

Comitê de Investimentos

Ata nº 37/2019—aos quatro dias do mês de setembro 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, José Daniel Rodrigues, Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – presidente do BERTPREV, Alexandre Hope Herrera e 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 30/08/2019, 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	Estável	5,00	5,00
PIB	Mediana agregada	2019	Elevação	0,80	0,87
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2019	Elevação	R\$ 3,80	R\$ 3,85
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2019	Estável	5,00%	5,00%
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2019	Estável	3,51%	3,51%
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8820 d.u. - 2056)	Anbima – 03/09/2019	2019	Elevação	3,9325	3,9893
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2049)	Anbima – 03/09/2019	2019	Elevação	3,88954	3,9543
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2039)	Anbima – 03/09/2019	2019	Elevação	3,7676	3,8333
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2029)	Anbima – 03/09/2019	2019	Elevação	3,4471	3,5198
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2024)	Anbima – 03/09/2019	2019	Elevação	3,0380	3,0946
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2021)	Anbima – 03/09/2019	2019	Redução	2,2698	2,2650
Ibovespa	03/09/2019	2019	Elevação	97.276	99.680
Risco Brasil (JP Morgan)	03/09/2019	2019	Redução	250	249
Posição dos Investimentos	Jun/19–Jul/19	2019	em Mil	517.322	531.750

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 em todos os vértices exceto o mais curto; o risco Brasil apresentou redução; O IBOVESPA apresentou elevação para 99.680 pontos; o relatório semanal dos investimentos indica o patrimônio de R\$ 534.131M em 02/09/2019. Deliberou-se pela manutenção dos investimentos nas posições atuais.



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

198

Foram emitidas as seguintes APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
094/2019	30/08/2019	30.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 1)
095/2019	30/08/2019	230.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 3)

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

2

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera

*



Relatório Semanal de Investimentos

04 de setembro de 2019

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 26/08/2019	Posição 02/09/2019	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3822/10 Res. 4604/17 Res. 4695/18	Limite % Pro-Gestão Nível II	Limite inferior (%)	Estratégia Ativo	Limite Superior (%)	Margem	Enquadramento
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	531.369.844,04	534.131.394,02	0,52%	100,0%	100,00%						
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%							
	Títulos Públicos Federais	166.546.475,24	164.922.944,46	-0,97%	30,88%	100,00%	100,00%	10,00%	31,00%	100,00%	0,12%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	166.546.475,24	164.922.944,46	-0,97%	30,88%							
	Fundos 100% Títulos Públicos	82.725.591,68	82.470.447,31	-0,31%	15,44%			10,00%	16,00%	100,00%	0,56%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	18.848.505,00	18.807.776,00	-0,22%	3,521%							
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.348.666,80	16.194.502,40	-0,94%	3,032%							
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TP VII FI	16.304.612,61	16.303.299,33	-0,01%	3,052%							
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	5.896.995,56	5.882.769,24	-0,24%	1,101%							
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.013.531,36	15.976.645,37	-0,23%	2,951%							
19.303.795/0001-35	BB PREV TP IPCA III	9.313.280,35	9.305.454,97	-0,08%	1,742%							
	Fundos Referenciados Renda Fixa	141.064.533,56	139.658.714,62	-1,00%	26,15%			0,00%	22,00%	50,00%	-4,15%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	44.122.098,22	42.751.300,69	-3,11%	8,004%		50,00%					
21.838.150/0001-49	ITALI INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	96.942.435,34	96.907.413,93	-0,04%	18,143%							
	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.694.371,34	3.691.864,20	-0,07%	0,69%			0,00%	1,00%	15,00%	0,31%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.694.371,34	3.691.864,20	-0,07%	0,691%		15,00%					
	FI ref Índice de RV divulgado pela B3 - Comp por no mín 50 ações	36.123.158,72	37.883.773,25	4,87%	7,09%			0,00%	7,00%	40,00%	-0,09%	Artigo 8, Inciso I, Alínea A
08.817.414/0001-10	ITALI FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	36.123.158,72	37.883.773,25	4,87%	7,093%		40,00%					
	Fundos de Investimentos em Ações	86.268.836,51	90.613.484,40	5,04%	16,96%			0,00%	20,00%	30,00%	3,04%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	16.473.263,39	17.528.446,12	6,41%	3,282%							
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	10.698.208,01	11.245.204,93	5,11%	2,105%							
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	41.284.197,39	43.199.384,91	4,64%	8,088%							
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.904.406,65	7.137.750,38	3,38%	1,336%		30,00%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	7.652.271,63	8.079.158,32	5,58%	1,513%							
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.256.489,44	3.423.539,74	5,13%	0,641%							
	Fundo de Investimento em Participações	14.946.876,99	14.890.165,78	-0,38%	2,79%			0,00%	3,00%	5,00%	0,21%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	8.200.982,83	8.194.975,93	-0,07%	1,534%		5,00%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	6.745.894,16	6.695.189,85	-0,75%	1,253%							

Alexandre Hope Herrera
Coord. Ativo - Financeira
Reg.: 2018 BERTPREV