%
2016	11,07%	13,21%	119,30%
2017	7,58%	11,58%	152,80%
2018	8,15%	10,37%	127,20%
2019	8,74%	10,96%	125,38%
2020	8,42%	6,31%	74,85%
2021	12,25%	2,05%	16,71%
2022	10,01%	6,61%	66,09%
2023	8,74%	12,06%	137,98%
2024 ²	2,61%	2,63%	100,90%
Acumulado	165,63%	154,65%	93,37%

Notas:

(1) Meta Atuarial definida na Política Anual de Investimentos do SUPSEC/PREVID:

De **2014 a 2015**: variação do INPC + 4,50% a.a.; De **2016 a 2017**: variação do IPCA + 4,50% a.a.; De **2018 a 2019**: variação do IPCA + 4,25% a.a.; **2020**: variação do IPCA + 3,75% a.a.; **2021**: variação do IPCA + 2,00% a.a.; **2022**: variação do IPCA + 4,00% a.a.; **2023**: variação do IPCA + 4,00% a.a.

(2) **2024**: variação do IPCA + 4,94% a.a. (Atualizada até março)

Fonte: Dginv e LDB Consultoria.

2. Relatório Trimestral dos Investimentos

Rendimento das Carteiras - 2024

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Trimestre (R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,85 102,12	2,62 99,68	2,62 99,68	5,56 100,47	9,78 79,11	22.132.492,85	22.132.492,85
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,77 92,15	2,36 89,93	2,36 89,93	5,18 93,46	10,53 85,22	10.425.158,62	10.425.158,62
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,89 106,47	2,85 108,62	2,85 108,62	5,93 107,15	13,16 106,46	2.144.534,99	2.144.534,99
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,42 2,13	-6,13 -1,60	-6,13 -1,60	4,85 -5,05	16,59 -9,15	-1.202.137,07	-1.202.137,07
Artigo 9º III % do CDI	3,48 417,27	14,98 570,76	14,98 570,76	23,77 429,35	32,44 262,42	3.684.924,63	3.684.924,63
CEARÁ - PREVID (Total)						37.184.974,02	37.184.974,02

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Trimestre (R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,80 95,55	2,47 94,12	2,47 94,12	5,37 96,90	12,08 97,72	7.495.938,97	7.495.938,97
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						7.495.938,97	7.495.938,97

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Trimestre (R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,80 95,55	2,47 94,12	2,47 94,12	5,37 96,90	12,08 97,72	3.015.178,83	3.015.178,83
CEARÁ - PREVMILITAR (Total)						3.015.178,83	3.015.178,83

CEARÁ - CONSOLIDADO (Total)						47.696.091,80	47.696.091,80
------------------------------------	--	--	--	--	--	----------------------	----------------------

2. Relatório Trimestral dos Investimentos

Análise de Risco

- **Value at Risk (VaR)** é um método para avaliar o risco em operações financeiras. O VaR resume, em um número, o risco de um produto financeiro ou o risco de uma carteira de investimentos. Esse número representa a pior perda esperada em um dado horizonte de tempo e é associado a um intervalo de confiança.
- Essa técnica visa quantificar o *risco de mercado*, ou seja, do risco de perdas monetárias decorrentes da variação de preços, de taxas de juros ou de taxas de câmbio.

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 6.631.582,40

Value-At-Risk: 0,45%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,38	0,20	5,00	0,14	-0,00	0,83	1.385.641.213,06	93,15
Artigo 8º	14,91	5,99	20,00	0,27	0,04	1,42	73.654.720,63	4,95
Artigo 9º	12,38	5,51	20,00	0,04	0,21	3,48	28.282.255,23	1,90
CEARÁ - PREVID		0,45		0,45			1.487.578.188,92	100,00

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

Artigo 7º I, Alinea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,61	0,99	32.256.451,49	2,17
NTN-B 150535 (5,784900%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,66	1,00	32.770.298,17	2,20
NTN-B 150535 (5,886400%)	0,25	0,15	0,00	0,17	0,70	1,01	7.689.878,15	0,52
NTN-B 150535 (5,909200%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,70	1,01	87.728.360,60	5,90
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,70	1,01	13.141.344,93	0,88
NTN-B 150535 (6,216000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,79	1,03	2.785.261,58	0,19
NTN-B 150545 (5,897300%)	0,29	0,23	-0,00	0,24	0,63	1,01	123.556.293,53	8,31
NTN-B 150545 (5,900200%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,69	1,01	132.333.526,11	8,90
NTN-B 150832 (5,763300%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,65	1,00	43.534.867,73	2,93
NTN-B 150840	3,27	2,26	0,05	2,25	-0,48	-0,74	47.920.860,56	3,22
NTN-B 150840 (5,347000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,53	0,97	8.717.487,31	0,59
NTN-B 150850 (5,674000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,63	0,99	22.423.635,42	1,51
NTN-B 150860	4,88	2,85	0,03	2,85	-0,31	-0,69	24.476.578,96	1,65
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,56	0,98	19.615.182,91	1,32
NTN-B 150860 (5,599600%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,60	0,99	91.224.388,86	6,13
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,66	1,00	75.415.684,33	5,07
NTN-B 150860 (5,926400%)	0,25	0,15	0,00	0,17	0,72	1,01	18.044.772,02	1,21
NTN-B 150860 (5,949840%)	0,25	0,15	0,00	0,17	0,71	1,01	73.666.292,58	4,95
NTN-B 150860 (5,959200%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,71	1,01	86.549.128,20	5,82
NTN-B 150860 (5,986700%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,72	1,02	30.172.783,45	2,03
NTN-B 150860 (6,225100%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,79	1,04	6.250.654,62	0,42
Sub-total	0,39	0,21	0,09		0,04	0,85	980.273.731,51	65,90

2. Relatório Trimestral dos Investimentos

Análise de Risco - Cont.

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,18	0,09	0,00	0,05	-0,21	0,80	34.170.585,08	2,30
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	2,03	1,19	0,01	0,02	-0,22	0,39	26.604.913,39	1,79
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,51	0,84	0,01	0,02	-0,22	0,50	26.657.193,85	1,79
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,42	0,33	0,00	1,29	0,20	0,92	213.400.333,99	14,35
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,34	1,25	0,02	0,38	-0,36	-0,00	31.314.879,51	2,11
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,42	0,34	0,00	0,35	0,20	0,92	12.939.838,60	0,87
Sub-total	0,40	0,32	0,05		-0,16	0,77	345.087.744,42	23,20

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,03	0,01	0,00	0,01	0,02	0,83	4.525.752,66	0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	NaN	0,00	NaN	-3,99	0,75	0,00	0,00
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,06	0,00	0,06	1,32	0,91	55.753.984,47	3,75
Sub-total	0,05	0,06	0,00		1,06	0,89	60.279.737,13	4,05

Fonte: Dginv e LDB Consultoria.

2. Relatório Trimestral dos Investimentos

Análise de Risco - Cont.

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,99%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC	16,36	12,18	0,08	0,34	0,03	1,31	11.275.713,62	0,76
BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FI	9,85	6,13	0,07	3,80	0,04	1,25	19.977.678,57	1,34
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	13,23	9,03	0,04	0,17	0,10	2,09	7.401.328,44	0,50
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	9,81	4,68	0,04	5,39	0,25	3,29	20.000.000,00	1,34
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	8,72	5,73	0,05	2,02	-0,19	-0,86	15.000.000,00	1,01
Sub-total	14,91	5,99	0,27		0,04	1,42	73.654.720,63	4,95

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,51%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,38	5,51	0,04	0,56	0,21	3,48	28.282.255,23	1,90
Sub-total	12,38	5,51	0,04		0,21	3,48	28.282.255,23	1,90

Fonte: Dginv e LDB Consultoria.

