COMITÊ DE INVESTIMENTOS DA CAPSECI

(Portaria Nº 174/2022 de 24/08/2022, publicada em 26/08/2022)

ATA Nº 02/2023

REUNIÃO ORDINÁRIA

Aos 23 dias do mês de fevereiro do ano de dois mil e vinte e três **(23/02/2023)**, às nove horas (09:00), na sede da Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte, estiveram reunidos os membros do Comitê de Investimentos, sob a presidência de Giovana Sayuri Medeiros Hirata e secretariado por Luiz Fernando Russo de Oliveira, que, após verificação do quorum legal, declarou aberta a reunião. Estiveram presentes os seguintes membros que abaixo assinam. Iniciaram-se os trabalhos com a leitura da ata número 01/2023 pela Presidente do Comitê de Investimentos que, em seguida, apresentou a seguinte pauta: **PAUTA ORDINÁRIA Nº 02**; **ITEM UM – 1. Demonstrativo dos Fundos de Investimentos da CAPSECI – Janeiro/2023**. A presidente passou a posição financeira e rendimento das aplicações financeiras, por contas bancárias, destacando que a rentabilidade total do mês de janeiro foi de R$ 2.467.318,31 (dois milhões, quatrocentos e sessenta e sete mil, trezentos e dezoito reais e trinta e um centavos). Em seguida foi apresentado um extrato consolidado extraído da plataforma da consultoria de investimentos, onde constam, além de outras informações, a rentabilidade mensal e acumulada no ano por fundos de investimento e o enquadramento da carteira. Uma vez concluída a discussão da pauta, o membro Luiz Fernando Russo de Oliveira apresentou os relatórios que deram suporte à aquisição de títulos públicos federais efetuada em 03 de fevereiro, também informou que foi enviada solicitação de cotação de preços para diversas instituições corretoras previamente credenciadas, e as Instituições que retornaram proposta foram XP Investimentos CCTVM S/A, Genial Investimentos S.A., BTG Pactual CTVM S/A e BGC Liquidez DTVM Ltda. De posse das propostas, a Instituição que apresentou a melhor remuneração e, portanto, foi declarada vencedora, foi a XP Investimentos CCTVM S/A com os títulos NTN-B's pagando IPCA+6,63%. Dessa forma, foi efetuada aquisição dos referidos títulos com vencimento em agosto de 2024, com marcação na curva. Após a explanação, o comitê passou às seguintes deliberações: ficou decidido a utilização dos recursos do fundo BB Previdenciário RF Perfil, do Banco do Brasil, para a próxima folha de pagamento. O comitê também discutiu sobre a possibilidade de nova aquisição de títulos públicos, na forma do Art. 7º, I, "a" da Resolução 4.963/2021. Na ocasião, ficou preestabelecido que será efetuada a compra de NTN-B's no montante aproximado de R$ 4.000.000,00 (quatro milhões de reais) com vencimento em 15/08/2028, ficando para a próxima reunião a deliberação definitiva sobre o tema e a origem dos recursos para alocação. É parte integrante da presente ata, as cotações de preços que deram suporte à aquisição de títulos públicos, bem como a Nota de Negociação dos mesmos. Não havendo mais nada a tratar, foi encerrada a reunião às 10 horas e 30 minutos e eu, Luiz Fernando Russo de Oliveira, fui encarregado de redigir a presente ata que, após lida e aprovada, será assinada por mim e os demais presentes que assim desejarem. Cianorte-PR, 23 de fevereiro de 2023.

