

Comitê de Investimentos

Ata nº 54/2019—aos vinte e seis dias do mês de dezembro 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, Jean Mamede de Oliveira, Wilson Paschoal dos Santos, José Daniel Rodrigues, Maristela Regina Teodoro Costa e Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade. 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 20/12/2019, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	30/10/19 a 11/12/19	2019	Redução	5,0%	4,5%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2019	Estável	-	-
PIB	Mediana agregada	2019	Elevação	1,12	1,16
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2019	Redução	4,15	4,10
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2019	Estável	-	-
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2019	Elevação	3,95	4,04
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8820 d.u. - 2056)	Anbima –24/12/2019	2019	Elevação	3,6536	3,7934
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2049)	Anbima –24/12/2019	2019	Elevação	3,6656	3,7586
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2039)	Anbima –24/12/2019	2019	Elevação	3,5871	3,637
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2029)	Anbima –24/12/2019	2019	Elevação	3,1554	3,2726
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2024)	Anbima –24/12/2019	2019	Elevação	2,488	2,585
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2021)	Anbima –24/12/2019	2019	Elevação	1,1901	1,2352
Ibovespa	23/12/2019	2019	Elevação	112.615	115.863
Risco Brasil (JP Morgan)	23/12/2019	2019	Redução	215	212
Posição dos Investimentos	out/19–nov/19	2019	em Mil	561.197	556.013

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; o risco Brasil apresentou redução; O IBOVESPA avançou para 115.863 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 23/12/2019 indica o patrimônio de R\$ 573.846M. Segue em anexo calendário de reuniões para o exercício de 2020. Acusamos o recebimento dos processos de credenciamento das seguintes instituições financeiras: 085/2018 – BTG Pactual Serviços Financeiros; 086/2018 – BTG Pactual Asset; 175/2018 – Banco Santander; 177/2018 – BB Gestão de Recursos e 250/2018 – Itaú Unibanco S/A a ser analisados nas próximas reuniões. Continua em apreciação o solicitado pela Sra. Coordenadora Jurídico Previdenciária quanto a manifestação da assessoria técnica jurídica do TCE-SP.



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
140/2019	19/12/2019	165.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 3)

2

Nada mais, foi encerrada a reunião às 15:30 horas, e lavrada em ata e assinada pelos presentes a esta reunião.

Jean Mamede de Oliveira

Wilson Paschoal dos Santos

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



Relatório Semanal de Investimentos

26 de dezembro de 2019

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 16/12/2019	Posição 23/12/2019	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10 Res. 4604/17 Res. 4695/18	Limite % Pré-Gestão Nível II	Saldo Dez/13 Evolução PL	R\$ 452.636.394,03 R\$ 121.210.384,40	17,43% 26,78%	
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO (*) CONTA TRANSITÓRIA	572.620.310,75	573.846.778,43	0,21%	100,0%	100,0%		Limite Inferior (%)	Estratégia Ativo	Margem	Enquadramento
CP 0184	Títulos Públicos Federal	172.479.739,82	169.875.624,48	-1,51%	29,60%	100,0%	100,0%	10,00%	31,00%	1,40%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	172.479.739,82	169.875.624,48	-1,51%	29,60%	100,0%	100,0%	10,00%	31,00%	1,40%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
	Fundos 100% Títulos Públicos	110.125.691,79	109.683.412,13	-0,40%	19,11%	100,0%	100,0%	10,00%	16,00%	-3,11%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.743.555,00	19.657.625,00	-0,44%	3,426%	100,0%	100,0%	10,00%	16,00%	-3,11%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	17.044.416,80	16.821.592,80	-1,31%	2,931%	100,0%	100,0%	10,00%	16,00%	-3,11%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
BB PREV RF TP VII FI		16.825.384,90	16.840.326,79	0,09%	2,935%	100,0%	100,0%	10,00%	16,00%	-3,11%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
19.523.305/0001-06	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.151.735,89	30.042.146,55	-0,36%	5,235%	100,0%	100,0%	10,00%	16,00%	-3,11%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	16.704.457,52	16.671.880,52	-0,20%	2,905%	100,0%	100,0%	10,00%	16,00%	-3,11%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	9.656.141,68	9.649.840,47	-0,07%	1,682%	100,0%	100,0%	10,00%	16,00%	-3,11%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
19.303.795/0001-35	BB PREV TP IPCA III				0,000%	100,0%	100,0%	10,00%	16,00%	-3,11%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
	Fundos Referenciados Renda Fixa	126.668.729,70	126.933.904,28	0,21%	22,12%	100,0%	100,0%	10,00%	22,00%	-0,12%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	27.959.659,28	28.148.495,30	0,68%	4,905%	100,0%	100,0%	10,00%	22,00%	-0,12%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	98.709.070,42	98.785.408,98	0,08%	17,215%	100,0%	100,0%	10,00%	22,00%	-0,12%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.839.173,11	3.832.080,13	-0,18%	0,67%	100,0%	100,0%	10,00%	22,00%	-0,12%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.839.173,11	3.832.080,13	-0,18%	0,668%	100,0%	100,0%	10,00%	22,00%	-0,12%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
	FI ref Índice de RV divulgado pela B3 - Comp por no mín 50 açõ	42.225.039,19	43.620.831,18	3,31%	7,60%	100,0%	100,0%	10,00%	22,00%	-0,12%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	42.225.039,19	43.620.831,18	3,31%	7,601%	100,0%	100,0%	10,00%	22,00%	-0,12%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
	Fundos de Investimentos em Ações	99.948.310,31	102.567.299,40	2,62%	17,87%	100,0%	100,0%	10,00%	20,00%	2,13%	Artigo 8, inciso II, Alínea A
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	20.410.636,68	20.973.988,55	2,76%	3,655%	100,0%	100,0%	10,00%	20,00%	2,13%	Artigo 8, inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	12.253.122,71	12.507.439,48	2,08%	2,180%	100,0%	100,0%	10,00%	20,00%	2,13%	Artigo 8, inciso II, Alínea A
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	46.973.239,17	48.160.624,91	2,53%	8,393%	100,0%	100,0%	10,00%	20,00%	2,13%	Artigo 8, inciso II, Alínea A
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.770.344,95	8.000.009,44	2,96%	1,394%	100,0%	100,0%	10,00%	20,00%	2,13%	Artigo 8, inciso II, Alínea A
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.801.334,65	9.091.664,41	3,30%	1,584%	100,0%	100,0%	10,00%	20,00%	2,13%	Artigo 8, inciso II, Alínea A
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.739.632,15	3.833.572,61	2,51%	0,668%	100,0%	100,0%	10,00%	20,00%	2,13%	Artigo 8, inciso II, Alínea A
	Fundo de Investimento em Participações	17.333.626,83	17.333.626,83	0,00%	3,02%	100,0%	100,0%	10,00%	3,00%	-0,02%	Artigo 8, inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	7.562.524,57	7.562.524,57	0,00%	1,318%	100,0%	100,0%	10,00%	3,00%	-0,02%	Artigo 8, inciso IV, Alínea A
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTII	9.771.102,26	9.771.102,26	0,00%	1,703%	100,0%	100,0%	10,00%	3,00%	-0,02%	Artigo 8, inciso IV, Alínea A

Jose Ferreira Melo Filho
Escriturário - BERTPREV
Reg. 007