

Comitê de Investimentos

Ata nº 07/2020—aos doze dias do mês de fevereiro do ano de dois mil e vinte, 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 e Maristela Regina Teodoro Costa**. 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 07/02/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	11/12/19 a 05/02/20	2020	Redução	4,50%	4,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	4,25	4,25
PIB	Mediana agregada	2020	Estável	2,30	2,30
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	4,10	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	Redução	3,26	3,08
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –11/02/2020	2020	Redução	3,6612	3,5711
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –11/02/2020	2020	Redução	3,6782	3,5914
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –11/02/2020	2020	Redução	3,5747	3,5045
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –11/02/2020	2020	Redução	3,0478	3,0166
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –11/02/2020	2020	Elevação	2,3863	2,3962
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –11/02/2020	2020	Elevação	1,4493	1,499
Ibovespa	11/02/2020	2020	Redução	116.028	115,370
Risco Brasil (JP Morgan)	10/02/2020	2020	Redução	219	216
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 do vértice 1260 e 504, com redução nos demais vértices; o risco Brasil apresentou redução; O IBOVESPA reduziu para 115.370 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 10/02/2020 indica o patrimônio de R\$ 584.209M. Encaminhamos ao CAF o P.A. nº 215/2014-BB Previdenciário RF Crédito Privado IPCA III, deliberando pelo seu 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:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
014/2020	07/02/2020	80.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 3)
015/2020	10/02/2020	2.630.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 3)

2

Nada mais, foi encerrada a reunião às 16:45 horas, e lavrada em ata e assinada pelos presentes a esta reunião.

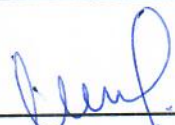
Clayton Faria Schmidt



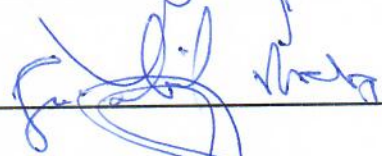
Jean Mamede de Oliveira



Wilson Paschoal dos Santos



José Daniel Rodrigues



Maristela Regina Teodoro Costa





Relatório Semanal de Investimentos

12 de fevereiro de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 04/02/2020	Posição 10/02/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Pré-Gestão	Saldo Dez/19 Evolução PL	R\$ 576.535.620,84	27,37%
XXX XXX XXX		587.648.600,06	584.209.375,33	-0,59%	100,0%	Res. 4604/17	Nível II	Res. 7.673.754,49	1,33%	
TOTAL PATRIMÔNIO										
(*) CONTA TRANSITÓRIA										
Títulos Públicos Federais										
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	174.028.442,29	174.802.772,02	0,44%	29,92%	100,00%	100,00%	0,08%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A	
Fundos 100% Títulos Públicos										
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	111.272.238,62	110.198.501,79	-0,96%	18,86%	100,00%	100,00%	3,14%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B	
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	20.007.273,00	19.978.452,00	-0,14%	3,420%	100,00%	100,00%			
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TP VII FI	17.275.870,40	17.344.916,40	0,40%	2,969%	100,00%	100,00%			
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	16.926.509,37	16.467.156,45	-2,71%	2,819%	100,00%	100,00%			
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	30.415.867,79	30.470.551,93	0,18%	5,216%	100,00%	100,00%			
19.303.795/0001-35	BB PREV TP IPCA III	16.908.692,33	16.456.489,49	-2,67%	2,817%	100,00%	100,00%			
		9.738.025,73	9.480.935,52	-2,64%	1,623%					
Fundos Referenciados Renda Fixa										
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	129.853.422,35	132.603.293,57	2,12%	22,70%	0,00%	17,30%	50,00%	-5,40%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	30.623.904,85	33.353.560,12	8,91%	5,709%	40,00%	50,00%			
		99.229.517,50	99.249.733,45	0,02%	16,989%					
FI Renda Fixa Crédito Privado										
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.884.723,98	3.872.415,89	-0,32%	0,66%	5,00%	15,00%	0,04%		Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
		3.884.723,98	3.872.415,89	-0,32%	0,663%					
FI ref Índice de RV divulgado pela B3 - Comp por no mín 50 açõ										
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	44.861.455,81	43.415.076,72	-3,22%	7,43%	30,00%	40,00%	-0,43%		Artigo 8, Inciso I, Alínea A
		44.861.455,81	43.415.076,72	-3,22%	7,431%					
Fundos de Investimentos em Ações										
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	108.415.998,63	103.984.996,96	-4,09%	17,80%			2,20%		Artigo 8, Inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	23.267.607,94	21.936.648,02	-5,72%	3,755%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	13.292.254,83	12.709.598,62	-4,38%	2,176%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	50.291.918,91	48.489.641,07	-3,58%	8,300%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.259.471,52	8.047.591,58	-2,57%	1,378%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	9.275.835,95	8.905.904,12	-3,99%	1,524%					
		4.028.909,48	3.895.613,55	-3,31%	0,667%					
Fundo de Investimento em Participações										
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	15.332.318,38	15.332.318,38	0,00%	2,62%			5,00%	0,38%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTII	5.097.720,57	5.097.720,57	0,00%	0,873%	5,00%	5,00%			
		10.234.597,81	10.234.597,81	0,00%	1,752%					