3. Proposta de Alocação

3. Proposta de Alocação

☐ Pagamento de Cupons = Comprar Títulos Públicos Federais

- ✓ Utilizar os recursos do pagamento de cupons para aquisição de TPF, observando que a contratação desses ativos deva estar sempre vinculada a uma rentabilidade superior à meta atuarial de longo prazo (IPCA + 4,94%), conforme deliberado por este Comitê na 26 RO – 12/08/2022;
- ✓ Os recursos estão no Fundo BTG Pactual Tesouro Selic junto com o restante que ficou da última compra.

PAGAMENTOS DE CUPONS				
BTG PACTUAL - 15/05/2024				
ATIVO	EMISSOR	VCTO. ATIVO	JUROS	
NTN-B 15/05/2035 (6,2160%) Liq: 23/11/2022	BACEN	15/05/2035	R\$	82.061,80
NTN-B 15/05/2035 (5,8864%) Liq: 09/11/2022	BACEN	15/05/2035	R\$	220.935,62
NTN-B 15/05/2035 (5,9270%) Liq: 14/09/2022	BACEN	15/05/2035	R\$	378.746,79
NTN-B 15/05/2035 (5,6342%) Liq: 13/04/2022	BACEN	15/05/2035	R\$	908.992,30
NTN-B 15/05/2035 (5,7849%) Liq: 08/06/2022	BACEN	15/05/2035	R\$	934.242,08
NTN-B 15/05/2035 (5,9092%) Liq: 16/03/2022	BACEN	15/05/2035	R\$	2.524.978,62
NTN-B 15/05/2045 (5,9002%) Liq: 23/03/2022	BACEN	15/05/2045	R\$	3.534.970,06
NTN-B 15/05/2045 (5,8973%) Liq: 27/03/2024	BACEN	15/05/2045	R\$	3.787.467,93
			TOTAL R\$	12.372.395,20

Fonte: BTG Pactual e Dginv.

3. Proposta de Alocação

❑ Comprar LFs considerando a estratégia alvo da P.I.

- ✓ A Instituição Financeira deve estar na Lista Exaustiva do BACEN; [Lista Exaustiva - BACEN](#)
- ✓ Ser classificada pelo BACEN como Segmento S1 ou S2; e [Regulação Prudencial Segmentação](#)
- ✓ E apresentar no mínimo os *ratings* atribuídos por agências classificadoras de risco de crédito atuantes no Brasil:
 - **brA-** da Agência Standard & Poor's; ou
 - **A3.br** da Agência Moody's; ou
 - **A-(bra)** da Agência Fitch Ratings; ou
 - **brA** da Agência SR Ratings; ou
 - **brAA** da Agência Austin Rating.

Fitch Ratings		Moody's		Standard & Poor's		Significado na escala
AAA		Aaa		AAA		↑ Grau de investimento com qualidade alta e baixo risco
AA+		Aa1		AA+		
AA		Aa2		AA		
AA-		Aa3		AA-		
A+		A1		A+		
A		A2		A		
A-		A3		A-		
BBB+		Baa1		BBB+		Grau de investimento, qualidade média
BBB		Baa2		BBB		
BBB-		Baa3		BBB-		
BB+		Ba1		BB+		Categoria de especulação, baixa classificação
BB		Ba2		BB		
BB-		Ba3		BB-		
B+		B1		B+		
B		B2		B		
B-		B3		B-		
CCC		Caa1		CCC+		Risco alto de inadimplência e baixo interesse
CC		Caa2		CCC		
C		Caa3		CCC-		
RD		Ca		CC		
D		C		C		
				D		

Fonte: Fitch Ratings; Standard & Poor's; Moody's

3. Proposta de Alocação

❑ Alocar os recursos do FI CAIXA IRF-M TP RF LP e FI CAIXA IRF-M1+ TP RF LP para BRADESCO FI RF REF. DI PREMIUM

- ✓ D0 = 04/08/2023;
- ✓ Recurso aportado = R\$ 25.000.000,00 em cada Fundo;
- ✓ Tom mais duro do COPOM (Juros Brasileiros);

17 de maio de 2024

Expectativas de Mercado

Mediana - Agregado	2024						
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***
IPCA (variação %)	3,73	3,76	3,80 ▲	(2)	151	3,84	72
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	2,02	2,09	2,05 ▼	(1)	116	2,02	46
Câmbio (R\$/US\$)	5,00	5,00	5,04 ▲	(1)	122	5,02	55
Selic (% a.a)	9,50	9,75	10,00 ▲	(3)	144	10,00	86

Fonte: BACEN

- ✓ Tom mais duro do FOMC (Juros Americanos).

3. Proposta de Alocação

CDI	IPCA	IMA-B	IRF-M	SELIC	IBOVESPA
SMLL	BDRX	IDIV	ICON		

No Ano	12 Meses	24 Meses	36 Meses	Desde Início	Personalizado
--------	----------	----------	----------	--------------	---------------

Início	Final	
04/08/2023	27/05/2024	Aplicar

Fundo de Renda Fixa



Fonte: SGOLD

3. Proposta de Alocação

INFORMAÇÕES GERAIS SOBRE OS FUNDOS DE INVESTIMENTOS

Fundo	CNPJ	Gestor	PL Atual (R\$)	Cotistas	Tx. Admin.	Tx. Perf.	Cota de Apli.	Cota de Resg.	Pag. do Resg.
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	10.577.519/0001-90	CAIXA DISTRIBUIDO...	1.181.671.603,73	247	0,20%	0,00%	D+0	D+0	D+0
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	14.508.605/0001-00	CAIXA DISTRIBUIDO...	2.282.922.434,49	451	0,20%	0,00%	D+0	D+0	D+0
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI...	03.399.411/0001-90	BRAM - BRADESCO ...	11.895.167.656,83	475	0,20%	0,00%	D+0	D+0	D+0

RENTABILIDADES HISTÓRICAS

Fundos	No Mês	No Ano	3 Meses	6 Meses	12 Meses	24 Meses	36 Meses
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	0,17%	1,06%	0,26%	3,16%	10,35%	26,70%	25,45%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	0,28%	1,79%	0,80%	3,60%	10,50%	26,31%	28,32%
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PR...	0,71% 🏆	4,63% 🏆	2,72% 🏆	5,81% 🏆	13,03% 🏆	28,63% 🏆	39,56% 🏆

AVALIAÇÃO DE RISCO E INDICADORES (12 Meses)

Fundo	Volatilidade	Retorno Positivo	Sharpe	Sortino	Beta	Treynor	PL/Cotistas (R\$)
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	3,29%	62,65%	-0,51	-0,80	5,19	-0,32	4.784.095,56
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	2,34%	65,06%	-0,66	-1,05	4,05	-0,38	5.061.912,27
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PR...	0,11% 🏆	100,00% 🏆	9,21 🏆	-	1,10 🏆	0,91 🏆	25.042.458,22 🏆

