



Comitê de Investimentos

Ata nº 54/2021 – aos vinte e quatro dias do mês de novembro do ano de dois mil e vinte e um, às 9 horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **Roberto Cassiano Guedes - Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê, Clayton Faria Schmidt, Patrícia Ramos Quaresma, Victor Mendes Neto e o Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do BERTPREV.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM mercedores de destaque, conforme Relatório Focus de 22/11/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	22/09/21 a 27/10/21	2021	Elevação	6,25%	7,75%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Estável	9,25	9,25
PIB	Mediana agregada	2021	Redução	4,88	4,80
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,50	5,50
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2021	Elevação	9,77	10,12
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	60,00	59,60
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	-0,95	-0,70

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8316 d.u. - 2054)	Anbima – 23/11/2021	2021	Elevação	5,3777	5,4508
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 23/11/2021	2021	Elevação	5,3720	5,4362
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 23/11/2021	2021	Elevação	5,3409	5,3575
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 23/11/2021	2021	Redução	5,2622	5,1925
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 23/11/2021	2021	Redução	5,2525	5,1684
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 23/11/2021	2021	Elevação	5,3999	5,4484

Ibovespa	23/11/2021	2021	Redução	104.404	103.653
Risco Brasil (JP Morgan)	22/11/2021	2021	Elevação	336	339

Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.

Posição dos Investimentos	Setembro /21-Outubro/21	2021	em Mil	Fechamento	Fechamento
				Setembro	Outubro
				635.280	620.053

No relatório Focus, a expectativa da SELIC chega a 9,25% ao final do exercício, apontando para 11% ao final de 2022. Segue expectativa de que uma elevação mais significativa nas curvas de juros poderá ocorrer em função de reavaliação da trajetória da dívida pública atualmente suavizada em razão do incremento das receitas causado pelo ciclo inflacionário, e eventualmente por conta de expectativas relacionadas a possíveis elevações nas taxas de juros praticadas pelos bancos centrais das principais economias mundiais para fazer frente a



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

uma inflação elevada mundialmente, se os efeitos permanecerem duradouros. Nesta última semana a ETTJ apresentou redução nos vértices 2520 d.u. e 1260 d.u e elevação nos demais vértices, com impacto patrimonial negativo na carteira de renda fixa em razão da marcação a mercado. O risco Brasil teve elevação; no IBOVESPA houve redução para 103.653 pontos; o segmento de renda variável apresentou variação patrimonial negativa. Acusamos o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 18/11/2021 com o patrimônio de R\$ 627.904M, o relatório mensal referente a outubro com o patrimônio de R\$ 620.053M e o relatório bimestral setembro-outubro/2021. Foram emitidas as seguintes APRs.

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
105/2021	17/11/2021	2.090.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
106/2021	18/11/2021	120.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
107/2021	19/11/2021	1.090.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
108/2021	19/11/2021	360.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

Registra-se a participação da Coordenadora da CJP que atualizou ao Comitê a situação da tramitação do processo administrativo autuado junto à PMB para instrução do PL de alteração da LC 95/2013, enfatizando ao Comitê que a eventual postergação da atualização do plano de aportes necessários para a cobertura do deficit atuarial representará redução no volume de recursos financeiros disponíveis para investimentos. O Comitê delibera por solicitar as atas dos conselhos Administrativo e Fiscal que tratam do tema a fim de atualizar o conhecimento oficial da situação. Para fins de atendimento conclusivo aos memorandos 120/2021 e 154/2021 – ADM/BERTPREV foi encaminhada minuta por meio do Memorando 12/2021 – COINV que dispõe sobre as atividades desenvolvidas nas reuniões ordinárias do Comitê. Nada mais, foi encerrada a reunião às 17:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

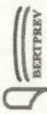
Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



