



EQTPREV – Equatorial Energia Fundação de Previdência
Reunião do Comitê de Investimento
Ata de Reunião Nº 01/2024

1. Dados da Reunião

Data	Hora início	Hora término	Local
19/01/2024	14h15min	14h52min	reunião efetuada por acesso remoto (videoconferência), via <i>link</i> gerado pela entidade.

2. Pauta

Item	Descrição
I	Apresentação do Cenário Macroeconômico;
II	Resultados do Mês de Dezembro;
III	Riscos dos Investimentos e Desenquadramentos;
IV	Fluxo Financeiro dos Planos
V	Títulos Públicos

3. Participantes

Nome	Cargo	Assinatura
Mauro Chaves de Almeida	Dir. Presidente	<i>Mauro Chaves de Almeida</i>
Carlos Antônio Brito dos Santos	Dir. Financeiro, AEQT	<i>Carlos Antônio Brito dos Santos</i>
Júlio César Bueno de Brito	Ger. Investimentos	<i>Júlio César Bueno de Brito</i>
Tatiana Queiroga Vasques	Membro Indicado	<i>Tatiana Queiroga Vasques</i>
Leonardo da Silva Lucas Tavares de Lima	Membro Indicado	<i>[Assinatura]</i>
Ricardo José Teixeira	Membro Indicado	<i>[Assinatura]</i>

4. Secretária

Nome	Cargo	Assinatura
Larissa Karine Vera dos Santos	Analista Riscos e Controles Internos	<i>LARISSA KARINE VERA DOS SANTOS</i>



EQTPREV – Equatorial Energia Fundação de Previdência
Reunião do Comitê de Investimento
Ata de Reunião Nº 01/2024

5. Ordem do Dia e Recomendações

Dando início à reunião, o Diretor Administrativo e Financeiro da EQTPREV, Carlos Brito, na condição de Coordenador deste colegiado, cumprimentou a todos e comentou juntamente com o Sr. Mauro Chaves a respeito da incorporação da Eletra e os Planos que iremos ter posse de administração e o aumento no valor do patrimônio administrado pela EQTPREV. Em seguida fez um breve comentário sobre as rentabilidades dos planos em 2023. Na sequência instalou a reunião lendo a ordem do dia. Em seguida passou a palavra para o Sr. Júlio Cesar para apresentação do primeiro item:

I. Cenário Macroeconômico:

Cenário Global: Nos EUA o FED manteve a taxa no intervalo entre 5,25% e 5,50%, em linha já com as expectativas apontadas pelo mercado. Na EUROPA, a taxa de juros foi mantida em 4,0% como esperado. A CHINA os resultados praticamente não alteraram, a produção industrial registrou expansão de 6,6%, acima da projeção mediana sugerida pelos analistas de mercado.

Cenário Doméstico: O COPOM seguiu o corte de juros em 50bps. Na Política Fiscal não houve grandes mudanças devido ao período de recesso parlamentar, e ficando para 2024 novas expectativas de mudanças. Já a Inflação segue em seu ritmo de desinflação, apoiado principalmente pela perda de tração da atividade econômica. Os principais índices de renda fixa no mês performaram todos de forma positiva, tanto o IMA-B (2,75%) e IMA-B 5 (1,46%) que são atrelados a títulos curtos, quanto o IMA-B 5+ que estão atrelados aos títulos longos e ambos no mês superaram o CDI (0,90%). Assim como no ano também os índices longos obtiveram retorno satisfatório trazendo destaque principalmente para o IMA-B 5+ (19,28%).

Na renda variável em dezembro, foi percebida uma forte valorização da bolsa local (IBOVESPA 5,38%) seguindo o mesmo ritmo no mês anterior, o que foi um resultado significativo para entrega de resultados positivos principalmente para o Perfil Arrojado que possui maior exposição a ativos desse segmento. Esse movimento foi favorecido principalmente pela redução da taxa de juros de 10 anos americana (saindo de 4,99% no meio



EQTPREV – Equatorial Energia Fundação de Previdência
Reunião do Comitê de Investimento
Ata de Reunião Nº 01/2024

de outubro para 4,33% no fim de novembro, chegando a atingir a mínima de 3,79% ao longo de dezembro). Movimento esse que favorece os emergentes.