3. Proposta de Alocação

Gráfico de Risco X Retorno



Gráfico de Correlação de Pearson

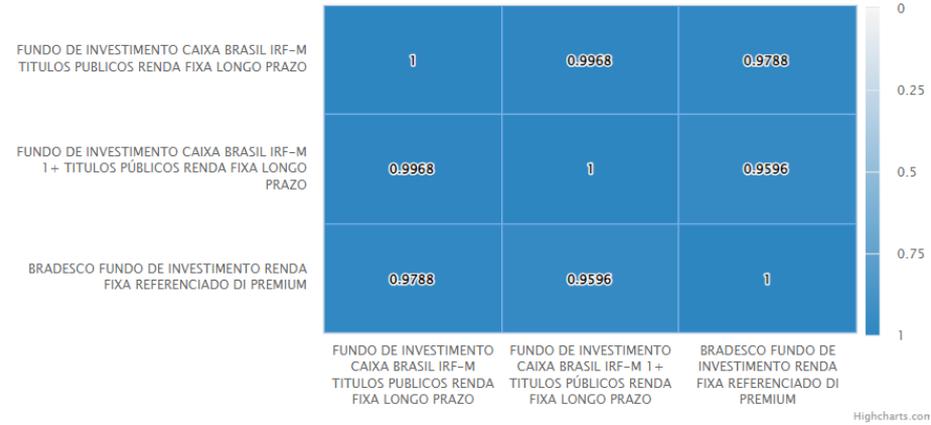


Gráfico Cotistas

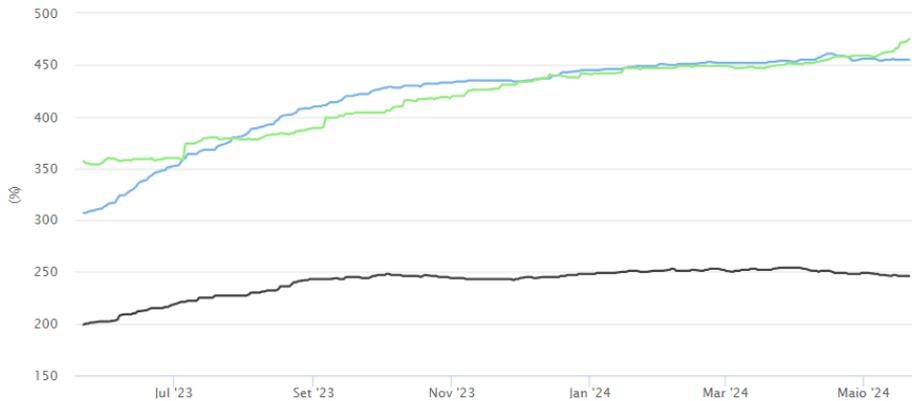
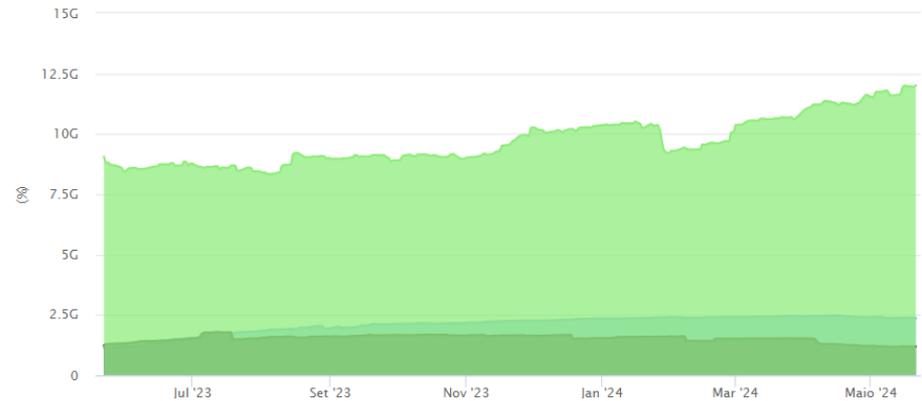


Gráfico Evolução do Patrimônio



3. Proposta de Alocação

AVALIAÇÃO DOS FUNDOS

Fundos	Avaliação	Categorias
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	☆☆☆☆☆☆☆☆	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	☆☆☆☆☆☆☆☆	
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	★★★★★★★★	Rentabilidade Curto Prazo, Rentabilidade Médio Prazo, Rentabilidade Longo Prazo, Risco, Retorno Positivo, Sharpe, Beta, PL Por Cotistas

Fonte: SGOLD

3. Proposta de Alocação

Posição: 22/05/2024

Simulação

Fundo	Res. CMN nº 4.963/2021	D0	DATA (D0)	Aplicação	Saldo Após aplicação	% da Carteira	Estratégia Alvo	Patrimônio Fundo	% Patrimônio Fundo
TÍTULOS PÚBLICOS	Art. 7º, I - a	920.082.320,29	Mar/22 a Mar/24	16.988.508,70	996.019.533,06	62,12%	59,15%	-	-
SUBTOTAL		-	-	-	-	62,12%	59,15%	-	-
FI BRASIL IRFM 1*	Art. 7º, I - b	21.114,33	04/08/2023	-40.000.000,00	54.703.625,94	3,41%	12,77%	8.777.091.547,62	0,62%
FI BRASIL 2024 IV TP RF		160.399.411,08	06/09/2018		216.182.823,74	13,48%		3.962.247.252,49	5,46%
FI BRASIL 2030 III TP RF*		40.000.000,00	04/06/2018		31.176.792,01	1,94%		236.140.690,28	13,20%
FI BRASIL IRFM 1 MAIS		25.000.000,00	04/08/2023	-26.420.965,42	0,00	0,00%		2.370.286.068,59	0,00%
FI BRASIL IRF-M TP RF LP		25.000.000,00	04/08/2023	-26.614.629,20	0,00	0,00%		1.191.020.456,48	0,00%
BB PREV XXI		12.003.778,42	26/01/2022		13.108.583,05	0,82%		3.636.759.436,45	0,36%
SUBTOTAL	-	-	-	-	-	19,66%	12,77%	-	-
BTG PACTUAL TESOURO SELIC*	Art. 7º, III - a	22.000.000,00	09/03/2022	-16.988.508,70	0,00	0,00%	7,00%	21.395.173.050,69	0,00%
BRADESCO FI REF DI PREMIUM*		104.548.163,97	28/10/2022	53.035.594,62	109.670.860,43	6,84%		12.012.321.591,90	0,91%
BB PREVID FLUXO RF		-	-		0,00	0,00%		4.654.600.894,66	0,00%
SUBTOTAL	-	-	-	-	-	6,84%	7,00%	-	-
LETRAS FINANCEIRAS	Art. 7º, IV	40.000.000,00	03/05/2024	40.000.000,00	80.233.108,83	5,00%	5,00%	12.012.321.591,90	0,67%
SUBTOTAL		-	-	-	-	-	5,00%	5,00%	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA	Art. 8º, I	20.000.000,00	28/03/2024		20.298.940,77	1,27%	5,08%	1.431.351.893,86	1,42%
BB CONSUMO FIC AÇÕES		20.160.122,00	24/11/2020		10.900.472,59	0,68%		87.244.309,17	12,49%
BB AÇÕES DIVID MIDCAPS		20.000.000,00	27/03/2024		19.002.119,77	1,19%		736.287.118,21	2,58%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		8.000.000,00	04/11/2020		6.798.858,52	0,42%		636.605.160,36	1,07%
SANTANDER - AÇÕES DIVIDENDOS		15.000.000,00	28/03/2024		15.155.376,07	0,95%		195.017.293,65	7,77%
SUBTOTAL	-	-	-	-	-	4,50%	5,08%	-	-
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	Art. 9º, III	24.000.000,00	05/05/2021		30.043.911,77	1,87%	2,00%	2.418.294.314,67	1,24%
SUBTOTAL		-	-	-	-	-	1,87%	2,00%	-
TOTAL	-	-	-	-	1.603.295.006,55	100,00%	-	-	-

* Fundos com Resgates/Aplicações

Fonte: Dginv

4. Edital de Credenciamento

5. Encaminhamentos e Deliberações

5. Encaminhamentos e Deliberações

I. Aprovação das atas da 13ª, 14ª e 15ª R.E.;

II. Aprovação do Relatório Trimestral;

III. Aprovação da Proposta de Alocação;

IV. Aprovação do Edital de Credenciamento.

SIGA

as redes sociais da Cearaprev

   /cearaprev

OBRIGADO

Paulo Sucupira - Diretor

Diretoria de Gestão de Investimentos - Dginv/Cearaprev

paulo.sucupira@cearaprev.ce.gov.br

(85) 3108-0149

EDITAL DE CREDENCIAMENTO DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS

FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ (Cearaprev) - Unidade Gestora do Regime Próprio de Previdência Social dos Servidores Públicos do Estado do Ceará, comunica aos interessados que se encontra aberto o **CREDENCIAMENTO** de Instituições Financeiras, nos seguintes termos:

Objeto: O credenciamento se aplica às seguintes Instituições:

- I - Administradores e Gestores de Fundos de Investimentos;
- II - Distribuidores de Produtos de Investimentos;
- III - Custodiantes de Ativos Financeiros;
- IV - Instituições Financeiras Bancárias Emissoras de Ativo Financeiro de Renda Fixa;
- V - Corretoras e Distribuidoras de Títulos e Valores Mobiliários;
- VI - Fundos de Investimento.

Todas as instituições devem ter autorização para, nos termos da legislação em vigor, atuar no Sistema Financeiro Nacional, observando-se integralmente as normas que regulamentam as aplicações de recursos dos Regimes Próprios de Previdência Social - RPPS no mercado financeiro nacional, em especial as estabelecidas pelo Conselho Monetário Nacional - CMN e Secretaria de Regime Próprio e Complementar - SRPC do Ministério da Previdência Social - MPS, e no que couber, as leis federal e estadual de licitações e contratos.

Os interessados poderão efetuar o *download* deste Edital de Credenciamento no portal eletrônico da Cearaprev: www.cearaprev.ce.gov.br/Edital-de-credenciamento na aba Edital de Credenciamento - Edital de Credenciamento 2024.

Edital de Credenciamento

1. Introdução

De acordo com a Resolução CMN nº 4.963/2021 e Portaria MTP nº 1.467/2022, em conjunto com a Política de Investimentos vigente da Cearaprev, ficam estabelecidos os critérios e as condições para o credenciamento de Instituições Financeiras.

2. Objeto

Credenciar Instituições Financeiras, nos termos da legislação em vigor, que atuam no Sistema Financeiro Nacional, observando-se as normas que regulamentam as aplicações de recursos dos Regimes Próprios de Previdência Social - RPPS no mercado financeiro nacional, em especial as estabelecidas pelo Conselho Monetário Nacional - CMN e Secretaria do Regimes Próprio e Complementar - SRPC do Ministério da Previdência Social - MPS e, no que couber, as leis federal e estadual de licitações e contratos.

3. Credenciamento

Os interessados em se credenciar deverão apresentar as seguintes documentações:

3.1. Administradores e Gestores de Fundo de Investimento, que cumprem o previsto no artigo 21, § 2º, I, da Resolução CMN nº 4.963/2021 e artigo 107, inciso II da Portaria MTP nº 1.467/2022.

Documentação:

- a. Requerimento para Credenciamento como Administrador ou Gestor de Recursos de Terceiros; (Anexo I)
- b. Ato declaratório da Comissão de Valores Mobiliários (CVM), situação cadastral junto à CVM; [Sistemas CVM](#) (disponível em 06/05/2024)
- c. Ato de registro ou autorização para funcionamento expedido pelo Banco Central do Brasil (BACEN), certidão do BACEN quanto à situação da Instituição

(emissão da certidão para entidades supervisionadas); [Emissão de Certidão para Entidades Supervisionadas](#) (disponível em 06/05/2024)

- d. Certidão Conjunta Negativa de Débitos Relativos aos tributos federais e à dívida ativa da União - CND expedida, conjuntamente pelo Ministério da Economia, Secretaria Especial da Receita Federal do Brasil e Procuradoria-Geral da Fazenda Nacional; [Certidão de Débitos Relativos a Créditos Tributários Federais e à Dívida Ativa da União](#) (disponível em 06/05/2024)
- e. Certidões negativas de débitos tributários relativas aos entes municipal, estadual e distrital;
- f. Certidão de regularidade junto ao Fundo de Garantia do Tempo de Serviço (FGTS) expedida pela Caixa Econômica Federal; [Consulta Regularidade do Empregador](#) (disponível em 06/05/2024)
- g. Cópia atualizada do Ato Constitutivo do Administrador e/ou Gestor e última alteração, devidamente registrados ou Contrato Social;
- h. Cópia dos documentos comprobatórios da capacidade jurídica de seus representantes legais, prepostos e profissionais vinculados (Carteira de Identidade - RG e Cadastro de Pessoas Físicas - CPF);
- i. Relação dos fundos de investimento ofertados pela instituição enquadrados à Resolução CMN nº 4.963/2021, citando suas respectivas classes;
- j. Relação dos principais contatos com o RPPS: cargo, e-mail e telefone;
- k. Se **ADMINISTRADOR**, enviar documento assinado pelos representantes legais, com firma reconhecida ou assinatura digital, declarando que (Anexo II):
 - ✓ Não efetuará quaisquer retenções tributárias, dada a Imunidade Tributária dos Fundos Públicos de Natureza Previdenciária;
 - ✓ Que tem sob sua administração recursos oriundos de RPPS no valor máximo de 50% (cinquenta por cento) do total.

- l. Balanço Patrimonial e demonstrações contábeis do último exercício social, já exigíveis e apresentados na forma da lei, sendo vedada a sua substituição por balancetes ou balanços provisórios;
- m. Administra e gere recursos de terceiros no país pelo período mínimo de 05 (cinco) anos com montante igual ou superior a R\$ 2.500.000.000,00 (dois bilhões e quinhentos milhões de reais) e que não possui fato impeditivo, sendo todas as informações prestadas verdadeiras; [Administradores - ANBIMA](#) (disponível em 06/05/2024)
- n. Certidão Negativa de Débitos Trabalhistas (CNDT), instituída pela lei 12.440/2011;
- o. Termo de Credenciamento de administrador; [Termo de Credenciamento - Administrador ou Gestor de Fundo de Investimento](#) (disponível em 06/05/2024)
- p. Apresentar declaração emitida por agência classificadora de risco quanto à Gestão de Fundo de Investimento. Somente será credenciado o Gestor de Fundo de Investimento que estiver com uma das seguintes classificações:
 - ✓ Excelente ou Forte da Agência Fitch Ratings; ou
 - ✓ MQ1 ou MQ2 da Agência Moody's; ou
 - ✓ AMP1 ou AMP2 da Agência Standard & Poor's; ou
 - ✓ AM1 ou AM2 da Agência Liberum Ratings; ou
 - ✓ QG1 ou QG2 da Agência Austin Rating; ou
 - ✓ G1 ou G2 da SR Rating.

3.2. Gestores de Fundo de Investimento, que NÃO cumprem o previsto no artigo 21, § 2º, I, da Resolução CMN nº 4.963/2021 e artigo 107, inciso II da Portaria MTP nº 1.467/2022.

Documentação:

- a. Requerimento para Credenciamento de Instituição Financeira como Gestor de Recursos de Terceiros; (Anexo I)

- b. Ato declaratório da Comissão de Valores Mobiliários (CVM), situação cadastral junto à CVM; [Sistemas CVM](#) (disponível em 06/05/2024)
- c. Ato de registro ou autorização para funcionamento expedido pelo Banco Central do Brasil, certidão do BACEN quanto à situação da Instituição (emissão da certidão para entidades supervisionadas); [Emissão de Certidão para Entidades Supervisionadas](#) (disponível em 06/05/2024)
- d. Certidão Conjunta Negativa de Débitos Relativos aos tributos federais e à dívida ativa da União - CND expedida, conjuntamente pelo Ministério da Economia, Secretaria Especial da Receita Federal do Brasil e Procuradoria Geral da Fazenda Nacional; [Certidão Relativa a Débitos da Receita - CNDT](#) (disponível em 06/05/2024)
- e. Certidões negativas de débitos tributários relativas aos entes municipal, estadual e distrital;
- f. Certidão de regularidade junto ao Fundo de Garantia do Tempo de Serviço (FGTS) expedida pela Caixa Econômica Federal; [Consulta Regularidade do Empregador](#) (disponível em 06/05/2024)
- g. Cópia atualizada do Ato Constitutivo da Gestora e última alteração, devidamente registrados ou Contrato Social;
- h. Cópia dos documentos comprobatórios da capacidade jurídica de seus representantes legais, prepostos e profissionais vinculados (Carteira de Identidade - RG e Cadastro de Pessoas Físicas - CPF);
- i. Relação dos fundos de investimento ofertados pela instituição enquadrados à Resolução CMN nº 4.963/2021, citando suas respectivas classes;
- j. Relação dos principais contatos com o RPPS: cargo, e-mail e telefone;
- k. Questionário Padrão *Due Diligence* da ANBIMA (Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiros e de Capitais) para Fundos de

Investimento: Seção 1 - Informações sobre a empresa e Seção 3 - Resumos Profissionais;

- I. Prova de adesão ao Código de Ética da Anbima, ou próprio ou documento que comprove elevado padrão ético;
- m. Documento assinado pelos representantes legais, com firma reconhecida ou assinatura digital, declarando que (Anexo III):
 - ✓ Os fundos de investimento ofertados ao RPPS têm administrador que atenda o previsto no artigo 21, § 2º, I e II, da Resolução CMN nº 4.963/2021 e artigo 107, inciso II da Portaria MTP nº 1.467/2022;
 - ✓ Não possui penalidade imputada pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM) em razão de infração média e/ou grave nos 05 (cinco) anos anteriores à data de publicação deste Edital;
 - ✓ Realiza gestão de recursos de terceiros no país pelo período mínimo de 05 (cinco) anos com montante igual ou superior a R\$ 2.500.000.000,00 (dois bilhões e quinhentos milhões de reais) e que não possui fato impeditivo, sendo todas as informações prestadas verdadeiras.
[Gestores - ANBIMA](#) (disponível em 06/05/2024)
 - ✓ Não se encontra impedido, nem suspenso, nem foi declarado inidôneo para participar de licitações, ou contratar com o Poder Público e que informará, sob as penalidades cabíveis, a superveniência de fato impeditivo ou suspensivo da manutenção do credenciamento; e que
 - ✓ As informações apresentadas por esta Instituição são verdadeiras e autênticas, e a mesma concorda com as condições estipuladas no Edital de Credenciamento e está ciente de assumir todas as obrigações dele decorrentes

- n. Apresentar declaração emitida por agência classificadora de risco quanto à Gestão de Fundo de Investimento. Somente será credenciado o Gestor de Fundo de Investimento que estiver com uma das seguintes classificações:
- ✓ Excelente ou Forte da Agência Fitch Ratings; ou
 - ✓ MQ1 ou MQ2 da Agência Moody's; ou
 - ✓ AMP1 ou AMP2 da Agência Standard & Poor's; ou
 - ✓ AM1 ou AM2 da Agência Liberum Ratings; ou
 - ✓ QG1 ou QG2 da Agência Austin Rating; ou
 - ✓ G1 ou G2 da SR Rating.
- o. Balanço Patrimonial e demonstrações contábeis do último exercício social, já exigíveis e apresentados na forma da lei, sendo vedada a sua substituição por balancetes ou balanços provisórios;
- p. Em se tratando de Empresa ou Sociedade Estrangeira em funcionamento no País, Decreto de Autorização;
- q. Apresentar Certidão Negativa de falência, concordata ou recuperação judicial;
- r. Certidão Negativa de Débitos Trabalhistas (CNDT), instituída pela lei 12.440/2011;
- s. Termo de Credenciamento de Gestor; [Termo de Credenciamento - Administrador ou Gestor de Fundo de Investimento](#) (disponível em 06/05/2024)

3.3. Para o Distribuidor de produtos de investimento ou Pessoas Jurídicas que atuem como agentes autônomos de investimentos, deverá apresentar os seguintes documentos:

Documentação:

- a. Requerimento para Credenciamento como Distribuidor de Produtos de Investimentos; (Anexo I)

- b. Ato declaratório da Comissão de Valores Mobiliários (CVM), situação cadastral junto à CVM; [Sistemas CVM](#) (disponível em 06/05/2024)
- c. Ato de registro ou autorização para funcionamento expedido pelo Banco Central do Brasil, certidão do BACEN quanto à situação da Instituição (emissão da certidão para entidades supervisionadas); [Emissão de Certidão para Entidades Supervisionadas](#) (disponível em 06/05/2024)
- d. Certidão Conjunta Negativa de Débitos Relativos aos tributos federais e à dívida ativa da União - CND expedida, conjuntamente pelo Ministério da Economia, Secretaria Especial da Receita Federal do Brasil e Procuradoria Geral da Fazenda Nacional; [Certidão Negativa Débitos Receita Federal](#) (disponível em 06/05/2024)
- e. Certidões negativas de débitos tributários relativas aos entes municipal, estadual e distrital;
- f. Certidão de regularidade junto ao Fundo de Garantia do Tempo de Serviço (FGTS) expedida pela Caixa Econômica Federal; [Consulta Regularidade do Empregador](#) (disponível em 06/05/2024)
- g. Cópia atualizada do Ato Constitutivo da Instituição e última alteração, devidamente registrados ou Contrato Social;
- h. Cópia dos documentos comprobatórios da capacidade jurídica de seus representantes legais, prepostos e profissionais vinculados (Carteira de Identidade - RG e Cadastro de Pessoas Físicas - CPF);
- i. Relação dos principais contatos com o RPPS: cargo, e-mail e telefone;
- j. Contrato de prestação de serviços firmado entre o distribuidor ou a pessoa jurídica que atue como agente autônomo de investimento e a instituição financeira representada;
- k. Questionário ANBIMA de *Due Diligence* para contratação de Distribuidor de Produtos de Investimento ou Agente Autônomo de Investimento;

- l. Questionário ANBIMA Padrão *Due Diligence* para Fundos de Investimento - Resumos Profissionais;
- m. Balanço Patrimonial e demonstrações contábeis do último exercício social, já exigíveis e apresentados na forma da lei, sendo vedada a sua substituição por balancetes ou balanços provisórios;
- n. Não possui penalidade imputada pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM) em razão de infração média e/ou grave nos 05 (cinco) anos anteriores à data de publicação deste Edital;
- o. Certidão Negativa de Débitos Trabalhistas (CNDT), instituída pela lei 12.440/2011;
- p. Termo de Credenciamento de Distribuidor e Agente Autônomo de Investimentos. [Termo de Credenciamento de Distribuidor](#) e [Termo de Credenciamento de Agente Autônomo de Investimentos](#) (disponível em 06/05/2024)

3.4. Para o Custodiante de Ativos Financeiros, deverá apresentar os seguintes documentos:

Documentação:

- a. Requerimento para Credenciamento como Custodiante de Ativos Financeiros; (Anexo I)
- b. Ato declaratório da Comissão de Valores Mobiliários (CVM), situação cadastral junto à CVM; [Sistemas CVM](#) (disponível em 06/05/2024)
- c. Certidão Conjunta Negativa de Débitos Relativos aos tributos federais e à dívida ativa da União - CND expedida, conjuntamente pelo Ministério da Economia, Secretaria Especial da Receita Federal do Brasil e Procuradoria Geral da Fazenda Nacional; [Certidão de Débitos Relativos a Créditos Tributários Federais e à Dívida Ativa da União](#) (disponível em 06/05/2024)

