

Comitê de Investimentos

Ata nº 19/2019—Aos nove de maio do ano de dois mil e dezenove, às dez horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto os Srs. **Wilson Paschoal dos Santos – Presidente do Comitê, Marco Aurélio de Thommazo, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Jean Mamede de Oliveira e Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – presidente do BERTPREV.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 03/05/2019, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	20/03/19 a 08/05/19	2019	Estável	6,50%	6,50%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2019	Estável	6,50	6,50
PIB	Mediana agregada	2019	Redução	1,70%	1,49%
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2019	Estável	R\$ 3,75	R\$ 3,75
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2019	Estável	6,50%	6,50%
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2019	Elevação	3,99%	4,06%
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8946 d.u. - 2056)	Anbima – 08/05/2019	2019	Redução	4,5763	4,5223
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2049)	Anbima – 08/05/2019	2019	Redução	4,5541	4,5048
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2039)	Anbima – 08/05/2019	2019	Redução	4,4855	4,4482
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2029)	Anbima – 08/05/2019	2019	Redução	4,3139	4,2786
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2024)	Anbima – 08/05/2019	2019	Redução	4,032	3,9397
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2021)	Anbima – 08/05/2019	2019	Redução	3,2215	3,1186
Ibovespa	08/05/2019	2019	Redução	96.353	95.596
Risco Brasil (JP Morgan)	08/05/2019	2019	Estável	250	250
Posição dos Investimentos	Mar/19–Abr/19	2019	em Mil	477.338	485.277

Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.

O cenário econômico continua estável quanto à política de manutenção de juros baixos e conforme reunião do COPOM finalizada em 08/05/2019 foi mantida a taxa de juros em 6,50%; A ETTJ apresentou redução em todos os vértices; o risco Brasil apresenta estabilidade; O IBOVESPA apresentou redução para 95.596 pontos; o relatório semanal dos investimentos indica o patrimônio de R\$ 485.091M em 06/05/2019 e o relatório de fechamento mensal de Abril/2019 ficou no montante de R\$ 485.277M.



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

Foram emitidas as seguintes APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
051/2019	08/05/2019	30.000,00	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 3)

2

Nada mais, foi encerrada a reunião às 16:30 horas, e lavrada em ata e assinada pelos presentes a esta reunião.

Wilson Paschoal dos Santos

Clayton Faria Schmidt

Jean Mamede de Oliveira

José Daniel Rodrigues

Marco Aurélio de Thommazo

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



Relatório de Investimentos

Março / 19 - Abril / 19

CNPJ	Fundo	Competência Março/19	Competência Abril/19	Variação Mensal	% PL	Limite % PL 3922/10 PL 4604/17	Saldo Dez/18 Evolução PL	R\$ 452.636.394,03 R\$ 32.640.851,36	17,42% 7,21%
Evolução PL Acumulada Saldo Anterior									
Limite Inferior (%)									
Estratégia Alvo									
Limite Superior (%)									
Margem									
Enquadramento									
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	477.338.817,36	485.277.245,39	1,66%	100,0%				
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,00%				
CP 0184	Títulos Públicos Federais	151.791.874,20	154.159.800,46	1,56%	31,77%	100,00%	20,00%	60,00%	28,23%
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	151.791.874,20	154.159.800,46	1,56%	31,77%				
	Fundos 100% Títulos Públicos	78.390.085,55	79.283.731,62	1,14%	16,34%		10,00%	18,00%	1,66%
	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	15.671.702,16	15.835.432,20	1,04%	3,26%				
	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	5.540.290,04	5.588.481,42	0,87%	1,15%				
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	15.399.751,79	15.571.916,66	1,12%	3,20%				
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	8.850.440,76	8.949.802,34	1,12%	1,84%				
	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	15.011.170,80	15.209.118,00	1,32%	3,14%				
	FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	17.916.730,00	18.128.981,00	1,18%	3,73%				
	Fundos Referenciados Renda Fixa	122.010.244,74	124.127.156,12	1,74%	25,58%		5,00%	15,00%	-10,58%
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	9.445.302,02	10.817.305,29	14,53%	2,22%				
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	78.458.910,69	78.978.257,18	0,66%	16,27%	40,00%			
25.306.703/0001-73	ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA (III) RF FIC DE FI	34.106.032,03	34.331.593,65	0,66%	7,07%				
14.091.645/0001-91	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.528.141,80	3.568.452,49	1,14%	0,74%	5,00%	0,00%	1,00%	0,26%
	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.528.141,80	3.568.452,49	1,14%	0,73%				
08.817.414/0001-10	FI ref Índice de RV divulgado pela B3 - Comp por no mín 50 ações	34.717.848,11	35.052.920,06	0,97%	7,22%	30,00%	0,00%	8,00%	0,78%
	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	34.717.848,11	35.052.920,06	0,97%	7,22%				
11.392.165/0001-72	Fundos de Investimentos em Ações	77.262.267,36	79.512.046,83	2,91%	16,38%		0,00%	18,00%	1,62%
	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	14.307.644,61	14.671.970,91	2,55%	3,02%				
	QUEST AÇÕES FIC FIA	10.164.026,24	10.342.366,41	1,75%	2,13%				
	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	36.064.974,54	37.511.002,07	4,01%	7,73%				
	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.202.257,10	6.431.332,69	3,69%	1,32%	20,00%			
	WESTERN ASSET VALUATION FIA	7.462.909,69	7.429.453,71	-0,45%	1,53%				
	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.060.455,18	3.125.921,04	2,14%	0,64%				
16.437.148/0001-28	Fundo de Investimento em Participações	9.638.355,60	9.573.137,81	-0,68%	1,97%		0,00%	4,00%	2,03%
	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	8.206.797,75	8.217.187,55	0,13%	1,69%				
	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRAT	1.431.557,85	1.355.950,26	-5,28%	0,27%	5,00%			