18/11/2021

CNPJ	Fundo	Posição 11/11/2021	Posição 18/11/2021	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3822/10 Res. 4604/17 Res. 4695/18	Limite % Pro-Gestão Nível II	Saldo Dez/20 Evolução PL	RS 632.604.044,97 -R\$ 4.699.723,78	9,90% -0,74%
		Estratégia Ano		Limite Superior (%)		Enquadramento				
TOTAL PATRIMÔNIO										
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA	635.886.040,85	627.904.321,19	-1,26%	100,0%	100,0%				
Títulos Públicos Federais										
CP 0184	CAIXA PRÓPRIA (NTNs)	162.524.038,02	159.066.510,03	-2,13%	25,33%	100,0%	100,0%	100,0%	26,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
Fundos 100% Títulos Públicos										
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	64.653.105,47	64.848.231,43	0,30%	10,33%	100,0%	100,0%	100,0%	10,50%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.828.657,77	5.846.832,58	0,31%	0,931%	100,0%	100,0%			
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.112.226,80	16.149.312,00	0,23%	2,572%	100,0%	100,0%			
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.659.341,00	19.722.365,00	0,32%	3,141%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.118.033,98	6.137.295,41	0,31%	0,977%					
Fundos Referenciados Renda Fixa										
09.577.447/0001-00	SANTANDER DI TITULOS PUBL PREMIUM*	204.377.855,41	206.788.496,08	1,18%	32,93%	0,000%		0,00%	26,00%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	59.651.453,31	61.810.511,53	3,62%	9,844%	40,00%	50,0%			
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	104.536.816,22	104.758.106,88	0,21%	16,684%					
FI Renda Fixa Crédito Privado										
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.226.091,56	4.240.071,87	0,33%	0,68%	5,00%	15,00%	0,00%	0,70%	Artigo 7, inciso VII, Alínea B
Fundos de Investimentos em Ações										
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	138.337.955,08	129.645.115,99	-6,28%	20,65%	0,000%		0,00%	26,00%	Artigo 8, inciso II, Alínea A
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	19.266.822,54	18.453.982,04	-4,22%	2,939%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	19.491.395,77	18.650.467,64	-4,31%	2,970%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	6.965.369,73	6.541.158,97	-6,09%	1,042%					
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	41.907.984,15	38.090.197,53	-9,11%	6,066%	20,00%	30,0%			
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	39.293.108,14	37.146.175,38	-5,46%	5,916%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	7.658.307,17	7.120.413,06	-7,02%	1,134%					
Fundos de Investimento em Participações										
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	23.070.993,08	23.070.993,04	0,00%	3,67%	5,00%	5,00%	0,00%	3,80%	Artigo 8, inciso IV, Alínea A
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP N	4.987.907,93	4.987.907,93	0,00%	0,794%					
Fundos de Investimentos no Exterior										
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIOR	18.083.085,15	18.083.085,11	0,00%	2,880%	0,000%		0,00%	3,40%	Artigo 9 A, inciso II
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	27.132.560,33	28.169.455,28	3,82%	4,49%					
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	10.819.544,70	11.230.322,39	3,80%	1,789%					
Fundos de Investimentos no Exterior										
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	10.861.564,00	11.285.710,35	3,91%	1,797%					
17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.451.451,63	5.653.422,54	3,70%	0,900%	10,00%	10,00%	0,00%	2,60%	Artigo 9 A, inciso III
		11.563.441,90	12.075.447,47	4,43%	1,92%			0,00%	10,00%	
		5.688.947,68	5.953.257,70	4,65%	0,948%					
		5.874.494,22	6.122.189,77	4,22%	0,975%					