(*)

Alexandre Hope Herrerio
Coord. Adm. Financeira
Reg.: 019 Bertprev



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	Gestora e Distribuidora de Fundos de Investimentos	enviado ao comitê em 26/12/2019
	BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM	59.281.253/0001-23	Sim	Administradora e Distribuidora de Fundos de Investimentos	enviado ao comitê em 26/12/2019
	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIA	09.290.813/0001-38		Fundo de investimento	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		Fundo de investimento	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	Gestora de fundos de investimentos	RENOVADO
	PRIVATIZA Agentes Autônomos de Investimentos Ltda EPP	00.840.515/0001-08	Não	Distribuidora de fundos de investimentos	RENOVADO
002/18	BEIM - DTVM LTDA	00.066.670/0001-00	Sim	Administradora de Recursos	RENOVADO
	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	11.392.165/0001-72		Fundo de investimento	RENOVADO
	QUEST AÇÕES FIC FIA	07.279.657/0001-89		Fundo de investimento	RENOVADO
004/15 012/15	ITAÚ - UNIBANCO S.A	60.701.190/0001-04	Sim	Banco Múltiplo, Gestor e Administrador de Fundos de Investimentos	enviado ao comitê em 26/12/2019
	ITAÚ DTVM	33.311.713/0001-25		Gestora de fundos de investimentos	enviado ao comitê em 29/01/2020
	ITAÚ RPI	08.817.414/0001-10		Fundo de investimento	Aguardando parecer da consultoria de investimentos da necessidade do demonstrativo de desempenho e Relatório de Rating
	ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA	21.838.150/0001-49		Fundo de investimento	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	Administradora e Gestora de Fundos de Investimentos	enviado ao comitê em 29/01/2020
007/17	VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA	10.912.835/0001-64	Não	Gestora de Recursos	Solicitado relatório de Rating e atualização do Due Diligence em 27/01/2020 reenviado email em 08/02/2020 e 10/02/2020
	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

