

Comitê de Investimentos

Ata nº 13/2020—aos vinte e cinco dias do mês de março do ano de dois mil e vinte, às dez horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. **Clayton Faria Schmidt— Presidente do Comitê, Jean Mamede de Oliveira, Wilson Paschoal dos Santos, José Daniel Rodrigues, Maristela Regina Teodoro Costa, Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Presidente do Bertprev 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 20/03/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/02/2020 a 18/03/20	2020	Redução	4,25%	3,75%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Redução	3,75	3,75
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	1,68	1,48
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Elevação	4,35	4,50
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	3,38	3,38
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,92	2,73
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –24/03/2020	2020	Redução	5,135	5,0404
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –24/03/2020	2020	Redução	5,0699	5,0105
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –24/03/2020	2020	Elevação	4,8448	4,8981
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –24/03/2020	2020	Elevação	4,4058	4,6103
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –24/03/2020	2020	Elevação	3,8893	4,1863
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –24/03/2020	2020	Elevação	2,5952	3,0757
Ibovespa	24/03/2020	2020	Elevação	66.894	69.729
Risco Brasil (JP Morgan)	17/03/2020	2020	Estável	374	374
Posição dos Investimentos	Dez/19–jan/20	2019	em Mil	575.862	582.196

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, exceto 8694 d.u. e 7560 d.u.; o risco Brasil se manteve estável; o IBOVESPA tem elevação para 69.729 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 20/03/2020 indica o patrimônio de R\$ 500.518M. Foi solicitada ao Presidente do Bertprev junto aos administradores dos fundos de ações a posição da carteira aberta inclusive a posição dos fundos mãe e ordem de serviço que oficialize a continuidade das reuniões de forma remota, em consonância com o Decreto Municipal nº 3319/2020 e que contemple a interferência nas tarefas administrativas, como por exemplo, os processos de credenciamento das instituições financeiras e respectivos fundos de Investimentos. No momento o Comitê deliberou em não realizar novas movimentações financeiras, mas continua atento aos desdobramentos da pandemia junto ao mercado financeiro. No aguardo da citada ordem de serviço determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas



Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertioga

ESTADO DE SÃO PAULO

a manifestação dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos.

Foram emitidas as seguintes APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
038/2020	17/03/2020	6.000,00	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF REF DI (3-3)
039/2020	17/03/2020	8.000,00	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF REF DI (1-9)
040/2020	25/03/2020	700.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF REF DI (3-3)
041/2020	27/03/2020	1.850.000,00	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF REF DI (3-3)
042/2020	27/03/2020	150.000,00	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF REF DI (1-9)
043/2020	20/03/2020	10.000,00	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF REF DI (1-9)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:26 horas, e lavrada em ata e assinada pelos presentes a esta reunião.

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Maristela Regina Teodoro Costa

Jean Mamede de Oliveira

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera



*

Relatório Semanal de Investimentos

25 de março de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 13/03/2020	Posição 20/03/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Res. 4604/17	Limite % Proq. Gestão Res. 4695/18	Saldo Dez/19 Evolução PL	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)	Enquadramento
XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	537.493.606,13	500.518.032,12	-6,88%	100,0%	100,0%						
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%							
CP 0184	Títulos Públicos Federais	163.836.864,49	153.700.432,37	-6,19%	30,71%	100,0%				30,00%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	163.836.864,49	153.700.432,37	-6,19%	30,71%							
	Fundos 100% Títulos Públicos	106.529.724,12	103.728.003,05	-2,63%	20,72%							
	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.064.214,00	18.429.879,00	-3,33%	3,682%							
	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.235.470,00	15.374.515,60	-5,30%	3,072%							
	BB PREV RF TP VII FI	15.981.203,33	15.786.006,38	-1,22%	3,154%							
	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	29.801.704,56	29.256.034,52	-1,83%	5,845%							
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.283.590,19	15.888.780,79	-2,42%	3,174%							
	BB PREV TP IPCA III	9.163.542,04	8.992.786,76	-1,86%	1,797%							
	Fundos Referenciados Renda Fixa	126.696.234,24	125.571.387,15	-0,89%	25,09%					17,30%	50,00%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	27.138.277,35	25.976.279,66	-4,28%	5,190%	40,0%		50,0%				
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	99.557.956,89	99.595.107,49	0,04%	19,898%							
14.091.645/0001-91	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.832.306,42	3.756.126,84	-1,99%	0,75%	5,00%		15,00%		0,70%	15,00%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.832.306,42	3.756.126,84	-1,99%	0,75%							
	FI ref índice de RV divulgado pela B3 - Comp por no mín 50 ações	32.417.437,45	25.850.673,06	-20,26%	5,16%							
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	32.417.437,45	25.850.673,06	-20,26%	5,165%	30,0%		40,0%		7,00%	40,00%	Artigo 8, Inciso I, Alínea A
11.392.165/0001-72	Fundos de Investimentos em Ações	85.875.752,88	68.436.999,12	-20,31%	13,67%							
	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	16.297.119,42	12.516.560,65	-23,20%	2,501%							
	QUEST AÇÕES FIC FIA	17.049.427,43	13.333.105,54	-21,80%	2,664%							
	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	36.618.010,50	29.649.619,88	-19,03%	5,924%							
	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.334.458,34	5.324.498,08	-15,94%	1,064%	20,00%		30,00%				
	WESTERN ASSET VALUATION FIA	6.510.655,37	5.131.869,42	-21,18%	1,025%							
	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.066.081,82	2.481.345,55	-19,07%	0,496%							
	Fundo de Investimento em Participações	18.305.286,53	19.474.410,53	6,39%	3,89%							
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.784.133,45	5.784.133,45	0,00%	1,156%							
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIE	12.521.153,08	13.690.277,08	9,34%	2,735%	5,00%		5,00%		3,00%	5,00%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A

(*)

Waf:

[Assinatura]

Alexandre Afonso Herrera
Coord. Adj. Financeira
Reg. 019