(*) ANTIGO SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI

Katia Hidalgo Dalm

Katia Hidalgo Dalm
Coord. Adm. Financeira
Reg.: 002 - BERTPREV



Relatório de Investimentos

COMPARATIVO BIMESTRAL SETEMBRO E OUTUBRO/2021

CNPJ	Fundo	Competência setembro/21	Competência outubro/21	Variação Mensal	% PL	Limite % PL 4604/17	Limite % Pro-Gestão Nível II	Saldo Dez/20	Evolução PL	Evolução PL Acumulada Saldo Anterior	Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)	Enquadramento
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO (*) CONTA TRANSITÓRIA	635.280.042,33	620.053.716,56	-2,40%	100,00%								
CP 0184	Títulos Públicos Federais	163.725.321,52	158.604.767,48	-3,13%	25,58%	100,00%	100,00%	10,00%			10,00%	100,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	163.725.321,52	158.604.767,48	-3,13%	25,58%								
15.486.093/0001-83	Fundos 100% Títulos Públicos	64.728.777,21	63.783.010,94	-1,46%	10,29%								
19.523.305/0001-06	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.953.659,09	16.767.523,26	-1,10%	2,70%								Artigo 7, inciso I, Alínea B
25.078.994/0001-90	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.795.005,20	5.766.248,13	-0,50%	0,93%								
19.769.046/0001-06	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	16.160.241,60	15.772.480,00	-2,40%	2,54%								
22.791.074/0001-26	FI CAIXA BRASIL 2020 II TP RF	19.720.961,00	19.426.394,00	-1,49%	3,13%								
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.098.910,32	6.050.365,55	-0,80%	0,98%								
09.577.447/0001-00	Fundos Referenciados Renda Fixa	198.342.775,88	200.221.797,67	0,95%	32,29%								Artigo 7, inciso IV, Alínea A
21.838.150/0001-49	SANTANDER DI TÍTULOS PUBL PREMIUM*	54.170.907,45	56.706.843,71	4,68%	9,15%								
28.515.874/0001-09	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	104.013.567,18	103.644.006,94	-0,36%	16,72%	40,00%	50,00%	0,00%					
14.091.645/0001-91	BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.158.299,25	39.870.947,02	-0,72%	6,43%								
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.224.662,25	4.173.943,47	-1,20%	0,67%	5,00%	15,00%	0,00%					Artigo 7, inciso VII, Alínea B
	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.224.662,25	4.173.943,47	-1,20%	0,67%								
07.279.657/0001-89	Fundos de investimentos em Ações	144.269.148,51	130.428.382,28	-9,59%	21,04%								Artigo 8, inciso I, Alínea A
11.392.165/0001-72	QUEST AÇÕES FIC FIA	20.319.682,33	18.748.616,35	-7,73%	3,02%								
09.290.813/0001-38	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	20.090.570,69	18.761.612,70	-6,61%	3,03%								
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.254.222,11	6.638.059,39	-8,49%	1,07%								
08.817.414/0001-10	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	44.054.164,09	38.300.869,66	-13,06%	6,18%	20,00%	30,00%	0,00%					
09.087.523/0001-91	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	40.890.945,95	37.299.090,15	-8,78%	6,02%								
15.154.441/0001-15	WESTERN ASSET VALUATION FIA	7.945.816,68	7.126.290,61	-10,31%	1,15%								
	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.713.742,66	3.553.843,42	-4,31%	0,57%								
16.437.148/0001-28	Fundo de investimento em Participações	23.274.049,20	23.070.993,04	-0,87%	3,72%								Artigo 8, inciso IV, Alínea A
27.782.774/0001-78	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.034.279,93	4.987.907,93	-0,92%	0,80%	5,00%	5,00%	0,00%					
	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP M	18.239.769,27	18.083.085,11	-0,86%	2,92%								
33.913.562/0001-85	Fundos de investimentos no Exterior	25.870.678,85	27.870.476,13	7,73%	4,49%								Artigo 9 A, inciso II
17.804.792/0001-50	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIOR	10.351.949,77	11.115.786,89	7,38%	1,79%								
31.964.961/0001-40	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	10.345.234,33	11.158.282,90	7,86%	1,80%								
19.436.818/0001-80	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR I	5.173.494,75	5.596.406,34	8,17%	0,90%	10,00%	10,00%	0,00%					Artigo 9 A, inciso III
17.502.937/0001-68	Fundos de investimentos no Exterior	10.844.635,91	11.900.345,55	9,73%	1,92%								
	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.375.069,22	5.833.018,50	8,52%	0,94%								
	FI CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.469.566,69	6.067.327,05	10,93%	0,98%								

