COMITÊ DE INVESTIMENTOS DA CAPSECI

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

ATA Nº 09/2024

REUNIÃO ORDINÁRIA

Aos dezoito dias do mês de setembro do ano de dois mil e vinte e quatro **(18/09/2024)**, às quatorze horas (14h00min), 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 da Srta. Giovana Sayuri Medeiros Hirata e secretariada pelo Sr. Luiz Fernando Russo de Oliveira, que, após verificação do quórum legal, declarou aberta a reunião. Inicialmente, a Presidente do Comitê realizou a leitura da pauta do dia: **PAUTA ORDINÁRIA Nº 09**: **1. Demonstrativos dos Fundos de Investimentos da CAPSECI – Agosto/2024; 1.1. Relatório das Aplicações Financeiras com detalhamento por contas bancárias; 1.2. Posição de Ativos e Enquadramento da Carteira. 2. Análise de cenário e propostas de realocação; 2.1. Boletim FOCUS; 2.2. Quadro-Resumo de Indicadores ANBIMA; 2.3. Taxas Indicativas de Títulos Públicos; 2.4. Comparativos de Fundos de Investimentos e ETFs; 3.1 Credenciamento de Instituições Financeiras; 3.2 Demonstrativo das aquisições de Títulos Públicos Federais; 3.3. Demais assuntos**. Dando início às discussões da pauta, a Srta. Giovana, apresentou o **Item 1. Demonstrativo dos Fundos de Investimentos da CAPSECI – Agosto/2024**, foi exposta a posição financeira e rendimento das aplicações financeiras por contas bancárias, destacando que a rentabilidade total do mês foi de R$ 2.330.855,24 (dois milhões, trezentos e trinta mil, oitocentos e cinquenta cinco reais e vinte e quatro centavos), enquanto que no acumulado do ano a rentabilidade foi de R$ 8.829.204,71 (oito milhões, oitocentos e vinte e nove mil, duzentos e quatro reais e setenta e um centavos); ainda, foi apresentado um extrato consolidado extraído da plataforma da consultoria de investimentos onde constam, além de outras informações, a rentabilidade mensal por fundos de investimento e o enquadramento da carteira. **2. Análise de cenário e propostas de realocação.** De forma prévia às discussões, o gestor Luiz Fernando apresentou para análise do comitê de investimentos a documentação do Fundo de Investimento It Now IBOVESPA Fundo de Índice - BOVV11, CNPJ 21.407.758/0001-19. De posse da documentação, o comitê procedeu a análise e aprovou o fundo para eventual decisão de alocação, nos termos do Edital de Credenciamento 01/2022 da CAPSECI e utilizando também como base para aprovação o relatório parecer favorável da consultoria contratada. Logo após, iniciaram as discussões acerca do cenário econômico; durante os debates, foram analisados o Boletim Focus, o Quadro-Resumo de Indicadores ANBIMA, as Taxas Indicativas de Títulos Públicos, bem como os comparativos levantados dentre as diversas instituições credenciadas, de fundos pertencentes aos seguimentos de Crédito Privado, fundos Multimercado, fundos com benchmark em IDKA 2A e fundos de ETFs; posteriormente, os membros expuseram suas visões de mercado e possíveis estratégias. Concluídos os debates, o comitê passou a discutir as aplicações e/ou realocações de investimentos; foram aprovadas as seguintes movimentações: aquisição de Títulos Públicos (NTN-B) no valor de R$ 5.000.000,00 (cinco milhões de reais) com vencimento no ano de 2026, indexado ao IPCA e com marcação na curva, sendo pontuado que as cotações para a busca da melhor taxa deverão ser realizadas via e-mail e posteriormente anexadas a esta ata; os recursos para tais aquisições serão oriundos do resgate do fundo BB Previdenciário