- d. Certidões negativas de débitos tributários relativas aos entes municipal, estadual e distrital;
- e. Certidão de regularidade junto ao Fundo de Garantia do Tempo de Serviço (FGTS) expedida pela Caixa Econômica Federal; [Consulta Regularidade do Empregador](#) (disponível em 06/05/2024)
- f. Certidão Negativa de Débitos Trabalhistas (CNDT), instituída pela lei 12.440/2011;
- g. Cópia atualizada do Ato Constitutivo da Administradora e última alteração, devidamente registrados ou Contrato Social;
- h. Não possui penalidade imputada pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM) em razão de infração média e/ou grave nos 05 (cinco) anos anteriores à data de publicação deste Edital;
- i. Administra recursos de terceiros no país pelo período mínimo de 05 (cinco) anos com montante igual ou superior a R\$ 2.500.000.000,00 (dois bilhões e quinhentos milhões de reais); [Administradores - ANBIMA](#) (disponível em 06/05/2024) (Anexo II)
- j. Que não possui fato impeditivo, sendo todas as informações prestadas verdadeiras;
- k. Em se tratando de Empresa ou Sociedade Estrangeira em funcionamento no País, Decreto de Autorização;
- l. Termo de Credenciamento de Custodiante. [Termo de Credenciamento de Custodiante](#) (disponível em 06/05/2024)

3.5. Instituições Financeiras Bancárias Emissoras de ativos financeiros aptos a receberem diretamente as aplicações do RPPS.

Documentação:

- a. Requerimento para Credenciamento de Instituição Financeira Emissora de Ativos Financeiros; (Anexo I)
- b. Ato declaratório da Comissão de Valores Mobiliários (CVM), situação cadastral junto à CVM; [Sistemas CVM](#) (disponível em 06/05/2024)
- c. Ato de registro ou autorização para funcionamento expedido pelo Banco Central do Brasil, certidão do BACEN quanto à situação da Instituição (emissão da certidão para entidades supervisionadas); [Emissão de Certidão para Entidades Supervisionadas](#) (disponível em 06/05/2024)
- d. Certidão Conjunta Negativa de Débitos Relativos aos tributos federais e à dívida ativa da União - CND expedida, conjuntamente pelo Ministério da Economia, Secretaria Especial da Receita Federal do Brasil e Procuradoria-Geral da Fazenda Nacional; [Certidão Negativa de Débitos da Receita](#) (disponível em 06/05/2024)
- e. Certidões negativas de débitos tributários relativas aos entes municipal, estadual e distrital;
- f. Certidão de regularidade junto ao Fundo de Garantia do Tempo de Serviço (FGTS) expedida pela Caixa Econômica Federal; [Consulta Regularidade do Empregador](#) (disponível em 06/05/2024)
- g. Cópia atualizada do Ato Constitutivo da Instituição e última alteração, devidamente registrados;
- h. Cópia dos documentos comprobatórios da capacidade jurídica de seus representantes legais, prepostos e profissionais vinculados (Carteira de Identidade - RG e Cadastro de Pessoas Físicas - CPF);
- i. Relação dos principais contatos com o RPPS: cargo, e-mail e telefone;
- j. Comprovação de que a Instituição faz parte da lista exaustiva das instituições que atendem as condições previstas no inciso I do § 2º do artigo 21 da

Resolução CMN nº 4.963/2021 e artigo 107, inciso II da Portaria MTP nº 1.467/2022; [Lista Exaustiva - BACEN](#) (disponível em 06/05/2024)

- k. Relação de ativos financeiros de renda fixa de emissão com obrigação ou coobrigação de Instituições Financeiras bancárias, ofertados aos RPPS;
- l. Balanço Patrimonial e demonstrações contábeis do último exercício social, já exigíveis e apresentados na forma da lei, sendo vedada a sua substituição por balancetes ou balanços provisórios;
- m. Termo de análise de credenciamento (TAC) de Instituição Financeira Bancária Emissora de Ativo Financeiro de Renda Fixa; [Termo de Credenciamento - Instituição Financeira Bancária emissora de ativo financeiro de renda fixa](#) (disponível em 06/05/2024)
- n. Fazer parte da Regulação Prudencial nas segmentações S1 ou S2 emitida pelo Banco Central; [Regulação Prudencial Segmentação](#) (disponível em 06/05/2024)
- o. A Cearaprev utilizará para essa avaliação de risco de crédito da Instituição Financeira Bancária Emissora de Ativo Financeiro de Renda Fixa os *ratings* atribuídos por agências classificadoras de risco de crédito atuantes no Brasil, sendo no mínimo:
 - ✓ brA- da Agência Standard & Poor's; ou
 - ✓ A3.br da Agência Moody's; ou
 - ✓ A-(bra) da Agência Fitch Ratings; ou
 - ✓ brA da Agência SR Ratings; ou
 - ✓ brAA da Agência Austin Rating.

3.6. Corretoras e Distribuidoras de títulos e valores mobiliários para as operações diretas com títulos de emissão do Tesouro Nacional registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia - SELIC.

Documentação:

- a. Requerimento para Credenciamento de Corretoras e Distribuidoras de títulos e valores mobiliários; (Anexo I)
- b. Ato declaratório da Comissão de Valores Mobiliários (CVM), situação cadastral junto à CVM; [Sistemas CVM](#) (disponível em 06/05/2024)
- c. Não possui penalidade imputada pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM) em razão de infração média e/ou grave nos 05 (cinco) anos anteriores à data de publicação deste Edital;
- d. Em se tratando de Empresa ou Sociedade Estrangeira em funcionamento no País, Decreto de Autorização;
- e. Certidão Negativa de Débitos Trabalhistas (CNDT), instituída pela lei 12.440/2011;
- f. Cópia atualizada do Ato Constitutivo da Administradora e última alteração, devidamente registrados ou Contrato Social;
- g. Que não possui fato impeditivo, sendo todas as informações prestadas verdadeiras;
- h. Ato de registro ou autorização para funcionamento expedido pelo Banco Central do Brasil, certidão do BACEN quanto à situação da Instituição (emissão da certidão para entidades supervisionadas); [Emissão de Certidão para Entidades Supervisionadas](#) (disponível em 06/05/2024)
- i. Certidão Conjunta Negativa de Débitos Relativos aos tributos federais e à dívida ativa da União - CND expedida, conjuntamente pelo Ministério da Economia, Secretaria Especial da Receita Federal do Brasil e Procuradoria Geral da Fazenda Nacional; [Certidão Negativa de Débitos da Receita](#) (disponível em 06/05/2024)
- j. Certidões negativas de débitos tributários relativas aos entes municipal, estadual e distrital;

- k. Certidão de regularidade junto ao Fundo de Garantia do Tempo de Serviço (FGTS) expedida pela Caixa Econômica Federal;
[Consulta Regularidade do Empregador](#) (disponível em 06/05/2024)
- l. Cópia atualizada do Ato Constitutivo da Instituição e última alteração, devidamente registrados;
- m. Cópia dos documentos comprobatórios da capacidade jurídica de seus representantes legais, prepostos e profissionais vinculados (Carteira de Identidade - RG e Cadastro de Pessoas Físicas - CPF);
- n. Relação dos principais contatos com o RPPS: cargo, e-mail e telefone;
- o. Comprovação de que a instituição faz parte da lista exaustiva das instituições que atendem as condições previstas no inciso I do § 2º do artigo 21 da Resolução CMN nº 4.963/2021 e artigo 107, inciso II da Portaria MTP nº 1.467/2022; [Lista Exaustiva - BACEN](#) (disponível em 06/05/2024)
- p. Comprovação de que a instituição (instituição financeira/corretora/distribuidora) faz parte da relação de *dealers* credenciados pelo Tesouro Nacional; [Dealers - Tesouro Nacional](#) (disponível em 06/05/2024)
- q. Balanço Patrimonial e demonstrações contábeis do último exercício social, já exigíveis e apresentados na forma da lei, sendo vedada a sua substituição por balancetes ou balanços provisórios.

