



Comitê de Investimentos Reunião Extraordinária

Ata nº 05/2022 – aos doze dias do mês de janeiro do ano de dois mil e vinte e dois, às 13 horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê**, **Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê**, **Clayton Faria Schmidt**, **Patrícia Ramos Quaresma**, **Victor Mendes Neto** e o **Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do Instituto**. Considerando diretrizes administrativas do Comitê esta reunião extraordinária servirá para definir parâmetros visando realização de operação para aquisição de Títulos Públicos Federais. As considerações iniciais são as seguintes: 1) atualmente (posição do dia 06/01/2022) o Instituto detém 36,48% da carteira investida em TP e a PI 2022 estabeleceu limite superior de até 100%, com estratégia alvo de 52%; a operação definida para ocorrer até o limite de 75 milhões respeita tais limites; 2) as taxas negociadas na véspera para as NTNBS consideradas superam a meta atuarial de IPCA +4,99% a.a. definida para o exercício; 3) o último estudo de ALM disponível sugere margem de alocação para NTNBS 2040 de até 32,4MM; 2045 de até 16,5MM, NTNBS 2050 de até 46MM e NTNBS 2055 de 76,7MM; 4) nos vencimentos considerados, relatório ANBIMA apurou taxas mínimas para liquidação D+1 oscilando entre IPCA+5,54 e IPCA 5,61 na véspera; 5 e 6) as operações serão realizadas mediante consulta de Instituições Financeiras integrantes da lista exaustiva da SPREV e que utilizam plataforma eletrônica, figurando como dealers de mercado aberto junto ao BACEN e STN além de serem credenciadas junto ao BERTPREV (serão consultados BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander e XP); 7, 8 e 9) as taxas mínimas de atratividade para aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+5,54 para 2040, IPCA+5,60 para 2045, IPCA+5,61 para 2050 e IPCA+5,61 para 2055; 10) foi realizada reunião com pessoal do administrativo do BERTPREV visando realizar a operação em 13/01/2022 até as 12 horas; 11) serão consultadas as Instituições BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander e XP; 12) os títulos serão custodiados em empresa licitada e contratada pelo BERTPREV; 13) nessa reunião foram verificadas condições de operação para aquisição de TPs; 14) o volume financeiro estabelecido será de até 75MM, as taxas mínimas de atratividade para aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+5,54 para 2040, IPCA+5,60 para 2045, IPCA+5,61 para 2050 e IPCA+5,61 para 2055 e a reunião que tratar da aquisição dos TPs terá registro em ata com assinaturas dos participantes. E nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 16:50 horas, sendo a presente ata assinada pelos participantes.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade