

Comitê de Investimentos

Ata nº 01/2020—aos três dias do mês de janeiro do ano de dois mil e vinte, às dez horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto os **Srs. Jean Mamede de Oliveira eleito extraordinariamente para presidir a presente reunião, Wilson Paschoal dos Santos e Maristela Regina Teodoro Costa**. Registra-se a ausência do Sr. Clayton Faria Schmidt e do Sr. José Daniel Rodrigues por férias. 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 27/12/2019, 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	1,16	1,17
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2019	Estável	4,10	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	4,04	4,12
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8820 d.u. - 2056)	Anbima -01/02/2020	2019	Redução	3,7934	3,6999
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2049)	Anbima -01/02/2020	2019	Redução	3,7586	3,6633
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2039)	Anbima -01/02/2020	2019	Redução	3,637	3,5353
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2029)	Anbima -01/02/2020	2019	Redução	3,2726	3,1522
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2024)	Anbima -01/02/2020	2019	Redução	2,585	2,4594
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2021)	Anbima -01/02/2020	2019	Elevação	1,2352	1,2707
Ibovespa	02/01/2020	2019	Elevação	115.863	118.573
Risco Brasil (JP Morgan)	31/12/2019	2019	Elevação	212	217
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 redução dos vértices mais longos e elevação do mais curto; o risco Brasil apresentou elevação; O IBOVESPA avançou para 118.573 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 31/12/2019 indica o patrimônio de R\$ 576.535M. Segue em anexo relatório de acompanhamento da renovação de credenciamento das instituições financeiras enviado pelo CAF. Permanece em análise o credenciamento das instituições enviadas ao comitê no relatório supracitado. Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:00 horas, e lavrada em ata e assinada pelos presentes a esta reunião.



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

Jean Mamede de Oliveira

Wilson Paschoal dos Santos

Maristela Regina Teodoro Costa

Three horizontal lines with blue ink signatures written over them. The signatures are stylized and overlapping.



*

Relatório Semanal de Investimentos

03 de janeiro de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 23/12/2019	Posição 31/12/2019	Varição Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Pro-Gestão	Saldo Dez/19 Evolução PL	R\$ 576.535.620,84 R\$ 0,00	17,43% 0,00%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO (*) CONTA TRANSITÓRIA	573.846.778,43	576.535.620,84	0,47%	100,0%	Res. 4604/17 Res. 4695/18	Nível II			
CP 0184	Títulos Públicos Federais	169.875.624,48	172.290.685,98	1,42%	29,88%	100,00%	100,00%	10,00%	31,00%	1,12%
	Fundos 100% Títulos Públicos	109.683.412,13	110.391.930,74	0,65%	19,15%	100,00%	100,00%	10,00%	16,00%	-3,15%
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.657.625,00	19.814.886,00	0,80%	3,437%					
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.821.592,80	17.022.438,00	1,19%	2,953%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TP VII FI	16.840.326,79	16.882.481,13	0,25%	2,928%					
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.042.146,55	30.206.800,46	0,55%	5,239%					
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.671.880,52	16.776.832,11	0,63%	2,910%					
19.303.795/0001-35	BB PREV TP IPCA III	9.649.840,47	9.688.493,04	0,40%	1,680%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	126.933.904,28	126.037.632,97	-0,71%	21,86%			0,00%	22,00%	0,14%
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	28.148.495,30	27.175.597,73	-3,46%	4,714%					
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	98.785.408,98	98.862.035,24	0,08%	17,148%	40,00%	50,00%			
	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.832.080,13	3.847.199,49	0,39%	0,67%			0,00%	1,00%	0,33%
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.832.080,13	3.847.199,49	0,39%	0,667%	5,00%	15,00%			
	FI ref Índice de RV divulgado pela B3 - Comp por no mín 50 aq	43.620.831,18	43.708.352,32	0,20%	7,58%			0,00%	7,00%	-0,58%
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVSPA ATIVO FIC FI	43.620.831,18	43.708.352,32	0,20%	7,581%	30,00%	40,00%			
	Fundos de Investimentos em Ações	102.567.299,40	102.926.192,51	0,35%	17,85%			0,00%	20,00%	2,15%
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	20.973.988,55	21.068.181,66	0,45%	3,654%					
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	12.507.439,48	12.563.398,13	0,45%	2,179%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	48.160.624,91	48.225.746,39	0,14%	8,365%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	8.000.009,44	8.037.735,36	0,47%	1,394%			20,00%		
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	9.091.664,41	9.144.965,13	0,59%	1,586%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.833.572,61	3.886.165,84	1,37%	0,674%					
	Fundo de Investimento em Participações	17.333.626,83	17.333.626,83	0,00%	3,01%			0,00%	3,00%	-0,01%
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	7.562.524,57	7.562.524,57	0,00%	1,312%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTI	9.771.102,26	9.771.102,26	0,00%	1,695%	5,00%	5,00%			