Giovana Sayuri Medeiros Hirata

Mayara Vitti Parissenti

Luíz Fernando Russo de Oliveira

Rodrigo Gardin Pires

Lucas Alberto dos Santos Montanha

Títulos Públicos Federais **02/Fev/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)
760100	15/07/2000	15/03/2023	4,8504	4,7804	4,8286	4.120,975785	3,6428	7,1964	3,6320	7,2116
760199	15/07/2000	15/05/2023	4,8787	4,7836	4,8233	4.090,296988	3,9274	6,5718	3,9149	6,5791
760199	15/07/2000	15/08/2024	6,7140	6,6870	6,7032	4.097,872149	6,2478	6,9840	6,4207	7,1572
760199	15/07/2000	15/05/2025	6,3027	6,2763	6,2905	4.055,257345	5,8562	6,5356	6,0201	6,6997
760199	15/07/2000	15/08/2026	6,3129	6,2854	6,2997	4.099,485340	5,9280	6,5255	6,0163	6,6139
760199	15/07/2000	15/05/2027	6,2652	6,2311	6,2485	4.042,774221	5,8682	6,4486	5,9454	6,5260
760199	15/07/2000	15/08/2028	6,3195	6,2912	6,3060	4.083,152280	5,9510	6,5002	5,9956	6,5450
760199	15/07/2000	15/08/2030	6,2827	6,2485	6,2680	4.078,702930	5,9468	6,4370	5,9864	6,4768
760199	15/07/2000	15/08/2032	6,3424	6,3127	6,3289	4.048,539067	6,0430	6,4952	6,0707	6,5231
760199	15/07/2000	15/05/2033	6,4033	6,3656	6,3841	3.969,170857	6,1100	6,5515	6,1330	6,5747
760199	15/07/2000	15/05/2035	6,4259	6,3851	6,4060	3.949,293603	6,1540	6,5732	6,1703	6,5897
760199	15/07/2000	15/08/2040	6,4558	6,4213	6,4434	3.961,318115	6,2331	6,6179	6,2322	6,6172
760199	15/07/2000	15/05/2045	6,4628	6,4286	6,4487	3.877,975258	6,2502	6,6185	6,2492	6,6179
760199	15/07/2000	15/08/2050	6,4615	6,4340	6,4505	3.917,689535	6,2585	6,6159	6,2588	6,6166
760199	15/07/2000	15/05/2055	6,4643	6,4223	6,4415	3.851,078008	6,2485	6,5995	6,2543	6,6058
760199	15/07/2000	15/08/2060	6,4668	6,4185	6,4440	3.898,769737	6,2566	6,6029	6,2602	6,6070

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 Janeiro:

Média apurada pela Comitê de Acompanhamento Macroeconômico da ANBIMA: 0,56%

Gmail

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

3 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 2 de fevereiro de 2023 às 09:22
Para: OL-Titulos-Publicos@btgpactual.com, Dayane.Pereira@btgpactual.com

Prezados,

Solicito a cotação para compra de Títulos Públicos para a Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte – CAPSECI.

TIPO TPF	NTN-B 2024
VOLUME	R$ 4.000.000,00
QUANTIDADE	-
PU D1	-
TAXA	-

Horário de corte para envio da proposta: 02/02/2023 – 11 horas.

Obs.: As compras de TPF devem ocorrer dentro do túnel da ANBIMA.

Atenciosamente,

Luiz Fernando Russo de Oliveira
Contador

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

Fone/Fax: (44) 3631-1838 / 3631-3971 / 9.9175-3528 / 9.9119-0047 http://www.cianorte.pr.gov.br/a-prefeitura/capseci/

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 2 de fevereiro de 2023 às 09:24
Para: "Alves, Caio" <Caio.Alves@btgpactual.com>, "Kami, Gabriel" <Gabriel.Kami@btgpactual.com>

[Texto das mensagens anteriores oculto]

Pelluchi, Geraldo <Geraldo.Pelluchi@btgpactual.com> 2 de fevereiro de 2023 às 10:59
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Cc: OL-Titulos-Publicos <OL-Titulos-Publicos@btgpactual.com>, OL-institucionais <OL-institucionais@btgpactual.com>

Bom dia

Segue cotação indicativa para liquidação em 03/02.

NTN-B 2024

Quantidade 974
PU 4.105,648545
Taxa 6,6000%

Atenciosamente,

Geraldo G. Pelluchi Jr.

Corretora BM&F

Tel. +55 11 3383 2021

Cel. +55 11 99123 0033

btgpactual

btgpactual.com

Internal Use Only

From: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Sent: Thursday,02 February, 2023 09:22
To: OL-Titulos-Publicos <OL-Titulos-Publicos@btgpactual.com>; Pereira, Dayane <Dayane.Pereira@btgpactual.com>
Subject: Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

CAUTION: External email.

