

Ata de Reunião ordinária Comitê de Investimentos

REUNIÃO N.º 13/2024 (extraordinária)
ASSUNTO: Avaliação investimentos, resgates e aplicações
DATA: 19 de novembro de 2024
HORÁRIO: 08 hs30 horas
LOCAL: CAPSIRATI
DOCUMENTOS ANALISADOS:
PAUTA: Apresentação da empresa Próprio Capital; Apresentação da R3 investimentos Avaliação da Lema assessoria referente aos recursos recebidos de cupons semestrais e as possíveis aplicações financeiras
PRESENTES NA REUNIÃO: Comitê de investimentos: Fernando José dos Anjos, Rozenilda Romaniw Bárbara, Antônio Carlos Mucham, Antônio Sidnei Martins e Antônio Valmor Ferreira Equipe administrativa: Eduardo Carach Menon, Jean Lucca Menon

Aos 19 dias do mês de novembro, foi realizada a reunião ordinária da Comissão de Investimentos na sede do Capsirati para tratar da pauta supracitada.

Através do Google Meet, foram realizadas duas reuniões com os parceiros da Próprio Capital e com a R3 Investimentos.

1. Apresentação da Próprio Capital

A primeira apresentação foi com o representante da Próprio Capital, senhor Elanir Santos que destacou sobre o mercado financeiro, destacando que a realidade que se apresenta no momento é de juros altos e que este processo será um desafio para o cumprimento da meta atuarial para os RPPS com os títulos em renda fixa.

Há no momento o que pode-se chamar de compasso de espera pelas medidas do governo que devem ser anunciadas ainda neste ano, e que o controle de despesas deve ser um dos pilares do arcabouço fiscal, pois as contas públicas tem pressionado a taxa de juros por conta dos indicadores inflacionários e que por essa razão deve haver aumento na taxa de juros. Por sua vez ainda o mercado deve sofrer oscilações pela mudança do presidente do Banco Central em janeiro de 2025, mas que tudo indica aumento inflacionário e seus reflexos na bolsa de valores.

Por outro lado, Elanir pondera sobre a economia americana que deve ter mais um corte de juros em dezembro e isto deve se manter em janeiro impactando os investimentos para os mercados emergentes.

Em seguida apresentou os principais produtos que representa e que podem compor a carteira de investimentos do RPPS, os quais destacam-se a seguir:

1. Fundo Classic FIF CIC RF CP- é o maior fundo em patrimônio, antigo, tem entregado neste na ordem de 114% do CDI, possui baixa volatilidade, alta liquidez, fundo D+1 e recomendo que voltemos investir nesse fundo.
2. Fundo Daycoval Classic Títulos Bancários FIRFCP- são títulos emitidos por instituições financeiras com taxa de juro de 0,35 ao ano, resgate D+0, os RPPS são cotadas e na sua manifestação salientou que o fundo é um dos melhores investimentos para RPPS.

Com relação a Quartzo Capital, Elanir salientou que a empresa atua no mercado a 11 anos, como distribuidora de fundos, e possui como Gestora o Banco Daycoval, MDS Capital, Quartzo Capital e Próprio Capital. Esta empresa atua no mercado imobiliário, convidando a comissão na empresa, cuja sede está sediada em Curitiba.

2. Apresentação da R3 Investimentos

A outra apresentação por google meet foi da R3 Investimentos, onde o Alexandre esplanou sobre o sistema de gestão para acompanhar os

investimentos pela R3 Investimentos e que está disponível para o Capsirati com login e senha. Com relação a possíveis investimentos, ponderou ser interessante para o Capsirati adicionar na carteira de investimentos, títulos da bolsa americana, também encurtar a carteira de investimentos reduzindo a volatilidade de alguns ativos como os IMABs e IDKAs, também ponderou ser interessante inserir na carteira do Caps, títulos de crédito privado que possuem taxas maiores que o CDI, investir em renda variável em dólar para diversificação,. Com relação aos produtos que a R3 oferece, destacou:

1 Fundo Classic FIF CIC RF CP- é o maior fundo em patrimônio, antido, tem entregado neste na ordem de 114% do CDI, possui baixa volatilidade, alta liquidez, fundo D+1 e recomendo que voltemos investir nesse fundo. Também discorreu sobre o Fundo Arbor (BDR) , Fundo Icatu, como opções viáveis ao CAPS.

Na sequência, Rozenilda comunicou que recebeu correspondência do Banco BTG no início do mês de novembro informando o depósito de juros das NTNBS no dia 18 de novembro, o que se concretizou nesta data.

Por se tratar de juros de NTNBS, optou-se por reinvestimentos em títulos públicos, razão pela qual informou que fora expedido ofício no dia 12 de novembro para Lema Assessoria com os valores que o Capsirati tem como demanda para investir, para que orientasse sobre a possibilidade de serem realizados reinvesitmentos em NTNBS.

Além do pagamento de juros das NTNBS, o Banco do Brasil também realizou o pagamento de cupons provenientes dos Vértices com vencimento 2025, 2026 e 2029.

Ao todo, o Caps recebeu o montante de juros pelo contas no BTG o valor de R\$ 1.325.604,01 e pelo Banco do Brasil, o valor de R\$ 461.079,86, dos quais os valores de R\$ 333.414,24 creditados na conta geral do BB serão utilizados para folha de pagamento e somente da conta de aporte que serão utilizados

para reinvestimentos no valor de R\$ 127.665,24, seguidos de recursos da conta do Comprev no valor de até R\$ 550.000,00, totalizando reinvestimentos em títulos no valor de até 1.875.000,00 e R\$ 127.665,62 em vértice, um total aproximados de R\$ 2.000.000,00.

Com os valores estabelecidos, foi solicitado para Lema Assessoria que fizesse uma análise, a qual acenou positivamente para reinvestimento em títulos, orientando para a cotação com as instituições financeiras credenciadas e observar os procedimentos da elaboração dos atestados de compatibilidade com as obrigações presentes e futuras que devem ser

O Comitê sinalizou positivamente para emitir ofício para as instituições credenciadas cotando as NTNBS e vértices no mesmo dia da reunião e assim que fosse recebido as cotações, a diretoria deve optar pela melhor opção e realizar os investimentos dos recursos.

Nada mais havendo a tratar, eu Rozenilda Romaniw Bárbara redigi a presente ata que segue com a lista de presença e os demais documentos pertinentes.

**ATESTADO DE COMPATIBILIDADE COM
OBRIGAÇÕES PRESENTES E FUTURAS**

Seção IV, Art. 115, § 1º da Portaria 1.467/2022.

ATESTADO 001 /11 /2024

Irati, 21 de novembro de 2024.

Atestamos que a aplicação de R\$ 1.870.944,21 (Um milhão, oitocentos e setenta mil, novecentos e quarenta e quatro reais e vinte e um centavos em títulos do Tesouro Nacional, cujo prazo de resgate está em compatibilidade com as obrigações presentes e futuras do regime, de acordo com a Avaliação Atuarial posicionada na data de 31.12.2023.

O valor imobilizado para este fundo, tomando como base o patrimônio líquido em 31/10/2024 de R\$ 145.085,764,49 será de 1,29%.

Portanto, considerando o prazo de desinvestimento dos fundos com carência para resgate e conversão de cotas que compõem a carteira de investimentos do RPPS é possível atestar que o (CAPSIRATI, tem intenção e capacidade financeira de manter em sua carteira até o vencimento a aplicação sem comprometer as suas obrigações presentes e futuras.

O fundo de investimentos está enquadrado na Resolução 4.963/2021 e na Política de Investimentos vigente.

Rozenilda Romaniw Bárbara
Superintendente

Fernando José dos Anjos
Gestor de Recursos

**ATESTADO DE COMPATIBILIDADE COM
OBRIGAÇÕES PRESENTES E FUTURAS**

Seção IV, Art. 115, § 1º da Portaria 1.467/2022.

ATESTADO 002 /11 /2024

Irati, 21 de novembro de 2024.

Atestamos que a aplicação de R\$ 127.655,52 (Cento e vinte e sete mil, seiscientos e cinquenta e cinco reais e cinquenta e dois centavos) em fundos de vértice 2025 junto ao Banco do Brasil, cujo prazo de resgate está em compatibilidade com as obrigações presentes e futuras do regime, de acordo com a Avaliação Atuarial posicionada na data de 31.12.2023.

O valor imobilizado para este fundo de vértice, tomando como base o patrimônio líquido em 31/10/2024 de R\$ 145.085,764,49 será de 0,09%.

Portanto, considerando o prazo de desinvestimento dos fundos com carência para resgate e conversão de cotas que compõem a carteira de investimentos do RPPS é possível atestar que o (CAPSIRATI, tem intenção e capacidade financeira de manter em sua carteira até o vencimento a aplicação sem comprometer as suas obrigações presentes e futuras.

O fundo de investimentos está enquadrado na Resolução 4.963/2021 e na Política de Investimentos vigente.


Rozenilda Romaniw Bárbara
Superintendente


Fernando José dos Anjos
Gestor de Recursos



CAIXA DE APOSENTADORIA E PENSÃO
DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE IRATI

LISTA DE PRESENÇA

CAPSIRATI

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

19 de novembro de 2024

1.	JEAN LUCCA MENON
2.	Antonio Carlos Mucha
3.	ANTONIO SIDNEI MARTINS
4.	Fernando José dos Anjos
5.	Eduardo E. ...
6.	Antonio Carlos ...
7.	
8.	
9.	
10.	
11.	
12.	
13.	
14.	
15.	
16.	
17.	

IRATI, 19 de novembro de 2024.

RES: cotação Irati

1 mensagem

Fernanda Kaline Ferreira de Sepulvida <fernanda.sepulvida@bancodaycoval.com.br>19 de novembro de 2024 às
15:41

Para: "capsirati@gmail.com" <capsirati@gmail.com>

Cc: "captacao.aai" <captacao.aai@bancodaycoval.com.br>, Beatriz Castro Barbosa <beatriz.barbosa@bancodaycoval.com.br>, rendafixa <rendafixa@bancodaycoval.com.br>, "elanir.santos@opatirarca.com.br" <elanir.santos@opatirarca.com.br>, Aline Fujitani <Aline.fujitani@opatirarca.com.br>

Prezados, boa Tarde!

Segue cotação conforme solicitado, liquidação D+1:

Vencim.	Taxa
2025	4,95%
2026	6,95%
2027	6,85%
2028	6,86%
2029	6,84%
2030	6,82%

IMPORTANTE: As cotações de NTN-B são suscetíveis a oscilações inerentes ao mercado e podem sofrer alteração no momento do fechamento da operação

Cotação válida apenas para liquidação e custódia no próprio Banco Daycoval.

Atenciosamente;

**Fernanda Kaline F. de Sepulvida**

Daycoval Investimentos

(11) 3138-1719

fernanda.sepulvida@bancodaycoval.com.br

Banco Daycoval S.A

www.daycoval.com.br

De: Elanir Santos <elanir.santos@opatriarca.com.br>

Enviada em: terça-feira, 19 de novembro de 2024 15:16

Para: Beatriz Castro Barbosa <beatriz.barbosa@bancodaycoval.com.br>

Cc: captacao.aai <captacao.aai@bancodaycoval.com.br>; Aline Fujitani <Aline.fujitani@opatriarca.com.br>

Assunto: ENC: cotação Irati

Beatriz, boa tarde.

Poderia nos encaminhar cotação para as respectivas compras de Títulos públicos pelo instituto de Irati?

Atenciosamente,

Elanir Santos, CFP®

Sócio Sênior

(11) 4506-3104 | 99390-5456

www.opatriarca.com.br

São Paulo | SP: Av. Brig. Faria Lima 1478, sl. 415, Pinheiros, CEP: 01451-001



De: CAPS IRATI <capsirati@gmail.com>

Enviada em: terça-feira, 19 de novembro de 2024 14:45

Para: Elanir Santos <elanir.santos@opatriarca.com.br>

Assunto: cotação

Prezado Elanir, por orientação da comissão, vamos utilizar os juros das NTNBS para reinvestir em NTNBS curtas, pode orçar para nó?

Grata pela atenção

Rozenilda Romaniw Bárbara

Superintende do Capsirati

42- 99917-8150

Nota de Negociação de Títulos Públicos

Data da Operação: 22/11/2024

Nº da Operação: 40530501

CAIXA DE APOSENTADORIA E PENSÃO DOS SERV PLANO 1

C.N.P.J 04.525.731/0001-01

R CEL EMILIO GOMES 22
CEP 84500-054 IRATI PR

Características dos Títulos Públicos

Título	Ambiente de negociação	Data da Emissão	Vencimento
NTNB	BACEN	06/01/2016	15/08/2026

Características da Operação

Tipo de Operação	Quantidade	Preço Unitário	Valor Total	IRR	IOF	Valor Líquido
Compra	159,00	4.364,70918500	693.988,76	0,00	0,00	693.988,76

Taxa de operação
6,9700

Forma de Liquidação Financeira

SELIC

Forma de Custódia dos Títulos

SELIC

Operação de Origem

Caso não esteja de acordo com as condições expressas nesta nota, favor manifestar-se no prazo máximo de 10 (dez) dias.



Luiz Cornetta
Procurador(a)



Marina Garcia
Procurador(a)

Rio de Janeiro, 22 de novembro de 2024.

Importante

- Este documento é intransferível e inegociável sendo instrumento hábil para comprovação de retenção do imposto de renda na fonte;
- Deverão estar formalizados neste documento compromissos de recompra ou revenda acaso existentes. Nestes casos, ficam asseguradas a recompra e / ou revenda de nossa parte e a revenda e / ou recompra por parte de V.Sa(s) dos títulos objeto desta operação, só podendo ser alteradas com a concordância de ambas as partes.

BANCO BTG PACTUAL S.A

Praia de Botafogo, 501 - 6º andar - Torre Corcovado - CEP 22250-040 - Rio de Janeiro - RJ - Brasil
Av. Brigadeiro Faria Lima, 3477 - 14º andar - CEP 04538-133 - São Paulo - SP - Brasil

Tel. (21) 3262-9600
Tel. (11) 3383-2000

C.N.P.J. 30.306.294/0001-45
C.N.P.J. 30.306.294/0002-26



Nota de Negociação de Títulos Públicos

Data da Operação: 22/11/2024

Nº da Operação: 40531246

CAIXA DE APOSENTADORIA E PENSÃO DOS SERV PLANO 2

C.N.P.J 04.525.731/0001-01

R CEL EMILIO GOMES 22

CEP 84500-054 IRATI PR

Características dos Títulos Públicos

Título	Ambiente de negociação	Data da Emissão	Vencimento
NTNB	BACEN	06/01/2016	15/08/2026

Características da Operação

Tipo de Operação	Quantidade	Preço Unitário	Valor Total	IRR	IOF	Valor Líquido
Compra	212,00	4.364,70918500	925.318,34	0,00	0,00	925.318,34

Taxa de operação
6,9700

Forma de Liquidação Financeira

SELIC

Forma de Custódia dos Títulos

SELIC

Operação de Origem

Caso não esteja de acordo com as condições expressas nesta nota, favor manifestar-se no prazo máximo de 10 (dez) dias.

Luiz Cornetta
Procurador(a)

Marina Garcia
Procurador(a)

Rio de Janeiro, 22 de novembro de 2024.

Importante

- Este documento é intransferível e inegociável sendo instrumento hábil para comprovação de retenção do imposto de renda na fonte;
- Deverão estar formalizados neste documento compromissos de recompra ou revenda acaso existentes. Nestes casos, ficam asseguradas a recompra e / ou revenda de nossa parte e a revenda e / ou recompra por parte de V.Sa(s) dos títulos objeto desta operação, só podendo ser alteradas com a concordância de ambas as partes.

BANCO BTG PACTUAL S.A

Praia de Botafogo, 501 - 6º andar - Torre Corcovado - CEP 22250-040 - Rio de Janeiro - RJ - Brasil
Av. Brigadeiro Faria Lima, 3477 - 14º andar - CEP 04538-133 - São Paulo - SP - Brasil

Tel. (21) 3262-9600
Tel. (11) 3383-2000

C.N.P.J. 30.306.294/0001-45
C.N.P.J. 30.306.294/0002-26



Nota de Negociação de Títulos Públicos

Data da Operação: 22/11/2024

Nº da Operação: 40530502

CAPSIRATI - CAIXA DE APOSENTADORIA E PENSÃO

C.N.P.J 04.525.731/0001-01

CEL EMILIO GOMES 22 CENTRO
CEP 84500-000 IRATI PR

Características dos Títulos Públicos

Título	Ambiente de negociação	Data da Emissão	Vencimento
NTNB	BACEN	06/01/2016	15/08/2026

Características da Operação

Tipo de Operação	Quantidade	Preço Unitário	Valor Total	IRR	IOF	Valor Líquido
Compra	62,00	4.364,70918500	270.611,96	0,00	0,00	270.611,96

Taxa de operação
6,9700

Forma de Liquidação Financeira

SELIC

Forma de Custódia dos Títulos

SELIC

Operação de Origem

Caso não esteja de acordo com as condições expressas nesta nota, favor manifestar-se no prazo máximo de 10 (dez) dias.

