

Comitê de Investimentos **Reunião Extraordinária**

Ata nº 26/2024 – Faz-se registro nesta data, a partir das oito horas dos atos realizados em operação para aquisição de TPs, em vinte e três de maio de dois mil e vinte e quatro, com parâmetros para realização de tal operação registrada na ata nº 25/2024 lavrada a partir do dia 22/05/2024 e encerrada às 09:30hs do dia 23/05/2024. Partindo dos parâmetros estabelecidos em ata mencionada reuniram-se, **Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê, Clayton Faria Schmidt, Alexandre Hope Herrera.** Iniciados os trabalhos naquela ocasião tendo como pauta o registro da operação de aquisição de Títulos Públicos conforme reunião iniciada no dia 22/05/2024 – ata nº 25/2024. A fim de instruir o Proc. Adm. 173/2021 deverão ser juntados as cópias do Estudo de ALM 2024 elaborado pela LDB Consultoria, além da documentação aqui mencionada. Com base em tais instrumentos e também mediante análise do Estudo Atuarial da autarquia, o Comitê verificou haver condições de adquirir títulos públicos com vencimentos em 2050, em volume financeiro na ordem de R\$ 20.000.000,00 (vinte milhões de reais), respeitando também a política de investimentos aprovada pelo Conselho de Administração e vigente para o ano de 2024, com cópia que também deverá ser juntada ao P.A. 173/2021. Seguindo o roteiro previamente estabelecido (Anexo I), estimativas ANBIMA desde o dia 16/05/2024 até 22/05/2024 (Anexo II), acerca dos preços praticados para títulos públicos NTN-B. Por deliberação inicial do Comitê, fica estabelecido o limite financeiro para aquisição de títulos públicos na ordem de R\$ 20.000.000,00 (vinte milhões de reais), sendo escolhido os títulos NTN-B com vencimentos em 2050. Observando o intervalo indicativo para liquidação financeira em D+1 constante da estimativa ANBIMA de 16/05/2024 até 22/05/2024 para os títulos públicos NTN-B em questão, observam-se as seguintes taxas mínimas de atratividade: IPCA+6,00 para 2050. Após tais providências, foram iniciados por parte dos servidores do corpo administrativo da autarquia procedimentos para consultas das instituições BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander, BGC, Renascença e XP, integrantes de relações de dealers habilitados ou junto a STN ou BACEN e também credenciadas junto a Autarquia. A Sra. Patrícia iniciou contatos com as instituições financeiras relacionadas, com vistas à intermediação da operação, sendo disparadas simultaneamente consultas por e-mail (Anexo III) às 10h20 para as instituições financeiras consignando prazo de 10 (dez) minutos para formulação de proposta visando aquisição de NTN-B 2050 até o volume de 20MM, a fim de tentar reduzir o efeito da volatilidade de mercado nas cotações. Recebidas as propostas de: **a) BTG; b) BGC; c) BRADESCO; d)XP; e)CAIXA; f) ITÁU; g) RENASCENÇA; h) BANCO DO BRASIL**, a participante que ofertou a melhor proposta não conseguiu realizar a operação nas condições apresentadas, o mesmo ocorrendo com a a segunda melhor proposta. Diante do exposto foi necessário realizar nova rodada visando aquisição dos TPs. A Sra. Patrícia retomou contatos com as instituições financeiras relacionadas, com vistas à intermediação da operação, sendo disparadas simultaneamente consultas por e-mail as 11hs: (Anexo III) para as instituições financeiras consignando prazo de 10 (dez) minutos para formulação de proposta visando aquisição de NTN-B 2050 até o volume de 20MM, a fim de tentar reduzir o efeito da volatilidade de mercado nas cotações. Recebidas as propostas de: a) **BTG** – p.u. 4.273,358142 com taxa de IPCA+6,1650% a.a.; b) **BGC** - com taxa de



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

IPCA+6,1576% a.a, correspondente p.u. 4.277,308601; c) **XP** – p.u. 4.277,629255 com taxa de IPCA+6,1570% a.a.; (Anexo IV). Concluído o processo de apuração, o pessoal do administrativo do BERTPREV, foram lançadas as propostas completas em mapa de apuração (Anexo V) foi considerada a mais vantajosa para o BERTPREV aquela oferecida pela **BTG** – p.u. 4.273,358142 e com taxa de IPCA+6,1650% a.a. Ato contínuo, foi realizado contato telefônico por parte dos servidores administrativo do BERTPREV para concretização da operação aqui descrita, e obtenção das informações das boletas de negociação que serviram para registro das informações para consolidação dos valores financeiros que deverão ser juntadas ao processo. Após confirmada a operação de aquisição de NTN-Bs, segue o resumo:

Ativo	Vencimento	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2050-08	agosto/2050	4.680	6,1650%	4.273,358142	19.999.316,10

Dados para registro: GENIAL INVESTIMENTOS CVM S.A; CNPJ: 27.652.684.0001/62 – Custódia BERTPREV. 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, sendo indicado resgate do fundo SANTANDER RF REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI - CNPJ. 09.577.447/0001-00 para liquidação da operação de Compra dos Títulos Públicos NTN-B 2050, com valor financeiro total de R\$ **19.999.316,10**. 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 o respectivo vencimento e mediante marcação dos papéis na curva conforme possibilitou a IN 464/18 cabendo esclarecer que os papéis são negociáveis a qualquer momento no mercado secundário. Os trabalhos da operação da aquisição foram concluídos às 12:30h, objetivando o aguardo de remessa da boleta de negociação por parte da empresa responsável pela custódia dos Títulos Públicos. Nesta data passou-se ao registro dos dados constantes da boleta recebida da Genial Investimentos que permitiu concluir os registros necessários. E nada mais havendo a tratar, a presente reunião foi encerrada às 9 horas, sendo a presente ata lavrada, mediante disponibilidade de boleta de negociação nº 1785558, após discutida e aprovada segue assinada pelos participantes. Bertioga, 29/05/2024.

Alexandre Hope Herrera

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Victor Mendes Neto