(*) Obs: ANTIGO SANTANDER FIC FI SOBRERANO RF REF DI

K. Oliveira
Katia Hidalgo Daud
 Coord. Adm. Financeira
 Reg.: 002 - BERTPREV



Relatório de Investimentos

OUTUBRO

2021

CNPJ	Fundo	Patrimônio	% PL	CMN Limite % Res. 3922/10	Limite % Pró-Gestão	Saldo Dez/20 Evolução PL	Enquadramento
TOTAL PATRIMÔNIO		620.053.716,56	100,0%				Enquadramento
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA	-	0,000%			R\$ 632.604.044,97	9,90%
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	158.604.767,48	25,58%			-R\$ 12.550.328,41	-1,98%
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	158.604.767,48	25,58%				
	Fundos de Investimentos - 100% Títulos Públicos	63.783.010,94	10,29%				
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.767.523,26	2,704%	100,00%	100,00%	26,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
19.523.305/0001-06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.766.248,13	0,930%				
25.078.994/0001-90	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	-	0,000%				
19.769.046/0001-06	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	15.772.480,00	2,544%	100,00%	100,00%	10,50%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
22.791.074/0001-26	FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.426.394,00	3,133%				
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.050.365,55	0,976%				
	Fundos Renda Fixa em geral	200.221.797,67	32,29%				
09.577.447/0001-00	SANTANDER RF REF DI TP PREMIUM FIC FI	56.706.843,71	9,145%			26,00%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	103.644.006,94	16,715%	40,00%	50,00%		
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	39.870.947,02	6,430%				
	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	4.173.943,47	0,67%				
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.173.943,47	0,673%	5,00%	15,00%	0,70%	Artigo 7, inciso VII, Alínea B
	Fundos de Investimentos de Ações em geral	130.428.382,28	21,04%				
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	18.748.616,35	3,024%				
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	18.761.612,70	3,026%				
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.638.059,39	1,071%				
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	38.300.869,66	6,177%	20,00%	30,00%		
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	37.299.090,15	6,015%				
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	7.126.290,61	1,149%				
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC EM AÇÕES	3.553.843,42	0,573%				
	Fic em Participações - Fechado - (Investimentos Estruturados)	23.070.993,04	3,72%				
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	4.987.907,93	0,804%	5,00%	5,00%	3,80%	Artigo 8, inciso IV, Alínea A
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRAT	18.083.085,11	2,916%				
	Fundos de Investimentos no Exterior	27.870.476,13	4,50%				
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIOR	11.115.786,89	1,793%				
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	11.158.282,90	1,800%				
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	5.596.406,34	0,903%	10,00%	10,00%		
	Fundos de Investimentos no Exterior	11.900.345,55	1,920%				
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.833.018,50	0,941%				
17.502.937/0001-68	FI CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6.067.327,05	0,979%				

Coord. Adm. Financeira

 BERTPREV



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

Bertioga, 24 de novembro de 2021.

Memorando nº 012/2021 – COINV.

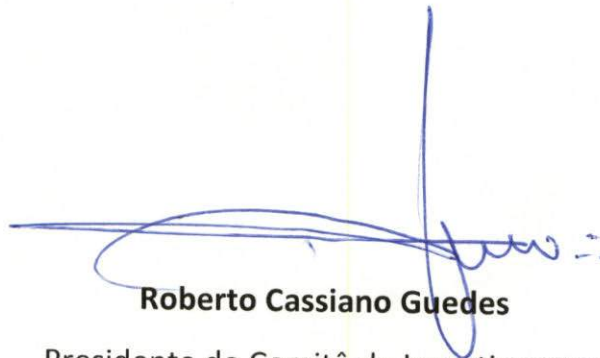
De: Comitê de Investimentos

Para: CAF – BERTPREV

Encaminhamos no anexo minuta da Resolução que trata das atividades desenvolvidas nas reuniões ordinárias, previstas no artigo 122 da LC 95/2013, conforme deliberação constante da ata nº 054/2021 de 24 de novembro de 2021.

Esclarecemos que a referida minuta está circunscrita às atribuições do Comitê estabelecidas no artigo 113 da LC 95/2013, devendo as demais demandas apresentadas nos memorandos nº 120/2021 e 154/2021 – ADM/BERTPREV, ser tratadas no âmbito de atuação operacional da Autarquia.

Sem mais para o momento, segue para providências necessárias.


Roberto Cassiano Guedes
Presidente do Comitê de Investimentos

Recebido
24/11/21

Katia Hidalgo Daia
Coord. Adm. Financeira
Reg.: 002 - BERTPREV



ANEXO

Considerando as atribuições do Comitê de Investimentos previstas no artigo 113 da Lei Complementar 95/2013 e a necessidade de compatibilizar as atividades de suas reuniões ordinárias conforme estabelece o artigo 122 da mesma Lei às disposições do Manual do Pró-gestão RPPS versão 3.2, no que se refere a manualização de procedimentos, o Comitê encaminha conforme deliberado em ata nº 054/2021 de 24/11/2021 a presente minuta de Resolução, solicitando a adoção de providências visando sua efetivação.