Prezados,

Solicito a cotação para compra de Títulos Públicos para a Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte – CAPSECI.

TIPO TPF	NTN-B 2024
VOLUME	R$ 4.000.000,00

QUANTIDADE	-
6.6PU D1	-
TAXA	-

[Texto das mensagens anteriores oculto]

Gmail

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

2 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 2 de fevereiro de 2023 às 09:15
Para: cotacao@gridinvestimentos.com, Pedro <pedro@gridinvestimentos.com>

Prezados,

Solicito a cotação para compra de Títulos Públicos para a Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte – CAPSECI.

TIPO TPF	NTN-B 2024
VOLUME	R$ 4.000.000,00
QUANTIDADE	-
PU D1	-
TAXA	-

Horário de corte para envio da proposta: 02/02/2023 – 11 horas.

Obs.: As compras de TPF devem ocorrer dentro do túnel da ANBIMA.

Atenciosamente,

Luiz Fernando Russo de Oliveira
Contador

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

Fone/Fax: (44) 3631-1838 / 3631-3971 / 9.9175-3528 / 9.9119-0047 http://www.cianorte.pr.gov.br/a-prefeitura/capseci/

Mauro Christ - Genial <Mauro.Christ@genial.com.vc> 2 de fevereiro de 2023 às 11:07
Para: "sedecapseci@gmail.com" <sedecapseci@gmail.com>
Cc: Andre Cortes - Genial Institucional <andre.cortes@genial.com.vc>

Prezados, bom dia.

Segue taxa indicativa no termo D+1

Vendo

975 NTN-B 2024 @6,55

Att.

Mauro Christ | Corretora - Futuros & RF
| 11 3206 8248
Av. Brig. Faria Lima, 3400 - Itaim Bibi - 9º Andar - São Paulo
www.genial.com.vc



Mauro Christ | Corretora - Futuros & RF
| 11 3206 8248
Av. Brig. Faria Lima, 3400 - Itaim Bibi - 9º Andar - São Paulo
www.genial.com.vc



Este e-mail e seus anexos, se houver, podem conter: (i) dados pessoais e/ou dados sensíveis, (ii) informações confidenciais e/ou protegidas por sigilo. Caso você tenha recebido este e-mail por engano, destrua-o imediatamente, juntamente com quaisquer cópias e anexos, e notifique o remetente prontamente. É expressamente vedada a cópia, reprodução, distribuição, uso ou tratamento das informações aqui contidas, salvo mediante expressa autorização do remetente. Se autorizado o tratamento de dados pessoais ou sensíveis, o agente de tratamento deverá observar estritamente as disposições do remetente deste e-mail e, em caso de irregularidade do tratamento, ficará sujeito às sanções previstas na Lei 13.709/18 (Lei Geral de Proteção de Dados - LGPD). / This email and its attachments may contain: (i) personal and/or sensitive data, (ii) confidential information and/or information covered by confidentiality. If you have received this email by mistake, please destroy it, as well as any copies and attachments, and notify the sender immediately. Any copy, reproduction, distribution, use or processing of the information contained herein is strictly forbidden, unless expressly authorized by the sender. If the processing of personal or sensitive data is authorized, the processing agent must strictly observe the provisions of the sender in this email and, in case of irregularity in the data processing, will be submitted to the penalties provided for in Brazilian Law n. 13.709/18 (Brazilian General Data Protection Law- LGPD)

De: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Enviado: quinta-feira, 2 de fevereiro de 2023 09:15:16 (UTC-03:00) Brasilia
Para: Cotação – Grid Investimentos <cotacao@gridinvestimentos.com>; Pedro <pedro@gridinvestimentos.com>
Assunto: Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

Prezados,

Solicito a cotação para compra de Títulos Públicos para a Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte – CAPSECI.

TIPO TPF	**NTN-B 2024**
VOLUME	R$ 4.000.000,00
QUANTIDADE	-

PU D1	-
TAXA	-

Horário de corte para envio da proposta: 02/02/2023 – 11 horas.

