

Comitê de Investimentos

Ata nº 05/2020—aos vinte e nove 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 24/01/2020, 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	2020	Redução	4,50	4,25
PIB	Mediana agregada	2020	Estável	2,31	2,31
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Elevação	4,05	4,10
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	4,25	4,25
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Estável	3,40	3,40
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –28/01/2020	2020	Elevação	3,6923	3,7196
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –28/01/2020	2020	Elevação	3,7145	3,7271
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –28/01/2020	2020	Redução	3,6699	3,6279
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –28/01/2020	2020	Redução	3,2616	3,1533
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –28/01/2020	2020	Redução	2,5784	2,4799
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –28/01/2020	2020	Redução	1,4281	1,3802
Ibovespa	28/01/2020	2020	Redução	117.026	116.478
Risco Brasil (JP Morgan)	27/01/2020	2020	Elevação	209	232
Posição dos Investimentos	nov/19–dez/19	2019	em Mil	556.013	575.862

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 dos vértices 8694 e 7560, com redução nos demais vértices; o risco Brasil apresentou forte elevação; O IBOVESPA reduziu para 116.478 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 27/01/2020 indica o patrimônio de R\$ 583.808M. Recebemos o P.A. 79/2019 – Prestação de Contas 2018, que foi respondido a CAF através do Memo. 02/2020 e P.A. 258/2019 – Itaú Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. para análise de credenciamento. Foi entregue pelo CAF o relatório atualizado de acompanhamento de credenciamento de Instituições e Fundos. Fica pautada para próxima reunião a análise dos credenciamentos.

Foram emitidas as seguintes APRs:



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

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
008/2020	29/01/2020	1.700.000,00	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 3)
009/2020	29/01/2020	105.000,00	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 1)

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

2

Jean Mamede de Oliveira

Wilson Paschoal dos Santos

Maristela Regina Teodoro Costa



Relatório Semanal de Investimentos

29 de janeiro de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 20/01/2020	Posição 27/01/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10 Res. 4604/17 Res. 4695/18	Limite % Pró-Gestão Nível II	Saldo Dev/19 Evolução PL	Res. 576.535.620,84 Res. 7.273.340,22	27.37% 1,26%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	586.736.246,97	583.808.961,06	-0,50%	100,0%					
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%					
	Títulos Públicos Federais									
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	171.674.836,57	172.655.850,56	0,57%	29,57%					
	Fundos 100% Títulos Públicos	171.674.836,57	172.655.850,56	0,57%	29,57%					
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	110.615.989,75	110.956.451,16	0,31%	19,01%					
19.769.045/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	19.867.107,00	19.929.221,00	0,31%	3,41%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TP VII FI	17.029.264,40	17.140.970,80	0,66%	2,936%					
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	16.914.514,95	16.932.236,52	0,10%	2,900%					
15.485.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	30.256.168,24	30.330.849,16	0,25%	5,195%					
19.303.795/0001-35	BB PREV TP IPCA III	16.832.757,76	16.888.165,63	0,33%	2,893%					
		9.716.177,40	9.735.008,05	0,19%	1,667%					
					0,000%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	128.587.071,96	128.688.706,61	0,08%	22,04%					
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF DEF DI	29.526.371,43	29.551.210,58	0,08%	5,062%					
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	99.060.700,53	99.137.496,03	0,08%	16,981%					
					0,000%					
	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.865.882,41	3.877.157,11	0,29%	0,66%					
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.865.882,41	3.877.157,11	0,29%	0,664%					
					0,000%					
	FI ref índice de RV divulgado pela B3 - Comp por no mín 50 aqç	45.575.717,37	44.133.239,20	-3,17%	7,56%					
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	45.575.717,37	44.133.239,20	-3,17%	7,560%					
					0,000%					
	Fundos de Investimentos em Ações	108.856.413,87	105.937.221,38	-2,68%	18,15%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	23.009.356,38	22.480.912,94	-2,30%	3,851%					
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	13.502.313,73	13.066.897,25	-3,22%	2,238%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	50.403.753,21	49.103.968,01	-2,58%	8,411%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	8.367.205,00	8.157.900,68	-2,50%	1,397%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	9.499.930,49	9.154.663,94	-3,63%	1,568%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	4.073.855,06	3.972.878,56	-2,48%	0,681%					
					0,000%					
	Fundo de Investimento em Participações	17.560.335,04	17.560.335,04	0,00%	3,01%					
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	7.523.307,54	7.523.307,54	0,00%	1,289%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTII	10.037.027,50	10.037.027,50	0,00%	1,719%					

