

Comitê de Investimentos

1

Ata nº 38/2019—aos onze 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 e José Daniel Rodrigues.** Registra-se a ausência da Sra. Maristela Regina Teodoro Costa, pela participação no Congresso Jurídico-Financeiro da APEPREM. 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 06/09/2019, mercedores 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	Estável	0,87	0,87
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2019	Elevação	R\$ 3,85	R\$ 3,87
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	Redução	3,51%	3,46%
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8820 d.u. - 2056)	Anbima – 10/09/2019	2019	Redução	3,9893	3,9406
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2049)	Anbima – 10/09/2019	2019	Redução	3,9543	3,9093
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2039)	Anbima – 10/09/2019	2019	Redução	3,8333	3,80
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2029)	Anbima – 10/09/2019	2019	Redução	3,5198	3,4923
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2024)	Anbima – 10/09/2019	2019	Redução	3,0946	3,0059
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2021)	Anbima – 10/09/2019	2019	Redução	2,2650	2,0382
Ibovespa	10/09/2019	2019	Elevação	99.680	103.031
Risco Brasil (JP Morgan)	09/09/2019	2019	Redução	249	234
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 redução em todos os vértices; o risco Brasil apresentou redução; O IBOVESPA apresentou elevação para 103.031 pontos; o relatório semanal dos investimentos indica o patrimônio de R\$ 536.649M em 06/09/2019. Deliberou-se pela manutenção dos investimentos nas posições atuais.



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

Foram emitidas as seguintes APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
096/2019	10/09/2019	2.800.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 3)
097/2019	12/09/2019	24.000,00	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 1)
098/2019	06/09/2019	110.000,00	Aplicação	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

Jean Mamede de Oliveira

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

*



Relatório Semanal de Investimentos

10 de setembro de 2019

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 02/09/2019	Posição 06/09/2019	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Pro-Gestão	Saldo Dez/18	Evolução PL	Limite Superior (%)	Estratégia Ativo	Margem	Enquadramento
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	534.131.394,02	536.649.338,89	0,47%	100,0%	100,00%	Nível II						
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%								
CP 0184	Títulos Públicos Federais	164.922.944,46	166.407.034,71	0,90%	31,01%	100,00%	100,00%			10,00%	31,00%	-0,01%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
	CARTERA PRÓPRIA (NTNs)	164.922.944,46	166.407.034,71	0,90%	31,01%								
	Fundos 100% Títulos Públicos	82.470.447,31	82.890.001,11	0,51%	15,45%					10,00%	16,00%	0,55%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	18.807.776,00	18.922.514,00	0,61%	3,526%								
	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.194.502,40	16.305.546,40	0,69%	3,038%								
	BB PREV RF TP VII FI	16.303.299,33	16.345.620,42	0,26%	3,046%								
	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	5.882.769,24	5.907.571,10	0,42%	1,101%								
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	15.976.645,37	16.067.627,58	0,57%	2,994%								
	BB PREV TP IPCA III	9.305.454,97	9.341.121,61	0,38%	1,741%								
	Fundos Referenciados Renda Fixa	139.658.714,62	140.020.114,20	0,26%	26,09%					0,00%	22,00%	-4,09%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	42.751.300,69	42.901.703,03	0,35%	7,994%	40,00%	50,00%						
21.838.150/0001-49	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	96.907.413,93	97.118.411,17	0,22%	18,097%								
14.091.645/0001-91	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.691.864,20	3.706.701,83	0,40%	0,69%					0,00%	1,00%	0,31%	Artigo 7, inciso VII, Alínea B
	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.691.864,20	3.706.701,83	0,40%	0,691%	5,00%	15,00%						
08.817.414/0001-10	FI ref Índice de RV divulgado pela B3 - Comp por no mín 50 ações	37.883.773,25	38.254.900,27	0,98%	7,13%					0,00%	7,00%	-0,13%	Artigo 8, inciso I, Alínea A
	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	37.883.773,25	38.254.900,27	0,98%	7,128%	30,00%	40,00%						
11.392.165/0001-72	Fundos de Investimentos em Ações	90.613.484,40	90.480.420,99	-0,15%	16,86%					0,00%	20,00%	3,14%	Artigo 8, inciso II, Alínea A
	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	17.528.446,12	17.140.892,83	-2,21%	3,194%								
	QUEST AÇÕES FIC FIA	11.245.204,93	11.273.565,58	0,25%	2,101%								
	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	43.199.384,91	43.332.277,57	0,31%	8,075%								
	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.137.750,38	7.212.462,45	1,05%	1,344%	20,00%	30,00%						
	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.079.158,32	8.106.498,87	0,34%	1,511%								
	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.423.539,74	3.414.723,69	-0,26%	0,636%								
16.437.148/0001-28	Fundo de Investimento em Participações	14.890.165,78	14.890.165,78	0,00%	2,77%					0,00%	3,00%	0,23%	Artigo 8, inciso IV, Alínea A
	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	8.194.975,93	8.194.975,93	0,00%	1,527%	5,00%	5,00%						
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	6.695.189,85	6.695.189,85	0,00%	1,248%								

Alexandre Hope Herrera
Coord. Ativos Financeiros
Reg.: 619