3.7. Para o Credenciamento dos Fundos de Investimentos, o Administrador do Fundo, ou o Distribuidor por ele designado, deve apresentar os seguintes documentos:

Documentação:

- a. Requerimento para Credenciamento de Fundos de Investimentos, do Administrador do Fundo, ou do Distribuidor; (Anexo I)

- b. Questionário Padrão *Due Diligence* para Fundo de Investimento - Seção 2 da ANBIMA;
 - c. Regulamento em vigor;
 - d. Lâmina de Informações Essenciais;
 - e. Carteira aberta do fundo de investimento, inclusive do fundo máster quando se tratar de FIC ou Feeder;
 - f. Relatório de Evolução Histórica do fundo de Investimentos dos últimos 03 (três) anos, no mínimo.
- 3.8. Somente serão aceitos os Requerimentos das Instituições Financeiras Corretoras ou Distribuidoras de Valores Mobiliários que estejam selecionados pelo Tesouro Nacional a operar como *dealers*, e exclusivamente para as operações diretas com Títulos de emissão do Tesouro Nacional registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia - SELIC.
- 3.9. As Instituições Financeiras CTVM ou DTVM já credenciadas junto à Cearaprev como Administrador, Gestor e/ou Custodiante de Recursos de Terceiros, selecionadas como *dealers*, estão autorizadas a operar com Títulos do Tesouro, em favor da Cearaprev, até o vencimento do Credenciamento dessa instituição financeira.
- 3.10. Os Requerimentos para Credenciamento cujo Administrador de Fundos de Investimentos não conste da lista exaustiva divulgada pelo Ministério da Previdência serão indeferidos de imediato.

4. DA ENTREGA DA DOCUMENTAÇÃO:

- 4.1. Os documentos solicitados no presente Edital deverão ser enviados exclusivamente para o e-mail da Diretoria de Gestão de Investimentos - Dginv: dginv@cearaprev.ce.gov.br, anexados por meio eletrônico (arquivo em PDF), podendo ser solicitado arquivo físico, caso seja necessário;

- 4.2. Toda a documentação deverá ser entregue de uma só vez, quando da solicitação de credenciamento por parte da instituição solicitante;
- 4.3. O prazo para análise da documentação pela Cearaprev será de 15 (quinze) dias úteis, devendo a solicitação de Credenciamento ser registrada em ata de Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos;
- 4.4. Sendo considerada HABILITADA, o processo seguirá para HOMOLOGAÇÃO do Comitê de Investimentos. Nos casos em que a documentação apresentada não contemplar todos os requisitos deste Credenciamento, a instituição terá direito de solicitar por duas vezes a revisão do credenciamento, mediante apresentação do(s) documento(s) saneador(es) dos requisitos. Neste caso, o prazo mínimo para reanálise pela Cearaprev será de 10 (dez) dias úteis;
- 4.5. Todas as certidões solicitadas deverão estar dentro de seu prazo de validade, quando da solicitação do credenciamento;
- 4.6. Todo e qualquer esclarecimento com relação ao Edital de Credenciamento deverá ser feito por escrito através do e-mail: dginv@cearaprev.ce.gov.br em atenção a Dginv;
- 4.7. Os documentos físicos, quando solicitados, deverão ser entregues na sede da Fundação de Previdência Social do Estado do Ceará (Cearaprev), na Rua Vinte e Cinco de Março, 300 - Centro, Fortaleza - CE, 60060-120, das 8:00 às 17:00 (oito às dezessete) horas, e serão recebidos constituindo um procedimento administrativo.

5. DA HABILITAÇÃO:

- 5.1. A aprovação no Processo de Credenciamento não gera, para a Cearaprev, quaisquer obrigações de alocar, manter, contratar ou aplicar recursos junto à Instituição Financeira, mas somente o direito a compor do banco de dados de entidades credenciadas;

- 5.2. Será considerada inabilitada a instituição que deixar de apresentar a documentação solicitada ou apresentá-la com vícios, rasuras ou contrariando qualquer exigência contida neste Edital;
- 5.3. Será considerada credenciada a instituição que:
- 5.3.1. Atender a todos os critérios estabelecidos neste Edital;
 - 5.3.2. For considerada APTA pela Dginv;
 - 5.3.3. Obter voto de HOMOLOGAÇÃO de Credenciamento do Comitê de Investimentos.
- 5.4. À Cearaprev, de acordo com a sua Política Anual de Investimentos, caberá selecionar as instituições devidamente credenciadas para atuar como parceiros na aplicação dos recursos financeiros do RPPS;
- 5.5. O Credenciamento vigorará na forma prevista no artigo 106, inciso II, da Portaria MTP nº 1.467/2022 e terá início a partir da aprovação/homologação ocorrida em reunião do Comitê de Investimentos, devendo ser atualizado a cada 24 meses, ou a qualquer tempo a critério da Dginv. A renovação do processo ocorrerá após verificação do cumprimento de todos os critérios definidos para o Credenciamento.

6. DAS OBRIGAÇÕES:

- 6.1. Administrador e/ou Distribuidor deverá apresentar, no mínimo mensalmente, relatório detalhado contendo informações sobre:
- 6.1.1. Extrato Bancário contendo as informações das Rentabilidade acumulada no mês, anual e dos últimos 12 (doze) meses dos Fundos de Investimento enquadrados à legislação específica para os RPPS;
 - 6.1.2. Análise de Cenário Econômico;
 - 6.1.3. Estratégia de gestão adotada para os Fundos de Investimentos;

6.1.4. Carteira do Fundo: Composição e Patrimônio Líquido;

6.1.5. Risco e Volatilidade.

7. DA AVALIAÇÃO E ACOMPANHAMENTO:

7.1. A Cearaprev acompanhará o desempenho do fundo e da Instituição Financeira credenciada, mensalmente, mediante análise dos seguintes critérios:

7.1.1. Gestão do Fundo de Investimento;

7.1.2. Análise de Risco x Retorno do fundo;

7.1.3. Relacionamento da instituição financeira com Cearaprev;

7.1.4. Transparência nas operações demandadas pela Cearaprev; e

7.1.5. Tempestividade na prestação de informações.

7.2.A performance dos fundos será avaliada em relação aos *benchmarks* determinados para cada segmento, e a análise das rentabilidades está associada à capacidade das instituições na obtenção de valor adicionado (líquido de taxas) e assunção de riscos iguais ou inferiores àqueles apresentados pelos *benchmarks*, avaliados trimestralmente com foco em médias anuais.

7.3.A Instituição credenciada quando solicitada, poderá realizar atividades como: palestras, *workshops*, *conference call* para análise de cenário econômico, ou ainda, visitas periódicas, desde que possam contribuir para qualificação dos membros do Comitê de Investimentos e da Dginv, além de partes relacionadas e demais servidores da Cearaprev.

8. DO DESCRENDENCIAMENTO:

8.1.As entidades serão descredenciadas pelos seguintes motivos:

8.1.1. Descumprirem quaisquer das leis e normas que regem os Regimes Próprios de Previdência Social, bem como aos ditames da Resolução CMN nº 4.963/2021, e da Portaria MTP nº 1.467/2022 e normas editadas pelos órgãos que regulamentam o Sistema Financeiro Nacional ou a pedido do Comitê de Investimentos;

8.1.2. Deixarem de executar o serviço na forma e nos prazos estabelecidos no Regulamento dos fundos ou infringirem qualquer disposição do Termo de Adesão;

8.1.3. Recusarem a receber ou a cumprir instruções para melhor execução dos serviços;

8.1.4. Descumprir qualquer artigo do Item 06 deste Edital;

8.1.5. Para o Descredenciamento será aberto processo administrativo onde serão assegurados ao credenciado, direito ao contraditório e ampla defesa;

8.1.6. No caso de descredenciamento, a Cearaprev comunicará a Instituição Financeira e promoverá a publicação do ato na imprensa oficial, independente de quaisquer sanções legais aplicáveis ao caso, bem como levará ao conhecimento dos órgãos de regulamentação e fiscalização, quando for o caso.