II. Resultados do Mês de Dezembro/23

Na sequência, o Sr. Júlio Cesar prosseguiu com o segundo item da pauta: Apresentadas as rentabilidades por segmento dos planos, atribuições de performance por segmento dos planos no mês e no ano, alocações por segmento dos planos, rentabilidades de títulos públicos. Alocações em Títulos Públicos dos planos administrados pela EQTPREV.

III. Riscos dos Investimentos e Desenquadramentos

O terceiro item da pauta trata-se do, apresentando os riscos dos investimentos até novembro/2023. Durante o período ocorreram 04 desenquadramentos:

Desenquadramento 1 – PLANO BD AL: No fechamento de julho, o valor do Stress Test do plano Equatorial BD Alagoas superou o parâmetro de - 4,00% estabelecido pela política de investimentos. Cabe ressaltar que tal parâmetro não configura limite estrito, e deve ser realizado acompanhamento específico sobre esse tema nas próximas posições.

Desenquadramento 2 – PLANO CD ALAGOAS: No fechamento de novembro, o plano Equatorial CD Alagoas possuía ativos sem ISIN através do fundo BTG PACTUAL CDB PLUS FIRF CRED PRIV, em desconformidade com a Resolução CMN nº 4.994, Capítulo III, Art. 18 "Os ativos financeiros devem ser identificados pelo código ISIN - Internacional Securities Identification Number". Conforme definido no parágrafo único deste mesmo artigo, "a EFPC deve justificar a impossibilidade de identificar os ativos financeiros na forma definida pelo caput". Cabe ressaltar que as informações foram obtidas de forma bruta através do arquivo XML recebido, sendo necessária a confirmação do gestor/administrador quanto possíveis inadequações dos dados.

Desenquadramento 3 – PLANO EQT CD PERFIL ARROJADO: No fechamento de novembro, o valor do Stress Test do plano Equatorial CD Perfil Arrojado superou o parâmetro de -4,00% estabelecido pela política de investimentos. Cabe ressaltar que tal parâmetro não



EQTPREV – Equatorial Energia Fundação de Previdência
Reunião do Comitê de Investimento
Ata de Reunião Nº 01/2024

configura limite estrito, e deve ser realizado acompanhamento específico sobre esse tema nas próximas posições.

Desenquadramento 4 – PLANO CV PIAUÍ: No fechamento de novembro, o valor do Stress Test do plano Equatorial CV PI superou o parâmetro de -4,00% estabelecido pela política de investimentos. Cabe ressaltar que tal parâmetro não configura limite estrito, e deve ser realizado acompanhamento específico sobre esse tema nas próximas posições.

IV. Fluxo financeiro dos planos

Quanto ao quarto item da pauta, foram apresentados os principais resgates e aplicações ocorridos no mês de dezembro/23. Apresentadas as liquidez dos planos para os próximos 12 meses, considerando seus respectivos saldos em conta corrente e em fundos de caixa, bem como seus respectivos índices caixa / saldo e valores previstos de entrada e saída nos planos.

V. Títulos Públicos

Dando continuidade o Sr. Júlio Cesar entrou no quinto item da pauta, sendo que no mês os títulos curtos e longos apresentaram resultados positivos. Os Planos BD's, já no longo prazo apresentaram resultados acima do esperado como no CEMAR BD (NTN – B 2050) e Equatorial BD AL (NTN-B 2050) com alta de 2,19% e 1,49% respectivamente mantendo mesmo comportamento do mês anterior.

Já nos Planos CD's a maior rentabilidade foi no Plano CD Arrojado (NTN-B 2050) com resultado 4,85 % e no Plano CD Perfil Moderado (NTN-B 2028) 2,00%. Resultados estes significativos para entrega das rentabilidades no mês.

Como nada mais foi dito, a reunião foi encerrada, autorizando-se a lavratura da presente Ata.

Anexos:

Anexo I - Relatório de Compliance

Anexo II – Apresentação Mensal