(*)

Alexandre Hope Henri
Coord. Admin. Financeira
Reg.: 019 Bertrow

W.F.



Relatório Semanal de Investimentos

08/05/2019

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 29/04/2019	Posição 06/05/2019	Variação Semanal	% PL	Limite % PL 392Z/10	Saldo Dez/18 Evolução PL	R\$ 452.636.394,03 R\$ 32.455.601,94	17,43% 7,17%		
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO (*) CONTA TRANSITÓRIA	483.980.227,19	485.091.995,97	0,23%	100,0%	PL 4604/17	Limite Inferior (%)	Estratégia Ativo	Margem	Enquadramento	
CP 0184	Títulos Públicos Federais	153.669.025,64	154.815.683,92	0,75%	31,91%	100,00%	10,00%	44,00%	100,00%	12,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
	CARTEIRA PRÓPRIA (INTNS)	153.669.025,64	154.815.683,92	0,75%	31,91%	100,00%	10,00%	44,00%	100,00%	12,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
	Fundos 100% Títulos Públicos	79.173.905,69	79.551.180,92	0,48%	16,40%	100,00%	10,00%	18,00%	100,00%	1,60%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	18.104.775,00	18.193.643,00	0,49%	3,751%	100,00%	10,00%	18,00%	100,00%	1,60%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
	CAIXA BRASIL 2030 II TP	15.170.146,80	15.269.368,80	0,65%	3,148%	100,00%	10,00%	18,00%	100,00%	1,60%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
	BB PREV RF TP VII FI	15.823.007,59	15.874.076,29	0,32%	3,272%	100,00%	10,00%	18,00%	100,00%	1,60%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	5.581.047,32	5.601.765,66	0,37%	1,155%	100,00%	10,00%	18,00%	100,00%	1,60%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	15.553.842,22	15.635.130,42	0,52%	3,223%	100,00%	10,00%	18,00%	100,00%	1,60%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
	BB PREV TP IPCA III	8.941.086,76	8.977.196,75	0,40%	1,851%	100,00%	10,00%	18,00%	100,00%	1,60%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
	Fundos Referenciados Renda Fixa	123.961.036,94	124.335.316,47	0,30%	25,63%	100,00%	10,00%	13,00%	40,00%	-12,63%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	10.744.681,48	10.825.181,00	0,75%	2,232%	40,00%	0,00%	1,00%	5,00%	0,26%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	78.913.095,94	79.117.864,84	0,26%	16,310%	40,00%	0,00%	5,00%	30,00%	-2,16%	Artigo 8, Inciso I, Alínea A
25.306.703/0001-73	ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA (II) RF FIC DE FI	34.303.259,52	34.392.270,63	0,26%	7,090%	30,00%	0,00%	5,00%	20,00%	-1,19%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
14.091.645/0001-91	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.565.590,62	3.577.958,72	0,35%	0,74%	5,00%	0,00%	1,00%	5,00%	0,26%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI		3.565.590,62	3.577.958,72	0,35%	0,738%	5,00%	0,00%	1,00%	5,00%	0,26%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
06.817.414/0001-10	FI ref índice de RV divulgado pela B3 - Comp por no mín 50 ações	34.969.601,98	34.713.274,35	-0,73%	7,16%	30,00%	0,00%	5,00%	30,00%	-2,16%	Artigo 8, Inciso I, Alínea A
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI		34.969.601,98	34.713.274,35	-0,73%	7,156%	30,00%	0,00%	5,00%	30,00%	-2,16%	Artigo 8, Inciso I, Alínea A
11.392.165/0001-72	Fundos de Investimentos em Ações	79.002.710,72	78.525.443,78	-0,60%	16,19%	20,00%	0,00%	15,00%	20,00%	-1,19%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	14.587.872,44	14.605.803,16	0,12%	3,011%	20,00%	0,00%	15,00%	20,00%	-1,19%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
11.977.794/0001-64	QUEST AÇÕES FIC FIA	10.275.257,71	10.224.404,66	-0,49%	2,108%	20,00%	0,00%	15,00%	20,00%	-1,19%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	37.208.135,91	36.897.305,83	-0,84%	7,606%	20,00%	0,00%	15,00%	20,00%	-1,19%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
09.087.523/0001-91	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.402.448,95	6.327.874,71	-1,16%	1,304%	20,00%	0,00%	15,00%	20,00%	-1,19%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
15.154.441/0001-15	WESTERN ASSET VALUATION FIA	7.406.526,97	7.367.340,17	-0,53%	1,519%	20,00%	0,00%	15,00%	20,00%	-0,53%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.122.468,74	3.102.715,25	-0,63%	0,640%	20,00%	0,00%	15,00%	20,00%	-0,63%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
16.437.148/0001-28	Fundo de Investimento em Participações	9.638.355,60	9.573.137,81	-0,68%	1,97%	5,00%	0,00%	4,00%	5,00%	2,03%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
27.782.774/0001-78	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	8.206.797,75	8.217.187,55	0,13%	1,694%	5,00%	0,00%	4,00%	5,00%	2,03%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	1.431.557,85	1.355.950,26	-5,28%	0,280%	5,00%	0,00%	4,00%	5,00%	2,03%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A

