

ATA DE REUNIÃO – DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Reunião Extraordinária nº 006/2024

Data: 06 de agosto de 2024

Hora: 14:00h

Local: Sala de Reunião da APE – 4º andar – Sede IPAJM

Participantes:

Gilberto de Souza Tulli - Diretor de Investimentos

Elisa do Carmo Medeiros Fonseca - Gerente de Investimentos

Albert Iglesia Correa dos Santos Junior - Membro do Comitê de Investimentos

Lucas José das Neves Rodrigues - Membro do Comitê de Investimentos

Roseane Dalvi Pedruzzi - Membro do Comitê de Investimentos

Shirlene Pires Mesquita - Membro do Comitê de Investimentos

Tatiana Gasparini Silva Stelzer - Membro do Comitê de Investimentos

Ordem do Dia:

1. Apresentação dos novos membros do COMIN;
2. Proposta de realocação de recursos;
3. Deliberações.

Item 01:

Reuniram-se na sala de reunião da Assessoria da Presidência Executiva – APE a Diretoria de Investimentos e o Comitê de Investimentos para deliberarem sobre a realocação de recursos da Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário. O ilustre Presidente Executivo, Sr. José Elias do Nascimento Marçal, prestigiando a reunião com sua presença, iniciou os trabalhos dando as boas-vindas aos novos membros do comitê, Sr. Albert e Sra. Shirlene, agradecendo por terem aceito o desafio e a responsabilidade de atuarem na gestão de um volume tão grande de recursos. Em sua fala de agradecimento, destacou a importância de cada um no grupo, expressando sua satisfação em tê-los na equipe e manifestou sua confiança no potencial do comitê, se comprometendo a manter a isenção e independência nas decisões, enfatizando a necessidade da observância de critérios técnicos e objetivos, sempre rigorosamente dentro das normas estabelecidas. Na oportunidade, o presidente agradeceu também pelo empenho dos servidores que atuam no comitê com zelo e dedicação, deixando o recinto em seguida, para a continuidade da reunião. Com a palavra, o diretor reforçou os agradecimentos do presidente, saudando a chegada dos novos membros, que completam a composição do comitê de investimentos e fez um breve relato sobre as rotinas, procedimentos, normas e sistemas utilizados no IPAJM, apresentando também um histórico da situação até a configuração atual das carteiras dos fundos geridos por essa equipe.

Item 02:

Passando ao próximo ponto de pauta, o diretor informou que no próximo dia 15

de agosto serão creditados cerca de cinquenta e dois milhões de reais na conta do fundo previdenciário na XP, referente ao pagamento de cupons de juros dos títulos públicos com vencimentos em anos pares. Como esses recursos ainda não podem ser aplicados em fundos administrados pela XP, será necessário realizar a transferência desses recursos para outra instituição financeira. Explicou também que temos cerca de quarenta milhões de reais no fundo previdenciário do Banestes, que precisam ser realocados para manutenção do enquadramento ao limite de 5% do patrimônio sob gestão do banco. Ponderando sobre os eventos que estressaram os mercados nos últimos dias, as novas expectativas de queda dos juros americanos e a consequente redução das taxas das NTN-Bs, os participantes avaliaram que seria importante aproveitar as taxas ainda próximas de 6% para comprar mais títulos públicos indexados à inflação, garantindo uma rentabilidade acima da meta e avançando no objetivo definido na política de investimentos, de alcançar 50% de alocação da carteira em títulos públicos. Considerando as taxas indicativas da Anbima no dia anterior, foi sugerida a compra de vinte mil NTN-Bs com vencimento em 2050, cujo montante deve se aproximar a oitenta e cinco milhões de reais, recompondo com alguma folga o valor que será pago pelos cupons. Como o diretor estará em viagem na próxima semana, entre os dias 13 e 17, chegou-se ao consenso de que esta movimentação deve ser realizada no dia 8 de agosto, com liquidação em D+1. Considerando os recursos que devem sair do Banestes, formulou-se a proposta de transferir quarenta e cinco milhões da Caixa e cerca de quarenta milhões do Banestes para a custodiante XP, realocando os recursos aplicados em fundos DI dos respectivos bancos. Quando os cupons de juros forem creditados na conta da XP, devem retornar para a Caixa, sendo aplicados novamente no fundo DI.