9. DISPOSIÇÕES GERAIS:

9.1. As Instituições interessadas deverão INDICAR, via requerimento (Anexo I), o seu propósito junto à Cearaprev, como:

9.1.1. Administrador de Recursos de Terceiros;

9.1.2. Gestor de Recursos de Terceiros;

9.1.3. Distribuidor de Produtos de Investimento;

9.1.4. Custodiante de Ativos Financeiros;

9.1.5. Corretoras de Títulos e Valores Mobiliários;

9.1.6. Distribuidoras de Títulos e Valores Mobiliários; ou

9.1.7. Instituições Financeiras Bancárias Emissoras de Ativo Financeiro de Renda Fixa.

9.2. Estarão impedidos de participar do processo interessados que se enquadrem em uma ou mais situações a seguir:

9.2.1. Estejam cumprindo penalidade de suspensão temporária imposta por qualquer órgão da Administração Pública;

9.2.2. Sejam declaradas inidôneas em qualquer esfera do Governo;

9.2.3. Estejam sob intervenção, falência, dissolução ou liquidação;

9.2.4. Possuírem condenação na Comissão de Valores Mobiliários - CVM e Banco Central - BACEN;

- 9.2.5. Possuírem penalidades aplicadas por descumprimento aos códigos de autorregulação ANBIMA.
- 9.3. A Cearaprev poderá solicitar, a seu critério, esclarecimentos e informações complementares.
- 9.4. Uma vez apresentados os documentos para seleção e credenciamento, a instituição declara-se implicitamente “de acordo” com as condições e os termos do presente Edital.
- 9.5. As regras constantes deste Edital poderão ser alteradas a qualquer momento por modificações no mercado de capitais ou legais.
- 9.6. Os casos omissos, imprevisíveis ou previsíveis, mas de natureza incalculáveis, serão tratados pela Dginv e Comitê de Investimentos, à luz da boa técnica do mercado de capitais e da legislação de regência.
- 9.7. O foro competente para dirimir eventuais demandas oriundas, derivadas ou conexas com o presente Edital e consequente Credenciamento é o da Justiça Estadual da Comarca de Fortaleza, capital do Estado do Ceará.
- 9.8. Este Edital entra em vigor na data de sua publicação,

Fortaleza, 07 de maio de 2024.

ANEXOS:

Anexo I - Requerimento para Credenciamento;

Anexo II - Modelo de declaração para Administradores de Fundos de Investimento, que atendem ao previsto no artigo 21, § 2º, I, da Resolução CMN nº 4.963/2021 e artigo 107, inciso II da Portaria MTP nº 1.467/2022; e

Anexo III - Modelo de declaração para Gestor de Fundo de Investimento que NÃO cumpre o previsto no artigo 21, § 2º, I, da Resolução CMN nº 4.963/2021 e artigo 107, inciso II da Portaria MTP nº 1.467/2022.

ANEXO I

REQUERIMENTO PARA CREDENCIAMENTO DE INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

À CEARAPREV,

A/C DIRETORIA DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS - Rua 25 DE MARÇO, 300 - 2º andar - Centro, Fortaleza - CE - 60060-120.

Nos termos da legislação vigente, por meio deste instrumento, _____(Representante Legal)_____, _____(cargo)_____, requer o credenciamento da instituição _____(nome da instituição)_____, inscrita no CNPJ _____, como _____(Administrador/Gestor/Distribuidor de Produtos/Custodiante/Corretora ou Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários/ Instituição Financeira Bancária Emissora de Ativo Financeiro de Renda Fixa)_____, apresentando, em anexo, as documentações na íntegra, sob pena de sumário indeferimento.

Declara estar ciente dos demais requisitos dispostos no Edital de credenciamento.

Atenciosamente,

Local e data

(Assinatura do(s) representante(s) legal(is) com firma reconhecida ou assinatura digital)

ANEXO II

MODELO DE DECLARAÇÃO PARA ADMINISTRADORES DE FUNDO DE INVESTIMENTO, QUE ATENDEM AO PREVISTO NO ARTIGO 21, § 2º, I, DA RESOLUÇÃO CMN Nº 4.963/2021 E ARTIGO 107, INCISO II DA PORTARIA MTP Nº 1.467/2022

À CEARAPREV,

A/C DIRETORIA DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS - Rua 25 DE MARÇO, 300 - 2º andar - Centro, Fortaleza - CE - 60060-120.

Informamos que ___(razão social)___ inscrito sob o CNPJ nº _____:

1. Reconhece a abrangência da **Imunidade Tributária** dos Fundos Públicos de Natureza Previdenciária: Fundo Previdenciário (PREVID), CNPJ nº 19.419.301/0001-82, Fundo Financeiro (FUNAPREV), CNPJ nº 04.108.594/0001-00 e Fundo Militar (PREVMILITAR), CNPJ nº 19.419.293/0001-74 e não irá reter tributos sobre suas aplicações financeiras, dada a natureza, afetação, origem e finalidade, nos termos do art. 150, inciso VI, alíneas “a” e “c”, da Constituição Federal. Solicitamos que a Cearaprev, por intermédio da Diretoria de Gestão de Investimentos - Dginv, nos informe qualquer modificação que possa levar a um eventual desenquadramento da atual condição;
2. Tem sob administração recursos oriundos de RPPS no valor máximo de 50% (cinquenta por cento) do total.

Atenciosamente,

Local e data

(Assinatura do(s) representante(s) legal(is) com firma reconhecida ou assinatura digital)

ANEXO III

MODELO DE DECLARAÇÃO PARA GESTOR DE FUNDO DE INVESTIMENTO QUE NÃO CUMPRE O PREVISTO NO ARTIGO 21, § 2º, I, DA RESOLUÇÃO CMN Nº 4.963/2021 E ARTIGO 107, INCISO II DA PORTARIA MTP Nº 1.467/2022

À CEARAPREV,

A/C DIRETORIA DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS - Rua 25 DE MARÇO, 300 - 2º andar - Centro, Fortaleza - CE - 60060-120.

_____ (razão social) _____ inscrito sob o CNPJ nº _____ informa que:

1. Os Fundos de Investimento ofertados ao RPPS têm administrador que atenda o previsto pelo artigo 21, § 2º, I, da Resolução CMN nº 4.963/2021 e artigo 107, inciso II da Portaria MTP nº 1.467/2022;
2. Não há penalidade imputada pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM) em razão de infração média e/ou grave nos 05 (cinco) anos anteriores à data de publicação deste Edital;
3. Realiza Gestão de recursos de terceiros no país pelo período mínimo de 05 (cinco) anos com montante igual ou superior a R\$ 2.500.000.000,00 (dois bilhões e quinhentos milhões de reais);
4. Não se encontra impedido, nem suspenso, nem foi declarado inidôneo para participar de licitações, ou contratar com o Poder Público e que informará, sob as penalidades cabíveis, a superveniência de fato impeditivo ou suspensivo da manutenção do credenciamento; e que
5. As informações apresentadas por esta Instituição são verdadeiras e autênticas, e a mesma concorda com as condições estipuladas no Edital de Credenciamento e está ciente de assumir todas as obrigações dele decorrentes.

Atenciosamente,

Local e data

(Assinatura do(s) representante(s) legal(is) com firma reconhecida ou assinatura digital)