Alexandre Hope Henri
Coord. Adm. - Finanças
Coord. - OAG Bertprev



Relatório de Investimentos

Abril 2019

CNPJ	Fundo	Patrimônio	% PL	Limite % PL 3922/10	Saldo Dez/18 Evolução PL	R\$ 452.636.394,03 R\$ 32.640.851,36	Limite Superior (%)	Margem	Enquadramento
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	485.277.245,39	100,0%	PL 4604/17	Limite Inferior (%)	Evolução PL Acumulada Saldo Anterior			
CP 0184	(*) CONTA TRANSITÓRIA		0,000%						
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	154.159.800,46	31,77%	100,00%	10,00%	44,00%	100,00%	12,23%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	154.159.800,46	31,77%						
	Fundos de Investimentos 100% Títulos Públicos	79.283.731,62	16,34%		10,00%	18,00%	100,00%	1,66%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
19.523.305/0001-06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	15.835.432,20	3,263%						
25.078.994/0001-90	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	5.588.481,42	1,152%						
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	15.571.916,66	3,209%						
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	8.949.802,34	1,844%						
19.769.046/0001-06	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	15.209.118,00	3,134%						
22.791.074/0001-26	FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	18.128.981,00	3,736%						
	Fundos Renda Fixa em geral	124.127.156,12	25,58%		0,00%	13,00%	40,00%	-12,58%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	10.817.305,29	2,229%						
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	78.978.257,18	16,275%	40,00%					
25.306.703/0001-73	ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA (III) RF FIC DE FI	34.331.593,65	7,075%						
	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	3.568.452,49	0,74%		0,00%	1,00%	5,00%	0,26%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.568.452,49	0,735%	5,00%					
	FI de ações - com no mínimo 50 ações	35.052.920,06	7,22%		0,00%	5,00%	30,00%	-2,22%	Artigo 8, Inciso I, Alínea A
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	35.052.920,06	7,223%	30,00%					
	Fundos de Investimentos de Ações em geral	79.512.046,83	16,38%		0,00%	15,00%	20,00%	-1,38%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	14.671.970,91	3,023%						
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	10.342.366,41	2,131%						
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	37.511.002,07	7,730%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.431.332,69	1,325%						
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	7.429.453,71	1,531%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.125.921,04	0,644%						
	FI em Participações - Fechado - (Investimentos Estruturado)	9.573.137,81	1,97%		0,00%	4,00%	5,00%	2,03%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	8.217.187,55	1,693%						
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	1.355.950,26	0,279%	5,00%					

Alexandre Flope Martins
Coord. Área Financeira
Reg.: 019 Bertprev

12/1

José Ferreira

De: José Ferreira <joseferreira@bertprev.sp.gov.br>
Enviado em: quarta-feira, 8 de maio de 2019 14:32
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Assunto: Emissão de APR

Prioridade: Alta

Sinalizador de acompanhamento:

Status do sinalizador: Acompanhar
Sinalizada

Jean, bom dia.

Solicito a emissão de APR conforme abaixo:

RESGATE:

Santander FIC FI Institucional REF DI

Valor R\$ 30.000,00

Conta ag. 0712 c/c 57-000001-9

Data 08/05/2019

Histórico: Para pagamento da folha de adiantamento – maio/19, despesas e taxas associativas, ABIPEM, APEPREM, Correios, Luz e Água.

Att.

José Ferreira Melo Filho CPA-10

Setor Administrativo



Instituto de Previdência Social dos Serv. Públicos do Mun. de Bertioga

"Nossa missão é garantir parte do seu futuro"

CNPJ: 02.581.343/0001-12 | Tel. 13 3319-9292

Rua Rafael Costáble, 596 | Centro | Bertioga - SP | CEP: 11250-000

www.bertprev.sp.gov.br | e-mail: joseferreira@bertprev.sp.gov.br