Item 03:

Com base nas informações expostas, considerando a impossibilidade de definir previamente os valores exatos de cada operação, foi deliberado pelos participantes a aquisição de 20.000 NTN-Bs com vencimento em 2050 e as respectivas realocações dos recursos para liquidação destas operações nos dias e valores aproximados, conforme resumo abaixo:

- **COMPRA** no dia 08/08/2024 de 20.000 (vinte mil) NTN-Bs com vencimento em 15/08/2050, no valor aproximado de **R\$ 85.000.000,00** (oitenta e cinco milhões de reais) com liquidação em 09/08/2024;
- **RESGATE** no dia 08/08/2024 de **R\$ 30.000.000,00** (trinta milhões de reais) do fundo BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RF, da conta do Fundo Previdenciário no Banestes;
- **RESGATE** no dia 08/08/2024 de aproximadamente **R\$ 10.000.000,00** (dez milhões de reais) do fundo BANESTES LIQUIDEZ FI RF REF DI, da conta do Fundo Previdenciário no Banestes;
- **TRANSFERÊNCIA** no dia 09/08/2024 de aproximadamente **R\$ 40.000.000,00** (quarenta milhões de reais) da conta do Fundo Previdenciário no Banestes para a XP;
- **RESGATE** no dia 09/08/2024 de **R\$ 45.000.000,00** (quarenta e cinco milhões de reais) do fundo CAIXA FI BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO, da conta do Fundo Previdenciário na Caixa;
- **TRANSFERÊNCIA** no dia 09/08/2024 de **R\$ 45.000.000,00** (quarenta e

cinco milhões de reais) da conta do Fundo Previdenciário na Caixa para a XP;

- **TRANSFERÊNCIA** no dia 15/08/2024 de aproximadamente **R\$ 52.000.000,00** (cinquenta e dois milhões de reais) da conta do Fundo Previdenciário na XP para a Caixa (referente aos cupons de juros recebidos neste dia);
- **APLICAÇÃO** no dia 15/08/2024 de aproximadamente **R\$ 52.000.000,00** (cinquenta e dois milhões de reais) no fundo CAIXA FI BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO, da conta do Fundo Previdenciário na Caixa;

Considerações Finais:

Nada mais havendo a tratar, foi encerrada a reunião e lavrada a presente Ata, que vai assinada por todos os presentes.

Documento original assinado eletronicamente, conforme MP 2200-2/2001, art. 10, § 2º, por:

GILBERTO DE SOUZA TULLI
DIRETOR SETORIAL
DIN - IPAJM - GOVES
assinado em 07/08/2024 17:33:34 -03:00

ELISA DO CARMO MEDEIROS FONSECA
GERENTE
GIN - IPAJM - GOVES
assinado em 07/08/2024 17:44:16 -03:00

ALBERT IGLÉSIA CORREA DOS SANTOS JÚNIOR
MEMBRO DE COMITE DE INVESTIMENTOS
STC - IPAJM - GOVES
assinado em 07/08/2024 17:41:58 -03:00

LUCAS JOSÉ DAS NEVES RODRIGUES
MEMBRO DE COMITE DE INVESTIMENTOS
SFX - IPAJM - GOVES
assinado em 07/08/2024 17:34:35 -03:00

ROSEANE DALVI PEDRUZZI DE JESUS
MEMBRO DE COMITE DE INVESTIMENTOS
SAR - IPAJM - GOVES
assinado em 07/08/2024 17:44:26 -03:00

SHIRLENE PIRES MESQUITA
MEMBRO DE COMITE DE INVESTIMENTOS
STC - IPAJM - GOVES
assinado em 08/08/2024 08:36:24 -03:00

TATIANA GASPARINI SILVA STELZER
MEMBRO DE COMITE DE INVESTIMENTOS
SAR - IPAJM - GOVES
assinado em 07/08/2024 17:42:39 -03:00



INFORMAÇÕES DO DOCUMENTO

Documento capturado em 08/08/2024 08:36:24 (HORÁRIO DE BRASÍLIA - UTC-3)
por GILBERTO DE SOUZA TULLI (DIRETOR SETORIAL - DIN - IPAJM - GOVES)
Valor Legal: ORIGINAL | Natureza: DOCUMENTO NATO-DIGITAL

A disponibilidade do documento pode ser conferida pelo link: <https://e-docs.es.gov.br/d/2024-0R306L>