MINUTA DE RESOLUÇÃO

Em razão das atribuições previstas no artigo 113 da Lei Complementar 95/2013 e necessidade de compatibilizar as atividades de reuniões ordinárias conforme estabelece o artigo 122 da mesma Lei às disposições do Manual do Pró-gestão RPPS versão 3.2, no que se refere a manualização de procedimentos, o Comitê deliberou em 24/11/2021 conforme consta de ata nº 054/2021 pela edição da presente Resolução.

Artigo 1º. Nas reuniões ordinárias os seguintes assuntos deverão compor a pauta com registro obrigatório em ata:

§ 1º. Análise do cenário macroeconômico de curto prazo, bem como as expectativas de mercado, observando preferencialmente:

I – Relatórios de instituições oficiais com projeções de expectativas de instituições financeiras sobre o cenário econômico;

II – Avaliação das variações da estrutura das curvas de juros a termo;

III – Consulta relacionada à variação do risco soberano;

IV – Verificação do principal índice da Bolsa de valores local;

§ 2º. Avaliação dos investimentos que compõe o patrimônio dos diversos segmentos de aplicação, considerando minimamente:

I – Planilhas de acompanhamento de investimentos elaborados pela CAF abrangendo as periodicidades semanal, mensal e bimestral;

II – Relatórios de acompanhamento da Consultoria prestadora de serviços do Instituto, com emissão mensal de parecer pelo Comitê de Investimentos, a ser encaminhado para apreciação dos Conselhos Administrativo e Fiscal;



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

III – Comparação dos ativos integrantes da carteira a outros dos mesmos segmentos estabelecidos em Resolução do CMN.

§ 3º. Análise do fluxo de caixa, considerando as obrigações previdenciárias e administrativas para o mês em curso, dando suporte a emissão das APRs necessárias a aplicações e resgates correspondentes.

§ 4º. Proposições de investimentos/desinvestimentos, considerando avaliações técnicas com relação aos ativos objetos da proposta, que justifique o movimento proposto, mediante emprego, quando apropriado, de:

- I – Política de Investimentos vigente;
- II – Meta atuarial estabelecida para o exercício por consultoria especializada contratada pelo Instituto;
- III – Estudo de ALM elaborada por consultoria especializada contratada pelo Instituto;
- IV – Rol de Instituições aptas a receber aportes de investimentos.

Artigo 2º. Sem prejuízo das ações estabelecidas no artigo 1º deverão também ser adotadas as seguintes providências periódicas:

§ 1º. Mensalmente:

I – Análise de processos que tratem de solicitação inicial e renovação de credenciamento de Instituições financeiras, seus prestadores de serviço e respectivos fundos de investimentos, considerando a ordem cronológica das solicitações.

II – Emissão de parecer acerca dos relatórios mencionados no artigo 1º, §2º – II;

§ 2º. Anualmente:

I – Avaliação acerca da necessidade de atualização da Política de Investimentos vigente;

II – Acompanhamento dos estudos técnicos de definição da meta atuarial a vigor do exercício subsequente considerada a duração do passivo do plano previdenciário;

III – Elaboração da Minuta da Política de Investimentos para o exercício seguinte a ser remetida ao Conselho Administrativo;

IV – Execução do calendário oficial de reuniões ordinárias do Comitê de Investimentos.

Artigo 3º. Quando considerado necessário pelo Comitê será aberta agenda para reunião com representantes de Instituições Financeiras para tratar de apresentação de produtos de investimento, gestão de ativos integrantes da carteira do BERTPREV e discussão de assuntos econômicos com o respectivo registro em ata.

Parágrafo Único. A critério do Comitê poderão ser designados componentes específicos para participar das atividades relacionadas no caput.



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

Artigo 4º. Quando, em razão do excesso de demanda, não for possível a conclusão dos trabalhos fixados nesta resolução em reunião ordinária caberá convocação, na ocasião, de reunião extraordinária para tratar dos temas pendentes.

Artigo 5º. Outros assuntos relacionados às atribuições do Comitê serão submetidos ao colegiado para fins de inclusão em pauta de reunião.

Artigo 6º. Esta Resolução entra em vigor na data de sua publicação.



*Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertioga*

Estado de São Paulo

Bertioga, 17 de novembro de 2021.