08/02/2020

Alexandre Hope Herrera
Coord. Adm. Financeira
Reg.: 019 Bertprev

	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	WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA	07.437.241/0001-41	Não	Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários	encaminhado ao comitê em 12/02/2020
005/14 007/15 015/15	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	renovado em 06/02/2020
	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	25.078.994/0001-90		Fundo de investimento	renovado em 06/02/2020
	BB PREV RF TP IPCA FI	15.486.093/0001-83		Fundo de investimento	renovado em 06/02/2020
	BB PREV TP IPCA III	19.303.795/0001-35		Fundo de investimento	renovado em 06/02/2020
	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	ENCAMINHADO À CIP EM 11/02/2020
	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 ao comitê em 12/02/2020
008/17	LIONS TRUST ADM DE RECURSOS LTDA	15.675.095.0001.10	Não	Administradora de Recursos	1. Atto constitutivo / 2. certidão municipal / 3. relatório estadual / 6. relatório de gestão de qualidade / 7. relatório de rating / 8. relatório due diligence email enviado em 23/01/2020, reenviado em 29/01/2020 e 06/02/2020 e 10/02/2020
	KINEA PRIVATE EQUITY II	16.437.148/0001-28		Fundo de investimento	
	KINEA PRIVATE EQUITY IV	27.782.774/0001-78		Fundo de investimento	

Reg.: 019
Coord. Administradora
Bertriv
eire

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535	6,07	0,92	1,68	118.372.135,20	20,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	3,42	0,03	0,85	10.468.991,36	1,79
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	9,33	2,04	1,41	13.755.138,71	2,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	31,00	1,73	9,58	10.169.694,39	1,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	2,76	-0,13	0,55	22.036.812,36	3,77
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		5,70	0,86	1,46	174.802.772,02	29,92

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,76	-0,14	0,53	16.456.489,49	2,82	341.969.024,05	4,81
BB	BB	BB PREV RF VII	1,21	0,01	0,21	16.467.156,45	2,82	692.179.747,75	2,38
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	2,32	0,39	0,87	30.470.551,93	5,22	10.482.907.428,21	0,29
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF..	5,11	0,74	1,89	17.344.916,40	2,97	69.404.673,43	24,99
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	3,41	0,03	0,83	19.978.452,00	3,42	216.939.400,14	9,21
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,84	-0,01	0,41	9.480.935,52	1,62	897.928.623,54	1,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,78	0,21	0,83	110.198.501,79	18,86		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,06	0,10	0,47	33.353.560,12	5,71	4.292.325.131,71	0,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,73	0,09	0,43	99.249.733,45	16,99	5.196.969.477,19	1,91
		Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a	1,46	0,09	0,44	132.603.293,57	22,70		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB CRED PRIV III	1,76	-0,18	0,66	3.872.415,89	0,66	588.860.421,02	0,66
		Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b	1,76	-0,18	0,66	3.872.415,89	0,66		
		Renda Fixa	3,42	0,44	0,97	421.476.983,27	72,14		

Carteira: BERTIOGA

Data Extrato: 10/02/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,86%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AZ QUEST BTG PACTUAL	BEM BTG PACTUAL	AZ QUEST ACOES FIC FIA BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	18,79 15,12	-2,56 -0,70	1,16 0,12	12.709.598,62 8.047.591,58	2,18 1,38	1.034.012.028,62 93.715.800,17	1,23 8,59
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	16,58	-1,34	-0,67	43.415.076,72	7,43	879.585.876,37	4,94
AZ QUEST WESTERN	BEM BNP PARIBAS	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA WA ASSET VALUATION FIA	18,66 18,22	-2,39 -2,76	4,12 -2,61	21.936.648,02 8.905.904,12	3,75 1,52	1.547.973.466,55 192.682.253,89	1,42 4,62
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	16,69	-1,46	0,55	48.489.641,07	8,30	1.998.066.868,71	2,43
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	15,96	-1,27	0,24	3.895.613,55	0,67	938.930.974,82	0,41
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			16,80	-1,69	0,52	147.400.073,68	25,23		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
KINEA KINEA	KINEA LIONS TRUST	FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II.. KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	50,04 67,97	0,00 0,00	-10,37 1,97	5.097.720,57 10.234.597,81	0,87 1,75	36.172.783,53 163.241.839,11	14,09 6,27
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			41,20	0,00	-0,62	15.332.318,38	2,62		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			15,25	-1,53	0,53	162.732.392,06	27,86		
Total						584.209.375,33	100,00		