PAUTA EXTRAORDINÁRIA Nº 02

REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

29/09/2023

1. ***Proposta de aquisição de Títulos Públicos na forma do Art. 7º, I, "a" da Resolução CMN nº 4.963/2021.***

Títulos Públicos Federais **28/Set/2023**

Papel IPCA		NTN-B - Taxa (% a.a.)/252								
Código SELIC	Data Base/Emissão	Data de Vencimento	Tx. Compra	Tx. Venda	Tx. Indicativas	PU	Intervalo Indicativo			
							Mínimo (D0)	Máximo (D0)	Mínimo (D+1)	Máximo (D+1)
760199	15/07/2000	15/08/2024	6,5108	6,4764	6,4966	4.159,268388	6,1250	6,9774	6,1392	6,9988
760199	15/07/2000	15/05/2025	5,8581	5,8279	5,8406	4.248,767035	5,5759	6,1604	5,5424	6,1275
760199	15/07/2000	15/08/2026	5,6755	5,6407	5,6600	4.210,975401	5,4860	5,9776	5,4065	5,8982
760199	15/07/2000	15/05/2027	5,6829	5,6440	5,6641	4.282,583438	5,4942	5,9783	5,4072	5,8913
760199	15/07/2000	15/08/2028	5,7174	5,6844	5,6991	4.228,397605	5,5318	6,0194	5,4492	5,9370
760199	15/07/2000	15/08/2030	5,6923	5,6611	5,6758	4.253,708093	5,5441	6,0056	5,4456	5,9072
760199	15/07/2000	15/08/2032	5,7099	5,6785	5,6924	4.264,518730	5,5741	6,0050	5,4803	5,9114
760199	15/07/2000	15/05/2033	5,7953	5,7634	5,7800	4.306,459693	5,6490	6,0700	5,5735	5,9946
760199	15/07/2000	15/05/2035	5,7946	5,7568	5,7762	4.319,400954	5,6620	6,0607	5,5821	5,9808
760199	15/07/2000	15/08/2040	5,8734	5,8347	5,8549	4.244,725481	5,7584	6,1207	5,6806	6,0428
760199	15/07/2000	15/05/2045	5,9055	5,8690	5,8878	4.301,191165	5,8013	6,1460	5,7230	6,0675
760199	15/07/2000	15/08/2050	5,9396	5,9076	5,9200	4.228,352008	5,8370	6,1701	5,7616	6,0944
760199	15/07/2000	15/05/2055	5,9444	5,9132	5,9278	4.289,331796	5,8525	6,1788	5,7731	6,0990
760199	15/07/2000	15/08/2060	5,9630	5,9199	5,9415	4.221,317633	5,8737	6,1950	5,7896	6,1103

Quando uma taxa for interpolada será apresentada em negrito.

Os preços unitários são calculados a partir da projeção para o IPCA apurada pela Comitê de Acompanhamento Macroeconômico da ANBIMA para o mês, à exceção do período entre o dia de divulgação do IPCA final e o dia 15 do mês corrente, caso em que é utilizado o próprio índice do mês anterior, divulgado pelo IBGE.

Projeção IPCA para Setembro:

Média apurada pela Comitê de Acompanhamento Macroeconômico da ANBIMA: 0,32%

Títulos Públicos Federais na carteira da CAPSECI atualmente:

Nome do TP	Data Aquisição	Taxa	Vencimento	Valor aquisição
NTN-B	03/02/2023	IPCA + 6,63%	15/08/2024	3.997.290,84
NTN-B	21/03/2023	IPCA + 6,21%	15/05/2033	5.998.018,80
NTN-B	19/05/2023	IPCA + 5,68%	15/05/2033	3.996.498,02
NTN-B	19/05/2023	IPCA + 5,54%	15/08/2028	3.501.979,48