Obs.: As compras de TPF devem ocorrer dentro do túnel da ANBIMA.

Atenciosamente,

Luiz Fernando Russo de Oliveira

Contador

--

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

[Texto das mensagens anteriores oculto]

Gmail

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

4 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 2 de fevereiro de 2023 às 09:13
Para: rpps@bgcpartners.com

Prezados,

Solicito a cotação para compra de Títulos Públicos para a Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte – CAPSECI.

TIPO TPF	NTN-B 2024
VOLUME	R$ 4.000.000,00
QUANTIDADE	-
PU D1	-
TAXA	-

Horário de corte para envio da proposta: 02/02/2023 – 11 horas.

Obs.: As compras de TPF devem ocorrer dentro do túnel da ANBIMA.

Atenciosamente,

Luiz Fernando Russo de Oliveira
Contador

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

Fone/Fax: (44) 3631-1838 / 3631-3971 / 9.9175-3528 / 9.9119-0047 http://www.cianorte.pr.gov.br/a-prefeitura/capseci/

Cadilhe, Marcelle <MARCELLE.CADILHE@bgcpartners.com> 2 de fevereiro de 2023 às 10:57
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>, Regime Proprio Previdencia Social <rpps@bgcpartners.com>

Olá, bom dia!

Obrigada por cotar com a BGC Liquidez

Segue cotação solicitada:

Título: NTN-B

Vencimento: 2024

Volume: R$4.000.000,00

Taxa de venda: **6,612**

Taxa sujeita à confirmação devido à alta volatilidade do mercado.

Atenciosamente,

bgc liquidez
voice + electronic brokerage

Marcelle Cadilhe

Sales Institutional

Tel.: +55 11 3077-2354

Cel.: +55 21 98674-0059

marcelle.cadilhe@bgcpartners.com

.

Av. Brigadeiro Faria Lima, 3.144 – 7º andar CEP: 01451-000 São Paulo

Ouvidoria: 0800 282 9900

bgcliquidez.com

De: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Enviada em: quinta-feira, 2 de fevereiro de 2023 09:13
Para: Regime Proprio Previdencia Social <rpps@bgcpartners.com>
Assunto: Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

Some people who received this message don't often get email from sedecapseci@gmail.com. Learn why this is important

[External Email: Use Caution when clicking on links and attachments]

[Texto das mensagens anteriores oculto]

DISCLAIMER

This communication may include confidential and privileged information, is for information purposes only, is not a recommendation or a trade confirmation, is not an offer to sell, or a solicitation of an offer to buy. If you are not the intended recipient, please advise the sender immediately and delete or destroy this communication and any copies. Use by other than intended recipients is prohibited.
For additional disclosures, including disclosures relevant to your region, please see https://www.bgcpartners.com/disclaimers/electronic-communications-disclaimers-disclosures/

For disclosures related to how your personal data is processed in certain please see https://www.bgcpartners.com/privacy/

Cadilhe, Marcelle <MARCELLE.CADILHE@bgcpartners.com> 2 de fevereiro de 2023 às 11:14
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>, Regime Proprio Previdencia Social <rpps@bgcpartners.com>

Olá, bom dia!

Obrigada por cotar com a **BGC Liquidez**

Segue cotação solicitada:

Título: NTN-B

Vencimento: 2024

Volume: R$4.000.000,00

Taxa de venda: **6,616**

[Texto das mensagens anteriores oculto]
[Texto das mensagens anteriores oculto]

Cadilhe, Marcelle <MARCELLE.CADILHE@bgcpartners.com> 2 de fevereiro de 2023 às 11:22
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>, Regime Proprio Previdencia Social <rpps@bgcpartners.com>

Olá, bom dia!

Obrigada por cotar com a **BGC Liquidez**

Segue cotação solicitada:

Título: NTN-B

Vencimento: 2024

Volume: R$4.000.000,00

Taxa de venda: **6,60**

[Texto das mensagens anteriores oculto]

[Texto das mensagens anteriores oculto]

Gmail

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

5 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Para: bruno.bruschi@xpi.com.br, RPPS - XP Investimentos <rpps@xpi.com.br>

2 de fevereiro de 2023 às 09:16

Prezados,

Solicito a cotação para compra de Títulos Públicos para a Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte – CAPSECI.

