



Comitê de Investimentos **Reunião Extraordinária**

Ata nº 48/2023 – aos vinte dias do mês de setembro do ano de dois mil e vinte e três, às 9 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 e Alexandre Hope Herrera – Presidente Interino do Instituto**. O Comitê iniciou a reunião com a análise do relatório da Consultoria LDB relativo ao desempenho dos investimentos do mês de agosto, havendo emissão do parecer devidamente enviado ao CAF para providências. Acerca das conclusões constantes do parecer fica registrada deliberação do colegiado para que se informe no endereço eletrônico do BERTPREV e também para que seja providenciada a publicação no Boletim Oficial do Município a seguinte síntese: *“O patrimônio previdenciário até 31/08/2023 (R\$ 779.922.717,26) apresenta um expressivo crescimento. A carteira de investimentos do BERTPREV apresentou rentabilidade positiva em todos os meses de 2023, com resultado acumulado que supera o montante de R\$ 60.000.000,00, satisfazendo a meta atuarial no período com reduzida volatilidade.”* Dando sequência na reunião, foi requerida a participação do pessoal administrativo para adoção de providências visando aquisição de TPs. A reunião foi interrompida às 17:10 e retomada às nove horas do dia 21 de setembro 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, Clayton Faria Schmidt e Patrícia Ramos Quaresma**. Considerando diretrizes administrativas do Comitê esta reunião extraordinária presta-se à definição de parâmetros visando realização de operação para aquisição de Títulos Públicos Federais, com vencimento em 2045. As considerações iniciais são as seguintes: **1)** atualmente (posição do dia 18/09/2023) o Instituto detém 82,95% da carteira investida em TPs, e a PI 2023 vigente estabeleceu limite superior de até 96%. Considerando estar presente janela de oportunidade para aquisição de TPs com rentabilidade acima da meta atuarial, é julgado oportuno aumentar a alocação; a presente operação definida para ocorrer com volume financeiro da ordem de 20MM 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 aliadas ao fato da legislação permitir 100% de aplicação do patrimônio em TPs, observamos possibilidade de alocação para NTN-B 2045 com montante da ordem de 20MM; **4)** no vencimento considerado, relatórios ANBIMA permitem apurar taxa mínima para liquidação D+1 de IPCA+5,50 para NTNB 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 14/09/2023 até 20/09/2023, e que serão parâmetro para eventual aceitação das propostas



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

ficam definidas em IPCA+5,50 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 21/09/2023 a partir das 10 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 NTN-B 2045; **14)** para fins de oferta de parâmetros operacionais para o pessoal administrativo do Bertprev visando operação de aquisição de TPs em 21/09/2023 a partir das 10 horas, ficam estabelecidos: a) o volume financeiro será da ordem de 20MM para NTN-B 2045; b) as taxas mínimas de atratividade para aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+5,50 para NTN-B 2045. Registra-se que o mercado financeiro segue apresentando oscilação relevante em taxas de TPs por conta de expectativas acerca da evolução da economia, razão pela qual recomenda-se adotar prazo de até 10 minutos para encaminhamento de propostas a partir do horário fixado para início da operação. 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 de 2022, sendo indicado o resgate de montante na ordem de 20MM 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 13 horas, sendo a presente ata assinada pelos participantes.

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Clayton Faria Schmidt

Alexandre Hope Herrera

Patrícia Ramos Quaresma