RF Perfil no Banco do Brasil; em seguida, foi aprovado o resgate no valor de R$ 2.100.0000,00 (dois milhões e cem mil reais) do fundo BB Previdenciário Ações Alocação FIC FI, CNPJ 18.270.783/0001-99, sendo definido que o recurso oriundo deste resgate será realocado em três fundos do mesmo seguimento de renda variável, da seguinte forma: aplicação no valor de R$ 700.000,00 (setecentos mil reais) no fundo BB Ações Valor FIC Ações Previdenciário, no Banco do Brasil; aplicação no valor de R$ 700.000,00 (setecentos mil reais) no fundo Itaú Ações Dunamis FIC FI, no Itaú-Unibanco; e aplicação também no valor de R$ 700.000,00 (setecentos mil reais) no fundo Santander Ações Dividendos FIC FI no Banco Santander. Também foi aprovada mais uma alocação no valor de R$ 250.000,00 (duzentos e cinquenta mil reais) no fundo Santander Ações Dividendos FIC FI no Banco Santander, com recursos do fundo Itaú Institucional Renda Fixa Referenciado DI – FI, no Itaú-Unibanco, seguindo a decisão de aplicações parceladas em renda variável tomada em reuniões anteriores. Nesta reunião os membros do comitê decidiram por não efetuar nova aplicação no fundo FIA Caixa Institucional BDR Nível I, dada a incerteza no mercado global, o comitê optou por aguardar as próximas reuniões para decidir sobre a possibilidade de realizar novos aportes neste fundo. Em relação aos Fundos de Índice ETFs, o comitê discutiu e aprovou o investimento: inicialmente, a Srta. Giovana pontuou que caso o comitê aprove a aplicação, as Instituições Banrisul Corretora e a Premier Sul Agente Autônomo de Investimento Ltda. já se encontram devidamente credenciadas conforme Edital de Credenciamento nº 01/2022 da CAPSECI, restando apenas o cadastro e a abertura da conta junto ao Banco e à corretora; no tocante ao tema, os membros definiram que será disponibilizado o valor de R$ 1.000.000,00 (um milhão de reais) para a estratégia de gestão ativa em Fundos de Índices em Ações - ETFs, na forma do Art. 8º, Inciso II da Resolução CMN nº 4.963/2021. Para tanto, será efetuado resgate do fundo Bradesco FI RF Referenciado DI Premium no Banco Bradesco, agência e conta 00142/0471492-0, conforme definido na reunião anterior. O recurso para a execução da estratégia será transferido para a agência e conta de titularidade da CAPSECI, assim que aberta, e estará alocado no fundo Banrisul Absoluto FI Renda Fixa LP, CNPJ 21.743.480/0001-50 e/ou Banrisul Automático FI Renda Fixa Curto Prazo, CNPJ 01.353.260/0001-03. A estratégia definida pelo comitê de investimentos da CAPSECI foi a seguinte: deverá ser disponibilizado o valor de R$ 1.000.000,00 (um milhão de reais), sendo este valor dividido em 10 "mãos" (entradas) de R$ 100.000,00 (cem mil reais) cada, para aplicações no ETF It Now Ibovespa Fundo de Índice - BOVV11, inscrito sob o CNPJ nº 21.407.758/0001-19. Fica definida estratégia de compra a partir de 3,5% de queda em relação a última operação em aberto (que não foi vendida), ou ainda, caso a CAPSECI esteja sem posições em aberto, compra a partir de uma queda em relação a abertura de mercado do dia em questão e venda a partir de 1% de lucro líquido. Além disso, os agentes da Premier Investimentos, ficam autorizados a realizar operações com o BOVV11 até o limite de R$ 100.000,00 (cem mil reais) por "mão", sem a necessidade de Ofícios já que estão com a política definida previamente, mas condicionados a autorização expressa via telefone pela Presidente do Comitê, Srta. Giovana Sayuri Medeiros Hirata, ou pelo Gestor de Recursos Luiz Fernando Russo de Oliveira, pessoas previamente autorizadas. A Política de operações com ETFs foi aprovada pelo Comitê de Investimentos. Passado este assunto, ficou definido, por fim, que a folha de pagamento do mês de setembro será paga com recursos do fundo Caixa FI Brasil REF. DI Longo Prazo na Caixa Econômica Federal e que outros valores serão movimentados no fundo BB Previdenciário RF Perfil no Banco do Brasil S.A. até que ocorra a próxima reunião. **3. Análise do Credenciamento de Instituições Financeiras e de Fundos de Investimento.** Na sequência, acerca do

tema, o gestor Luiz Fernando apresentou para análise do comitê de investimentos, os documentos para renovação do credenciamento das seguintes instituições financeiras: Banco BTG Pactual S/A, CNPJ nº 30.306.294/0001-45, Instituição Custodiante e Emissora de Letras Financeiras; BTG Pactual CTVM S/A, CNPJ nº 43.815.158/0001-22, Instituição Corretora; e Banco BTG Pactual S/A, CNPJ nº 30.306.294/0001-45, Instituição Distribuidora de Valores. De posse da documentação, o comitê de investimentos realizou a análise e aprovou a renovação do credenciamento das instituições, por entender ter sido apresentada a documentação exigida por ocasião do Edital de Credenciamento nº 01/2022 da CAPSECI. Também foi utilizado como suporte para a decisão, os relatórios de análises individuais das Instituições disponibilizados pela empresa que presta serviços de consultoria para a CAPSECI. Por fim, o gestor de recursos informou que toda a documentação utilizada para análise está disponibilizada no *Google Drive* da CAPSECI, bem como permanecerão arquivadas em formato digital nos arquivos eletrônicos da CAPSECI. **4. Demonstrativo das aquisições de Títulos Públicos e Letras Financeiras.** Foi apresentado ao comitê de investimentos os demonstrativos das aquisições de Títulos Públicos deliberadas na reunião anterior. **5. Demais assuntos.** Foi discutido sobre o conteúdo das reuniões *on-line* que ocorreram no dia 29 de agosto com as Instituições Premier Sul Agente Autônomo de Investimento Ltda, sobre ETFs, e com representantes da BB Asset, na mesma data, onde foi explanado sobre as perspectivas para a economia, com especial atenção às sugestões de alocação no seguimento de renda variável. Ambas as reuniões atenderam à demanda do comitê definida na reunião anterior. Outro ponto, em relação a aplicações em ETFs, ativos enquadrados no Art. 8º, II - Fundos de Índices de Ações da Resolução CMN nº 4.963/2021, os membros do comitê concordaram em acompanhar a evolução do ETF com benchmark no SP500 para eventual decisão futura de alocação. Finalizado este assunto e nada mais tendo a tratar, foi declarada encerrada a reunião às dezesseis horas (16h00min) e eu, Luiz Fernando Russo de Oliveira, na qualidade de secretário, lavrei a presente ata, onde lida e achada exata, vai assinada pelos membros presentes.

Giovana Sayuri Medeiros Hirata

Rodrigo Gardin Pires

Mayara Vitti Parissenti

Marcos Alberto Valério

Luiz Fernando Russo de Oliveira