

Comitê de Investimentos

Reunião Extraordinária

Ata nº 49/2022 – ao quinze dia do mês de setembro do ano de dois mil e vinte e dois, às 14 horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê, Patrícia Ramos Quaresma, José Ferreira Melo Filho - CAF e o Sr. Alexandre Hope Herrera – Contador do Instituto**, a reunião foi interrompida às 16:50 e retomada às 9 horas do dia 16 de setembro de 2022. Considerando diretrizes administrativas do Comitê esta reunião extraordinária servirá para definir parâmetros visando realização de operação para aquisição de Títulos Públicos Federais, com preferência por vencimentos em 2032 e 2040. As considerações iniciais são as seguintes: **1)** atualmente (posição do dia 08/09/2022) o Instituto detém 67,14% da carteira investida em TPs e a PI 2022 vigente estabeleceu limite superior de até 100%. Considerando estar presente janela de oportunidade para aquisição de TPs com rentabilidade acima da meta atuarial, circunstância superveniente à elaboração da PI inicial, é julgado oportuno aumentar a alocação; a presente operação definida para ocorrer com volume financeiro de 24 milhões de reais respeita o limite superior de alocação, sendo 14MM em NTN-B 2032 e 10MM em NTN-B 2040; **2)** as taxas negociadas na véspera para as NTNBS consideradas (2032 e 2040) superam a meta atuarial vigente de IPCA +4,99% a.a.; **3)** considerando as aquisições recentes aliado ao fato da legislação permitir 100% de aplicação do patrimônio em TPs, observamos possibilidade de alocação para NTN-B 2032 14MM e NTN-B 2040 de 10MM; **4)** nos vencimentos considerados, relatórios ANBIMA permitem apurar taxas mínimas para liquidação D+1 de IPCA+5,59 para NTN-B 2032 e D+1 de IPCA+5,67 para NTN-B 2040 até a véspera, para o vencimento considerado; **5 e 6)** as operações serão realizadas mediante consulta de Instituições Financeiras que utilizam plataforma eletrônica, figurando como dealers de mercado aberto junto ao BACEN ou STN além de serem credenciadas junto ao BERTPREV (serão consultados BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander, BGC, Renascença e XP); **7, 8 e 9)** as taxas mínimas do intervalo indicativo para liquidação em D+1 utilizadas para definir atratividade, considerando as médias dos dias 09/09/2022 até 15/09/2022, e que serão parâmetro para eventual aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+5,59 para NTN-B 2032 e D+1 de IPCA+5,67 para NTN-B 2040; **10)** foi realizada reunião prévia com o pessoal do administrativo do BERTPREV que participará da operação de aquisição dos TPs, sendo encaminhada relação de material de apoio aos mesmos visando realizar a operação em 16/09/2022 até as 12 horas; **11)** serão consultadas as Instituições BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander, BGC, Renascença e XP; **12)** os títulos deverão ser custodiados em empresa licitada e contratada pelo BERTPREV; **13)** nessa reunião foram verificadas condições de operação para aquisição de TPs; **14)** para fins de oferta de parâmetros operacionais para o pessoal administrativo do Bertprev visando operação de aquisição de TPs em 16/09/2022 até as 12 horas, ficam estabelecidos: a) o volume financeiro será de 14MM para NTN-B 2032 e 10MM para NTN-B 2040; b) as taxas mínimas de atratividade para aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+5,59 para NTN-B 2032 e D+1 de IPCA+5,67 para NTN-B 2040. Fica mantida pelo Comitê a recomendação



Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertioga
ESTADO DE SÃO PAULO

de que os TPs a adquirir sejam marcados na curva, tal como ocorreu nas demais aquisições realizadas neste ano, sendo indicado o resgate de valores aplicados no fundo SANTANDER DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM para assegurar os recursos necessários à liquidação financeira das operações. E nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 10:25 horas, sendo a presente ata assinada pelos participantes.

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

José Ferreira Melo Filho

Alexandre Hope Herrera
