

Comitê de Investimentos **Reunião Extraordinária**

1

Ata nº 61/2022 – Faz-se registro em ata acerca de reunião que tratou de parâmetros para realização de operação visando aquisição de TPs, registrada na ata nº 60/2022 a partir do dia 09/11/2022, e encerrada às 11:10 do dia 11/11/2022. Partindo dos parâmetros estabelecidos em ata mencionada reuniram-se o **Sr. José Ferreira Melo Filho – Coordenador Administrativo Financeiro**, **Patrícia Ramos Quaresma – Técnica Contábil** e o **Sr. Alexandre Hope Herrera – Contador do Instituto** e o **Sr. Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê de Investimentos** e **Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê**. Iniciados os trabalhos tendo como pauta a operação de aquisição de Títulos Públicos conforme reunião iniciada no dia 09/11/2022 – ata nº 60/2022. A fim de instruir os presentes trabalhos foi juntado anteriormente no Proc. Adm. 173/2021 cópia do Estudo de ALM 2022 elaborado pela LDB Consultoria. Com base em tais instrumentos e também mediante análise do Estudo Atuarial da autarquia, o Comitê verifica haver condições de adquirir títulos públicos com vencimento 2045, em volume financeiro na ordem de R\$ 25.000.000,00 (vinte e cinco milhões de reais), respeitando também a política de investimentos aprovada pelo Conselho de Administração e vigente para o ano de 2022, com cópia também juntada ao P.A. 173/2021. Seguindo o roteiro previamente estabelecido (Anexo I), estimativas ANBIMA desde o dia 04/11/2022 até 10/11/2022 (Anexo II), acerca dos preços praticados para títulos públicos NTN-B. Por deliberação inicial do Comitê, fica estabelecido o volume financeiro para aquisição de títulos públicos correspondente a R\$ 25.000.000,00, sendo escolhido os títulos NTN-B com vencimentos em 2045 – 25MM. Observando o intervalo indicativo para liquidação financeira em D+1 constante da estimativa ANBIMA de 04/11/2022 até 10/11/2022 para os títulos públicos NTN-B em questão, observa-se que as taxas praticadas devem posicionar-se acima da seguinte taxa mínimas de atratividade: IPCA+5,74. Após tais procedimentos, foram consultados BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander, BGC, Renascença e XP; o Sr. Alexandre iniciou contatos com as instituições financeiras relacionadas, integrantes de relações de dealers habilitados ou junto a STN ou BACEN e também credenciadas junto a Autarquia, com vistas à intermediação da operação. Na sequência foram disparadas simultaneamente consultas por e-mail (Anexo III) às 11:15 hs para as instituições financeiras consignando prazo de 10 (dez) minutos para formulação de proposta, a fim de tentar reduzir o efeito da volatilidade de mercado nas cotações. Recebidas as seguintes propostas: a) **BGC** –2045 p.u. 4.027,307682 com taxa de IPCA+ 6,141% a.a.; b) **XP** – 2045 p.u. 4.034,750759 com taxa de IPCA+ 6,125% a.a.; c) **BB** - 2045 p.u. 4.065,201514 com taxa de IPCA+ 6,06% a.a.; d) **RENASCENÇA DTVM**– 2045 p.u. 4.041,281306 com taxa de IPCA+ 6,111% a.a.; e) **BRDESCO**– 2045 p.u. 4.041,749473 com taxa de IPCA+6,1100 a.a. (Anexo IV). Lançadas as propostas em mapa de apuração (Anexo V) foi considerada a mais vantajosa para o BERTPREV aquela oferecida pelo **BGC** no papel NTNB 2045 com o p.u. 4.027,307682 com taxa de IPCA+ 6,141% a.a. e ato contínuo, foi realizado contato telefônico por parte dos servidores administrativo do BERTPREV para concretização



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

da operação aqui descrita, e obtenção das informações das boletas de negociação que serviram para registro das informações para consolidação dos valores financeiros que serão juntadas ao processo, cujo o resumo vai a seguir:

Ativo	Vencimento	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2045-05	mai/2045	6.208	6,141	4.027,307682	25.001.526,08

Dados para registro: GENIAL INVESTIMENTOS CVM S.A; CNPJ: 27.652.684.0001/62 – Custódia BERTPREV. Registra-se que foram apresentadas intempestivamente propostas das Instituições CEF – 2045 p.u. 4.046,42321800 com taxa de IPCA+ 6,1000% a.a. e Santander – 2045 sem informação de p.u. e taxa de IPCA+ 6,12% a.a.; tais propostas não constam da apuração por exceder o prazo de envio mas corroboram os bons parâmetros da proposta considerada vencedora. Encerrados os procedimentos de julgamento, a CAF, de modo análogo às operações de aquisição de TPs realizadas anteriormente, iniciou procedimentos para resgate de aplicações que assegurarão a liquidação financeira da Compra de Títulos Públicos, havendo resgate de R\$ 25.000.000,00 do SANTANDER RF REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI - CNPJ. 09.577.447/0001-00 - sendo emitido o APR nº. 131/2022 para a operação de Compra dos Títulos Públicos NTN-B 2045, com valor financeiro total de R\$ 25.001.526,08, tendo ocorrido o aproveitamento de parte do saldo financeiro disponível na conta SELIC mantida junto à empresa custodiante, remanecendo saldo para posterior destinação, a critério do corpo administrativo da Autarquia na conta corrente do BERTPREV. Considerando a remuneração dos títulos públicos significativamente superior aos requisitos atuariais, e aquisição que considera também o último Estudo de ALM, o Comitê mantém solicitação anteriormente apresentada à Presidência para que emita atestado acerca da possibilidade de manter os papéis na carteira do BERTPREV até os respectivos vencimentos e mediante marcação dos papéis na curva conforme possibilita a IN 464/18 cabendo esclarecer que os papéis são negociáveis a qualquer momento no mercado secundário. E nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 11:50 horas, sendo a presente ata lavrada nesta data, mediante disponibilidade de boleta de negociação nº 1020953, após discutida e aprovada segue assinada pelos participantes. Bertioga, 16/11/2022.

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Alexandre Hope Herrera

José Ferreira Melo Filho



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