Alexandre Gomes de Oliveira
Coordenador de Investimentos
6/10/2019
Bertprev



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BERTIOGA

INSTITUIÇÕES DE INVESTIMENTOS CREDENCIADAS

Resolução nº 05/19 - C.A./BERTPREV e Resolução CMN 4.695

Certificado / Termo	Instituição	CNPJ	Resolução CMN 4.695	1ª Emissão
006/14 - 016/15 - 006/18 - 007/18 -	BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	29.650.082/0001-00	Sim	enviado ao comitê em 26/12/2019
	BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM	59.281.253/0001-23	Sim	enviado ao comitê em 26/12/2019
	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIA	09.290.813/0001-38		Aguardando parecer da consultoria de investimentos da necessidade do demonstrativo de desempenho e Relatório de Rating
	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC DE FIA	11.977.794/0001-64		Aguardando parecer da consultoria de investimentos da necessidade do demonstrativo de desempenho e Relatório de Rating
008/14 014/15	AZ QUEST Investimentos Ltda	04.506.394/0001-05	Não	RENOVADO
	PRIVATIZA Agentes Autônomos de Investimentos Ltda EPP	00.840.515/0001-08	Não	RENOVADO
002/18	BEM - DTVM LTDA	00.066.670/0001-00	Sim	RENOVADO
	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	11.392.165/0001-72		RENOVADO
	QUEST AÇÕES FIC FIA	07.279.657/0001-89		RENOVADO
004/15 012/15	ITAÚ - UNIBANCO S.A	60.701.190/0001-04	Sim	enviado ao comitê em 26/12/2019
	ITAÚ DTVM	33.311.713/0001-25		AGUARDANDO COMPROVAÇÃO DE 03 RPPS E CERTIDÃO DA FAZENDA ESTADUAL / REENVIADO EMAIL EM 02/01/2020
	ITAÚ RPI	08.817.414/0001-10		Aguardando parecer da consultoria de investimentos da necessidade do demonstrativo de desempenho e Relatório de Rating
	ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	21.838.150/0001-49		Aguardando parecer da consultoria de investimentos da necessidade do demonstrativo de desempenho e Relatório de Rating
001/16 005-18	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	00.360.305/0001-04	Sim	AGUARDANDO COMPROVAÇÃO DE 03 RPPS

Alexandre Hope Ferreira
Coord. Adm. - Bertprev
Reg.: 019

007/17	VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA	10.917.835/0001-64	Não	Gestora de Recursos	AGUARDANDO DECLARAÇÃO DE FATOS IMPEDITIVOS COM A ADMINISTRAÇÃO PÚBLICA / REENVIADO EMAIL EM 02/01/2020
	CAIXA BRASIL 2024 VI TP FI RF	22.791.074/0001-26		Fundo de investimento	Aguardando parecer da consultoria de investimentos da necessidade do demonstrativo de desempenho e Relatório de Rating
	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	15.154.441/0001-15		Fundo de investimento	Aguardando parecer da consultoria de investimentos da necessidade do demonstrativo de desempenho e Relatório de Rating
	CAIXA BRASIL 2030 II TP FI RF	19.769.046/0001-06		Fundo de investimento	Aguardando parecer da consultoria de investimentos da necessidade do demonstrativo de desempenho e Relatório de Rating
002/16	WESTERN ASSET MANAGEMENT				
004/18	COMPANY DTVM LTDA	07.437.241/0001-41	Não	Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários	EMAIL EM 17/12
007/15	Banco BNP Paribas Brasil S.A.	01.522.368/0001-82	Sim	Administrador de Fundos de Investimentos	EMAIL EM 18/12
008/18	WESTERN ASSET VALUATION FIA	09.087.523/0001-91		Fundo de investimento	
009/14	BB Gestão de Recursos - Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A.	30.822.936/0001-69	Sim	Administradora, Gestora, Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários	enviado ao comitê em 26/12/2019
	BB PREV RF TP VII FI	19.523.305/0001-06		Fundo de investimento	Aguardando parecer da consultoria de investimentos da necessidade do demonstrativo de desempenho e Relatório de Rating
	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	25.078.994/0001-90		Fundo de investimento	Aguardando parecer da consultoria de investimentos da necessidade do demonstrativo de desempenho e Relatório de Rating
	BB PREV RF TP IPCA FI	15.486.093/0001-83		Fundo de investimento	Aguardando parecer da consultoria de investimentos da necessidade do demonstrativo de desempenho e Relatório de Rating
	BB PREV TP IPCA III	19.303.795/0001-35		Fundo de investimento	Aguardando parecer da consultoria de investimentos da necessidade do demonstrativo de desempenho e Relatório de Rating
	BB PREV RF CREDITO PRIVADO IPCA III FI	14.091.645/0001-91		Fundo de investimento	Aguardando parecer da consultoria de investimentos da necessidade do demonstrativo de desempenho e Relatório de Rating
004/16	BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	90.400.888/0001-42	Sim	Administrador	enviado ao comitê em 26/12/2019
009/18	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	10.231.177/0001-52		Gestora de Recursos	AGUARDANDO COMPROVAÇÃO DE 03 RPPS E CERTIDÃO DA FAZENDA MUNICIPAL E DECLARAÇÃO DE FATOS IMPEDITIVOS COM A ADMINISTRAÇÃO PÚBLICA / REENVIADO EMAIL EM 02/01/2020
	SANTANDER INSTITUCIONAL REF DI	02.224.354/0001-45		Fundo de investimento	NÃO RECEBIDA A DOCUMENTAÇÃO
002/17	KINEA PRIVATE EQUITY				
011/18	INVESTIMENTOS S.A. (Kinea IV)	04.661.817.0001.61	Não	Gestora de Recursos	
008/17	LIONS TRUST ADM DE RECURSOS LTDA	15.675.095.0001.10	Não	Administradora de Recursos	EMAIL EM 17/12
	KINEA PRIVATE EQUITY II	16.437.148/0001-28			
	KINEA PRIVATE EQUITY IV	27.782.774/0001-78			

Alexandre Hoffe Herrera
 Coord. Adm. e Financeira
 Reg.: 019