TIPO TPF	NTN-B 2024
VOLUME	R$ 4.000.000,00
QUANTIDADE	-
PU D1	-
TAXA	-

Horário de corte para envio da proposta: 02/02/2023 – 11 horas.

Obs.: As compras de TPF devem ocorrer dentro do túnel da ANBIMA.

Atenciosamente,

Luiz Fernando Russo de Oliveira
Contador

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

Fone/Fax: (44) 3631-1838 / 3631-3971 / 9.9175-3528 / 9.9119-0047 http://www.cianorte.pr.gov.br/a-prefeitura/capseci/

Bruno Bruschi <bruno.bruschi@xpi.com.br> 2 de fevereiro de 2023 às 11:01
Para: "sedecapseci@gmail.com" <sedecapseci@gmail.com>, RPPS - XP Investimentos <rpps@xpi.com.br>

Cliente	Data Liquidação	Ativo	Quantidade	Taxa	PU	Financeiro
CIA NORTE	03/02/2023	NTN-B-2024-08	974	6,6050%	4.105,3749170	3.998.635,17

Aguardamos e obrigado,

banco de atacado
Bruno Bruschi
Distribuição Institucional
(19) 99758-5409
Bruno.Bruschi@xpi.com.br

De: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Enviada em: quinta-feira, 2 de fevereiro de 2023 09:17
Para: Bruno Bruschi <bruno.bruschi@xpi.com.br>; RPPS - XP Investimentos <rpps@xpi.com.br>
Assunto: Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

ATENÇÃO: Este e-mail foi recebido através de um remetente externo. Não clique em links ou abra anexos, a não ser que você reconheça o remetente e conheça o conteúdo. Denuncie e-mails suspeitos a Segurança da Informação por meio do botão Reportar Phish (Phish Alarm), que se encontra no canto superior direto da mensagem

[Texto das mensagens anteriores oculto]
[Texto das mensagens anteriores oculto]

Fone/Fax: (44) 3631-1838 / 3631-3971 / 9.9175-3528 / 9.9119-0047 http://www.cianorte.pr.gov.br/a-prefeitura/capseci/ [cianorte.pr.gov.br]

Bruno Bruschi <bruno.bruschi@xpi.com.br> 2 de fevereiro de 2023 às 11:13
Para: "sedecapseci@gmail.com" <sedecapseci@gmail.com>, RPPS - XP Investimentos <rpps@xpi.com.br>

Cliente	Data Liquidação	Ativo	Quantidade	Taxa	PU	Financeiro
CIA NORTE	03/02/2023	NTN-B-2024-08	974	6,6150%	4.104,8236370	3.998.098,22

[Texto das mensagens anteriores oculto]

2 de fevereiro de 2023 às 11:47

Bruno Bruschi <bruno.bruschi@xpi.com.br>
Para: "sedecapseci@gmail.com" <sedecapseci@gmail.com>, RPPS - XP Investimentos <rpps@xpi.com.br>

Atualização:

Cliente	Data Liquidação	Ativo	Quantidade	Taxa	PU	Financeiro
CIA NORTE	03/02/2023	NTN-B-2024-08	974	6,6300%	4.103,9947050	3.997.290,84

Obrigado e abs,

[Texto das mensagens anteriores oculto]

2 de fevereiro de 2023 às 11:48

Bruno Bruschi <bruno.bruschi@xpi.com.br>
Para: "sedecapseci@gmail.com" <sedecapseci@gmail.com>, RPPS - XP Investimentos <rpps@xpi.com.br>

Luiz, boa tade

Segue confirmação de operação com liquidação em D1:

Cliente	Data Liquidação	Ativo	Quantidade	Taxa	PU	Financeiro
CIA NORTE	03/02/2023	NTN-B-2024-08	974	6,6300%	4.103,9947050	3.997.290,84

Obrigado por escolher a XP!

[Texto das mensagens anteriores oculto]