

Comitê de Investimentos

Este volume.
7 de Agosto de 2019

1

Ata nº 32/2019—aos sete dias do mês de agosto do ano de dois mil e dezenove, às dez horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto os **Srs. Clayton Faria Schmidt – Presidente do Comitê, Wilson Paschoal dos Santos, Jean Mamede de Oliveira e José Daniel Rodrigues, como ouvinte a Sra. Maristela Regina Teodoro Costa.** 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 02/08/2019, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	19/06/19 a 31/07/19	2019	Redução	6,50%	6,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2019	Redução	5,50	5,25
PIB	Mediana agregada	2019	Estável	0,82%	0,82
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	Redução	5,50%	5,13%
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2019	Estável	3,83%	3,83%
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8820 d.u. - 2056)	Anbima – 06/08/2019	2019	Elevação	3,8306	3,8340
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2049)	Anbima – 06/08/2019	2019	Elevação	3,8028	3,8040
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2039)	Anbima – 06/08/2019	2019	Redução	3,706	3,6989
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2029)	Anbima – 06/08/2019	2019	Redução	3,431	3,3937
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2024)	Anbima – 06/08/2019	2019	Redução	2,9565	2,9057
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2021)	Anbima – 06/08/2019	2019	Redução	2,0644	2,0640
Ibovespa	06/08/2019	2019	Elevação	101.812	102.163
Risco Brasil (JP Morgan)	06/08/2019	2019	Elevação	214	233
Posição dos Investimentos	Mai/19–Jun/19	2019	em Mil	499.532	517.322

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou elevação nos vértices longos e redução nos vértices curtos; o risco Brasil apresentou elevação; O IBOVESPA apresentou elevação para 102.163 pontos; o relatório semanal dos investimentos indica o patrimônio de R\$ 530.076M em 05/08/2019. Foi dada ciência no processo administrativo 62/09. Deliberou-se pela manutenção dos investimentos nas posições atuais.



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

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

Jean Mamede de Oliveira

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Maristela Regina Teodoro Costa



Relatório Semanal de Investimentos

05 de agosto de 2019

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 30/07/2019	Posição 05/08/2019	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Pro-Gestão	Saldo Dez/18 Evolução PL	Res. 4604/17 Res. 4695/18	Limite Inferior (%)	Estratégia Ativo	Limite Superior (%)	Margem	Enquadramento
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	532.884.465,62	530.076.061,06	-0,53%	100,0%									
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%									
CP 0184	Títulos Públicos Federais	166.859.321,01	165.701.794,41	-0,69%	31,26%									
	CARTERA PRÓPRIA (NTNs)	166.859.321,01	165.701.794,41	-0,69%	31,26%									
	Fundos 100% Títulos Públicos	83.452.548,36	83.241.647,06	-0,25%	15,70%									
	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.329.921,00	19.286.293,00	-0,23%	3,638%									
	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.595.052,00	16.531.406,40	-0,38%	3,119%									
	BB PREV RF TP VII FI	16.290.078,41	16.273.284,97	-0,10%	3,070%									
	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	5.890.655,07	5.874.047,48	-0,28%	1,108%									
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.035.055,04	15.981.070,07	-0,34%	3,015%									
	BB PREV TP IPCA III	9.311.786,84	9.295.545,14	-0,17%	1,754%									
	Fundos Referenciados Renda Fixa	135.931.579,18	136.156.711,41	0,17%	25,69%									
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	39.278.224,25	39.589.701,33	0,79%	7,469%									
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	96.653.354,93	96.567.010,08	-0,09%	18,218%									
14.091.645/0001-91	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.693.964,16	3.686.068,97	-0,21%	0,70%									
	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.693.964,16	3.686.068,97	-0,21%	0,695%									
	FI ref Índice de RV divulgado pela B3 - Comp por no mín 50 ações	38.166.458,86	37.407.640,07	-1,99%	7,06%									
	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	38.166.458,86	37.407.640,07	-1,99%	7,057%									
	Fundos de Investimento em Ações	89.782.916,55	88.884.521,64	-1,00%	16,77%									
	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	17.135.820,88	17.124.879,45	-0,06%	3,231%									
	QUEST AÇÕES FIC FIA	11.229.358,87	11.139.867,49	-0,80%	2,102%									
	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	42.820.033,99	42.311.307,87	-1,19%	7,982%									
	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.216.972,82	7.107.481,18	-1,52%	1,341%									
	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.029.695,80	7.900.813,97	-1,61%	1,491%									
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.351.034,19	3.300.171,68	-1,52%	0,623%									
16.437.148/0001-28	Fundo de Investimento em Participações	14.997.677,50	14.997.677,50	0,00%	2,83%									
	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	8.206.965,34	8.206.965,34	0,00%	1,548%									
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	6.790.712,16	6.790.712,16	0,00%	1,281%									

Coord. Ass. Adm. e Financeira
Margarida Hope Henriques
01/8/2019