



Comitê de Investimentos **Reunião Extraordinária**

Ata nº 48/2024 – Faz-se registro nesta data, a partir das nove horas dos atos realizados em operação para aquisição de TPs, em vinte seis de setembro de dois mil e vinte e quatro, com parâmetros para realização de tal operação registrada na ata nº 47/2024 lavrada a partir do dia 25/09/2024 e encerrada às 10:50hs do dia 26/09/2024. Partindo dos parâmetros estabelecidos em ata mencionada reuniram-se, **Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê e Clayton Faria Schmidt** Iniciados os trabalhos naquela ocasião tendo como pauta o registro da operação de aquisição de Títulos Públicos conforme reunião iniciada no dia 25/09/2024 – Ata nº 47/2024. 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\$ 10.000.000,00 (dez 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 19/09/2024 até 25/09/2024 (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\$ 10.000.000,00 (dez 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 19/09/2024 até 25/09/2024 para os títulos públicos NTN-B em questão, observam-se as seguintes taxas mínimas de atratividade: IPCA+6,2881 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, Renascença, Santander 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 11hs para as instituições financeiras consignando prazo de 10 (dez) minutos para formulação de proposta visando aquisição de NTN-B 2050 até o volume de 10MM, a fim de tentar reduzir o efeito da volatilidade de mercado nas cotações. Recebidas as propostas de: a) **BRADERSCO** - p.u. 4.164,987841 com taxa de IPCA+6,393% a.a; b) **CEF** – p.u. 4.172,695986 com taxa de IPCA+6,3780% a.a.; c) **ITAÚ** - p.u. 4.161,395318 com taxa de IPCA+6,4000% a.a (**DECLINOU**), d) **RENASCENÇA** - p.u. 4.166,526877 com taxa de IPCA+6,390% a.a; e) **BTG** - p.u. 4.166,526876 com taxa de IPCA+6,3900% a. f) **XP** - p.u. 4.162,934353 com taxa de IPCA+6,3970% 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), cabendo registrar que a proposta apresentada pelo ITAÚ item “c” não foi mantida e então foi considerada a mais vantajosa para o BERTPREV aquela oferecida



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

pela **XP** - p.u. 4.162,934353 com taxa de IPCA+6,3970% 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	2.402	6,3970%	4.162,934353	9.999.368,31

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\$ **9.999.368,31**. 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 horas, 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 8:50hs, sendo a presente ata lavrada, mediante disponibilidade de boleta de negociação nº 2059953, após discutida e aprovada segue assinada pelos participantes. Bertioga, 02/10/2024.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes
