

Comitê de Investimentos

Ata nº 41/2019—aos dois dias do mês de outubro 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, Maristela Regina Teodoro Costa, Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e Alexandre Hope Herrera.** 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 27/09/2019, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	31/07/19 a 18/09/19	2019	Redução	6,00%	5,50%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2019	Redução	5,00	4,75
PIB	Mediana agregada	2019	Estável	0,87	0,87
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2019	Elevação	R\$ 3,95	R\$ 4,00
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2019	Estável	4,75%	4,75%
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2019	Estável	3,36%	3,36%
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8820 d.u. - 2056)	Anbima – 01/10/2019	2019	Redução	3,7834	3,7570
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2049)	Anbima – 01/10/2019	2019	Redução	3,7505	3,7159
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2039)	Anbima – 01/10/2019	2019	Redução	3,6352	3,5725
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2029)	Anbima – 01/10/2019	2019	Redução	3,2986	3,1763
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2024)	Anbima – 01/10/2019	2019	Redução	2,7252	2,6023
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2021)	Anbima – 01/10/2019	2019	Elevação	1,5673	1,5848
Ibovespa	01/10/2019	2019	Elevação	103.875	104.053
Risco Brasil (JP Morgan)	30/09/2019	2019	Elevação	234	247
Posição dos Investimentos	Jul/19–Ago/19	2019	em Mil	531.750	534.291

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 exceto o mais curto; o risco Brasil apresentou elevação; O IBOVESPA subiu para 104.053 pontos; o relatório semanal dos investimentos indica o patrimônio de R\$ 546.745M em 27/09/2019. Recebemos a visita da equipe do Banco Bradesco e da Sra. Denise Nassar da Distribuidora Eternum.



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
105/2019	30/09/2019	245.000,00	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.

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

02 de outubro de 2019

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 23/09/2019	Posição 27/09/2019	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Pro-Gestão	Saldo Dez/18 Evolução PL	R\$ 452.636.394,03 R\$ 94.108.827,22	17,43% 20,79%	
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO (*) CONTA TRANSITÓRIA	546.325.599,52	546.745.221,25	0,08%	100,0%	Res. 4604/17 Nível II	Limite Inferior (%)	Estratégia Ativo	Margem	Enquadramento	
CP 0184	Títulos Públicos Federais	169.841.774,63	170.819.230,29	0,58%	31,24%	100,00%	10,00%	31,00%	100,00%	-0,24% !!	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	169.841.774,63	170.819.230,29	0,58%	31,24%						
	Fundos 100% Títulos Públicos	83.985.494,87	84.207.735,23	0,26%	15,40%	100,00%	10,00%	16,00%	100,00%	0,60% (E)	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.208.488,00	19.250.374,00		3,51%						
	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.577.774,40	16.719.592,40	0,86%	3,058%						
	BB PREV RF TP VII FI	16.483.209,55	16.482.354,22	-0,01%	3,015%						
	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	5.963.852,10	5.976.306,54	0,21%	1,093%	100,00%					
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.301.305,34	16.329.953,44	0,18%	2,987%						
	BB PREV TP IPCA III	9.450.865,48	9.449.154,63	-0,02%	1,728%						
					0,000%						
	Fundos Referenciados Renda Fixa	143.735.607,94	142.604.974,71	-0,79%	26,08%		0,00%	22,00%	50,00%	-4,08% !!	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	46.180.151,20	44.928.579,01	-2,71%	8,217%	40,00%	50,00%				
	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	97.555.456,74	97.676.395,70	0,12%	17,865%						
					0,000%						
	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.751.638,76	3.755.260,17	0,10%	0,69%	5,00%	15,00%	1,00%	15,00%	0,31% (E)	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.751.638,76	3.755.260,17	0,10%	0,687%						
					0,000%						
	FI ref índice de RV divulgado pela B3 - Comp por no mín 50 ações	38.739.302,08	38.736.019,35	-0,01%	7,08%	30,00%	40,00%	0,00%	40,00%	-0,08% !!	Artigo 8, Inciso I, Alínea A
	ITAÚ FOF RFI AÇÕES BOVESPA ATIVO FIC FI	38.739.302,08	38.736.019,35	-0,01%	7,085%						
					0,000%						
	Fundos de Investimentos em Ações	91.381.615,46	91.731.835,72	0,38%	16,78%		0,00%	20,00%	30,00%	3,22% (E)	Artigo 8, Inciso I, Alínea A
	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	17.369.280,42	17.459.796,71	0,52%	3,193%						
	QUEST AÇÕES FIC FIA	11.379.627,12	11.491.891,93	0,99%	2,102%						
	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	43.758.088,25	43.854.704,48	0,22%	8,021%	20,00%	30,00%				
	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.273.613,15	7.297.233,91	0,32%	1,335%						
	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.170.423,44	8.203.703,18	0,41%	1,500%						
	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.430.583,08	3.424.505,51	-0,18%	0,626%						
					0,000%						
	Fundo de Investimento em Participações	14.890.165,78	14.890.165,78	0,00%	2,72%		0,00%	3,00%	5,00%	0,28% (E)	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	8.194.975,93	8.194.975,93	0,00%	1,499%	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%	1,225%						

Alexandre Jorge Ferreira
Coord. Adm. - Financeira
Reg.: 019 Bortprey