

ENERPREV – PREVIDÊNCIA COMPLEMENTAR DO GRUPO ENERGIAS DO BRASIL

CNPJ/MF nº. 08.710.526/0001-77

(“Enerprev” ou “Entidade”)

ATA DA 160ª REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA DO CONSELHO DELIBERATIVO

DATA: 15 de junho de 2022

HORÁRIO: 10 horas (São Paulo / Brasil)

LOCAL: Realizada na sede da Entidade, localizada na cidade de São Paulo, Estado de São Paulo, na Rua Werner Von Siemens, nº 111, codlog 44191-0, Prédio 22, Bloco A, sala 15, Lapa de Baixo, CEP 05.069-900.

PRESENTES: Os Conselheiros Deliberativos Srs.(as), Fernanda Nascimento Pires Carsughi, Henrique Manuel Marques Faria Lima Freire, Sérgio Tadeu Nabas, Nélia Maria de Campos Pozzi, Edson Wilson Bernardes França e Júlio Galvão de Araújo Junior.

MESA: Sra. Fernanda Nascimento Pires Carsughi e Sra. Miriam Cristina Carolino, que atuaram na qualidade de Presidente e Secretária dos trabalhos, respectivamente.

ORDEM DO DIA: Alteração das Políticas de Investimentos dos Planos da Enerprev.

DELIBERAÇÕES: Considerando que na 155ª Reunião do Conselho Deliberativo, ocorrida em 08 de dezembro de 2021, foram aprovadas as Políticas de Investimentos para o período de 2022 a 2026, ocasião em que a Meta Atuarial ainda era composta pelo IGP-DI; e considerando também a aprovação pela Previc da alteração do indexador do Plano PSAP (agora IPCA), bem como o novo valor da parcela de equacionamento de déficit, em vigor a partir de janeiro de 2022, a Diretoria Executiva realizou novos estudos ALM com alocações em NTNBS, marcadas na curva, num montante aproximado de R\$183 milhões, com o objetivo de superar uma meta composta pelo IPCA.

Estes estudos permitiram a aplicação em ativos mais longos, menos voláteis e de menor risco. Antes, para superar uma meta atuarial mais agressiva, era necessário realizar aplicações em Renda variável, que apesar de ter maior risco, possui maior liquidez.

Contudo, com a alteração dos Fluxos de recebimento, alterou-se também as necessidades de liquidez.

Tendo em vista os novos estudos realizados em 2022, que nortearam as compras na curva, também houve a revisão dos indicadores de liquidez, que são uma consequência do trabalho de imunização que vem sendo implementado. Sem este ajuste ocorrerá o desenquadramento no quesito liquidez.

O Percentual Mínimo de Liquidez refere-se ao valor hipoteticamente auferido, ao final de um período, em relação ao total da carteira. A Política de investimentos vigente apresenta os seguintes percentuais:

HORIZONTE	% MÍNIMO ATUAL
21 dias úteis	10%
252 dias úteis	30%
1260 dias úteis	50%

Com base no que dispõe o Art. 7º, da Instrução Previc nº 35, de 11 de novembro de 2020, a política de investimento a que se refere o art. 19 da Resolução CMN nº 4.661, de 2018, deve conter, no mínimo, as seguintes informações:

VII - as informações ou a indicação de documento em que conste procedimentos e critérios relativos à:

...

b) avaliação dos riscos de investimento, incluídos os riscos de crédito, de mercado, **de liquidez**, operacional, legal, sistêmico e outros inerentes às operações. (GRIFOS NOSSOS)

Por todo o exposto, os membros do Conselho Deliberativo acataram a proposta apresentada pela Diretoria Executiva e aprovaram, por unanimidade, a alteração dos percentuais mínimos de liquidez nas Políticas de Investimentos dos Planos da Enerprev, conforme segue:

HORIZONTE	% MÍNIMO ATUAL
21 dias úteis	5%
252 dias úteis	10%
1260 dias úteis	15%

Na sequência, autorizaram a Diretoria Executiva a adotar todas as providências necessárias para implementar as alterações ora aprovadas.

ENCERRAMENTO: Nada mais havendo a ser tratado e inexistindo qualquer outra manifestação, foi encerrada a presente reunião, da qual se lavrou a presente ata que, lida e achada conforme, foi assinada pela Presidente da Mesa, por mim, na condição de Secretária, e por todos os Conselheiros presentes.

Conselheiros:

DocuSigned by:
Fernanda Nascimento Pires Carsughi
FAC7630764FC492...
Fernanda Nascimento Pires Carsughi

DocuSigned by:
Henrique Manuel Marques Faria Lima Freire
F92E1F20F81C42A...
Henrique Manuel Marques Faria Lima Freire

DocuSigned by:
Sérgio Tadeu Nabas
7A6B9E9B00544CE...
Sérgio Tadeu Nabas

DocuSigned by:
Nélia Maria de Campos Pozzi
E90B41825EAF43E...
Nélia Maria de Campos Pozzi

DocuSigned by:
Edson Wilson Bernardes França
8C389118536F4A8...
Edson Wilson Bernardes França

DocuSigned by:
Júlio Galvão de Araújo Junior
AF4D34B21EE24A8...
Júlio Galvão de Araújo Junior

Secretária da Mesa:

DocuSigned by:
Miriam Cristina Carolino
C14870416AD04AF...
Miriam Cristina Carolino