

Ata de Reunião ordinária Comitê de Investimentos

REUNIÃO N.º 10/2023
ASSUNTO: aprovação da política de investimentos 2024
DATA 01 de novembro de 2023
HORÁRIO 9hrs
LOCAL: CAPSIRATI
DOCUMENTOS ANALISADOS: formulação da política de investimentos 2024
PAUTA: análise para alocação da estratégias de investimentos
<p>PRESENTES NA REUNIÃO:</p> <p>Comitê de investimentos: Guilherme Barby, Antônio Sidnei Martins, Fernando José dos Anjos</p> <p>Gestores: Rozenilda Romaniw Bárbara, Antônio Valmor Ferreira, João Marcos Batista, Eduardo Carach Menon</p> <p>Conselho de Administração: Cleide Aparecida da Cruz Andrade.</p> <p>Conselho Fiscal: Andrea Leonora Teixeira Likes.</p> <p>Participação: Gustavo da LEMA Consultoria .</p>

Aos primeiro dia do mês de novembro de 2023, a Comissão de Investimentos se reuniu, em reunião ordinária, junto com a equipe administrativa do CAPSIRATI e representantes do conselho de administração e do conselho fiscal para participar da reunião com o senhor Gustavo da Lema, para tratar da formatação da política de investimentos para o exercício de 2024, sobre a ALM, tendo como orientação o seguinte:

1. Análise das estratégias da política de 2023 e os ajustes para o exercício de 2024. Com apoio da Lema Assessoria, o comitê ajustou a estratégia de alocação de recursos para o ano de 2023, uma vez que uma das atribuições do comitê é fazer a política de investimentos, e para isso, Gustavo propôs que fossem analisados os segmentos possíveis para aplicações, os tipos de ativos, criando a estratégia alvo com base no mercado, nas possibilidades do Caps e os percentuais que pode aplicar sem comprometer as condições de pagamento dos seus compromissos com os beneficiários.

A seguir, reproduzimos a **Alocação Estratégica para o exercício de 2024, proposta pelo comitê e encaminhada para Lema Investimentos:**

Segmento	Tipo de alvo	Limite resolução 4.693	Limite inferior (%)	Estratégia alvo (%)	Limite superior (%)
Renda Fixa	7º I a - Títulos do Tesouro Nacional SELIC	100,00%	20	25	100
	7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	20	25	100

	7º I c - FI Ref em Índice de RF, 100% TP	100,00%	0	1	100
	7º II - Oper. compromissadas em TP TN	5,00%	0	0	0
	7º III a - FI RF	60,00%	0	20	60
	7º III b - FI de Índices RF	60,00%	0	1	5
	7º IV - Renda Fixa de emissão bancária	20,00%	3	7	20
	7º V a - FI em Direitos Creditórios - sênior	5,00%	0	0	0
	7º V b - FI Renda Fixa "Crédito Privado"	5,00%	0	0	0
	7º V c - FI de Debêntures Infraestrutura	5,00%	0	0	0
	Sub total	100,00%	43	79	100
Renda Variável	8º I - FI de Ações	30,00%	0	15	20,00
	8º II - ETF - Índice de Ações	30,00%	0	3	20,00
	Sub total		0	18	40,00
Investimentos exterior	FI Renda Fixa – Dívida Externa – art. 9.º, I	10,00%	0	0	0
	FI Investimento no Exterior – art. 9º, II	5,00%	0	0	2,00
	FI Ações – BDR Nivel I- art 9º, III	5,00%	0	2,00	10,00
	Sub total		0	2	14,00
Investimentos exterior	FI Multimercado – aberto – arti 10,I	10,00%	0	0	2,00
	FI em Participações – art. 10,II	5,00%	0	0	0
	FI "Ações – Mercado de Acesso", art. 10,III	5,00%	0	0	2,00
	Subtotal		0	0	4,00
Fundo Investimento	FI Imobiliário – art 11	5,00%	0	1,00	3,00
	Sub total		0	1,00	3,00

imobiliário					
Emprestimo consignado	Empréstimos consignados – art 12	5,00	0	0	0
	Sub total		0	0	0
	Total geral			100	

Nada mais havendo a tratar, eu Rozenilda Romaniw redigi a presente ata que segue com a lista de presença.
Rozenilda Romaniw Bárbara – Superintendente do Capsirati