

Comitê de Investimentos

Ata nº 25/2016 – Aos quinze dias do mês de junho do ano de dois mil e dezesseis A.D., às dez horas, na sede do Bertprev, localizado à Rua Rafael Costábile, 596, centro - Bertioga-SP, reuniram-se os Srs. **José Daniel Rodrigues – Presidente, Sr. José Ferreira Melo Filho – Secretário, Wilson Paschoal dos Santos, Marco Aurélio de Thommazo e Roberto Cassiano Guedes** membros do Comitê de Investimentos da autarquia. Iniciando os trabalhos, passamos à análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatando os seguintes parâmetros, com base no Relatório Focus de 10/06/2016, mercedores de destaque:

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2016	Elevação	12,88 %	13,00 %
PIB	Mediana agregada	2016	Elevação	-3,71 %	-3,60 %
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2016	Redução	R\$ 3,68	R\$ 3,65
Taxa Selic (Méd. Prazo – f. p.)	Mediana Top 5	2016	Elevação	13,63 %	13,75 %
IPCA (Curto Prazo)	Mediana Top 5	2016	Elevação	7,11 %	7,34 %
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 9702 d.u.)	Anbima – 14/06/2016	2016	Elevação	6,1583 %	6,2073 %
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u.)	Anbima – 14/06/2016	2016	Elevação	5,9981 %	6,0329 %
Ibovespa	BM&F – 14/06/2016	2016	Redução	51.629 p	48.648 p
Risco Brasil (JP Morgan)	14/06/2016	2016	Elevação	371	401
Posição dos Investimentos	Abr/16-Mai/16	2016	em Mil	R\$ 278.841	R\$ 278.962

Os indicadores econômicos apresentaram variações pouco significativas durante a semana, permanecendo as tendências apontadas anteriormente. Seguem as estratégias anteriormente formuladas para os segmentos de renda fixa e renda variável. Acusado o recebimento do relatório de investimentos com a posição semanal de 14/06/2016 com valor de R\$ 284.804.459,28 e a posição da competência maio/2016 com o valor de R\$ 278.962.437,13, emitidos pela CAF; reiteramos a recomendação do acréscimo do CNPJ de cada fundo no relatório de investimentos. Foi solicitada pela CAF a emissão de APR: 068/2016 de aplicação no valor de R\$ 1.713.000,00, referente recursos do repasse previdenciário da PMB em 10/junho, APR: 069/2016 de aplicação no valor de R\$ 95.000,00, referente repasse previdenciário da PMB em 13/junho, APR 070/2016 de aplicação no valor de R\$ 116.000,00 referente recursos do repasse previdenciário da PMB em 14/junho, todos com movimentação no fundo SANTANDER FIC FI CORPORATE REF DI. Nada mais, foi encerrada a



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

reunião às 16:00 horas, e lavrada em ata pelo secretário e assinada pelos presentes a esta reunião.

Roberto Cassiano Guedes

José Daniel Rodrigues

Marco Aurélio de Thommazo

Wilson Paschoal dos Santos

José Ferreira Melo Filho

ANBIMA					Política de Investimento	Evolução PL	47.665.667,74	20,10%
	TOTAL PATRIMÔNIO	284.804.459,28	99,99%		Limites	Margem	Enquadramento	
	Titulos Públicos	120.306.797,68	42,24%	100,00%	60,00%	17,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea A	
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	120.306.797,68	42,24%					
	Fundos que contenham somente títulos públicos	74170205,01	26,04%	100,00%	60,00%	33,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B	
152900	BTG PACTUAL IPCA FI RENDA FIXA	56.742,26	0,020%					
	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	15.063.620,00	5,289%					
xxx	CAIXA BRASIL 2030 II TP	11.962.051,60	4,200%					
251496	CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	105.713,98	0,037%					
233651	ITAU INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 RF FIC	602.973,40	0,212%					
286028	SANTANDER IMA-B 5 TIT PUBLIC FIC RF	172.032,57	0,043%					
	BB PREV RF TP VII FI	46.257.071,20	16,242%					
	Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKa	-	0,00%	80,00%	40,00%	40,00%	Artigo 7º, Inciso III	
		-	0,000%					
	Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa CDI	27.749.169,78	9,74%	30,00%	30,00%	20,26%	Artigo 7º, Inciso IV	
067601	SANTANDER FICFI CORPORATE REF DI	2.071.405,14	0,727%					
067601	SANTANDER FICFI CORPORATE REF DI	433.838,90	0,152%					
xxx	BB PREVIDENCIÁRIO RF TITULOS PUBLICOS IPCA FI	12.722.090,03	4,467%					
xxx	BB PREV TP IPCA III	8.774.982,71	3,081%					
xxx	FIC CAIXA BRASIL 2018 I TP RF	3.746.853,00	1,316%					
	FI Renda Fixa Crédito Privado	2.515.983,37	0,88%	5,00%	5,00%	4,12%	Artigo 7º, Inciso VII Alínea B	
	BB PREV RF CRÉD PRIV IPCA III	2.515.983,37	0,883%					
	Fundos de Renda Variável	18.116.425,25	6,36%	30,00%	10,00%	3,64%	Artigo 8º, Inciso I	
157661	GF PROGRAMADO IBOV ATIVO FIA	2.838.423,89	0,997%					
208507	ITAU RPI ACOES IBOVESPA FICFI	15.278.001,36	5,364%					
	Fundos de Renda Variável	35.397.315,37	12,43%	15,00%	15,00%	2,57%	Artigo 8º, Inciso III	
240737	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.312.817,97	0,461%					
145327	QUEST AÇÕES FIC FIA	1.340.695,69	0,471%					
258733	GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FIA	1.698.044,33	0,596%					
250392	GF DIVIDENDOS FI AÇÕES	813.765,93	0,286%					
252311	BTG ABSOLUTO INSTITUCIONAL	21.061.831,45	7,395%					
206032	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIA	9.170.160,00	3,220%					
	FI em Participações	6.982.401,72	2,45%	5,00%	5,00%	2,55%	Artigo 8º, Inciso V	
xxx	FIC DE FIP KINEA II	6.982.401,72	2,452%					

Alexandre Hope Herrera
Coord. Adm. Financeira
Reg.: 019 Bertprey



Relatório de Investimentos

maio 2016

			Evolução PL		41.823.645,59	17,64%
			Evolução em %		17,64%	
			Limites	Margem	Enquadramento	
					Artigo 7º, inciso I, Alínea A	
					Artigo 7º, inciso I, Alínea B	
TOTAL PATRIMÔNIO			278.962.437,13	100,0%		
Títulos Públicos			110.446.156,78	39,59%	100,00%	
CP0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	110.446.156,78	39,59%			
Fundos que contenham somente títulos públicos			77.062.879,34	27,63%	100,00%	
152900	BTG PACTUAL IPCA FI RENDA FIXA	1.154.201,49	0,414%			
	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	14.885.117,00	5,336%			
xxx	CAIXA BRASIL 2030 II TP	11.742.190,00	4,209%			
251496	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	1.290.950,54	0,463%			
233651	ITAU INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 RF FIC	596.188,56	0,214%			
286028	SANTANDER IMA B 5 TIT PUBLIC FIC RF	1.618.121,77	0,580%			
	BB PREV RF TP VII FI	45.776.109,98	16,409%			
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA			-	0,00%	80,00%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa CDI			29.273.496,21	10,49%	30,00%	
067601	SANTANDER FICFI CORPORATE REF DI	3.832.422,86	1,374%			
067601	SANTANDER FICFI CORPORATE REF DI	465.162,58	0,167%			
xxx	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PUBLICOS IPCA FI	12.526.791,35	4,490%			
xxx	BB PREV TP IPCA III	8.723.137,42	3,127%			
xxx	FIC CAIXA BRASIL 2018 I TP RF	3.725.982,00	1,336%			
FI Renda Fixa Crédito Privado			2.479.058,77	0,89%	5,00%	
	BB PREV RF CRÉD PRIV IPCA III	2.479.058,77	0,889%			
Fundos de Renda Variável			17.881.167,46	6,41%	30,00%	
157661	GF PROGRAMADO IBOV ATIVO FIA	2.824.878,96	1,013%			
208507	ITAU RPI ACOES IBOVESPA FICFI	15.056.288,50	5,397%			
Fundos de Renda Variável			34.782.150,17	12,47%	15,00%	
240737	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.292.737,33	0,463%			
145327	QUEST AÇÕES FIC FIA	1.333.393,17	0,478%			
258733	GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FIA	1.684.320,49	0,604%			
250392	GF DIVIDENDOS FI AÇÕES	811.713,44	0,291%			
252311	BTG ABSOLUTO INSTITUCIONAL	20.604.069,77	7,386%			
206032	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIA	9.055.915,97	3,246%			
FI Multimercado - aberto			-	0,000%	5,00%	
FI em Participações			7.502.690,98	2,69%	5,00%	
xxx	FIC DE FIP KINEA II	7.502.690,98	2,689%			
FI Imobiliário - cotas negociadas em bolsa			-	0,00%	3,00%	

Alexandre Hope Herrera
Coord. Adm. - Encargado
Req.: 019 - Bertprev