COMITÊ DE INVESTIMENTOS DA CAPSECI

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

ATA Nº 08/2023

REUNIÃO ORDINÁRIA

Aos vinte e cinco dias do mês de setembro do ano de dois mil e vinte e três **(25/09/2023)**, às quatorze horas e trinta minutos (14h30min), na sede da Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte, estiveram reunidos os membros do Comitê de Investimentos, que abaixo assinam, sob a presidência do Sr. Luiz Fernando Russo de Oliveira e secretariado pela Srta. Mayara Vitti Parissenti, que, após verificação do quórum legal, declarou aberta a reunião. Também participaram da reunião o Sr. Guilherme Henrique Maximo Rodrigues, técnico contábil da CAPSECI, e a Srta. Bianca Carolina de Carvalho, responsável pela unidade seccional de controle interno da CAPSECI. Inicialmente, o Presidente do Comitê realizou a leitura da pauta do dia: **PAUTA ORDINÁRIA Nº 08**: **1. Demonstrativo dos Fundos de Investimentos da CAPSECI – Agosto/2023; 1.1. Relatório das Aplicações Financeiras com detalhamento por contas bancárias; 1.2. Posição de Ativos e Enquadramento da Carteira; 2. Análise do Credenciamento de Instituições Financeiras e de Fundos de Investimento; 3. Apresentação da minuta da Política de Investimentos para o exercício de 2024; 4. Propostas de realocação; e 5. Assuntos gerais**. Em seguida, o Sr. Luiz Fernando franqueou a palavra aos representantes do Banco do Brasil, Sr. Ronaldo Willyan Tórtura e Sra. Lívia Paula Ferreira e Silva, que, de forma remota através da plataforma *Microsoft Teams,* dissertaram sobre o cenário econômico e ofertaram alguns produtos de investimento, dando ênfase aos fundos que possuem o objetivo de alongar a carteira do RPPS, com destaque para o fundo BB Prev RF IMA-B 5+ TP; finalizada a apresentação, o comitê deu início à discussão da pauta. **1. Demonstrativo dos Fundos de Investimentos da CAPSECI – Agosto/2023.** Foi exposta a posição financeira e rendimento das aplicações financeiras por contas bancárias, destacando que a rentabilidade total do mês de agosto foi de R$ 69.850,72 (sessenta e nove mil, oitocentos e cinquenta reais e setenta e dois centavos) e, no acumulado do ano, R$ 11.572.502,22 (onze milhões, quinhentos e setenta e dois mil, quinhentos e dois reais e vinte e dois centavos). Ainda, 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. **2. Análise do Credenciamento de Instituições Financeiras e de Fundos de Investimento.** Na sequência foi apresentado para análise a documentação relativa às propostas de renovação do credenciamento das seguintes instituições financeiras: BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM, CNPJ 29.650.082/0001-00, Instituição Gestora de Recursos; e BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM, CNPJ 59.281.253/0001-23, Instituição Administradora de Recursos. De posse da documentação, o comitê realizou a análise e aprovou a renovação do credenciamento das instituições citadas, por apresentarem a documentação exigida conforme Edital de Credenciamento nº 01/2022 da CAPSECI. Uma vez concluída a análise

das instituições, o comitê de investimentos passou a realizar a análise dos seguintes fundos de investimentos: Sicredi Ibovespa FIC Ações, CNPJ 06.051.151/0001-55; BB Previdenciário RF Crédito Privado IPCA III FI, CNPJ 14.091.645/0001-91; e BTG Absoluto Inst. FIQ FI AÇÕES, CNPJ 11.977.794/0001-64. Os fundos citados foram devidamente analisados e aprovados pelo comitê de investimentos. Em relação ao fundo BB Previdenciário RF Crédito Privado IPCA III FI, o comitê aprovou a análise após obter resposta ao Ofício da CAPSECI nº 057/2023, que solicita parecer sobre o enquadramento do referido fundo. Em resposta, datada de 21/09/2023, o banco informou que realocou o investimento realizado em CRA (Certificados Recebíveis do Agronegócio), de forma a afastar eventuais questionamentos sobre o enquadramento do fundo, uma vez que tais ativos são vedados pela Resolução CMN nº 4.963/2021. Já em relação ao fundo Sicredi Ibovespa FIC Ações, o presidente do comitê apresentou o fundo novamente para análise dos membros, tendo em vista que a instituição administradora apresentou novo Questionário Padrão Due Diligence para Fundos de Investimento – Seção 2, com data de 05 de setembro de 2023. De posse deste documento e dos demais exigidos pelo Edital de Credenciamento, o referido fundo teve sua análise efetuada e aprovada. **3. Apresentação da minuta da Política de Investimentos para o exercício de 2024.** Finalizado o assunto acerca do credenciamento, foi apresentada a minuta da Política de Investimentos para o exercício de 2024 para que os presentes pudessem apreciar e realizar as devidas sugestões de alteração, conforme as propensões de cada um, no entanto, foi consenso de todos postergar o assunto para a próxima reunião. **4. Propostas de realocação.** Acerca do tema, o gestor inicialmente explanou acerca de algumas deliberações efetuadas na reunião anterior e não concretizadas, apresentando as devidas justificativas, sendo: o comitê havia proposto a alocação de R$ 1.500.000,00 (um milhão e quinhentos mil reais) no fundo BRADESCO H FI RF NILO, porém, no momento de realizar a operação foi observado que o valor mínimo para aplicação, conforme regulamento do fundo, era de R$ 2.000.000,00 (dois milhões de reais). Tal fato impossibilitou a aplicação e já nesta presente reunião, o comitê optou pelo descarte momentâneo da mesma. Outra situação apresentada, foi que havia sido aprovada aplicação de R$ 200.000,00 (duzentos mil reais) no fundo SCHRODERS IBOVESPA FIA, decisão que não foi levada adiante, tendo em vista que a instituição administradora do fundo não havia apresentado toda a documentação atualizada para a análise do fundo de investimento na reunião de agosto. Passadas as explanações, o comitê passou a debater o cenário econômico, discutindo as expectativas para o atingimento da meta atuarial, ressaltando a preocupação com o cenário de incerteza que vem impactando de forma negativa os investimentos desde o mês de agosto; neste contexto, o comitê optou por descartar, neste momento, realocações que visem o alongamento da carteira, optando por manter os recursos em fundos de curto prazo. Sendo assim, foram efetuadas as seguintes deliberações: considerando que na data da presente reunião havia cerca de R$ 4.800.000,00 (quatro milhões e oitocentos mil reais) no fundo de aplicação automática BB Previdenciário RF Fluxo, ficou aprovado que, deste total, R$ 1.800.000,00 (um milhão e oitocentos mil reais) deverão ser alocados no fundo BB Previdenciário RF Perfil, e o restante, cerca de R$ 3.000.000,00 (três milhões de reais), deverá ser utilizado para saldar a folha de pagamento do mês de setembro. Também ficou definido que os valores que excederem ou faltarem

para as movimentações deliberadas, bem como valores de saldos existentes no final do mês em fundo de aplicação automática, poderão ser movimentados no fundo BB Previdenciário RF Perfil, no Banco do Brasil. **5. Assuntos gerais.** O presidente do comitê, atendendo a recomendação da srta. Mayara Vitti Parissenti, informou que criou uma pasta compartilhada no Google Drive, onde serão arquivados documentos diversos relacionados a investimentos, onde os membros do comitê poderão ter acesso a lâminas de fundos para RPPS's, boletins de investimentos, entre outros, de forma disseminar conteúdo e, assim, colaborar para os debates entre os membros. Também foi recomendado que na próxima reunião seja trazido para apreciação do comitê de investimento, fundos com indicador de referência IMA-B 5+, para análise de credenciamento e possível decisão de aplicação. Nada mais tendo a tratar, foi declarada encerrada a reunião às dezesseis horas e vinte minutos (16h20min) e eu, Mayara Vitti Parissenti, na qualidade de secretária, lavrei a presente ata, onde lida e achada exata, vai assinada pelos membros presentes. Cianorte-PR, 25 de setembro de 2023.

Marcos José da Silva

Mayara Vitti Parissenti

Lucas Alberto dos Santos Montanha

Rodrigo Gardin Pires

Luíz Fernando Russo de Oliveira