Memorando nº 154/21 – ADM/BERTPREV

Para: Comitê de Investimentos

Venho novamente informar, conforme memorando nº120/21, tendo em vista relatório recebido da empresa certificadora com apontamentos do não cumprimento de requisitos necessários para a renovação da certificação pró-gestão nível II, segue em anexo os dois manuais, o primeiro o manual que trata das aplicações financeira e do credenciamento e o segundo o que trata da elaboração da política de investimentos, peço análise e devolução para a inclusão dos fluxos, também mandei os manuais por e-mail para facilitar as alterações necessárias.

Registro que os manuais foram revistos/alterados com o acompanhamento e anuência do Sr. Evanilson Matos, membro do Comitê de Investimentos, o mesmo poderá tirar todas as dúvidas que eventualmente surgirem.

Além dos manuais, quanto as providencias que devem ser realizadas acerca dos relatórios que o Comitê deve providenciar, todos já citados no memorando 120/21 – BERTPREV, peço que sejam tomadas medidas e ações para comprovação do cumprimento dos requisitos abaixo:

- **Elaboração de plano de ação mensal com o cronograma das atividades a serem desempenhadas relativas à gestão dos recursos;**
- **Elaboração de relatórios mensais de diligências de verificação dos lastros relativos aos títulos ou a papéis incluídos em operações estruturadas adquiridas por meio de veículos de investimento, e de acompanhamento sistemático da situação patrimonial, fiscal, comercial e jurídica das instituições investidas e do desempenho dos papéis por elas emitidos**
- **Utilização do ALM, nos casos de RPPS com mais de 50 milhões de reais aplicados no mercado financeiro.**

O manual do pró-gestão poderá ser consultado no link abaixo, página 56 do manual atualizado (Manual do Pró-Gestão RPPS - Versão 3.2 - 18 de abril de 2021): <https://www.gov.br/previdencia/pt-br/assuntos/previdencia-no-servico-publico/pro-gestao-rpps-certificacao-institucional>.

Sem mais para o momento,

Atenciosamente,

Phelippe Santos do Bom Sussesso
Administração – Reg. 015

Phelippe Santos

De: Phelippe Santos <phelippe@bertprev.sp.gov.br>
Enviado em: quarta-feira, 17 de novembro de 2021 13:39
Para: 'comite@bertprev.sp.gov.br'
Cc: 'Evanilson Matos'
Assunto: manuais e demais providências necessárias - pró-gestão
Anexos: PROCEDIMENTOS PARA CREDENCIAMENTO E APLICAÇÕES FINANCEIRAS.docx; PROCEDIMENTOS PARA ELABORAÇÃO E ALTERAÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS.docx

Boa tarde,

Com finalidade de facilitar os trabalhos, conforme explicado no memorando nº 154/21 – BERTPREV, segue em anexo os arquivos: manual que trata do credenciamento e das aplicações financeira e o manual que trata da política de investimentos para as devidas alterações que se façam necessárias.

Seguem abaixo as demais providências necessárias, conforme memorando 120/21.

Além destes manuais, peço que sejam tomadas medidas e ações para comprovação do cumprimento dos requisitos abaixo:

- **Elaboração de plano de ação mensal com o cronograma das atividades a serem desempenhadas relativas à gestão dos recursos;**
- **Elaboração de relatórios mensais de diligências de verificação dos lastros relativos aos títulos ou a papéis incluídos em operações estruturadas adquiridas por meio de veículos de investimento, e de acompanhamento sistemático da situação patrimonial, fiscal, comercial e jurídica das instituições investidas e do desempenho dos papéis por elas emitidos**
- **Utilização do ALM, nos casos de RPPS com mais de 50 milhões de reais aplicados no mercado financeiro.**

O manual do pró-gestão poderá ser consultado no link abaixo, página 56 do manual atualizado (Manual do Pró-Gestão RPPS - Versão 3.2 - 18 de abril de 2021): <https://www.gov.br/previdencia/pt-br/assuntos/previdencia-no-servico-publico/pro-gestao-rpps-certificacao-institucional>.

Atenciosamente,

Phelippe Santos
Setor administrativo



Instituto de Previdência Social dos Serv. Públicos do Mun. de Bertioga

"Nossa missão é garantir parte do seu futuro"

CNPJ: 02.581.343/0001-12 | Tel. 13 3319-9292

Rua Rafael Costábile, 596 | Centro | Bertioga - SP | CEP: 11250-258

www.bertprev.sp.gov.br | e-mail: adm@bertprev.sp.gov.br