Luiz Cornetta
Procurador(a)

Marina Garcia
Procurador(a)

Rio de Janeiro, 22 de novembro de 2024.

Importante

- Este documento é intransferível e inegociável sendo instrumento hábil para comprovação de retenção do imposto de renda na fonte;
- Deverão estar formalizados neste documento compromissos de recompra ou revenda acaso existentes. Nestes casos, ficam asseguradas a recompra e / ou revenda de nossa parte e a revenda e / ou recompra por parte de V.Sa(s) dos títulos objeto desta operação, só podendo ser alteradas com a concordância de ambas as partes.

BANCO BTG PACTUAL S.A

Praia de Botafogo, 501 - 6º andar - Torre Corcovado - CEP 22250-040 - Rio de Janeiro - RJ - Brasil
Av. Brigadeiro Faria Lima, 3477 - 14º andar - CEP 04538-133 - São Paulo - SP - Brasil

Tel. (21) 3262-9600
Tel. (11) 3383-2000

C.N.P.J. 30.306.294/0001-45
C.N.P.J. 30.306.294/0002-26



Nota de Negociação de Títulos Públicos

Data da Operação: 22/11/2024

Nº da Operação: 40530503

CAIXA DE APOSENTADORIA E PENSÃO DOS SERVIDORES MUN

C.N.P.J 04.525.731/0001-01

CEL EMILIO GOMES 22 CENTRO
CEP 84500-000 IRATI PR

Características dos Títulos Públicos

Título	Ambiente de negociação	Data da Emissão	Vencimento
NTNB	BACEN	06/01/2016	15/08/2026

Características da Operação

Tipo de Operação	Quantidade	Preço Unitário	Valor Total	IRR	IOF	Valor Líquido
Compra	4,00	4.364,70918500	17.458,83	0,00	0,00	17.458,83

Taxa de operação
6,9700

Forma de Liquidação Financeira

SELIC

Forma de Custódia dos Títulos

SELIC

Operação de Origem

Caso não esteja de acordo com as condições expressas nesta nota, favor manifestar-se no prazo máximo de 10 (dez) dias.

Luiz Cornetta
Procurador(a)

Marina Garcia
Procurador(a)

Rio de Janeiro, 22 de novembro de 2024.

Importante

- Este documento é intransferível e inegociável sendo instrumento hábil para comprovação de retenção do imposto de renda na fonte;
- Deverão estar formalizados neste documento compromissos de recompra ou revenda acaso existentes. Nestes casos, ficam asseguradas a recompra e / ou revenda de nossa parte e a revenda e / ou recompra por parte de V.Sa(s) dos títulos objeto desta operação, só podendo ser alteradas com a concordância de ambas as partes.

BANCO BTG PACTUAL S.A

Praia de Botafogo, 501 - 6º andar - Torre Corcovado - CEP 22250-040 - Rio de Janeiro - RJ - Brasil
Av. Brigadeiro Faria Lima, 3477 - 14º andar - CEP 04538-133 - São Paulo - SP - Brasil

Tel. (21) 3262-9600
Tel. (11) 3383-2000

C.N.P.J. 30.306.294/0001-45
C.N.P.J. 30.306.294/0002-26

Escrever



Caixa de entrada 656

Com estrela

Mais

Marcadores

Censo previdenciário

comprev

consignados

Segue cotação indicativa para liquidação em 21/11.

BTG Pactual CTVM	CNPJ	43.815.158/0001-22	SELIC	16400030-2		
	Título	Taxa	Liquidacao	Quantidade	PU	Financeiro
BNTNB 6 05/15/25		4,5200	21/11/2024	426	4.395,763571	1.872.595,28
BNTNB 6 08/15/26		7,1500	21/11/2024	430	4.351,033068	1.870.944,21
BNTNB 6 05/15/27		7,0300	21/11/2024	438	4.271,566901	1.870.946,30
BNTNB 6 08/15/28		7,0300	21/11/2024	436	4.291,940159	1.871.285,90
BNTNB 6 05/15/29		6,9200	21/11/2024	443	4.225,567973	1.871.926,61
BNTNB 6 08/15/30		6,8900	21/11/2024	439	4.261,707186	1.870.889,45

Atenciosamente,

Geraldo G. Pelluchi Jr
Corretora BM&F

Tel. +55 11 3383 2021

Cel. +55 11 99123 0033

Atualizar

