

Comitê de Investimentos

Reunião Extraordinária

Ata nº 09/2023 – aos quinze dias do mês de fevereiro do ano de dois mil e vinte e três, às 14:00 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 e o Sr. Alexandre Hope Herrera – Contador do Instituto.** Considerando o exposto o Comitê iniciou atualização dos estudos de fluxo de investimento e tão logo concluídos será requerida a participação do pessoal administrativo para retomada das tratativas visando aquisição de TPs, a reunião foi interrompida às 16:20 e retomada às nove horas do dia 16 de fevereiro de dois mil e vinte e três com a participação dos membros do Comitê de Investimento, **Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê, Patrícia Ramos Quaresma.** 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 vencimento em 2045. As considerações iniciais são as seguintes: **1)** atualmente (posição do dia 10/02/2023) o Instituto detém 77,73% 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 35MM de reais em NTN-B 2045 respeita o limite superior de alocação; **2)** as taxas negociadas na véspera para a NTN-B considerada, superam a meta atuarial vigente para o ano de 2023 de IPCA+5,31%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 2045 com total da ordem de 35MM; **4)** no vencimento considerado, relatórios ANBIMA permitem apurar taxa mínima para liquidação D+1 de IPCA+6,23 para NTN-B 2045, até a véspera, para o vencimento considerado; **5 e 6)** a operação será realizada 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 úteis de 09/02/2023 até 15/02/2023, e que serão parâmetro para eventual aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+6,23 para NTN-B 2045; **10)** nesta reunião prévia com o pessoal do administrativo do BERTPREV que participará da operação de aquisição dos TPs, é encaminhada relação de material de apoio aos mesmos visando realizar a operação em 16/02/2023 a partir das 11 horas; **11)** serão consultadas as Instituições BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander, BGC, Renascença e XP; **12)** os títulos deverão ser custodiados em empresa 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 16/02/2023 a partir das 11 horas, ficam estabelecidos: a) o volume financeiro



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

será da ordem de 35MM para NTN 2045; b) as taxas mínimas de atratividade para aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+6,23 para NTN 2045. Registra-se que o mercado financeiro segue apresentando forte oscilação em taxas de TPs por conta de expectativas acerca da evolução da economia. Fica mantida pelo Comitê a recomendação de que os TPs a adquirir sejam marcados na curva, tal como ocorreu nas demais aquisições realizadas desde o início do ano anterior, sendo indicado o resgate de montante na ordem de 35MM necessário para liquidação das aquisições pretendidas do fundo Santander DI Títulos Públicos Premium – CNPJ 09.577.447/0001-00. E nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 10:50 horas, sendo a presente ata assinada pelos participantes.

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Clayton Faria Schmidt

Alexandre Hope Herrera