(*)

Coord. Adm. Financeira
Reg.: 018
Bertprev
Alexandre Jorge Moreira



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BERTIOGA
INSTITUIÇÕES DE INVESTIMENTOS CREDENCIADAS

Resolução nº 01/19 C.A./BERTPREV ; Resolução nº 02/17 - C.A./BERTPREV ; Resolução nº 05/18 - 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		enviado ao comitê em 29/01/2020
	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	enviado ao comitê em 29/01/2020
007/17	VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA	10.917.835/0001-64	Não	Solicitado relatório de Rating e atualização do Due Diligence em 27/01/2020

Alexandre Bortolotto
Coord. Adm. - BERTIOGA
Reg.: 01018

	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
002/16 004/18 005/14	WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTM LTDA	07.437.241/0001-41	Não	Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários	CND ESTADUAL DESATUALIZADA E SOLICITADO DECLARAÇÃO DE QUE O CONTRATO SOCIAL NÃO TEVE ATUALIZAÇÃO DESDE 2016
007/15 015/15	Banco BNP Paribas Brasil S.A.	01.522.368/0001-82	Sim	Administrador de Fundos de Investimentos	enviado ao comitê em 29/01/2020
	WESTERN ASSET VALUATION FIA	09.087.523/0001-91		Fundo de investimento	
009/14 003/16 008/18	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	enviado ao comitê em 22/01/2020
	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	25.078.994/0001-90		Fundo de investimento	enviado ao comitê em 22/01/2020
	BB PREV RF TP IPCA FI	15.486.093/0001-83		Fundo de investimento	enviado ao comitê em 22/01/2020
	BB PREV TP IPCA III	19.303.795/0001-35		Fundo de investimento	enviado ao comitê em 22/01/2020
	BB PREV RF CREDITO PRIVADO IPCA III FI	14.091.645/0001-91		Fundo de investimento	enviado ao comitê em 22/01/2020
004/16 010/18	BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	90.400.888/0001-42	Sim	Administrador	enviado ao comitê em 26/12/2019
004/16 009/18	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	10.231.177/0001-52		Gestora de Recursos	AGUARDANDO COMPROVAÇÃO DE US RPPS E CERTIDÃO DA FAZENDA MUNICIPAL E DECLARAÇÃO DE FATOS IMPEDITIVOS COM A ADMINISTRAÇÃO PÚBLICA / REENVIADO EMAIL EM 02/01/2020, reenviei email cobrando em 28/01/20
	SANTANDER INSTITUCIONAL REF DI	02.224.354/0001-45		Fundo de investimento	NÃO RECEBIDA A DOCUMENTAÇÃO
002/17 011/18	KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIMENTOS S.A. (Kinea IV)	04.661.817/0001-61	Não	Gestora de Recursos	enviado email em 28/01/2020 declaração informando que a última alteração no contrato social ocorreu em 2018. Relatório de Rating no CNPJ da Gestora (04.661.817/0001-61) Relatório de gestão de qualidade
008/17	LIONS TRUST ADM DE RECURSOS LTDA	15.675.095/0001-10	Não	Administradora de Recursos	EMAIL EM 17/12, reenviado email em 07/01/2020, COBRADO VIA TEL EM 13/01/2020, email reenviado em 29/01/2020
	KINEA PRIVATE EQUITY II	16.437.148/0001-28		Fundo de investimento	
	KINEA PRIVATE EQUITY IV	27.782.774/0001-78		Fundo de investimento	

Alexandre J. J. Pereira
 Coordenador
 010.610.610
 Reg.